

# Anlagestiftung Swiss Life BVG-Mix 45



**Nettovermögen (NAV) in Mio. CHF: 399.48**  
**Nettovermögen pro Anspruch in CHF: 218.33**

## 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.
<b>ANLAGEGRUPPE</b>	<b>7.07%</b>	<b>-2.14%</b>	<b>-0.39%</b>	<b>11.82%</b>	<b>6.34%</b>	<b>5.70%</b>	<b>6.62%</b>	<b>3.98%</b>
<b>BENCHMARK</b>	<b>6.99%</b>	<b>-2.09%</b>	<b>-0.32%</b>	<b>11.71%</b>	<b>6.70%</b>	<b>6.15%</b>	<b>6.96%</b>	<b>4.64%</b>

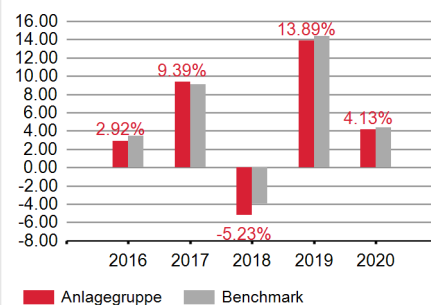
## Statistische Angaben (annualisiert)

	1 JAHR	3 JAHRE	5 JAHRE	10 JAHRE	AUFL.
Volatilität Anlagegruppe (in %)	6.66	7.52	6.16	5.70	6.40
Volatilität Benchmark (in %)	6.61	7.72	6.29	5.59	6.33
Tracking Error ex post (in %)	0.21	0.55	0.55	0.56	0.68
Information Ratio	0.50	-0.66	-0.82	-0.61	-0.98
Sharpe Ratio	1.77	0.92	1.03	1.22	0.59
Korrelation	1.00	1.00	1.00	1.00	0.99
Beta	1.01	0.97	0.98	1.01	1.01
Jensen-Alpha	0.01	-0.15	-0.29	-0.45	-0.69
Maximum Drawdown (in %)	-3.14	-16.22	-16.22	-16.22	-28.27
Recovery Period (Jahre)	0.03	0.67	0.67	0.67	3.76

**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.

## 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%

## Portfoliostruktur nach Anlagekategorien

	Anlagegruppe	Benchmark	max. BVV2
Liquidität	1.44%	2.00%	-
Obligationen CHF Inland	6.49%	12.00%	-
Obligationen CHF Ausland	3.99%	5.00%	-
Obligationen Fremdwährungen (CHF hedged)	24.39%	20.00%	-
Aktien Schweiz	23.73%	23.00%	-
Aktien Ausland	23.26%	22.00%	-
Aktien Ausland (CHF hedged)	2.08%	-	-
Immobilien Schweiz	10.52%	9.00%	30.00%
Immobilien Ausland (CHF hedged)	2.01%	2.00%	10.00%
Alternative Anlagen (CHF hedged)	2.09%	5.00%	15.00%
Total Aktien (In- und Ausland)	49.07%	45.00%	50.00%
Total Fremdwährungen	23.26%	22.00%	30.00%

## Portfoliostruktur nach Währungen

CHF	76.74%
USD	16.11%
EUR	2.74%
JPY	1.66%
ÜBRIGE	2.75%

## Benchmarkzusammensetzung

CITIGROUP CHF 1 M EURO DEPO	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	5.70
Durchschnittliches Rating	A-