

30. Juni 2021

# Anlagestiftung Swiss Life BVG-Mix 15

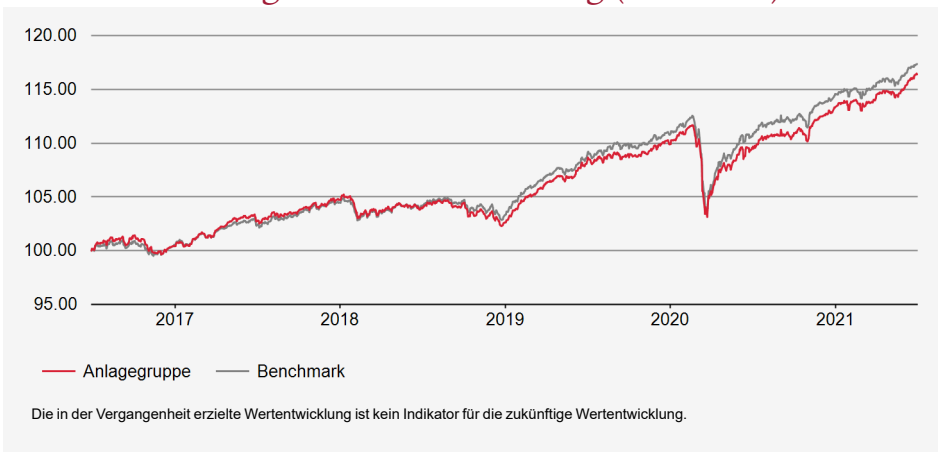


**Nettovermögen (NAV) in Mio. CHF: 225.33**  
**Nettovermögen pro Anspruch in CHF: 175.30**

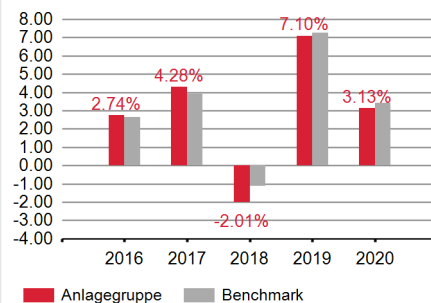
## Anlagestrategie

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



## 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](http://www.swisslife.ch/anlagestiftung)  
**Betriebsaufwandquote TER KGAST**  
**ex ante:** 0.53%  
**ex post per:** 30/09/2020 0.57%

## Performance in Referenzwährung

	KUMULIERTE PERFORMANCE			ANNUALISIERTE PERFORMANCE			
	YTD	1 MONAT	1 JAHR	3 JAHRE	5 JAHRE	10 JAHRE	AUFL.
ANLAGEGRUPPE	2.68%	1.25%	6.21%	3.81%	3.08%	3.74%	3.17%
BENCHMARK	2.44%	0.97%	6.03%	4.05%	3.25%	3.89%	3.52%

## Statistische Angaben (annualisiert)

	1 JAHR	3 JAHRE	5 JAHRE	10 JAHRE	AUFL.
Volatilität Anlagegruppe (in %)	2.48	3.54	2.94	2.59	2.68
Volatilität Benchmark (in %)	2.36	3.59	2.92	2.48	2.61
Tracking Error ex post (in %)	0.36	0.44	0.48	0.46	0.56
Tracking Error ex ante (in %)	0.50				
Information Ratio	0.50	-0.54	-0.36	-0.33	-0.63
Sharpe Ratio	2.70	1.27	1.30	1.61	1.14
Korrelation	0.99	0.99	0.99	0.98	0.98
Beta	1.04	0.98	0.99	1.03	1.01
Jensen-Alpha	-0.10	-0.13	-0.14	-0.27	-0.37
Maximum Drawdown (in %)	-1.10	-7.63	-7.63	-7.63	-7.63
Recovery Period (Jahre)	0.02	0.64	0.64	0.64	0.64

**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.

## Portfoliostruktur nach Anlagekategorien

	Anlagegruppe	Benchmark	max. BVV2
Liquidität	3.46%	2.00%	-
Hypotheken Schweiz	9.59%	13.00%	-
Obligationen CHF Inland	9.89%	13.00%	-
Obligationen CHF Ausland	4.03%	6.00%	-
Obligationen Fremdwährungen (CHF hedged)	32.49%	28.00%	-
Aktien Schweiz	8.36%	8.00%	-
Aktien Ausland	6.86%	7.00%	-
Aktien Ausland (CHF hedged)	2.76%	-	-
Immobilien Schweiz	17.89%	15.00%	30.00%
Immobilien Ausland (CHF hedged)	2.61%	3.00%	10.00%
Alternative Anlagen (CHF hedged)	2.06%	5.00%	15.00%
Total Aktien (In- und Ausland)	17.98%	15.00%	50.00%
Total Fremdwährungen	6.86%	7.00%	30.00%

## Portfoliostruktur nach Währungen

CHF	93.14%
USD	4.88%
EUR	0.76%
JPY	0.44%
ÜBRIGE	0.78%

## Benchmarkzusammensetzung

CITIGROUP CHF 1 M EURO DEPO	2.00%
CSA HYPOTHEKEN SCHWEIZ	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	4.58
Durchschnittliches Rating	A