

Swisscanto Flex Sammelstiftung

FLEX 35

Gemischtes Portfolio | Thesaurierend | März 2024 | Ausgabe Schweiz

Beschreibung

Das aktiv verwaltete Poolvermögen investiert global in Obligationen, Aktien und Immobilien. Das Vermögen wird primär in Fonds und Anlagegruppen der Marke Swisscanto investiert. Das Anlageprofil ist eher ausgewogen ausgerichtet, wobei die strategische Kategorienallokation wie folgt ist: 2% Liquidität, 39% Obligationen, 35% Aktien und 24% Immobilien. Zusätzlich sind taktische Investitionen in Gold zulässig. Es gelten die Anlagevorschriften nach BVV2.

Profil/Eignung

Zugelassen ist nur die Anlage von Mitteln steuerbefreier 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.

Eckwerte

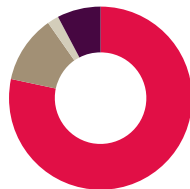
| | |
|-----------------------------|------------|
| Abschluss Rechnungsjahr | 31.12. |
| Start | 04.01.2010 |
| Rechnungswährung | CHF |
| Benchmark | Customized |
| Volumen in Mio. (28.3.2024) | 1154.04 |

Kennzahlen

| | |
|---------------------|-------|
| Volatilität p.a. | 5.19% |
| Tracking Error p.a. | 0.93% |

Aufteilung nach Währungen

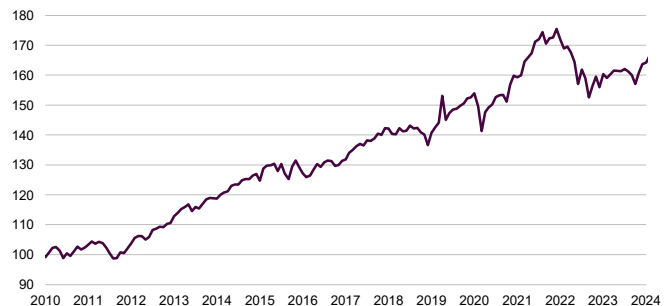
| | |
|--------|-------|
| CHF | 78.3% |
| USD | 12.0% |
| EUR | 2.0% |
| Andere | 7.7% |



Risikoindikator

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

Indexierte Performance in CHF (netto)



Performance in % bis 28.3.2024

| | 1M | 3M | YTD | 12M | Lanc. p.a. | 2022 | 2023 |
|-----------|------|------|------|------|------------|--------|------|
| Portfolio | 2.56 | 4.43 | 4.43 | 6.65 | 3.85 | -11.24 | 5.16 |
| Benchmark | 2.24 | 4.01 | 4.01 | 7.25 | 3.98 | -12.20 | 6.19 |

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

Aufteilung nach Anlagekategorien in %

| | Portfolio | BM | Delta | Bandbreite |
|--------------------|-----------|-------|-------|------------|
| Liquidität | 1.97 | 2.00 | -0.03 | 0 - 10 |
| Obligationen CHF | 20.92 | 25.00 | -4.08 | 17 - 33 |
| Obligationen FW | 14.91 | 14.00 | 0.91 | 8 - 20 |
| Aktien Schweiz | 17.62 | 17.50 | 0.12 | 12 - 23 |
| Aktien Ausland | 18.63 | 17.50 | 1.13 | 12 - 23 |
| Immobilien Schweiz | 20.18 | 22.00 | -1.82 | 17 - 27 |
| Immobilien Ausland | 4.75 | 2.00 | 2.75 | 0 - 5 |
| Gold | 1.02 | 0.00 | 1.02 | 0 - 5 |

Nachhaltigkeitsansätze in Anwendung



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

Stewardship - Voting / Engagement



Als Aktionärin wird aktiv ein kontinuierlicher Dialog mit den Unternehmensleitungen geführt. Dieser erfolgt gemäss den Engagement-Richtlinien des Asset Managements der Zürcher Kantonalbank. Firmen werden unter anderem aufgefordert, ehrgeizige Treibhausgas-Reduktionsziele zu formulieren, diese konsequent umzusetzen und transparent darüber zu berichten. Die Engagement-Aktivitäten und -Richtlinien werden auf <https://www.zkb.ch/de/unternehmen/asset-management/nachhaltigkeit/investment-stewardship.html> publiziert. Die Abstimmungsrichtlinie stützt sich auf schweizerische und internationale Corporate Governance Grundsätze und auf die Prinzipien für verantwortliches Investieren der Vereinten Nationen (UN PRI) ab. Der Schwellenwert zur Stimmrechtsausübung liegt bei ausländischen Abstimmungsmärkten bei CHF 5 Mio. je Aktienposition. Bei Schweizer Aktien wird flächendeckend abgestimmt. Das Abstimmungsverhalten ist einsehbar unter: <https://www.swisscanto.com/voting>

Kontroversen - Ausschlüsse Responsible



Anwendung weiterer Ausschlusskriterien - ergänzend zu den Ausschlüssen in Anlehnung an SVVK-ASIR - zur Reduktion von Nachhaltigkeitsrisiken und mit dem Ziel, keine Investitionen in Titel mit aus Nachhaltigkeitssicht kritischen Geschäftsmodellen zu tätigen. Die Ausschlusskriterien beziehen sich auf Unternehmen, die in Verbindung stehen mit der Förderung von Kohle (ex Metallproduktion; > 5% Umsatz)*, mit Kohlereserven (ex Metallproduktion)*, der Herstellung von Waffen und Munition, der Herstellung von Kriegstechnik (> 5% Umsatz), der Herstellung von Pornografie, ausbeuterischer Kinderarbeit und/oder UN-Global-Compact-Verstössen (Green und Sustainability Bonds gegebenenfalls ausgenommen). Verstösse gegen die UN-Global-Compact-Prinzipien, die das Screening hervorbringt, werden von Analysten noch einmal detailliert überprüft. Im Rahmen des Engagements wird der Dialog gesucht und die Unternehmen dazu aufgefordert, ihr Verhalten zu ändern. Tritt innert angemessener Zeit keine Änderung ein, sind bestehende Anlagen zu veräussern. *Ausgenommen Green und Sustainability Bonds.

ESG - 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.

Klima - CO₂e-Reduktion



Es wird eine im Vergleich zum Referenzindex tiefere CO₂e-Intensität angestrebt. Die CO₂e-Intensitäten errechnen sich aus dem CO₂e-Ausstoss im Verhältnis zum Umsatz bei Unternehmen und im Verhältnis zum Bruttoinlandsprodukt bei Staaten.

Weiterführende Angaben

Weitere, ergänzende produktspezifische Ausführungen bezüglich der angewendeten Nachhaltigkeitsansätze finden sich in den massgeblichen Rechtsdokumenten unter products.swisscanto.com.

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.

CO₂e

CO₂-Äquivalente (CO₂e) sind eine Masseinheit zur Vereinheitlichung der Klimawirkung der Treibhausgase Kohlendioxid (CO₂), Methan (CH₄), Lachgas (N₂O) 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.