

30. Juni 2021

Anlagestiftung Swiss Life BVG-Mix 45

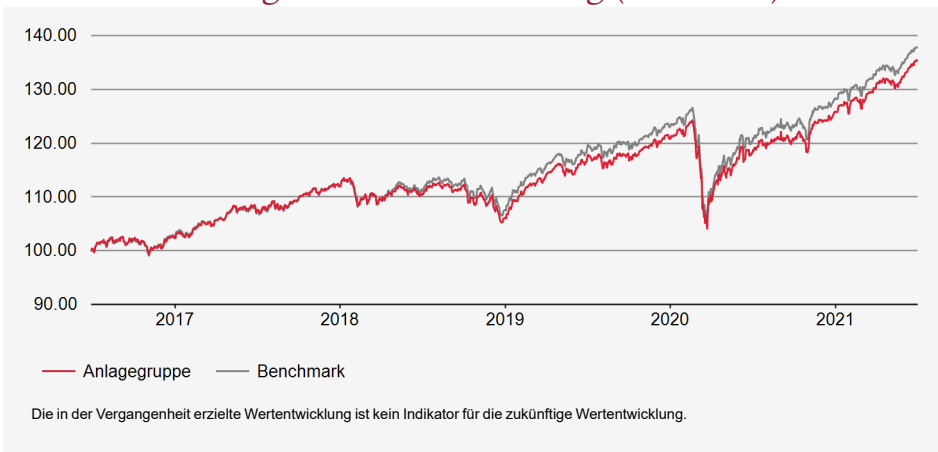


Nettovermögen (NAV) in Mio. CHF: 390.62
Nettovermögen pro Anspruch in CHF: 219.19

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)



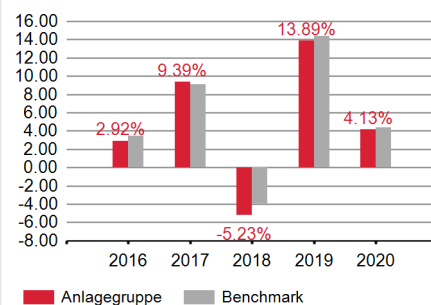
Performance in Referenzwährung

	KUMULIERTE PERFORMANCE			ANNUALISIERTE PERFORMANCE			
	YTD	1 MONAT	1 JAHR	3 JAHRE	5 JAHRE	10 JAHRE	AUFL.
ANLAGEGRUPPE	7.49%	2.30%	14.47%	6.93%	6.23%	6.24%	4.05%
BENCHMARK	7.33%	2.17%	14.51%	7.33%	6.61%	6.60%	4.72%

Statistische Angaben (annualisiert)

	1 JAHR	3 JAHRE	5 JAHRE	10 JAHRE	AUFL.
Volatilität Anlagegruppe (in %)	5.87	7.39	6.06	5.78	6.41
Volatilität Benchmark (in %)	5.84	7.60	6.19	5.66	6.34
Tracking Error ex post (in %)	0.32	0.55	0.56	0.57	0.68
Tracking Error ex ante (in %)	0.60				
Information Ratio	-0.13	-0.72	-0.69	-0.63	-0.98
Sharpe Ratio	2.41	1.01	1.13	1.14	0.60
Korrelation	1.00	1.00	1.00	1.00	0.99
Beta	1.00	0.97	0.98	1.02	1.01
Jensen-Alpha	-0.11	-0.16	-0.20	-0.47	-0.70
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

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: 0.56%
ex post per: 30/09/2020 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.

Portfoliostruktur nach Anlagekategorien

	Anlagegruppe	Benchmark	max. BVV2
Liquidität	3.85%	2.00%	-
Obligationen CHF Inland	5.62%	12.00%	-
Obligationen CHF Ausland	3.85%	5.00%	-
Obligationen Fremdwährungen (CHF hedged)	24.02%	20.00%	-
Aktien Schweiz	23.18%	23.00%	-
Aktien Ausland	23.30%	22.00%	-
Aktien Ausland (CHF hedged)	2.10%	-	-
Immobilien Schweiz	10.23%	9.00%	30.00%
Immobilien Ausland (CHF hedged)	1.74%	2.00%	10.00%
Alternative Anlagen (CHF hedged)	2.11%	5.00%	15.00%
Total Aktien (In- und Ausland)	48.58%	45.00%	50.00%
Total Fremdwährungen	23.30%	22.00%	30.00%

Portfoliostruktur nach Währungen

CHF	76.70%
USD	16.09%
EUR	2.76%
JPY	1.61%
ÜBRIGE	2.84%

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	5.48
Durchschnittliches Rating	A-