

30. Juni 2021

Anlagestiftung Swiss Life BVG-Mix 75



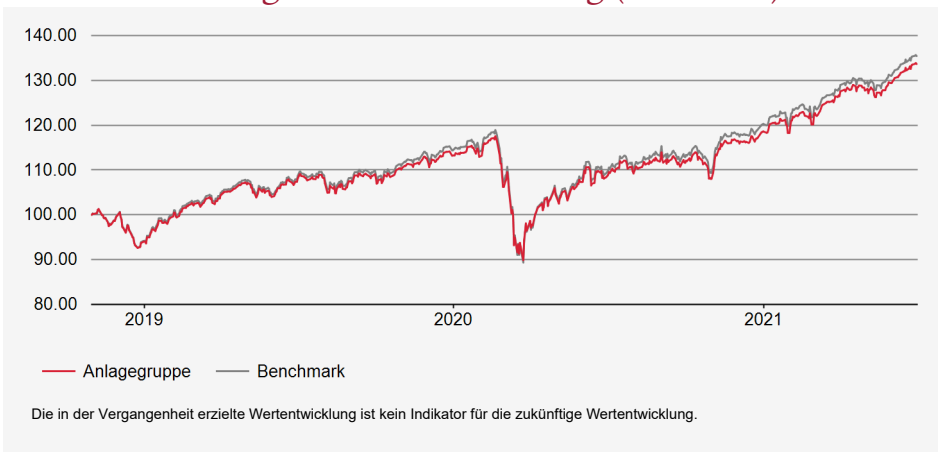
(Aktien- und Fremdwährungsquote gemäss BVV2 überschritten)

Nettovermögen (NAV) in Mio. CHF: 60.54
Nettovermögen pro Anspruch in CHF: 133.64

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)



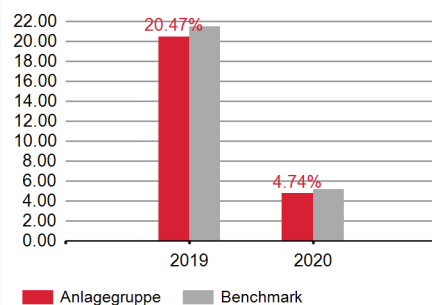
Performance in Referenzwährung

	KUMULIERTE PERFORMANCE			ANNUALISIERTE PERFORMANCE			
	YTD	1 MONAT	1 JAHR	3 JAHRE	5 JAHRE	10 JAHRE	AUFL.
ANLAGEGRUPPE	12.66%	3.30%	22.97%	-	-	-	11.49%
BENCHMARK	12.57%	3.37%	23.53%	-	-	-	12.04%

Statistische Angaben (annualisiert)

	1 JAHR	3 JAHRE	5 JAHRE	10 JAHRE	AUFL.
Volatilität Anlagegruppe (in %)	9.48	-	-	-	11.34
Volatilität Benchmark (in %)	9.45	-	-	-	11.83
Tracking Error ex post (in %)	0.41	-	-	-	0.93
Tracking Error ex ante (in %)	1.00	-	-	-	-
Information Ratio	-1.36	-	-	-	-0.57
Sharpe Ratio	2.25	-	-	-	1.00
Korrelation	1.00	-	-	-	1.00
Beta	1.00	-	-	-	0.96
Jensen-Alpha	-0.63	-	-	-	-0.01
Maximum Drawdown (in %)	-5.22	-	-	-	-23.54
Recovery Period (Jahre)	0.03	-	-	-	0.74

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: 0.62%
ex post per: 30/09/2020 0.63%

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.

(Aktien- und Fremdwährungsquote gemäss BVV2 überschritten)

Portfoliostruktur nach Anlagekategorien

	Anlagegruppe	Benchmark	max. BVV2
Liquidität	3.12%	2.00%	-
Obligationen Fremdwährungen (CHF hedged)	11.09%	13.00%	-
Aktien Schweiz	37.94%	38.00%	-
Aktien Ausland	39.80%	37.00%	-
Aktien Ausland (CHF hedged)	1.00%	-	-
Immobilien Schweiz	4.52%	5.00%	30.00%
Immobilien Ausland (CHF hedged)	0.24%	-	10.00%
Alternative Anlagen (CHF hedged)	2.29%	5.00%	15.00%
Total Aktien (In- und Ausland)	78.74%	75.00%	50.00%
Total Fremdwährungen	39.80%	37.00%	30.00%

Portfoliostruktur nach Währungen

CHF	60.20%
USD	27.36%
EUR	4.77%
JPY	2.78%
ÜBRIGE	4.90%

Benchmarkzusammensetzung

CITIGROUP CHF 1 M EURO DEPO	2.00%
BB* GL. AGG. TREAS. EX CH TR (CHF HEDGED)	2.00%
BB* GL. AGG. CORP. TR (CHF HEDGED)	4.00%
BB* 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, 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%

* Bloomberg Barclays

Eigenschaften der festverzinslichen Anlagen

Modified Duration	4.69
Durchschnittliches Rating	A-