

Rivora – Pool 30

März 2024

Poolbeschreibung

Die Anlagestrategie «Rivora – Pool 30» mit einer strategischen Aktienquote von 30%, steht allen Vorsorgewerken mit einer mittleren Risikofähigkeit zur Verfügung. Der Anlagepool investiert nach dem Grundsatz der Risikostreuung in die meisten vom BVG zugelassenen Anlagekategorien. Die Aktienquote wird ergänzt mit einem grossen Anteil direkt gehaltener Schweizer Immobilien, einer gut diversifizierten Quote in Alternativen Anlagen sowie einem aktiv verwalteten Obligationenanteil. Das Ziel ist es, bei moderatem Risiko eine Rendite über der gesetzlichen Minimalverzinsung zu erzielen.

- Moderates Risiko
- Diversifizierter Anlagepool
- Strategischer Aktienanteil 30%
- Aktive taktische Asset Allokation
- Renditeziel über BVG-Minimalverzinsung

Poolname	Rivora – Pool 30
Poolwährung	CHF
Abschluss Rechnungsjahr	31. Dezember
Ausgabe/Rücknahme	monatlich
Gesamtpoolvermögen (CHF in Mio.)	194.11
Benchmark ¹	Customized Benchmark

Poolstatistik

	1 Jahr	2 Jahre	3 Jahre
Alpha	0.43	-0.18	-0.60
Beta	1.10	0.94	0.98
Korrelation	0.9905	0.9788	0.9747
Volatilität ⁴			
– Pool	3.82%	5.19%	4.92%
– Benchmark	3.45%	5.43%	4.88%
Tracking Error (ex post)	0.62%	1.12%	1.10%
Information-Ratio	0.70%	-0.16%	-0.55%
Sharpe Ratio	1.06	0.05	0.14
Risikoloser Zinssatz	1.65%	0.87%	0.35%
R2	0.9811	0.9580	0.9501

Währungsgewichtungen (%) – aktuelle Allokation

Pool	
CHF	91.61
USD	6.98
EUR	0.47
Übrige	0.94

¹ SBR14T Index (6%), SARO3MI Index (4%), SPI Index (18%), WUPIIMM Index (24%), M1XCXSAQ Index (4%), MACXCSLA Index (4%), LEGATRCH Index (19%), M1EFES Index (4%), SPBDALFH Index (4%), EHFI300 Index (5%), Zielrendite 3.5% p.a. (8%).

² Referenzindex in der Währung der Anteilsklasse (ohne Kosten)

³ YTD: year-to-date (seit Jahresbeginn)

⁴ LTD: launch-to-date (seit Auflegung 29.01.2016, Rivora)

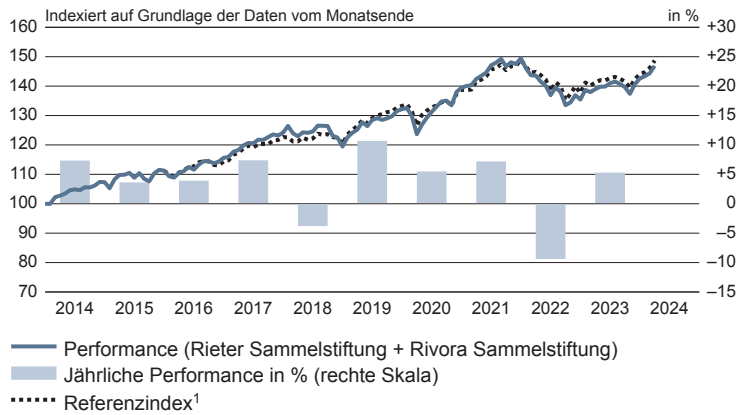
⁵ Annualisierte Standardabweichung

* Aufgrund unterschiedlicher Berechnungs-Methodiken, kann es zu geringfügigen Abweichungen zwischen diesem Factsheet (gem. SFAMA-Standard) und dem separaten Investment Reporting (in Anlehnung GIPS) kommen.

Bei Fragen zum Anlagepool:

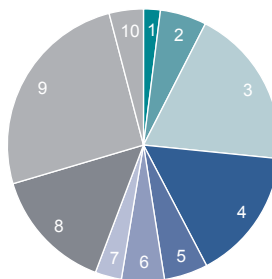
Rivora Sammelstiftung
Schlosstalstrasse 49
8406 Winterthur
www.rivora.ch

Wertentwicklung (indexiert)



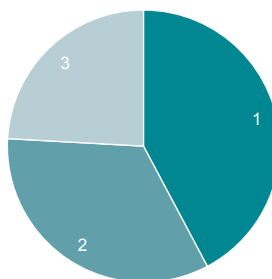
in %*	2020	2021	2022	2023	2024 YTD ²	LTD ³	5 Jahre	Ø p.a. 5 Jahre
Pool (CHF)	5.49	7.19	-9.39	5.29	3.01	34.35	17.29	3.24
Referenzindex ¹	4.12	7.33	-7.54	4.65	3.19	35.30	17.57	3.29
Überschussrendite	1.37	-0.14	-1.85	0.64	-0.18	-0.95	-0.28	-0.05

Anlageinstrumente (%) – aktuelle Allokation



1 Liquidität CHF	1.17
2 Obligationen CHF	5.55
3 Obligationen FW hedged	19.26
4 Aktien Schweiz	15.87
5 Aktien Welt	5.24
6 Aktien Welt hedged	5.11
7 Aktien Emerging Markets	3.15
8 Alternative Anlagen	14.80
9 Immobilien Schweiz	25.76
10 Immobilien Ausland	4.09

Alternative Anlagen (%) – aktuelle Allokation



1 ILS Insurance-Linked securities	42.23
2 Senior Secured Loans	33.65
3 Private Equity	24.12

Disclaimer: Das Dokument dient ausschliesslich Informationszwecken. Der Inhalt des Dokuments ist sorgfältig zusammengestellt. Dennoch kann die Rivora Sammelstiftung keine Gewähr für Inhalt und Vollständigkeit dieses Dokumentes übernehmen. Die historischen Renditeangaben geben keine Garantie für zukünftige Ergebnisse.