

# Globalance Sokrates Fund

Ein herausforderndes Jahr geht zu Ende

Obwohl die Inflationsraten in den USA stärker zurückgingen als erwartet, blieb die Weihnachtsrally im Dezember aus. Vielmehr drehten die Zinsniveaus erneut nach oben, was die Aktienmärkte belastete. Auch der Globalance Sokrates Fonds schloss den Berichtsmonat im negativen Bereich. Während die Immobilien, das Gold und die Versicherungsverbriefungen den Volatilitäten standhielten, führten die negative Performancebeiträge der Aktien und der Anleihen zu einem negativen Resultat im Monat und für das ganze Jahr. Trotz schmerzhafter Zäsur im Jahr 2022 hat sich an Relevanz und Potenzial der in der Anlagestrategie vom Sokrates verfolgten Zukunfts- und Megatrendthemen nichts geändert. Im Gegen teil, zukunftsorientierte Anlagen und Investitionen mit einer positiven Wirkung, sind wichtiger denn je.

**Statistik** (Performance und Risiko per 31. Dezember 2022)

Rendite Monat Dezember	<b>-2.0%</b>	Annualisierte Rendite seit 1.1.12	<b>2.0%</b>
Rendite seit Jahresbeginn	<b>-15.2%</b>	Annualisierte Volatilität	<b>7.0%</b>
Sharpe Ratio	<b>0.3</b>		

## 5 Gründe für den Globalance Sokrates Fund

- + Dynamischer Baustein für Ihr Anlage, Vorsorge- bzw. Stiftungsvermögen
- + Weltweit erster Fonds mit Footprint Report zur Wirkung in Wirtschaft, Gesellschaft und Umwelt
- + Investition in langfristige, nachhaltige Megatrends
- + Dynamische Anpassung der Asset Allocation erhöht die Rendite
- + Klima-Erwärmungspotenzial ihm Rahmen des Temperaturziels des globalen Pariser Abkommens

Mehr zur Nachhaltigkeit dieses Fonds erfahren Sie [hier](#).



## Anlagestrategie

Sokrates investiert (BVV2-konform) in eine dynamisch bewirtschaftete Kombination breit diversifizierter Anlageklassen von Aktien, Obligationen, Realwerten wie Immobilien oder tief korrelierten Anlagen wie beispielsweise Versicherungsverbriefungen oder Prämienstrategien.

Die Anlagestrategie erlaubt es, die Anlageklassen je nach Markteinschätzung zu gewichten. Basierend darauf investiert der Fonds in Einzelanlagen und Anlagegefässe mit positivem Footprint.

Die Attraktivität liegt für den Investor in der breiten Diversifikation der Anlageklassen, im Marktpotential der zukunftsorientierten Anlagethemen und dem positiven Footprint.

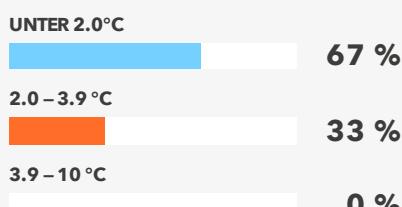


**KLIMA**  
**1,3°C**

— Vergleichsindex: 2,8°C  
..... Übereinkommen von Paris: 2,0°C

Dieses Portfolio weist ein geringes Erwärmungspotenzial auf. 67 % dieses Fonds haben ein Erwärmungspotenzial unter 2 °C.

### Fonds-Zusammensetzung

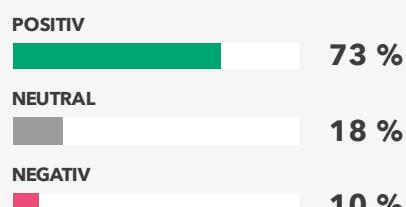


**FOOTPRINT**  
**64**

— Vergleichsindex: 59

Der Footprint dieses Portfolios ist positiv. 73 % des investierten Kapitals weist einen positiven Footprint auf.

### Fonds-Zusammensetzung



**MEGATRENDS**  
**87%**

— Vergleichsindex: 62 %

Dieses Portfolio ist bezüglich Megatrends hervorragend positioniert und weist einen Anteil von 38 % auf.

### Top 3 Megatrends



## Monatliche Nettorendite

Performance und Portfolio Struktur

Mehr zur  
Nachhaltigkeit dieses  
Fonds erfahren  
Sie [hier](#).



### Währungen



85.0	CHF	2.0	GBP
3.9	USD	4.0	Andere
2.9	JPY		
2.2	EUR		

### Portfolio-struktur nach Anlageklassen



39.3 Aktien	4.9 Absicherung Aktien (Futures)
30.0 Obligationen	5.2 Liquidität
12.9 Tief korrelierte Anlagen	
7.7 Realwerte	

### Fondsdaten \*

#### ANTEILKLASSE I (CHF)

Mindestanlage	> CHF 0.1 Mio.
Rechnungswährung	CHF
Inventarwert pro Anteil	CHF 112.0
Fondsvermögen	CHF 54.1
Management und Vertriebsgebühr	0.8%
ISIN	LU0585393688

#### FONDSDATEN

Rechtsstruktur	SICAV nach Luxemburger Recht
Zeichnungen und Rücknahmen	Börsentäglich, bei allen Vertriebs- und Zahlstellen
Vertriebszulassung	Schweiz, Luxemburg und Deutschland
Zahlstelle in der Schweiz	Credit Suisse (Schweiz) AG
Vertreterin	Acolin Fund Services AG, Zürich
Depotbank	Credit Suisse (Luxemburg) AG
Anlageberaterin	Globalance Bank AG
Kontakt	info@globalance.com

\*Der Fonds wurde von der FINMA in der Schweiz bzw. von der BaFin in Deutschland zugelassen und ist seit Januar 2015 BVV2-konform (Anlagevorschriften für Schweizer Vorsorgeguthaben).



**RENDITE  
-2,0 %**

### Kapitalanteil

Die 5 grössten Aktienpositionen per 31. Dezember 2022

1	3i Infrastructure	<b>2,0 %</b>
2	Nike Inc	<b>1,1 %</b>
3	Estee Lauder Companies Inc	<b>1,0 %</b>
4	Mettler Toledo International Inc	<b>1,0 %</b>
5	Thermo Fisher International Inc	<b>1,0 %</b>

Die 5 grössten Fondspositionen per 31. Dezember 2022

1	Optoflex	<b>7,0 %</b>
2	Globalance Zukunftsbewegter Focused Fund	<b>5,7 %</b>
3	Neuberger Berman Short Duration EMMA Debt	<b>4,5 %</b>
4	Nordea Danish Mortgage Bond Fund	<b>4,0 %</b>
5	Nordea Emerging Stars Equity Fund	<b>2,5 %</b>

### Jahresperformance

2022 YTD

2021

2020

2019

2018

2017

### Fonds netto in %

-15.2

7.4

4.4

11.2

-7.9

6.9

Quelle: Globalance Bank AG

### Nachhaltigkeitsbericht Dezember

per 31. Dezember 2022

## Klima

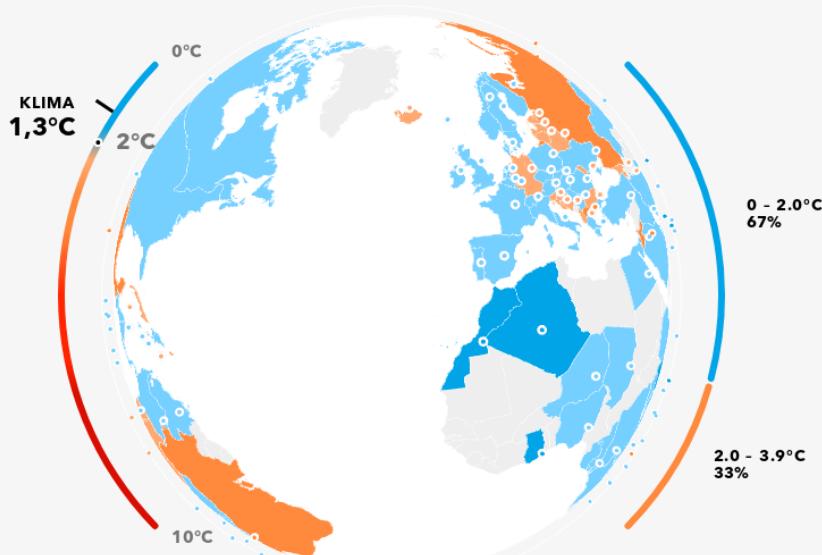
Das Erwärmungspotenzial von Globalance Sokrates Fund

Das Erwärmungspotenzial des Fonds [hier](#)



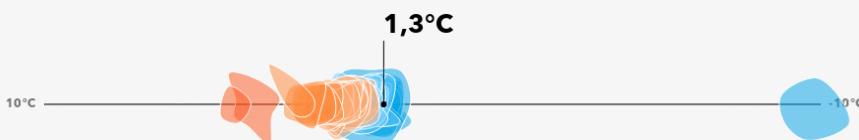
### Dieses Portfolio weist ein geringes Erwärmungspotenzial auf

Das Erwärmungspotenzial basiert auf einer vom MSCI ESG entwickelten Methode und zeigt auf, ob ein Portfolio innerhalb des vereinbarten Ziels des Pariser Klimaabkommens von 2015 liegt. Für die Berechnung werden die Werte der einzelnen Anlagen kapitalgewichtet und zusammengezählt.



**Erklärung:** 33 % des investierten Kapitals hat ein Erwärmungspotenzial von 2 - 3,9°C.

### Erwärmungspotenzial der einzelnen Positionen



**KLIMA  
1,3°C**

SPI (SCHWEIZ)	1,8 °C
DAX (DEUTSCHLAND)	2,5 °C
STOXX EUROPE 600	2,4 °C
S&P 500 (USA)	2,8 °C
MSCI WORLD INDEX	2,8 °C

### Klima-Score

Die fünf Anlagen mit dem besten Klima-Score

- 1 Globalance Climate -9,9 °C Offset  
KAPITALGEWICHT: 2,6 %
- 2 Corporacion Andina de Fomento 0.7%  
KAPITALGEWICHT: 2,8 %
- 3 Africa Fin Cor 1.2% 1,3 °C  
KAPITALGEWICHT: 2,1 %
- 4 NN (L) SICAV - NN (L) Green Bond Short Duration I Capitalisation  
KAPITALGEWICHT: 2,0 %
- 5 Accenture Plc Class A 1,3 °C  
KAPITALGEWICHT: 1,2 %

## Footprint

Die Wirkung von Globalance Sokrates Fund auf Wirtschaft, Gesellschaft und Umwelt

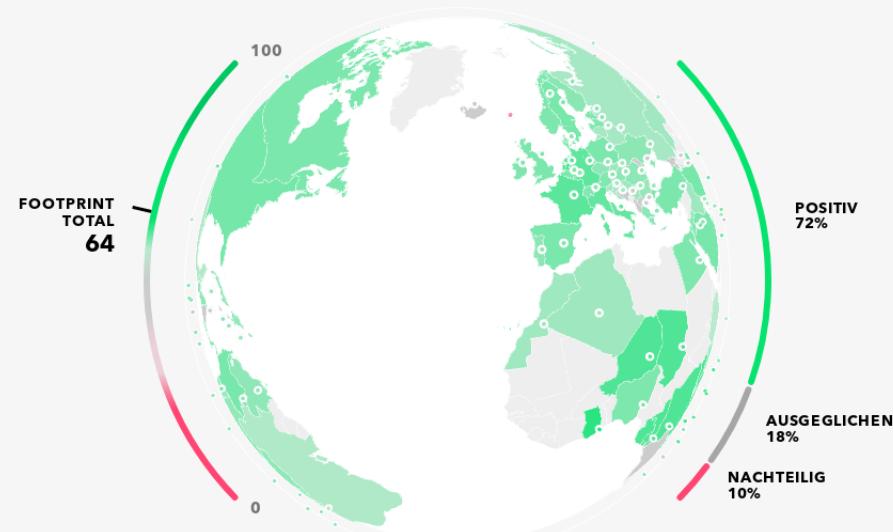
Den Footprint des Fonds [hier](#)



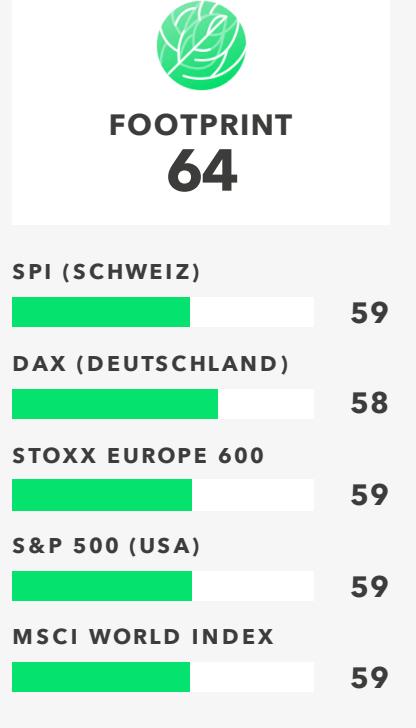
### Der Footprint dieses Portfolios ist positiv

Der Globalance Footprint® zeigt, was die Vermögen unserer Anleger\*innen rund um die Welt leisten – individuell und auf einen Blick. Unser Raster ist einfach und objektiv. Mittels neun Themen bewerten wir den Beitrag an den wirtschaftlichen Wohlstand, die Zukunftsfähigkeit der Gesellschaft und den Erhalt unserer natürlichen Lebensgrundlagen.

WIRTSCHAFT	64	GESELLSCHAFT	59	UMWELT	70
MÄRKTE UND INFRASTRUKTUR	69	ERNÄHRUNG	65	BIODIVERSITÄT	56
ARBEIT	56	GESUNDHEIT	57	RESSOURGEN UND KLIMA	72
STEUERSTRATEGIE	71	BILDUNG UND WISSEN	59	WASSER	46



**Erklärung:** 10 % des investierten Kapitals weist einen nachteiligen, 18 % des investierten Kapitals weist einen ausgeglichenen und 73 % des investierten Kapitals weist einen positiven Footprint aus. Jede der neun Dimensionen wird auf einer Skala von 0 – 100 bewertet und mit einem Gewicht versehen. Der Footprint-Gesamtwert errechnet sich durch die Addition der jeweils gewichteten Punktzahlen der einzelnen Dimensionen.



### Footprint-Score

Die fünf Unternehmen mit dem besten Footprint-Score

- |   |  |    |
|---|--|----|
| 1 | KDDI Corporation   | 92 |
|   | KAPITALGEWICHT: 1,1 %  |    |
| 2 | Automatic Data Processing, Inc.                                  | 91 |
|   | KAPITALGEWICHT: 1,1 %  |    |
| 3 | NN (L) SICAV - NN (L) Green Bond Short Duration I Capitalisation | 90 |
|   | KAPITALGEWICHT: 2,0 %  |    |
| 4 | 1.25 Lonza Swiss 15-23   | 89 |
|   | KAPITALGEWICHT: 0,5 %  |    |
| 5 | Mettler-Toledo International Inc.                                | 88 |
|   | KAPITALGEWICHT: 1,1 %  |    |

## Megatrends

So viele Zukunftsthemen sind im Globalance Sokrates Fund



### Dieses Portfolio ist bezüglich Megatrends hervorragend positioniert

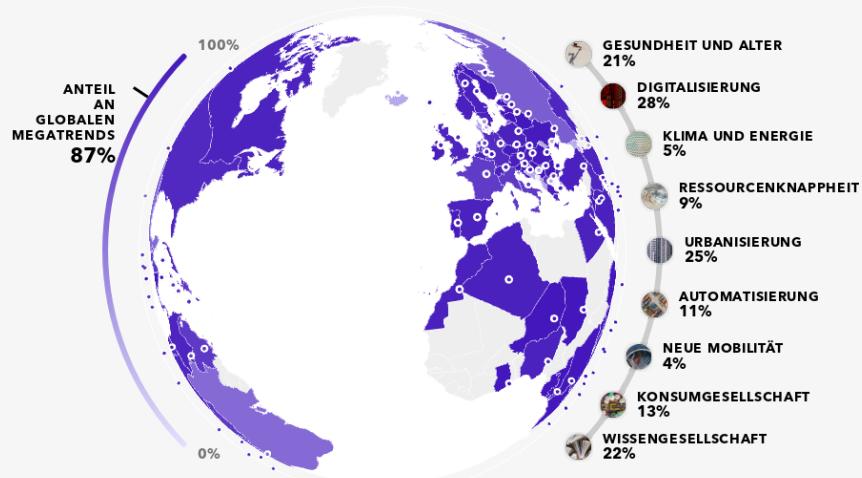
Der Globalance-Megatrend-Score zeigt den durchschnittlichen Umsatzanteil des Portfolios, der in einem oder mehreren Megatrends erzielt wird. Für die Berechnung werden die Megatrend-Anteile der einzelnen Anlagen kapital-gewichtet und zusammengezählt.

Den Megatrend-Anteil des Fonds [hier](#)



#### MEGATRENDS 87 %

SPI (SCHWEIZ)		73 %
DAX (DEUTSCHLAND)		53 %
STOXX EUROPE 600		53 %
S&P 500 (USA)		66 %
MSCI WORLD INDEX		62 %



#### Megatrend-Score

Die fünf Unternehmen mit dem besten Score für drei ausgewählte Megatrends

##### DIGITALISIERUNG



Rank	Company	Megatrend Score
1	Accenture Plc Class A	100 %
2	KLA Corporation	100 %
3	Microsoft Corporation	100 %
4	Intel Corporation	97 %
5	Alphabet Inc. Class A	92 %

##### URBANISIERUNG



Rank	Company	Megatrend Score
1	Cellnex Telecom S.A.U 0.78%	91 %
2	Rogers Communications Inc. Class B	88 %
3	American Water Works Company, Inc.	86 %
4	KDDI Corporation	85 %
5	Swiss Prime Site AG 1.25%	84 %

##### WISSENGESELLSCHAFT



Rank	Company	Megatrend Score
1	Automatic Data Processing, Inc.	100 %
2	Cellnex Telecom S.A.U 0.78%	96 %
3	KDDI Corporation	84 %
4	Wolters Kluwer NV	83 %
5	Alphabet Inc. Class A	80 %

## Weitere Informationen

Mehr erfahren

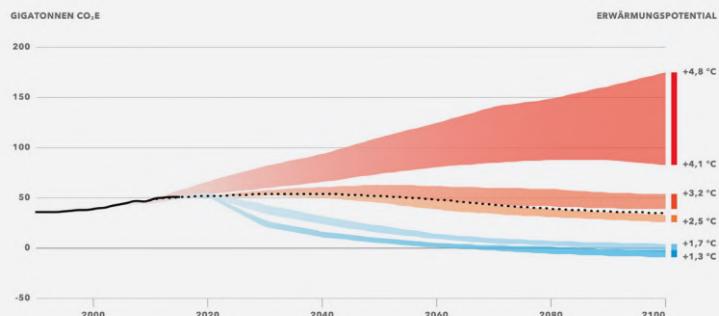


### Die Wirkung des Portfolios

Zunehmende Wetterextreme, das Abschmelzen der Polkappen und weitere Folgen können in direkten Zusammenhang mit der globalen Erwärmung gebracht werden. Die Klimakrise hat einen Einfluss auf Vermögen und umgekehrt. Die Prinzipien der Nachhaltigkeit sind die Grundlagen für eine lebenswerte Gesellschaft und eine gesunde Umwelt. Durch die Integration von Nachhaltigkeit in ein Portfolio vergrössern sich Widerstandsfähigkeit und Potenzial des Vermögens.

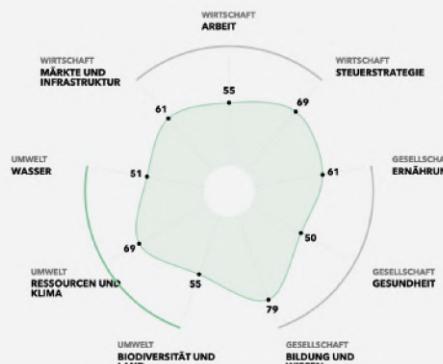
### Das Erwärmungspotenzial im globalen Kontext

Um das Erwärmungspotenzial in die richtige Perspektive zu rücken, zeigen wir die möglichen globalen Emissionspfade bis 2100 (Grafik). Diese wurden von Climate Action Tracker erstellt und zeigen verschiedene Szenarien, die von aktuellen politischen Projektionen über kurzfristige Länderzusagen (bis 2030) bis hin zu langfristigen Länderzusagen (bis 2050) reichen.



### Globalance Footprint

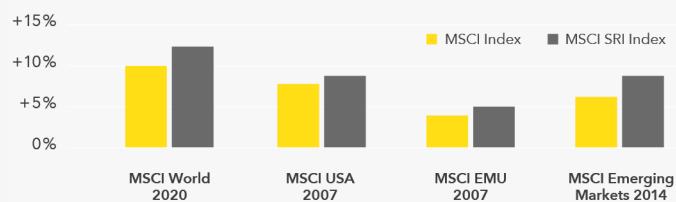
Der Globalance Footprint zeigt auf, was das Vermögen in der Welt leistet – in den Bereichen Wirtschaft, Gesellschaft und Umwelt. Ob Aktien, Immobilien oder Sachwerte: Wir nehmen eine systematische Einschätzung der Wirkung aller Investments vor. Unser Raster ist einfach und objektiv. Insgesamt neun Kriterien stehen stellvertretend für nachhaltige Grundlagen für Wohlstand, Zukunftsfähigkeit der Gesellschaft und Erhalt unserer natürlichen Lebensgrundlagen. Der Footprint ist positiv, wenn der Wert grösser als 54 ist.



### Rendite und Nachhaltigkeit

Historische Vergleiche zwischen traditionellen und nachhaltigen Aktienindizes (MSCI SRI Index) belegen, dass nachhaltige Indizes bessere Erträge generieren als traditionelle. Zusätzlich werden die Portfolios durch die Integration von Faktoren wie ESG als Risikoinstrument resilenter in Krisenzeiten und bieten somit ein besseres Risiko-/Ertragsprofil.

### Jährliche Rendite (seit Lancierung)





**Disclaimer** / Dieses Dokument dient ausschliesslich Informationszwecken. Es stellt weder ein Angebot noch eine Empfehlung zum Erwerb, Halten oder Verkauf von Finanzinstrumenten oder Bankdienstleistungen dar und entbindet die Empfänger\*innen nicht von ihrer eigenen Beurteilung. Insbesondere ist den Empfänger\*innen empfohlen, allenfalls unter Bezug einer Beratungsperson, die Informationen in Bezug auf die Vereinbarkeit mit ihren eigenen Verhältnissen auf juristische, regulatorische, steuerliche u. ä. Konsequenzen zu prüfen. Historische Performance-Daten sind keine Garantie für die zukünftige Entwicklung. Mit einer Anlage in Fondsanteilen sind Risiken, insbesondere diejenigen von Wert- und Ertragsschwankungen, verbunden. Bei der Rückgabe von Fondsanteilen können die Anleger\*innen weniger Geld zurückbekommen, als sie ursprünglich investiert haben. Bei Fremdwährungen besteht zusätzlich das Risiko, dass die Fremdwährung gegenüber der Referenzwährung der Anleger\*innen an Wert verliert. Die in der vorliegenden Publikation enthaltenen Daten und Informationen wurden von der Globalance Bank AG unter grösster Sorgfalt zusammengestellt. Die Globalance Bank AG übernimmt jedoch keine Gewähr für deren Korrektheit, Vollständigkeit, Zuverlässigkeit und Aktualität sowie keine Haftung für Verluste, die aus der Verwendung dieser Informationen entstehen. Dieses Dokument darf weder ganz noch teilweise ohne die schriftliche Genehmigung der Autor\*innen und der Globalance Bank AG reproduziert werden.

## Nachhaltigkeitsbericht Dezember

per 31. Dezember 2022