

Datum	Index	%
14.10.2021	2032.4	3.5%
31.12.2020	1963.5	5.0%
31.12.2019	1870.0	12.5%
31.12.2018	1662.3	-4.6%

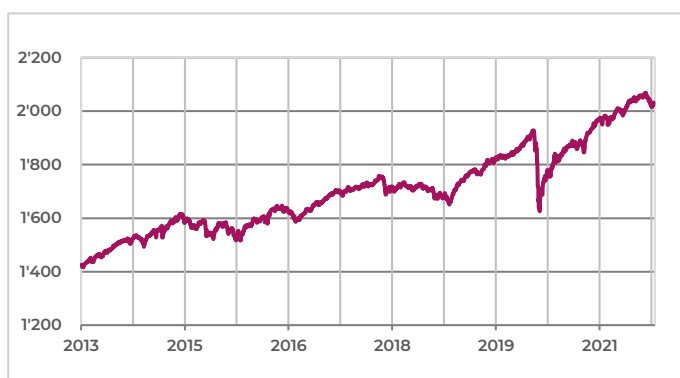
SPPi Swiss Pension Performance Index®

Index Factsheet

SPPi

- Der SPPi dient der Performance-Messung von Anlagestrategien, welche die Vorgaben der schweizerischen Gesetzgebung für Vorsorgeeinrichtungen einhalten (BVV2).
- Der Index erfüllt die Erfordernisse, die an einen Vergleichsindex zu stellen sind. Er ist investierbar und replizierbar.
- Der Index bildet ein Portfolio mit Finanzanlagen ab, die mit ETFs, Indexfonds oder Futures abgedeckt werden können, ein klar definiertes Finanzmarktsegment abbilden und untereinander eine möglichst tiefe Korrelation aufweisen.

SPPi Performance



Indexgewichtungen

	Strategisch	14. Okt 21
Geldmarkt CHF	10.0%	10.0%
Obligationen CHF	30.0%	29.9%
Global Corporate Bonds hedged	6.0%	6.0%
Emerging Market Bonds hedged	6.0%	6.0%
Convertibles hedged	6.0%	6.0%
Aktien Schweiz	9.0%	9.1%
Aktien Nordamerika	3.0%	3.0%
Aktien Europa	3.0%	3.0%
Aktien Japan	3.0%	2.9%
Aktien Emerging Markets	3.0%	3.0%
Infrastruktur hedged	3.0%	3.1%
Immobilien Schweiz	12.0%	11.8%
Global REITS hedged	3.0%	3.1%
Gold	3.0%	3.0%

* Quartalsweise Gewichts Anpassung

Index Kennzahlen

Performance % in CHF p.a.

2014	2015	2016	2017	2018	2019	2020	YTD
8.5%	0.3%	3.8%	7.6%	-4.6%	12.5%	5.0%	3.5%

Risikokennzahlen

	5 Jahre	10 Jahre
Volatilität	4.8%	4.5%
Performance p.a.	4.0%	4.6%
Risikoloser Zinssatz	-0.7%	-0.5%
Sharpe Ratio	0.98	1.12

zum Vergleich, Performance p.a.

	5 Jahre	10 Jahre
Obligationen Schweiz	0.8%	1.9%
BVG Zinssatz	1.0%	1.4%
Aktien Schweiz	6.9%	8.4%

Vorteile

- Der SPPi ist nach der Maxime Transparenz, Investierbarkeit, Liquidität und Unabhängigkeit der Trägerschaft aufgebaut.
- Der Index eignet sich als Basisstrategie für Gelder der 2. und 3. Säule.
- Der SPPi trägt den gesetzlichen Limiten der schweizerischen beruflichen Vorsorge Rechnung.
- Der Index wird unentgeltlich zur Verfügung gestellt, sofern keine kommerziellen Absichten verfolgt werden.

Über uns

- Der SPPi wird täglich von Weissenstein & Partner AG, Zürich berechnet.
- Die Zusammensetzung und Berechnung des SPPi wird von einer unabhängigen Indexkommission überwacht.
- Kontakt: info@sppi.swiss
- Die vollständigen und aktuellen Indexdaten sind auf www.sppi.swiss verfügbar.
- Alle Rechte vorbehalten Weissenstein & Partner AG