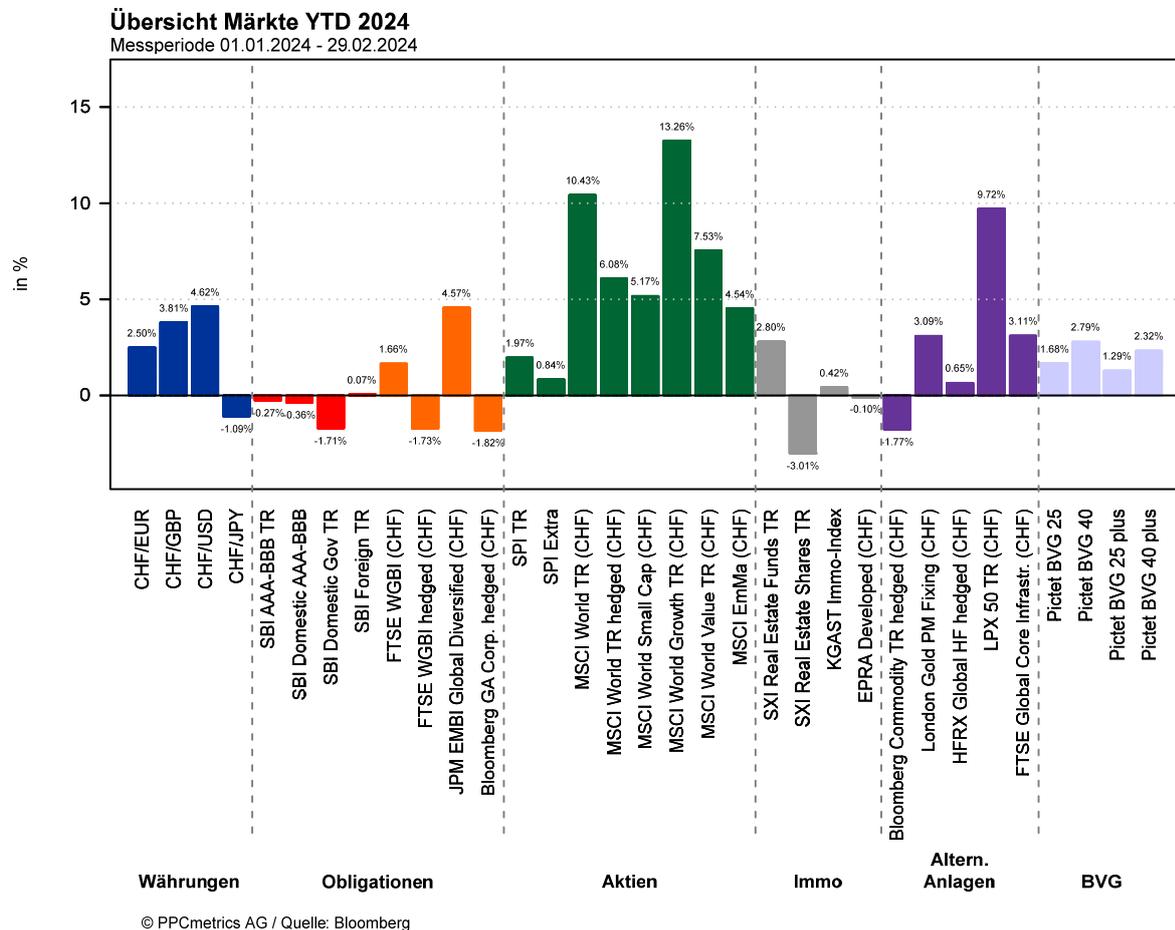


REVOR Invest: Factsheet per 29. Februar 2024

Übersicht Märkte 2024



Seit Jahresbeginn wiesen die Anlagemärkte unterschiedliche Renditen aus. Schweizer Obligationenindizes verzeichneten überwiegend negative Renditen, während globale währungsungesicherte Obligationenindizes positive Renditen erzielten. Die Währungsabsicherung hatte entsprechend einen negativen Renditebeitrag. Alle abgebildeten Aktienindizes erzielten positive Anlageresultate, wobei Schweizer Aktien eine geringere Rendite auswies als Globale Aktien. Bei den Immobilien erzielten kotierte Schweizer Immobilienfonds (SXI Real Estate Funds TR) und nicht kotierte Schweizer Anlagestiftungen (KGAST Immo-Index) positive, während kotierte Schweizer Immobilienaktien (SXI Real Estate Shares TR) und ausländische Immobilienaktien (EPRA Developed) negative Anlagerenditen aufwiesen. Bei den alternativen Anlagen gewannen mit Ausnahme der Rohstoffe (Bloomberg Commodity TR hedged) alle abgebildeten Anlagelassen an Wert.

Performance REVOR Invest

Renditen Berichtsjahr	CHF Mio.	Jan 24	Feb 24	YTD 2024*
Gesamtvermögen	820.3	0.49%	1.91%	2.42%
Customized Benchmark		0.25%	1.77%	2.02%
Differenz		0.25%	0.14%	0.40%

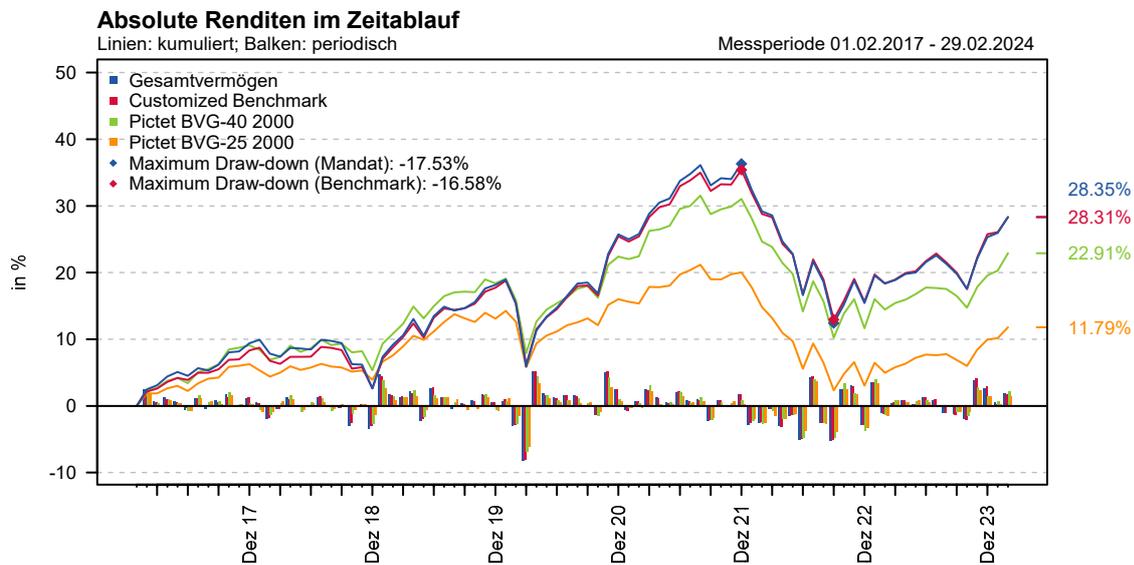
* bis 29.02.2024

© PPCmetrics AG

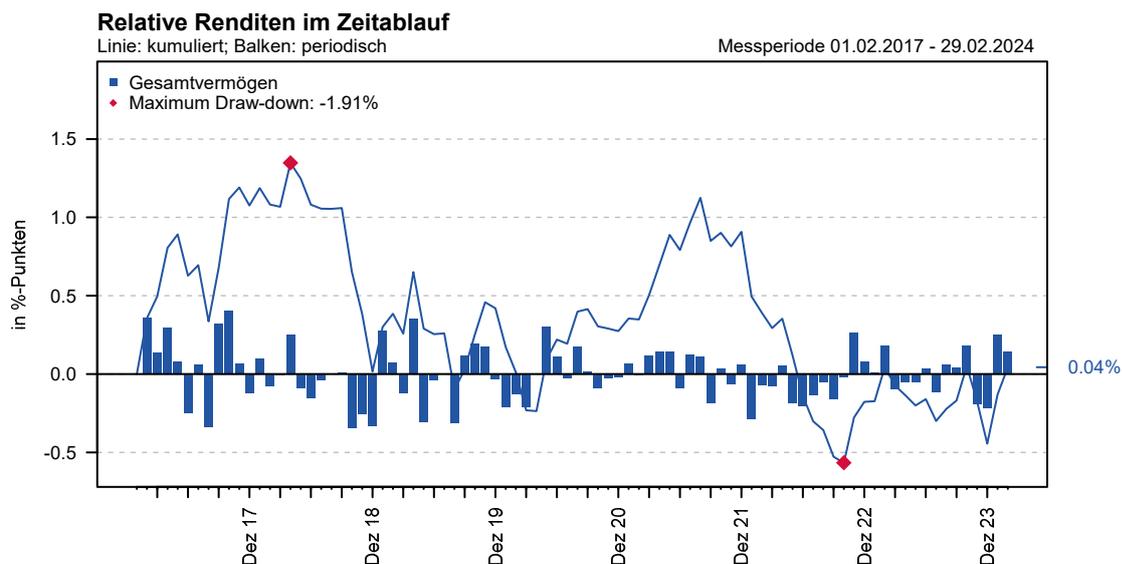
Jährliche Renditen	2017*	2018	2019	2020	2021	2022	2023	YTD 2024*	seit Messbeginn		
									kumuliert	annualisiert	Messbeginn
Gesamtvermögen	9.40%	-6.19%	15.13%	6.41%	8.42%	-15.31%	8.55%	2.42%	28.35%	3.59%	01.02.17
Customized Benchmark	8.33%	-5.28%	14.74%	6.55%	7.93%	-14.61%	8.77%	2.02%	28.31%	3.58%	
Differenz	1.08%	-0.92%	0.39%	-0.15%	0.49%	-0.70%	-0.22%	0.40%	0.04%	0.00%	

* Messperiode 2017: 01.02.2017 – 31.12.2017 / Messperiode 2023: 01.01.2024 – 29.02.2024

© PPCmetrics AG



© PPCmetrics AG



© PPCmetrics AG / REVOR Invest / Konsolidierung/Consolidation / Gesamtvermögen / 20265

Anlagestrategie und Benchmarks REVOR Invest

Revor Invest	Neutral = Benchmark	Strategie		Limiten gemäss BVV 2
		Taktische Min.	Bandbreite Max.	
Liquidität CHF	1%	0%	15%	
Obligationen CHF	35%	27%	43%	
Obligationen FW (hedged)	10%	7%	13%	
Aktien Schweiz	7%	5%	9%	50%
Aktien Welt (hedged)	24%	19%	29%	
Aktien Welt Small Cap	5%	3%	7%	
Aktien Emerging Markets	4%	3%	5%	
Immobilien Schweiz indirekt	14%	11%	17%	30%
Immobilien Schweiz Direktanlagen	0%	0%	5%	
Gold	0%	0%	5%	15%
Total	100%			
Total Fremdwährungen (nicht abgesichert)	9%	3%	20%	30%

Anlagekategorien	Benchmarks
Liquidität CHF	FTSE Eurodeposit 3 Monate
Obligationen CHF	SBI Gesamt-Rating (AAA-BBB) TR
Obligationen FW (hedged)	Bloomberg Barclays Capital Global Aggregate hedged in CHF TR
Aktien Schweiz	SPI TR
Aktien Welt (hedged)	MSCI World ex CH hedged in CHF net
Aktien Welt Small Cap	MSCI World Small Cap net
Aktien Emerging Markets	MSCI Emerging Markets net
Immobilien Schweiz indirekt	SXI Real Estate Funds Broad TR / KGAST
Immobilien Schweiz Direktanlagen	KGAST
Gold	London Gold PM Fixing*

* je nach Umsetzung der Vermögensverwalter mit oder ohne Währungsabsicherung