

30. September 2023

Anlagestiftung Swiss Life BVG-Mix 75



(Aktien- und Fremdwährungsquote gemäss BVV2 überschritten)

Nettovermögen (NAV) in Mio. CHF: 163.96
Nettovermögen pro Anspruch in CHF: 124.22

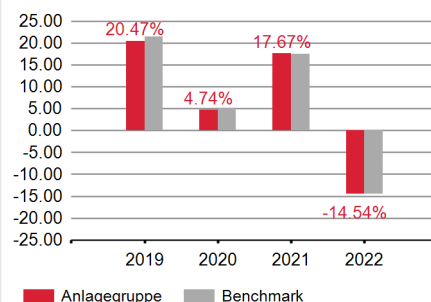
Anlagestrategie

Anlagen in alle vom BVG zugelassenen Anlagekategorien (strategischer Aktienanteil: 75%). Aktive Asset Allocation. Begrenzung für Beteiligungspapiere: 85%. Begrenzung für Fremdwährungen: 50%. Durchschnittliche Ratingqualität der Obligationen: mindestens BBB. Umsetzung mittels Einsatz artreiner Kollektivanlagen. Aufgrund des erhöhten Aktien- und Fremdwährungsanteils beinhaltet diese Anlagegruppe ein höheres Risiko im Vergleich zu einem BVG-Mix mit maximal 50% Aktien- bzw. maximal 30% Fremdwährungsanteil.

Wertentwicklung in Referenzwährung (Basis 100)



Performance



Produktinformationen

Valorennummer: 43583002
ISIN: CH0435830028
LEI: 2549007MI5RG5X8NMB06
Bloomberg-Code: SWABM75 SW
Benchmark: Customized
Währung: CHF
Domizil: Schweiz
Aufledgedatum: 31/10/2018
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: 0.64%
ex post per: 30/09/2023 0.64%

Performance in Referenzwährung

	KUMULIERTE PERFORMANCE				ANNUALISIERTE PERFORMANCE			
	YTD	1 MONAT	3 MONATE	1 JAHR	3 JAHRE	5 JAHRE	10 JAHRE	AUFL.
ANLAGEGRUPPE	4.14%	-1.42%	-1.93%	7.22%	3.64%	-	-	4.51%
BENCHMARK	5.12%	-1.41%	-1.80%	8.55%	4.04%	-	-	5.00%

Statistische Angaben (annualisiert)

	1 JAHR	3 JAHRE	5 JAHRE	10 JAHRE	AUFL.
Volatilität Anlagegruppe (in %)	8.06	10.56	-	-	10.93
Volatilität Benchmark (in %)	8.60	10.90	-	-	11.42
Tracking Error ex post (in %)	0.60	0.70	-	-	0.87
Information Ratio	-2.22	-0.58	-	-	-0.56
Sharpe Ratio	0.72	0.34	-	-	0.43
Korrelation	1.00	1.00	-	-	1.00
Beta	0.94	0.97	-	-	0.96
Jensen-Alpha	-0.87	-0.28	-	-	-0.25
Maximum Drawdown (in %)	-5.02	-17.76	-	-	-23.54
Recovery Period (Jahre)	0.14	-	-	-	0.74

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.

(Aktien- und Fremdwährungsquote gemäss BVV2 überschritten)

Portfoliostruktur nach Anlagekategorien

	Anlagegruppe	Benchmark	max. BVV2
Liquidität	4.79%	2.00%	-
Hypotheken Schweiz	0.40%	-	-
Obligationen Fremdwährungen (CHF hedged)	13.20%	13.00%	-
Aktien Schweiz	36.60%	38.00%	-
Aktien Ausland	33.97%	37.00%	-
Aktien Ausland (CHF hedged)	1.58%	-	-
Immobilien Schweiz	6.66%	5.00%	30.00%
Immobilien Ausland (CHF hedged)	0.48%	-	10.00%
Alternative Anlagen (CHF hedged)	2.32%	5.00%	15.00%
Total Aktien (In- und Ausland)	72.15%	75.00%	50.00%
Total Fremdwährungen	33.97%	37.00%	30.00%

Grösste Aktienpositionen

NESTLE SA-REG	6.92%
NOVARTIS AG-REG	4.96%
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	4.40%
MICROSOFT CORP.	1.97%
UBS GROUP AG-REG	1.73%
ZURICH INSURANCE GROUP AG	1.54%
CIE FINANCIERE RICHEMONT-REG	1.46%
ABB LTD-REG	1.32%
ALPHABET INC	1.30%
NVIDIA	0.95%

Benchmarkzusammensetzung

1M SARON	2.00%
BLOOMBERG GL. AGG. TREAS. EX CH TR (CHF HEDGED)	2.00%
BLOOMBERG GL. AGG. CORP. TR (CHF HEDGED)	4.00%
BLOOMBERG GL. AGG. CORP. SHORT TERM TR (CHF HEDGED)	4.00%
JP MORGAN CEMBI BROAD DIV IG INDEX (CHF HEDGED)	3.00%
SWISS PERFORMANCE INDEX	38.00%
MSCI WORLD EX CH ESG LEADERS, IN CHF	29.60%
MSCI AC WORLD SMALL CAP, IN CHF	5.55%
MSCI EMERGING MARKETS, IN CHF	1.85%
KGAST IMMO-INDEX	5.00%
HFRX GLOBAL HEDGE FUNDS (CHF HEDGED)	5.00%

Portfoliostruktur nach Währungen

CHF	66.03%
USD	23.45%
EUR	3.96%
JPY	2.30%
ÜBRIGE	4.26%

Eigenschaften der festverzinslichen Anlagen

Modified Duration	4.25
Durchschnittliches Rating	A-