

Anlagestiftung Swiss Life BVG-Mix 45

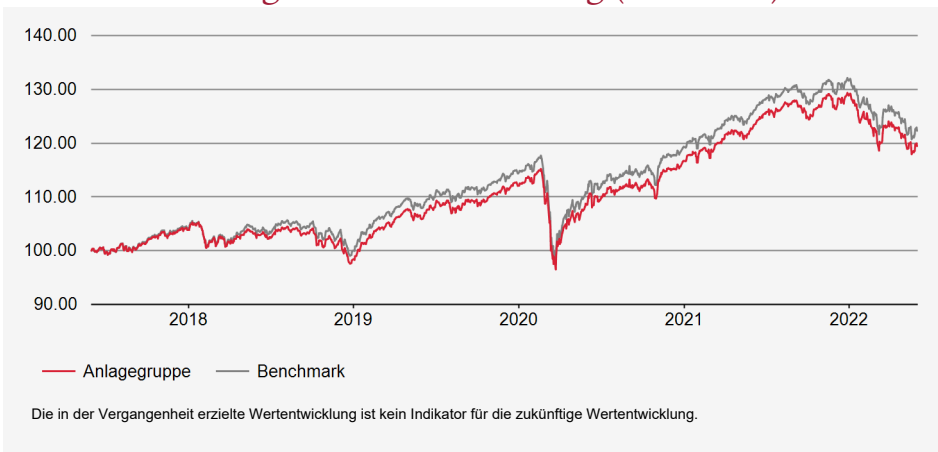


Nettovermögen (NAV) in Mio. CHF: 522.00
Nettovermögen pro Anspruch in CHF: 208.67

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)



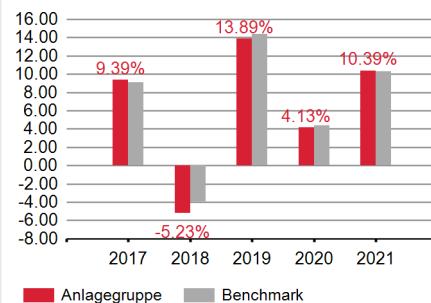
Performance in Referenzwährung

	KUMULIERTE PERFORMANCE				ANNUALISIERTE PERFORMANCE			
	YTD	1 MONAT	3 MONATE	1 JAHR	3 JAHRE	5 JAHRE	10 JAHRE	AUFL.
ANLAGEGRUPPE	-7.30%	-1.60%	-2.54%	-2.61%	4.10%	3.61%	5.39%	3.62%
BENCHMARK	-7.08%	-1.50%	-2.53%	-2.45%	4.26%	4.10%	5.73%	4.27%

Statistische Angaben (annualisiert)

	1 JAHR	3 JAHRE	5 JAHRE	10 JAHRE	AUFL.
Volatilität Anlagegruppe (in %)	6.12	7.22	6.47	5.84	6.40
Volatilität Benchmark (in %)	5.86	7.40	6.58	5.73	6.32
Tracking Error ex post (in %)	0.32	0.52	0.52	0.54	0.67
Information Ratio	-0.48	-0.30	-0.95	-0.64	-0.97
Sharpe Ratio	-0.32	0.65	0.67	1.00	0.54
Korrelation	1.00	1.00	1.00	1.00	0.99
Beta	1.04	0.97	0.98	1.01	1.01
Jensen-Alpha	-0.07	-0.02	-0.40	-0.44	-0.68
Maximum Drawdown (in %)	-8.81	-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: 2549001XL79VZWJO5Q69
Bloomberg-Code: SWABM45 SW
Benchmark: Customized
Währung: CHF
Domizil: Schweiz
Aufgatedatum: 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: 30/09/2021 0.62%

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	5.95%	2.00%	-
Hypotheken Schweiz	0.72%	-	-
Obligationen CHF Inland	6.56%	12.00%	-
Obligationen CHF Ausland	4.18%	5.00%	-
Obligationen Fremdwährungen (CHF hedged)	24.68%	20.00%	-
Aktien Schweiz	22.58%	23.00%	-
Aktien Ausland	20.57%	22.00%	-
Aktien Ausland (CHF hedged)	1.40%	-	-
Immobilien Schweiz	8.93%	9.00%	30.00%
Immobilien Ausland (CHF hedged)	2.30%	2.00%	10.00%
Alternative Anlagen (CHF hedged)	2.12%	5.00%	15.00%
Total Aktien (In- und Ausland)	44.55%	45.00%	50.00%
Total Fremdwährungen	20.57%	22.00%	30.00%

Portfoliostruktur nach Währungen

CHF	79.43%
USD	14.21%
EUR	2.32%
JPY	1.34%
ÜBRIGE	2.70%

Benchmarkzusammensetzung

1M SARON	2.00%
SBI DOMESTIC AAA-BBB	12.00%
SBI FOREIGN AAA-BBB	5.00%
BB* GL. AGG. TREAS. EX CH TR (CHF HEDGED)	2.50%
BB* GL. AGG. CORP. TR (CHF HEDGED)	6.50%
BB* 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, 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%

* Bloomberg Barclays

Eigenschaften der festverzinslichen Anlagen

Modified Duration	5.14
Durchschnittliches Rating	A