

30. Juni 2021

Anlagestiftung Swiss Life BVG-Mix 25

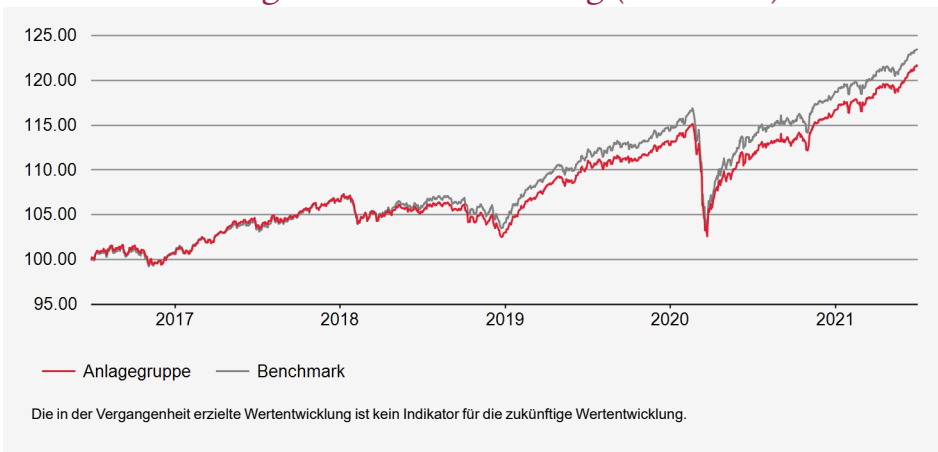


Nettovermögen (NAV) in Mio. CHF: 783.05
Nettovermögen pro Anspruch in CHF: 199.38

Anlagestrategie

Anlagen in alle vom BVG zugelassenen Anlagekategorien (strategischer Aktienanteil: 25%). Aktive Asset Allocation. Begrenzung für Beteiligungspapiere: 35%. Begrenzung für Fremdwährungen: 30%. Durchschnittliche Ratingqualität der Obligationen: mindestens BBB+. Umsetzung mittels Einsatz artreiner Kollektivanlagen. Empfohlene Schwankungsreserven: über 10%.

Wertentwicklung in Referenzwährung (Basis 100)



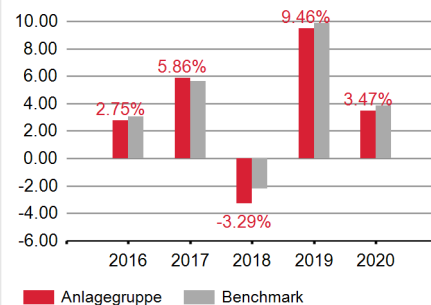
Performance in Referenzwährung

	KUMULIERTE PERFORMANCE			ANNUALISIERTE PERFORMANCE			
	YTD	1 MONAT	1 JAHR	3 JAHRE	5 JAHRE	10 JAHRE	AUFL.
ANLAGEGRUPPE	4.18%	1.55%	8.96%	4.87%	3.98%	4.67%	3.55%
BENCHMARK	3.95%	1.39%	8.86%	5.21%	4.30%	4.97%	4.09%

Statistische Angaben (annualisiert)

	1 JAHR	3 JAHRE	5 JAHRE	10 JAHRE	AUFL.
Volatilität Anlagegruppe (in %)	3.55	4.92	4.05	3.72	3.97
Volatilität Benchmark (in %)	3.50	5.13	4.18	3.64	3.89
Tracking Error ex post (in %)	0.31	0.48	0.47	0.50	0.58
Tracking Error ex ante (in %)	0.50				
Information Ratio	0.32	-0.69	-0.67	-0.59	-0.92
Sharpe Ratio	2.60	1.12	1.16	1.36	0.84
Korrelation	1.00	1.00	0.99	0.99	0.99
Beta	1.01	0.96	0.96	1.01	1.01
Jensen-Alpha	0.00	-0.06	-0.14	-0.37	-0.58
Maximum Drawdown (in %)	-1.75	-10.89	-10.89	-10.89	-14.16
Recovery Period (Jahre)	0.02	0.65	0.65	0.65	0.98

Performance



Produktinformationen

Valorennummer: 1245601
ISIN: CH0012456015
LEI: 254900JNOBNDNHDGRO53
Bloomberg-Code: SWABM25 SW
Benchmark: Customized
Währung: CHF
Domizil: Schweiz
Aufgagedatum: 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: 0.53%
ex post per: 30/09/2020 0.57%

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	3.31%	2.00%	-
Obligationen CHF Inland	12.06%	16.00%	-
Obligationen CHF Ausland	6.90%	9.00%	-
Obligationen Fremdwährungen (CHF hedged)	29.40%	28.00%	-
Aktien Schweiz	13.18%	13.00%	-
Aktien Ausland	11.63%	12.00%	-
Aktien Ausland (CHF hedged)	4.21%	-	-
Immobilien Schweiz	15.25%	13.00%	30.00%
Immobilien Ausland (CHF hedged)	1.96%	2.00%	10.00%
Alternative Anlagen (CHF hedged)	2.11%	5.00%	15.00%
Total Aktien (In- und Ausland)	29.02%	25.00%	50.00%
Total Fremdwährungen	11.63%	12.00%	30.00%

Portfoliostruktur nach Währungen

CHF	88.37%
USD	8.13%
EUR	1.34%
JPY	0.78%
ÜBRIGE	1.38%

Benchmarkzusammensetzung

CITIGROUP CHF 1 M EURO DEPO	2.00%
SBI DOMESTIC AAA-BBB	16.00%
SBI FOREIGN AAA-BBB	9.00%
BB* GL. AGG. TREAS. EX CH TR (CHF HEDGED)	4.00%
BB* GL. AGG. CORP. TR (CHF HEDGED)	9.00%
BB* GL. AGG. CORP. SHORT TERM TR (CHF HEDGED)	9.00%
JP MORGAN CEMBI BROAD DIV IG INDEX (CHF HEDGED)	6.00%
SWISS PERFORMANCE INDEX	13.00%
MSCI WORLD EX CH, IN CHF	9.60%
MSCI AC WORLD SMALL CAP, IN CHF	1.80%
MSCI EMERGING MARKETS, IN CHF	0.60%
KGAST IMMO-INDEX	13.00%
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	5.79
Durchschnittliches Rating	A