

# Vorsorgestiftung Film und Audiovision

## Anlagepolitik

Das Portfolio «Vorsorgestiftung Film & Audiovision» investiert mit einem aktiven Ansatz in Obligationen, Hypotheken, Aktien, Immobilien und Alternative Anlagen. Die Investitionen erfolgen ausschliesslich in kollektiven Kapitalanlagen innerhalb der jeweiligen gültigen Vorgaben und Rahmen des Bundesgesetzes über die berufliche Alters-, Hinterlassenen- und Invalidenvorsorge (BVG/BVV 2). Der strategische Aktienanteil beträgt 25% (taktische Bandbreite 15%-35%). Fremdwährungsrisiken werden zu mindestens 78% abgesichert.

## Produkteinformationen

|                               |                       |
|-------------------------------|-----------------------|
| Fondsmanager                  | AXA Versicherungen AG |
| Fondsmanager seit             | 01.01.2020            |
| Domizil                       | Schweiz               |
| Währung                       | CHF                   |
| Jahresabschluss               | 31. Dezember          |
| Nettoinventarwert (in Mio.)   | 146.20                |
| Lancierungsdatum              | 01.01.2020            |
| Verwaltungsgebühr p.a. (max.) | n/a                   |
| Ausgabeaufschlag              | n/a                   |
| Rücknahmeaufschlag            | n/a                   |
| Benchmark (BM)                | Kundenspezifisch      |
| Anteilsklassenwährung         | CHF                   |
| ISIN                          | XF0040950739          |
| Valoren-Nr.                   | 4095073               |

## Fondsstatistik

|                            |                |
|----------------------------|----------------|
|                            | seit Auflegung |
| Volatilität Portfolio p.a. | 5.08%          |
| Volatilität Benchmark p.a. | 6.60%          |
| Information Ratio          | -0.11          |
| Tracking Error (Ex post)   | 2.25%          |
| Alpha                      | 0.38%          |
| Sharpe Ratio               | 0.42           |

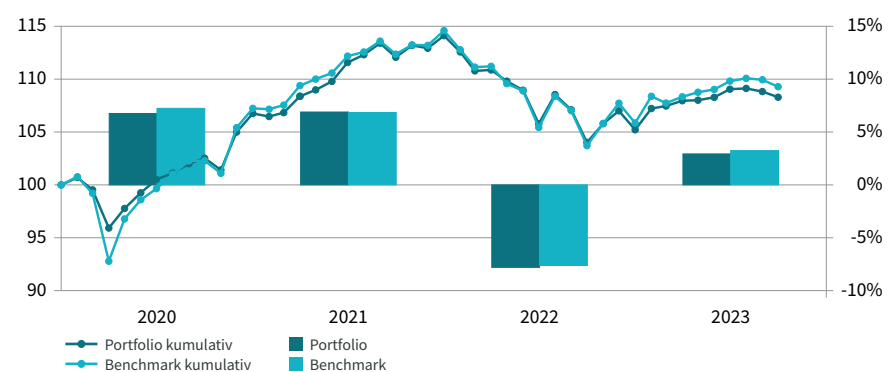
## Top 10 Equity Positionen in %

| Position                          | in % der Anlagen |
|-----------------------------------|------------------|
| Nestle Ltd.                       | 1.47             |
| Novartis Inc                      | 1.05             |
| Roche Holding Ltd                 | 1.01             |
| Apple Inc                         | 0.62             |
| Microsoft Corp                    | 0.56             |
| Alphabet Inc                      | 0.39             |
| UBS Group Inc.                    | 0.37             |
| Zurich Insurance Group Ltd        | 0.33             |
| COMPAGNIE FINANCIERE RICHEMONT SA | 0.31             |
| ABB Ltd                           | 0.28             |
| <b>Total</b>                      | <b>6.39</b>      |

## Top 10 Bond Positionen in %

| Position   | in % der Anlagen |
|--|------------------|
| United States of America                             | 1.89             |
| Pfandbriefbank Schweizerischer Hypothekarinstitute   | 1.64             |
| Pfandbriefzentrale der schweizerischen Kantonbanken  | 1.34             |
| Swiss Confederation                                  | 0.96             |
| The Government of Japan                              | 0.91             |
| Volksrepublik China                                  | 0.64             |
| Fannie Mae   | 0.37             |
| Federal Republic of Germany                          | 0.28             |
| United Kingdom of Great Britain and Northern Ireland | 0.28             |
| French Republic                                      | 0.22             |
| <b>Total</b>   | <b>8.53</b>      |

## Performance <sup>1)</sup>



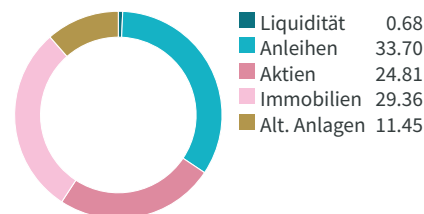
## Performance (in %) <sup>1)</sup>

|           | 1 Monat | 3 Monate | YTD   | 1 Jahr | 3 Jahre p.a. | Seit Lancierung |
|-----------|---------|----------|-------|--------|--------------|-----------------|
| Portfolio | -0.49   | -0.70    | 2.93  | 4.11   | 1.84         | 8.29            |
| Benchmark | -0.60   | -0.48    | 3.24  | 5.37   | 2.23         | 9.28            |
| Differenz | 0.11    | -0.21    | -0.31 | -1.26  | -0.39        | -0.99           |

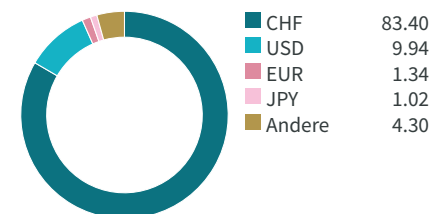
## Jahresperformance (in %) <sup>1)</sup>

| Jahr      | 2020  | 2021 | 2022  |
|-----------|-------|------|-------|
| Portfolio | 6.75  | 6.89 | -7.80 |
| Benchmark | 7.24  | 6.85 | -7.62 |
| Differenz | -0.49 | 0.04 | -0.18 |

## Anlageklassen (in %)



## Währungsallokation (in %) <sup>2)</sup>



1) Historische Performanceangaben und Finanzmarktszenarien sind keine verlässlichen Indikatoren für aktuelle oder zukünftige Ergebnisse. Bei den Performanceangaben sind die bei Ausgabe und Rücknahme von Fondsanteilen erhobenen Gebühren und Kosten nicht berücksichtigt.  
2) Nach Währungsabsicherung.

Der Disclaimer am Schluss dieses Dokuments gilt auch für diese Seite.

## Vermögensverwaltung per 29.09.2023

| Anlageklasse                      | Portfolio<br>Gewicht in % | Strategie<br>in % | Strategie Min<br>in % | Strategie Max<br>in % | Benchmark  |
|-----------------------------------|---------------------------|-------------------|-----------------------|-----------------------|--|
| <b>Liquidität</b>                 |                           |                   |                       |                       |  |
| Liquidität                        | 0.68                      | 1.00              | 0.00                  | 10.00                 | FTSE CHF 3M Euro Dep. [SBWMSF3L]                               |
|                                   | <b>0.68</b>               | <b>1.00</b>       | <b>0.00</b>           | <b>10.00</b>          |  |
| <b>Obligationen</b>               |                           |                   |                       |                       |  |
| Obligationen CHF                  | 9.51                      | 9.00              | 5.00                  | 15.00                 | SBI AAA-BBB (TR) [SBR14T]                                      |
| Obligationen Emerging Markets     | 0.00                      | 0.00              | 0.00                  | 5.00                  | Bloomberg EM USD Aggregate (TR) Value Hedged CHF [H00014CH]    |
| Obligationen Fremdwährung         | 10.02                     | 10.00             | 5.00                  | 15.00                 | Bloomberg Global-Aggregate (TR) Value Hedged CHF [LEGATRCH]    |
| Obligationen High Yield           | 9.06                      | 10.00             | 5.00                  | 15.00                 | ICE BofA 0-3 Year US High Yield hedged to CHF [HSA0CHF]        |
|                                   | <b>28.59</b>              | <b>29.00</b>      | <b>15.00</b>          | <b>50.00</b>          |  |
| <b>Hypotheken</b>                 |                           |                   |                       |                       |  |
| Hypotheken                        | 5.12                      | 5.00              | 0.00                  | 10.00                 | Swiss Bond Index (SBI) Domestic Swiss Pfandbrief (TR) [SML14T] |
|                                   | <b>5.12</b>               | <b>5.00</b>       | <b>0.00</b>           | <b>10.00</b>          |  |
| <b>Aktien</b>                     |                           |                   |                       |                       |  |
| Aktien Global                     | 15.99                     | 16.00             | 10.00                 | 22.00                 | MSCI ACWI [MXWD]   |
| Aktien Schweiz                    | 8.82                      | 9.00              | 5.00                  | 13.00                 | Swiss Performance Index (SPI) (TR) [SPI]                       |
|                                   | <b>24.81</b>              | <b>25.00</b>      | <b>15.00</b>          | <b>35.00</b>          |  |
| <b>Immobilien</b>                 |                           |                   |                       |                       |  |
| Immobilien Inland direkt          | 29.17                     | 30.00             | 15.00                 | 35.00                 | KGAST Immo-Index (Schweiz) (TR) [WUPIIMM]                      |
| Immobilien Inland indirekt listed | 0.19                      | 0.00              | 0.00                  | 5.00                  | SXI Real Estate Funds (TR) [SWIIT]                             |
|                                   | <b>29.36</b>              | <b>30.00</b>      | <b>15.00</b>          | <b>35.00</b>          |  |
| <b>Alternative Anlagen</b>        |                           |                   |                       |                       |  |
| Alternative Credit                | 0.00                      | 0.00              | 0.00                  | 5.00                  | S&P Global Leveraged Loan CHF (TR) Hedged [SPLGALFH]           |
| Infrastruktur                     | 7.96                      | 10.00             | 0.00                  | 15.00                 | FTSE CHF 3M Euro Dep. (+4%) [SBWMSF3L_400]                     |
| Private Equity (PE)               | 3.49                      | 0.00              | 0.00                  | 5.00                  | MSCI World 100% Hedged to CHF (NETR) [M0WOHCHF]                |
|                                   | <b>11.45</b>              | <b>10.00</b>      | <b>0.00</b>           | <b>15.00</b>          |  |
| <b>Total Portfolio</b>            | <b>100.00</b>             | <b>100.00</b>     |                       |                       |  |



Kontakt  
 AXA Versicherungen AG  
 Asset Management  
 General-Guisan-Strasse 40  
 8400 Winterthur

Datenquellen ab 29. September 2023: Credit Suisse, sofern nicht anders angegeben.

### Disclaimer

Dieses Dokument wird von der AXA Versicherungen AG in der Rolle als Vermögensverwalter für den Kunden erstellt und dient ausschliesslich Informationszwecken und der Nutzung durch den Empfänger. Bei diesem Dokument handelt es sich weder um ein Angebot oder eine Empfehlung zum Erwerb oder Verkauf von Finanzprodukten. Dieses Dokument darf ohne schriftliche Genehmigung der AXA Versicherungen AG weder auszugsweise noch vollständig vervielfältigt oder einem Dritten offengelegt werden. Dieses Dokument richtet sich ausschliesslich an natürliche und juristische Personen mit Wohnsitz bzw. Sitz in der Schweiz und ausdrücklich nicht an Personen, die einem Staat angehören oder in einem Staat wohnen bzw. ihren Sitz haben, in welchem die Zulassung bzw. der Vertrieb eines solchen Finanzprodukts untersagt oder eingeschränkt ist. Anteile der in dieser Publikation erwähnten Anlagefonds dürfen innerhalb der USA weder angeboten noch verkauft oder ausgeliefert werden. Die Zirkulation muss entsprechend beschränkt werden. Finanzprodukte sind keine risikofreien Investitionen.