

Anlagestiftung Swiss Life BVG-Mix 15

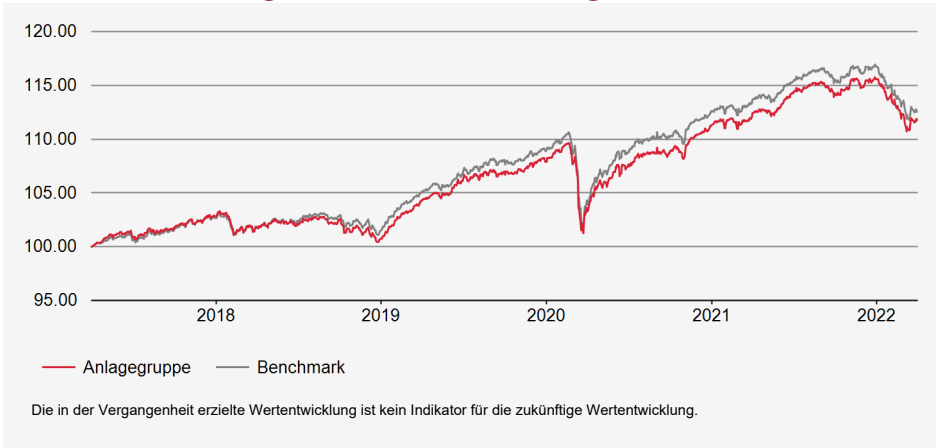


Nettovermögen (NAV) in Mio. CHF: 228.18
Nettovermögen pro Anspruch in CHF: 171.66

Anlagestrategie

Anlagen in alle vom BVG zugelassenen Anlagekategorien (strategischer Aktienanteil: 15%). Aktive Asset Allocation. Begrenzung für Beteiligungspapiere: 20%. Begrenzung für Fremdwährungen: 30%. Durchschnittliche Ratingqualität der Obligationen: mindestens BBB+. Umsetzung mittels Einsatz artreiner Kollektivanlagen. Empfohlene Schwankungsreserven: über 6.5%.

Wertentwicklung in Referenzwährung (Basis 100)



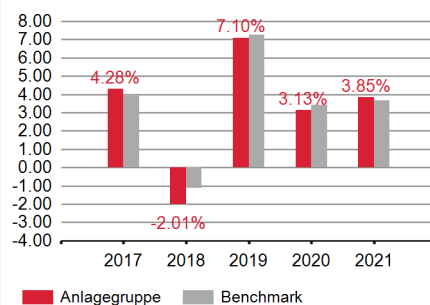
Performance in Referenzwährung

	KUMULIERTE PERFORMANCE				ANNUALISIERTE PERFORMANCE			
	YTD	1 MONAT	3 MONATE	1 JAHR	3 JAHRE	5 JAHRE	10 JAHRE	AUFL.
ANLAGEGRUPPE	-3.18%	-0.39%	-3.18%	-0.19%	2.38%	2.27%	3.10%	2.92%
BENCHMARK	-3.61%	-0.72%	-3.61%	-0.75%	2.32%	2.39%	3.19%	3.24%

Statistische Angaben (annualisiert)

	1 JAHR	3 JAHRE	5 JAHRE	10 JAHRE	AUFL.
Volatilität Anlagegruppe (in %)	2.90	3.65	3.08	2.68	2.70
Volatilität Benchmark (in %)	2.92	3.77	3.13	2.61	2.65
Tracking Error ex post (in %)	0.50	0.45	0.44	0.45	0.56
Information Ratio	1.13	0.13	-0.27	-0.18	-0.57
Sharpe Ratio	0.15	0.84	0.98	1.35	1.05
Korrelation	0.99	0.99	0.99	0.99	0.98
Beta	0.98	0.96	0.97	1.01	1.00
Jensen-Alpha	0.56	0.18	-0.04	-0.13	-0.32
Maximum Drawdown (in %)	-4.34	-7.63	-7.63	-7.63	-7.63
Recovery Period (Jahre)	-	0.64	0.64	0.64	0.64

Performance



Produktinformationen

Valorennummer: 1564965

ISIN: CH0015649657

LEI: 254900RW4KJYAQTH6Y97

Bloomberg-Code: SWABM15 SW

Benchmark: Customized

Währung: CHF

Domizil: Schweiz

Aufledgedatum: 30/06/2003

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: 0.57%

ex post per: 30/09/2021 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	3.70%	2.00%	-
Hypotheken Schweiz	9.82%	13.00%	-
Obligationen CHF Inland	9.22%	13.00%	-
Obligationen CHF Ausland	3.89%	6.00%	-
Obligationen Fremdwährungen (CHF hedged)	31.88%	28.00%	-
Aktien Schweiz	9.10%	8.00%	-
Aktien Ausland	6.73%	7.00%	-
Aktien Ausland (CHF hedged)	2.09%	-	-
Immobilien Schweiz	17.87%	15.00%	30.00%
Immobilien Ausland (CHF hedged)	3.59%	3.00%	10.00%
Alternative Anlagen (CHF hedged)	2.12%	5.00%	15.00%
Total Aktien (In- und Ausland)	17.92%	15.00%	50.00%
Total Fremdwährungen	6.73%	7.00%	30.00%

Portfoliostruktur nach Währungen

CHF	93.27%
USD	4.81%
EUR	0.72%
JPY	0.43%
ÜBRIGE	0.77%

Benchmarkzusammensetzung

1M SARON	2.00%
SBI DOMESTIC AAA-A 1-3Y	13.00%
SBI DOMESTIC AAA-BBB	13.00%
SBI FOREIGN AAA-BBB	6.00%
BB* GL. AGG. TREAS. EX CH TR (CHF HEDGED)	5.00%
BB* GL. AGG. CORP. TR (CHF HEDGED)	12.00%
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	8.00%
MSCI WORLD EX CH, IN CHF	5.60%
MSCI AC WORLD SMALL CAP, IN CHF	1.05%
MSCI EMERGING MARKETS, IN CHF	0.35%
KGAST IMMO-INDEX	15.00%
SL REF (LUX) GERMAN CORE REAL ESTATE (CHF HEDGED)	3.00%
HFRX GLOBAL HEDGE FUNDS (CHF HEDGED)	5.00%

* Bloomberg Barclays

Eigenschaften der festverzinslichen Anlagen

Modified Duration	4.32
Durchschnittliches Rating	A+