

Anlagestiftung Swiss Life BVG-Mix 35 P



Nettovermögen (NAV) in Mio. CHF: 295.64
Nettovermögen pro Anspruch in CHF: 169.80

Anlagestrategie

Die Anlagegruppe BVG-Mix 35 P investiert im Durchschnitt ca. 35% in Aktien. Etwas über die Hälfte des Aktienanteils wird in schweizerische Dividendenpapiere angelegt, der Rest entfällt auf ausländische Gesellschaften. Durchschnittlich sind rund 45% des Vermögens in Obligationen investiert. Es gelten folgende Höchstgrenzen: 45% Aktien, 30% Fremdwährungen. BVG-Mix 35 P eignet sich für Anleger, die bereit sind, mittlere Kursschwankungen in Kauf zu nehmen. Wir empfehlen einen Anlagehorizont von über sieben Jahren.

Wertentwicklung in Referenzwährung (Basis 100)



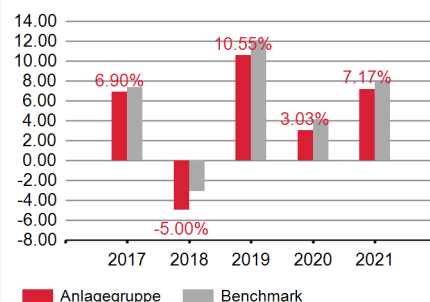
Performance in Referenzwährung

	KUMULIERTE PERFORMANCE				ANNUALISIERTE PERFORMANCE			
	YTD	1 MONAT	3 MONATE	1 JAHR	3 JAHRE	5 JAHRE	10 JAHRE	AUFL.
ANLAGEGRUPPE	-11.30%	1.90%	-3.49%	-10.19%	-0.29%	0.66%	2.76%	2.67%
BENCHMARK	-10.78%	2.22%	-3.51%	-9.60%	0.58%	1.84%	3.92%	4.07%

Statistische Angaben (annualisiert)

	1 JAHR	3 JAHRE	5 JAHRE	10 JAHRE	AUFL.
Volatilität Anlagegruppe (in %)	7.02	6.98	5.97	5.14	5.23
Volatilität Benchmark (in %)	-	7.45	6.30	5.20	5.20
Tracking Error ex post (in %)	0.90	0.72	0.64	0.59	0.68
Information Ratio	-0.66	-1.21	-1.83	-1.98	-2.08
Sharpe Ratio	-1.47	0.04	0.23	0.64	0.49
Korrelation	1.00	1.00	1.00	0.99	0.99
Beta	0.92	0.93	0.95	0.98	1.00
Jensen-Alpha	-1.37	-0.80	-1.04	-1.09	-1.39
Maximum Drawdown (in %)	-13.60	-13.60	-13.60	-13.60	-22.51
Recovery Period (Jahre)	-	-	-	-	3.44

Performance



Produktinformationen

Valorennummer: 1436916

ISIN: CH0014369166

LEI:

Bloomberg-Code: SLVOR35 SW

Benchmark: Customized

Währung: CHF

Domizil: Schweiz

Aufgagedatum: 30/09/2002

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: 1.41%

ex post per: 30/09/2022 1.42%

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.

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%

Grösste Aktienpositionen

	Anlagegruppe
NESTLE SA-REG	3.52%
ROCHE HOLDING AG	2.74%
NOVARTIS AG-REG	2.17%
MICROSOFT CORP.	0.82%
ZURICH INSURANCE GROUP AG	0.75%
UBS GROUP AG-REG	0.61%
CIE FINANCIERE RICHEMONT-REG	0.60%
ALPHABET INC	0.55%
ABB LTD-REG	0.53%
LONZA GROUP AG-REG	0.45%

Eigenschaften der festverzinslichen Anlagen

Modified Duration	5.12
Durchschnittliches Rating	A