

Anlagestiftung Swiss Life BVG-Mix 45

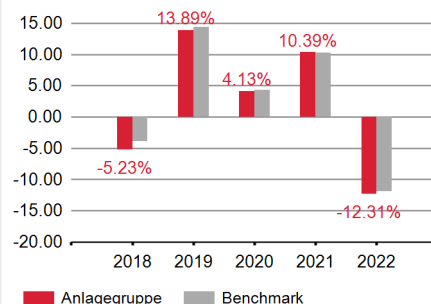


Nettovermögen (NAV) in Mio. CHF: 570.16
Nettovermögen pro Anspruch in CHF: 197.39

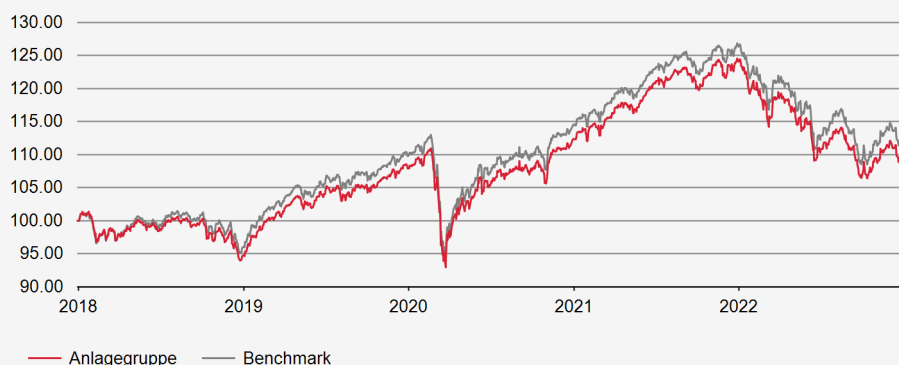
Anlagestrategie

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%.

Performance



Wertentwicklung in Referenzwährung (Basis 100)



Die in der Vergangenheit erzielte Wertentwicklung ist kein Indikator für die zukünftige Wertentwicklung.

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®

Performance in Referenzwährung

	KUMULIERTE PERFORMANCE				ANNUALISIERTE PERFORMANCE			
	YTD	1 MONAT	3 MONATE	1 JAHR	3 JAHRE	5 JAHRE	10 JAHRE	AUFL.
ANLAGEGRUPPE	-12.31%	-2.61%	1.87%	-12.31%	0.26%	1.70%	4.10%	3.25%
BENCHMARK	-11.93%	-2.72%	2.10%	-11.93%	0.45%	2.16%	4.50%	3.89%

Statistische Angaben (annualisiert)

	1 JAHR	3 JAHRE	5 JAHRE	10 JAHRE	AUFL.
Volatilität Anlagegruppe (in %)	8.53	8.52	7.39	6.35	6.56
Volatilität Benchmark (in %)	-	8.89	7.63	6.35	6.53
Tracking Error ex post (in %)	0.84	0.65	0.62	0.58	0.69
Information Ratio	-0.46	-0.28	-0.75	-0.69	-0.93
Sharpe Ratio	-1.51	0.09	0.32	0.72	0.47
Korrelation	1.00	1.00	1.00	1.00	0.99
Beta	0.93	0.96	0.97	1.00	1.00
Jensen-Alpha	-1.21	-0.14	-0.37	-0.38	-0.64
Maximum Drawdown (in %)	-14.46	-16.22	-16.22	-16.22	-28.27
Recovery Period (Jahre)	-	0.67	0.67	0.67	3.76

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	5.62%	2.00%	-
Hypotheken Schweiz	0.66%	-	-
Obligationen CHF Inland	8.63%	12.00%	-
Obligationen CHF Ausland	4.44%	5.00%	-
Obligationen Fremdwährungen (CHF hedged)	24.33%	20.00%	-
Aktien Schweiz	21.71%	23.00%	-
Aktien Ausland	18.50%	22.00%	-
Aktien Ausland (CHF hedged)	2.02%	-	-
Immobilien Schweiz	9.37%	9.00%	30.00%
Immobilien Ausland (CHF hedged)	2.40%	2.00%	10.00%
Alternative Anlagen (CHF hedged)	2.33%	5.00%	15.00%
Total Aktien (In- und Ausland)	42.23%	45.00%	50.00%
Total Fremdwährungen	18.50%	22.00%	30.00%

Portfoliostruktur nach Währungen

CHF	81.50%
USD	12.67%
EUR	2.32%
JPY	1.20%
ÜBRIGE	2.31%

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	4.93
Durchschnittliches Rating	A