

# Anlagestiftung Swiss Life BVG-Mix 35



**Nettovermögen (NAV) in Mio. CHF: 295.64**  
**Nettovermögen pro Anspruch in CHF: 192.09**

## Anlagestrategie

Anlagen in alle vom BVG zugelassenen Anlagekategorien (strategischer Aktienanteil: 35%). Aktive Asset Allocation. Begrenzung für Beteiligungspapiere: 45%. Begrenzung für Fremdwährungen: 30%. Durchschnittliche Ratingqualität der Obligationen: mindestens BBB+. Umsetzung mittels Einsatz artreiner Kollektivanlagen. Empfohlene Schwankungsreserven: über 15%.

## Wertentwicklung in Referenzwährung (Basis 100)



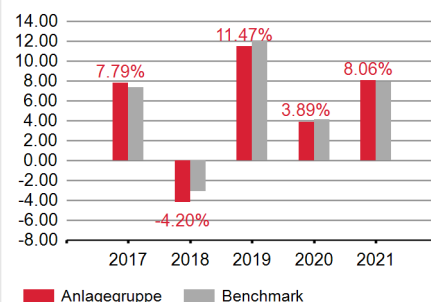
## Performance in Referenzwährung

|              | KUMULIERTE PERFORMANCE |         |          |        | ANNUALISIERTE PERFORMANCE |         |          |       |
|--------------|------------------------|---------|----------|--------|---------------------------|---------|----------|-------|
|              | YTD                    | 1 MONAT | 3 MONATE | 1 JAHR | 3 JAHRE                   | 5 JAHRE | 10 JAHRE | AUFL. |
| ANLAGEGRUPPE | -10.68%                | 1.97%   | -3.29%   | -9.44% | 0.54%                     | 1.50%   | 3.61%    | 3.14% |
| BENCHMARK    | -10.78%                | 2.22%   | -3.51%   | -9.60% | 0.58%                     | 1.84%   | 3.92%    | 3.67% |

## Statistische Angaben (annualisiert)

|                                 | 1 JAHR | 3 JAHRE | 5 JAHRE | 10 JAHRE | AUFL.  |
|---------------------------------|--------|---------|---------|----------|--------|
| Volatilität Anlagegruppe (in %) | 7.02   | 6.98    | 5.97    | 5.14     | 5.27   |
| Volatilität Benchmark (in %)    | -      | 7.45    | 6.30    | 5.20     | 5.24   |
| Tracking Error ex post (in %)   | 0.90   | 0.73    | 0.65    | 0.59     | 0.65   |
| Information Ratio               | 0.18   | -0.06   | -0.53   | -0.52    | -0.80  |
| Sharpe Ratio                    | -1.35  | 0.16    | 0.37    | 0.80     | 0.57   |
| Korrelation                     | 1.00   | 1.00    | 1.00    | 0.99     | 0.99   |
| Beta                            | 0.92   | 0.93    | 0.94    | 0.98     | 1.00   |
| Jensen-Alpha                    | -0.61  | 0.03    | -0.20   | -0.23    | -0.52  |
| Maximum Drawdown (in %)         | -13.03 | -13.41  | -13.41  | -13.41   | -21.36 |
| Recovery Period (Jahre)         | -      | 0.65    | 0.65    | 0.65     | 3.00   |

## Performance



## Produktinformationen

**Valorennummer:** 1245606

**ISIN:** CH0012456064

**LEI:** 254900SR5GM6HP44F130

**Bloomberg-Code:** SWABM35 SW

**Benchmark:** Customized

**Währung:** CHF

**Domizil:** Schweiz

**Aufledgedatum:** 30/09/2001

**Ausgabepreis:** 100.00

**Jahresabschluss:** 30.09

**Ausgabe/Rücknahme:** Täglich

**Annahmeschluss:** 14.00 Uhr

**Ausgabe-/Rücknahmekommission:** Keine

**Ausschüttungspraxis:** Thesaurierung

**Asset Manager:**

**Taktische Asset Allocation**

Swiss Life Asset Management AG

**Eingesetzte artreine Anlagegruppen**

Diverse gemäss

Swiss Life Best Select Invest Plus®

**Externe Beratung:**

PPCmetrics erbringt innerhalb der artreinen

Anlagegruppen folgende Dienstleistungen:

Beratung betreffend geeigneter

Mandatsstruktur, Unterstützung bei der

Selektion geeigneter Asset Manager sowie

Unterstützung bei der laufenden

Überwachung des Asset Managers und

Beurteilung der Anlageresultate.

**Kurspublikationen:** Bloomberg: ASSL

www.swisslife.ch/anlagestiftung

**Betriebsaufwandquote TER KGAST**

**ex ante:** 0.58%

**ex post per:** 30/09/2022 0.59%

**Asset Manager:** Die Auswahl der Manager, deren permanente Überwachung und die gesamte Prozessbegleitung erfolgen nach objektiven Kriterien und bester institutioneller Praxis durch Swiss Life Asset Management AG.

**Betriebsaufwandquote TER KGAST:** Die Betriebsaufwandquote TER KGAST deckt sämtliche Kosten mit Ausnahme der Transaktionskosten und der transaktionsbezogenen steuerlichen Abgaben ab.

**Kommission:** Vorbehalten bleiben abweichende Bestimmungen in den Gebührenordnungen von Freizügigkeitsstiftungen sowie Vorsorgestiftungen 3a.

**Performance:** Gesamtertrag über einen bestimmten Betrachtungszeitraum auf der Basis von zeitgewichteten Renditen.

**Statistische Angaben:** Die Risikokennzahlen basieren auf logarithmierten, monatlichen zeitgewichteten Renditen.

**Tracking Error ex ante:** Der erwartete Tracking Error für die nächsten 12 Monate entspricht dem ex post 3 Jahres Tracking Error.

## Portfoliostruktur nach Anlagekategorien

|  | Anlagegruppe | Benchmark | max. BVV2 |
|--|--------------|-----------|-----------|
| Liquidität                               | 5.18%        | 2.00%     | -         |
| Hypotheken Schweiz                       | 0.74%        | -         | -         |
| Obligationen CHF Inland                  | 11.48%       | 14.00%    | -         |
| Obligationen CHF Ausland                 | 4.49%        | 7.00%     | -         |
| Obligationen Fremdwährungen (CHF hedged) | 26.27%       | 24.00%    | -         |
| Aktien Schweiz                           | 17.34%       | 18.00%    | -         |
| Aktien Ausland                           | 15.00%       | 17.00%    | -         |
| Aktien Ausland (CHF hedged)              | 2.01%        | -         | -         |
| Immobilien Schweiz                       | 12.11%       | 11.00%    | 30.00%    |
| Immobilien Ausland (CHF hedged)          | 3.10%        | 2.00%     | 10.00%    |
| Alternative Anlagen (CHF hedged)         | 2.28%        | 5.00%     | 15.00%    |
| Total Aktien (In- und Ausland)           | 34.36%       | 35.00%    | 50.00%    |
| Total Fremdwährungen                     | 15.00%       | 17.00%    | 30.00%    |

## Portfoliostruktur nach Währungen

|        |        |
|--------|--------|
| CHF    | 85.00% |
| USD    | 10.66% |
| EUR    | 1.63%  |
| JPY    | 0.91%  |
| ÜBRIGE | 1.80%  |

## Benchmarkzusammensetzung

|   |        |
|---|--------|
| 1M SARON  | 2.00%  |
| SBI DOMESTIC AAA-BBB                                | 14.00% |
| SBI FOREIGN AAA-BBB                                 | 7.00%  |
| BLOOMBERG GL. AGG. TREAS. EX CH TR (CHF HEDGED)     | 3.50%  |
| BLOOMBERG GL. AGG. CORP. TR (CHF HEDGED)            | 7.50%  |
| BLOOMBERG GL. AGG. CORP. SHORT TERM TR (CHF HEDGED) | 8.00%  |
| JP MORGAN CEMBI BROAD DIV IG INDEX (CHF HEDGED)     | 5.00%  |
| SWISS PERFORMANCE INDEX                             | 18.00% |
| MSCI WORLD EX CH ESG LEADERS, IN CHF                | 13.60% |
| MSCI AC WORLD SMALL CAP, IN CHF                     | 2.55%  |
| MSCI EMERGING MARKETS, IN CHF                       | 0.85%  |
| KGAST IMMO-INDEX                                    | 11.00% |
| SL REF (LUX) GERMAN CORE REAL ESTATE (CHF HEDGED)   | 2.00%  |
| HFRX GLOBAL HEDGE FUNDS (CHF HEDGED)                | 5.00%  |

## Eigenschaften der festverzinslichen Anlagen

|                           |      |
|---------------------------|------|
| Modified Duration         | 5.12 |
| Durchschnittliches Rating | A    |