

Global Investment Performance Standards (GIPS)



Das XENTIS-Reportingangebot wird um das GIPS-Composite-Reporting-Modul erweitert, um die hohen Anforderungen bezüglich Disclosure und Reporting zu erfüllen.

GLOBAL INVESTMENT PERFORMANCE STANDARDS

Das Composite-Konzept ist ein zentraler Bestandteil der Global Investment Performance Standards und beinhaltet international anerkannte Richtlinien für eine einheitliche und transparente Präsentation der Performance gegenüber potenziellen Investoren und Kunden.

Mit dem GIPS-Composite-Reporting-Modul als Ergänzung zum XENTIS-Composite-Modul sind XENTIS-Kunden in der Lage, Composites GIPS-konform zu verwalten und die hohen Anforderungen bzgl. Disclosure und Reporting zu erfüllen.

UMFANG UND INHALT DES GIPS-COMPOSITE-REPORTING-MODUL

Dank dem modularen Aufbau als Kunden-Report-Mappe können XENTIS-Kunden das GIPS-Composite-Reporting-Modul via Konfiguration sowohl hinsichtlich Inhalt als auch Layout an ihre individuellen Bedürfnisse anpassen. Das GIPS-Composite-Reporting-Modul besteht aus den folgenden Submodulen:

Übersicht Composite

Dieses Auswertungsblatt besteht aus drei verschiedenen Sektionen:

- Composite-Stammdaten wie bspw. zugehörige GIPS-Firma, Bezeichnung, Startdatum, Anlagestrategie, Referenzwährung, Benchmark etc.
- Informationen/Kriterien bzgl. Portfolio-Zuteilung wie Mindestvolumen, Anlageklasse, maximaler Cashflow etc.
- Zugehörige Asset-Allokation inkl. der minimalen und maximalen Gewichtung pro Anlagekategorie

Übersicht Composite

Eigenschaften

GIPS Firma	Demo Asset Management
Startdatum GIPS Firma	01.01.2006
Bezeichnung	Obligationen CHF AAA-BBB
Benchmark	Swiss Bond Index AAA-BBB TR
Berechnung	per 31.10.2020
Anlagestrategie	Das Vermögen wird gemäss der offiziellen BVG-Strategie für geringere Risikofähigkeit verwaltet.
Gründungsdatum	
Startdatum	01.01.2006
Referenzwährung	01.01.2006
Rendite	CHF
	Bruttorendite

Einschlusskriterien (Business Rules)

Mindestvolumen	CHF 100 000
Max. Cash-Flow	1% des Composite-Volumens
Portfoliotyp	Vermögensverwaltungsportfolio
Anlageklasse	Obligationen CHF
Domizil	CH
Nachhaltigkeit	Nachhaltig

Allokation der Vermögenswerte

Anlagekategorie	BM	Bandbreiten Composite	
		Min.	Max.
Geldmarkt	7.0%	0.0%	15.0%
Obligationen CHF	73.0%	55.0%	88.0%
Obligationen Global	0.0%	0.0%	0.0%
Aktien Schweiz	20.0%	5.0%	30.0%
Aktien Global	20.0%	5.0%	30.0%
Immobilien	0.0%	0.0%	0.0%
Alternative Anlagen	0.0%	0.0%	0.0%



PERFORMANCE UND RISIKOKENNZAHLEN DES COMPOSITES

Die Performance des Composites, der zugehörigen Benchmarks sowie die Risikokennzahlen werden in separaten Auswertungsblättern für unterschiedliche Zeiträume (1-Jahres- / 3-Jahres- / 5-Jahres- / 10-Jahresperiode) ausgewiesen:

Performance 3 Jahre, annualisiert	Historische Rendite			Risikokennzahlen					
	PERIODE	ANNUALISIERTE RENDITE ÜBER 3 JAHRE			PERIODE	RISIKOKENNZAHLEN ANNUALISIERT ÜBER 3 JAHRE			
		COMPOSITE	BENCHMARK	AKTIVE		TRACKING ERROR	INFORMATION RATIO	VOLATILITÄT COMPOSITE	VOLATILITÄT BENCHMARK
	2018-2020	3.91%	3.55%	0.36%	2018-2020	1.24%	0.29%	1.74%	2.46%
	2017-2019	4.01%	4.65%	-0.65%	2017-2019	1.60%	-0.41%	2.30%	3.70%
	2016-2018	2.16%	1.70%	0.46%	2016-2018	1.83%	0.25%	3.71%	5.13%
	2015-2017	1.48%	1.02%	0.46%	2015-2017	1.86%	0.25%	3.80%	5.05%
	2014-2016	0.08%	-0.91%	0.99%	2014-2016	1.48%	0.67%	3.55%	4.22%
	2013-2015	3.48%	3.97%	-0.49%	2013-2015	0.90%	-0.55%	2.72%	2.63%
	2012-2014	4.67%	5.34%	-0.67%	2012-2014	0.72%	-0.94%	2.62%	2.57%
	2011-2013	5.51%	6.33%	-0.82%	2011-2013	0.77%	-1.06%	2.60%	2.62%
	2010-2012	2.32%	3.34%	-1.01%	2010-2012	0.75%	-1.35%	2.65%	2.87%

ALLGEMEINE COMPOSITE INFORMATIONEN

Dieses Auswertungsblatt beinhaltet für das Composite weitere von GIPS vorgeschriebene allgemeine Informationen – jeweils auf Jahresbasis:

- Anzahl zugeteilter Portfolios zu einem Composite
- Marktwert des Composites absolut
- Marktwert des Composites im Verhältnis zum Gesamtvermögen der GIPS-Firma
- Total Assets under Management der zugehörigen GIPS-Firma
- Dispersion der Performancewerte der im Composite enthaltenen Portfolios
- Anteil der „All-In-Fee“-Portfolios im Composite
- Anzahl nicht gebührenpflichtiger Portfolios im Composite

ZUSATZINFORMATIONEN COMPOSITE

Allfällige Zusatzinformationen zu einem Composite – bspw. ein Wechsel der Benchmark – werden bei Bedarf in diesem Submodul dargestellt.

DISCLOSURE

Dieser Abschnitt deckt die GIPS-Disclosure-Anforderungen ab und besteht im Wesentlichen aus frei konfigurierbaren Textbausteinen und Fliesstext zu folgenden Themen:

- GIPS-Statement
- Definition der GIPS-Firma
- Beschreibung der Renditeberechnungsmethodik
- Einsatz von Derivaten
- Informationen bzgl. der Gebührenstruktur der im Composite enthaltenen Portfolios
- Allfällige Einschränkungen bzgl. Mindestportfoliogrösse für das Composite
- Anwendung und Behandlung von signifikanten Cashflows

Eigenschaften GIPS Composite

Composite-Informationen	PERIODE	ANZAHL MANDATE	MARKTWERT (MIO. CHF)	COMPOSITE VERMÖGEN, %	FIRMEN ASSETS	PERFORMANCE DISPERSION	ANTEIL ALL-IN MANDATE	Anzahl nicht gebührenpflichtiger Portfolios
	2020	8	60	1%	4242	2.7	100%	-
	2019	10	595	13%	4583	5.2	100%	-
	2018	8	633	14%	4657	4.7	100%	-
	2017	8	688	15%	4629	3.7	100%	-
	2016	9	689	16%	4256	6.7	100%	-
	2015	1	1	0%	4547		100%	-
	2014	2	2	0%	3993		100%	-
	2013	2	2	0%	3688		100%	-
	2012	2	4	0%	3529			
2011	3	5	0%	2952				
2010	1	2	0%	2383				