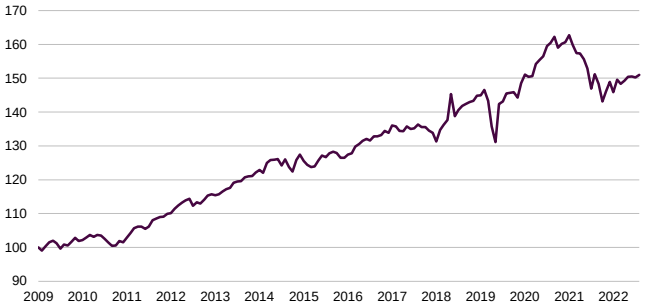
Swisscanto Flex Sammelstiftung
FLEX 20

Gemischtes Portfolio | Thesaurierend | Juli 2023 | Ausgabe Schweiz

Beschreibung

Das aktiv verwaltete Poolvermögen investiert in Obligationen, Aktien, Immobilien und Gold. Das Vermögen wird primär in Fonds und Anlagestiftungsanteile der Swisscanto investiert. Der Anlagepool ist eher konservativ investiert. Er verfolgt eine auf hohe laufende Erträge ausgerichtete Anlagestrategie. Der Aktienanteil liegt bei durchschnittlich 28%, der Obligationenanteil bei rund 42%, der Immobilienanteil bei ca. 25% und der Goldanteil bei etwa 3%. Diese Allokation trägt zur Diversifikation der Risiken und zur Erhöhung des Ertragspotenzials bei. Es gelten die Anlagevorschriften nach BVV2.

Indexierte Performance in CHF (netto)



Profil/Eignung

Zugelassen ist nur die Anlage von Mitteln steuerbefreiter Einrichtungen der beruflichen Vorsorge in der Schweiz (Säule 2).
Mit der Anlage sind Risiken, insbesondere diejenigen von Wert- und Ertragsschwankungen, verbunden. Weiter unterliegen Anlagen in Fremdwährungen Wechselkursschwankungen.

Performance in % bis 31.7.2023

	1M	3M	YTD	12M	Lanc. p.a.	2021	2022
Portfolio	0.47	0.40	3.65	-0.12	3.10	7.80	-10.52
Benchmark	0.32	0.87	4.30	-0.59	3.26	7.79	-11.81

Die vergangene Performance ist kein Indikator für die zukünftige Wertentwicklung und bietet keine Garantie für den Erfolg in der Zukunft.

Eckwerte

Abschluss Rechnungsjahr	31.07
Start	04.01.2010
Rechnungswährung	CHF
Benchmark	Customized
Volumen in Mio. (31.7.2023)	938.50

Kennzahlen

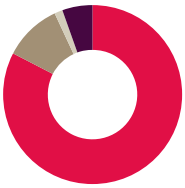
Volatilität p.a.	4.32%
Tracking Error p.a.	0.90%

Aufteilung nach Anlagekategorien in %

	Portfolio	BM	Delta	Bandbreite
Liquidität	2.73	2.00	0.73	0 - 10
Obligationen CHF	28.33	30.00	-1.67	22 - 38
Obligationen FW	11.65	12.00	-0.35	6 - 18
Aktien Schweiz	14.04	14.00	0.04	9 - 19
Aktien Ausland	12.36	14.00	-1.64	9 - 19
Immobilien CH	22.16	20.00	2.16	17 - 23
Immobilien Ausland	5.99	5.00	0.99	2 - 8
Gold	2.73	3.00	-0.27	0 - 5

Aufteilung nach Währungen

	CHF	82.6%
	USD	10.5%
	EUR	1.5%
	Andere	5.5%



Nachhaltigkeitsansätze in Anwendung

Risikoindikator

tief 1 2 **3** 4 5 6 7 hoch

Alle hier veröffentlichten Angaben dienen ausschliesslich Ihrer Information und stellen keine Anlageberatung oder sonstige Empfehlung dar. Wir haben den Inhalt sorgfältig recherchiert und zusammengestellt. Gleichwohl kann Swisscanto nicht die Gewähr der Richtigkeit, Vollständigkeit sowie die Aktualität der gemachten Angaben übernehmen. Wichtige Hinweise für die Schweiz: Alleinverbindliche Grundlage für den Anschluss ist die Anschlussvereinbarung. Die Reglemente und Geschäftsberichte können bei der Swisscanto Flex Sammelstiftung der Kantonalbanken, Geschäftsstelle, Postfach, 8152 Glattbrugg oder unter www.swisscanto-flex.ch kostenlos bezogen werden.

Erläuterungen zu Nachhaltigkeitsansätzen

Voting Engagement

Als Aktionär und Kreditgeber wird ein aktiver und kontinuierlicher Dialog mit den Unternehmensleitungen geführt. Diese werden aufgefordert ehrgeizige CO2e-Reduktionsziele zu formulieren, diese konsequent umzusetzen und transparent darüber zu berichten. Stimmrechte werden anhand eigener Abstimmungsrichtlinien, die sich auf schweizerische und internationale Corporate-Governance-Regeln sowie die Prinzipien für verantwortliches Investieren der Vereinten Nationen (UN PRI) stützen, ausgeübt. Bei Beteiligungsanlagen wird das Abstimmungsverhalten transparent auf www.swisscanto.com/voting publiziert.

Swisscanto Blacklist

Ausschlüsse Blacklist vor allem von Herstellern geächteter Waffen (Streubomben und Streumunition, Antipersonen- und Landminen, biologische und chemische Waffen, Atomwaffen Systeme oder Material*, angereichertes Uran* sowie Blendlaser- und Brandwaffen). Bei der Einschätzung stützen wir uns primär auf die Schweizer Gesetzgebung sowie auf von der Schweiz ratifizierte und anerkannte internationale Abkommen. Grundsätzlich deckt sich unsere Einschätzung auch mit den Ausschlussempfehlungen von SVVK-ASIR. *Nur bei einer Weiterverbreitung, die gegen den Vertrag über die Nichtverbreitung von Kernwaffen (Non-Proliferation Treaty: "NPT") verstösst.

Weitere Ausschlüsse

Anwendung weiterer Ausschlusskriterien, ergänzend zur Swisscanto Blacklist, zur Reduktion von ESG-Risiken und mit dem Ziel, keine Investitionen in Titel mit ESG-kritischen Geschäftsmodellen zu tätigen. Die Ausschlusskriterien betreffen Unternehmen, die in Verbindung stehen mit der Förderung von Kohle (> 5% Umsatz)*, Kohlereserven (ex Metallproduktion)*, Herstellung von Waffen & Munition, Herstellung von Kriegstechnik (> 5% Umsatz), Herstellung von Pornografie, Kinderarbeit und/oder UN Global Compact-Verstössen (Green und Sustainability Bonds ggf. ausgenommen). Verstösse gegen die UN Global Compact-Prinzipien, die unser Screening hervorbringt, werden von unseren Analysten noch einmal detailliert überprüft. Im Rahmen des Engagements suchen wir den Dialog und fordern die Unternehmen dazu auf, ihr Verhalten zu ändern. Tritt innert angemessener Zeit keine Änderung ein, sind bestehende Anlagen zu veräussern. Neben den Ausschlusskriterien für unternehmerische Tätigkeiten führen wir auch eine Ausschlussliste für Staaten. Bei der Erstellung dieser Ausschlussliste berücksichtigen wir vor allem sozioökonomische Risikodimensionen wie Geldwäsche und Korruption. *Ausgenommen Green und Sustainability Bonds

Systematische ESG-Integration

Die systematische Analyse von ESG-Kriterien ist integraler Bestandteil des aktiven Anlageprozesses, mit dem Ziel, Risiken und Opportunitäten aufgrund von ESG-Trends frühzeitig zu erkennen. ESG-Kriterien ergänzen die reine Finanzanalyse und führen zu fundierteren Anlageentscheidungen.

Pariser Klimaziel 2 °C

Nach Massgabe des Pariser Klimaziels ist die Investitionstätigkeit des Portfolios auf eine Reduktion der CO_2e-Intensität der Anlagen von mindestens 4% pro Jahr ausgerichtet. Die Zielvorgabe der Anlagestrategie richtet sich an der CO_2e-Intensität des Anlageuniversums per Ende 2019 aus.

Nachhaltigkeitsansätze

Die für das vorliegende Portfolio dargestellten Nachhaltigkeitsansätze werden für das gesamte Portfolio oder für einen wesentlichen Teil des Portfolios angewendet. Einzelne Kriterien können bei den verschiedenen eingesetzten Anlageprodukten und -kategorien unterschiedlich umgesetzt werden. Genaue Angaben zu den Swisscanto Fonds und Vermögen der Swisscanto Anlagestiftungen finden sich im jeweiligen Prospekt, Fondsvertrag bzw. in den Anlagerichtlinien.

CO_2e

CO_2-Äquivalente (CO_2e) sind eine Masseinheit zur Vereinheitlichung der Klimawirkung der Treibhausgase Kohlendioxid (CO_2), Methan (CH_4), Lachgas (N_2O) und fluorierte Treibhausgase (FCKW). Alle diese Gase weisen eine unterschiedliche Verweildauer in der Atmosphäre aus und tragen nicht in gleichem Masse zum Treibhauseffekt bei.

ESG

ESG steht für die Aspekte Umwelt (Environment; E), Soziales (Social; S) und Corporate Governance (Governance; G).

SVVK-ASIR

Der Schweizer Verein für verantwortungsbewusste Kapitalanlagen (SVVK) ist ein Zusammenschluss von institutionellen Anlegern und wurde 2015 gegründet. Der Verein erbringt für seine Mitglieder Dienstleistungen, damit sie ihre Anlageentscheide auf Umwelt, Gesellschaft und Wirtschaft ausrichten können.