

Anlagestiftung Swiss Life BVG-Mix 45



Nettvermögen (NAV) in Mio. CHF: 547.45
Nettvermögen pro Anspruch in CHF: 198.67

Anlagestrategie

Anlagen in alle vom BVG zugelassenen Anlagekategorien (strategischer Aktienanteil: 45%). Aktive Asset Allocation. Begrenzung für Beteiligungspapiere: 50%. Begrenzung für Fremdwährungen: 30%. Durchschnittliche Ratingqualität der Obligationen: mindestens BBB+. Umsetzung mittels Einsatz artreiner Kollektivanlagen. Empfohlene Schwankungsreserven: über 20%.

Wertentwicklung in Referenzwährung (Basis 100)



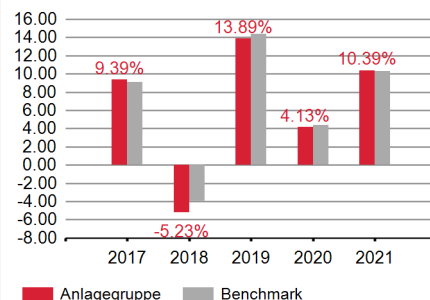
Performance in Referenzwährung

	KUMULIERTE PERFORMANCE				ANNUALISIERTE PERFORMANCE			
	YTD	1 MONAT	3 MONATE	1 JAHR	3 JAHRE	5 JAHRE	10 JAHRE	AUFL.
ANLAGEGRUPPE	-11.74%	2.53%	-3.51%	-10.28%	1.08%	1.98%	4.31%	3.31%
BENCHMARK	-11.33%	2.87%	-3.51%	-9.92%	1.31%	2.45%	4.71%	3.96%

Statistische Angaben (annualisiert)

	1 JAHR	3 JAHRE	5 JAHRE	10 JAHRE	AUFL.
Volatilität Anlagegruppe (in %)	8.35	8.34	7.23	6.26	6.54
Volatilität Benchmark (in %)	-	8.72	7.48	6.26	6.51
Tracking Error ex post (in %)	0.86	0.67	0.62	0.59	0.69
Information Ratio	-0.42	-0.35	-0.76	-0.69	-0.93
Sharpe Ratio	-1.25	0.20	0.37	0.77	0.48
Korrelation	1.00	1.00	1.00	1.00	0.99
Beta	0.93	0.95	0.96	1.00	1.00
Jensen-Alpha	-1.02	-0.14	-0.36	-0.38	-0.65
Maximum Drawdown (in %)	-14.55	-16.22	-16.22	-16.22	-28.27
Recovery Period (Jahre)	-	0.67	0.67	0.67	3.76

Performance



Produktinformationen

Valorennummer: 1245607

ISIN: CH0012456072

LEI: 2549001XL79VZWO5Q69

Bloomberg-Code: SWABM45 SW

Benchmark: Customized

Währung: CHF

Domizil: Schweiz

Aufgagedatum: 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: 0.59%

ex post per: 30/09/2022 0.60%

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	5.74%	2.00%	-
Hypotheken Schweiz	0.66%	-	-
Obligationen CHF Inland	8.54%	12.00%	-
Obligationen CHF Ausland	4.31%	5.00%	-
Obligationen Fremdwährungen (CHF hedged)	23.68%	20.00%	-
Aktien Schweiz	21.68%	23.00%	-
Aktien Ausland	19.42%	22.00%	-
Aktien Ausland (CHF hedged)	1.97%	-	-
Immobilien Schweiz	9.22%	9.00%	30.00%
Immobilien Ausland (CHF hedged)	2.49%	2.00%	10.00%
Alternative Anlagen (CHF hedged)	2.29%	5.00%	15.00%
Total Aktien (In- und Ausland)	43.07%	45.00%	50.00%
Total Fremdwährungen	19.42%	22.00%	30.00%

Portfoliostruktur nach Währungen

CHF	80.58%
USD	13.77%
EUR	2.12%
JPY	1.18%
ÜBRIGE	2.34%

Benchmarkzusammensetzung

1M SARON	2.00%
SBI DOMESTIC AAA-BBB	12.00%
SBI FOREIGN AAA-BBB	5.00%
BLOOMBERG GL. AGG. TREAS. EX CH TR (CHF HEDGED)	2.50%
BLOOMBERG GL. AGG. CORP. TR (CHF HEDGED)	6.50%
BLOOMBERG GL. AGG. CORP. SHORT TERM TR (CHF HEDGED)	7.00%
JP MORGAN CEMBI BROAD DIV IG INDEX (CHF HEDGED)	4.00%
SWISS PERFORMANCE INDEX	23.00%
MSCI WORLD EX CH ESG LEADERS, IN CHF	17.60%
MSCI AC WORLD SMALL CAP, IN CHF	3.30%
MSCI EMERGING MARKETS, IN CHF	1.10%
KGAST IMMO-INDEX	9.00%
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	4.97
Durchschnittliches Rating	A