

Anlagestiftung Swiss Life BVG-Mix 45 P



Nettovermögen (NAV) in Mio. CHF: 547.45
Nettovermögen pro Anspruch in CHF: 181.48

Anlagestrategie

Die Anlagegruppe BVG-Mix 45 P investiert im Durchschnitt ca. 45% in Aktien. Etwas über die Hälfte des Aktienanteils wird in schweizerische Dividendenpapiere angelegt, der Rest entfällt auf ausländische Gesellschaften. Durchschnittlich sind rund 37% des Vermögens in Obligationen investiert. Es gelten folgende Höchstgrenzen: 50% Aktien, 30% Fremdwährungen. BVG-Mix 45 P eignet sich für Anleger, die bereit sind, grössere Kursschwankungen in Kauf zu nehmen. Wir empfehlen einen Anlagehorizont von über zehn Jahren.

Wertentwicklung in Referenzwährung (Basis 100)



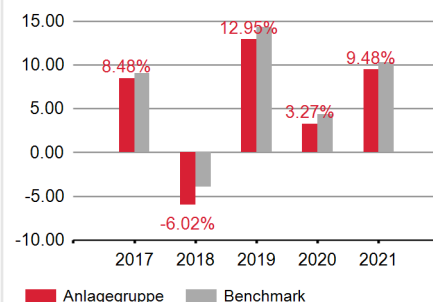
Performance in Referenzwährung

	KUMULIERTE PERFORMANCE				ANNUALISIERTE PERFORMANCE			
	YTD	1 MONAT	3 MONATE	1 JAHR	3 JAHRE	5 JAHRE	10 JAHRE	AUFL.
ANLAGEGRUPPE	-12.35%	2.46%	-3.71%	-11.02%	0.24%	1.14%	3.45%	3.01%
BENCHMARK	-11.33%	2.87%	-3.51%	-9.92%	1.31%	2.45%	4.71%	4.53%

Statistische Angaben (annualisiert)

	1 JAHR	3 JAHRE	5 JAHRE	10 JAHRE	AUFL.
Volatilität Anlagegruppe (in %)	8.35	8.33	7.23	6.26	6.45
Volatilität Benchmark (in %)	-	8.72	7.48	6.26	6.42
Tracking Error ex post (in %)	0.86	0.66	0.62	0.59	0.70
Information Ratio	-1.29	-1.60	-2.11	-2.16	-2.17
Sharpe Ratio	-1.34	0.10	0.25	0.63	0.45
Korrelation	1.00	1.00	1.00	1.00	0.99
Beta	0.93	0.95	0.96	1.00	1.00
Jensen-Alpha	-1.75	-0.98	-1.20	-1.25	-1.51
Maximum Drawdown (in %)	-15.10	-16.28	-16.28	-16.28	-29.17
Recovery Period (Jahre)	-	0.74	0.74	0.74	3.98

Performance



Produktinformationen

Valorennummer: 1436925
ISIN: CH0014369257
LEI: 2549001XL79VZWJO5Q69
Bloomberg-Code: SLVOR45 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: ASLL
www.swisslife.ch/anlagestiftung
Betriebsaufwandquote TER KGAST
ex ante: 1.42%
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	5.74%	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%

Grösste Aktienpositionen

	Anlagegruppe
NESTLE SA-REG	4.40%
ROCHE HOLDING AG	3.43%
NOVARTIS AG-REG	2.71%
MICROSOFT CORP.	1.07%
ZURICH INSURANCE GROUP AG	0.94%
UBS GROUP AG-REG	0.76%
CIE FINANCIERE RICHEMONT-REG	0.75%
ALPHABET INC	0.71%
ABB LTD-REG	0.66%
LONZA GROUP AG-REG	0.56%

Eigenschaften der festverzinslichen Anlagen

Modified Duration	4.97
Durchschnittliches Rating	A