

30. Juni 2021

Anlagestiftung Swiss Life BVG-Mix 35

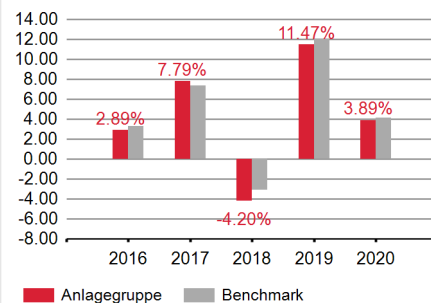


Nettovermögen (NAV) in Mio. CHF: 278.42
Nettovermögen pro Anspruch in CHF: 210.46

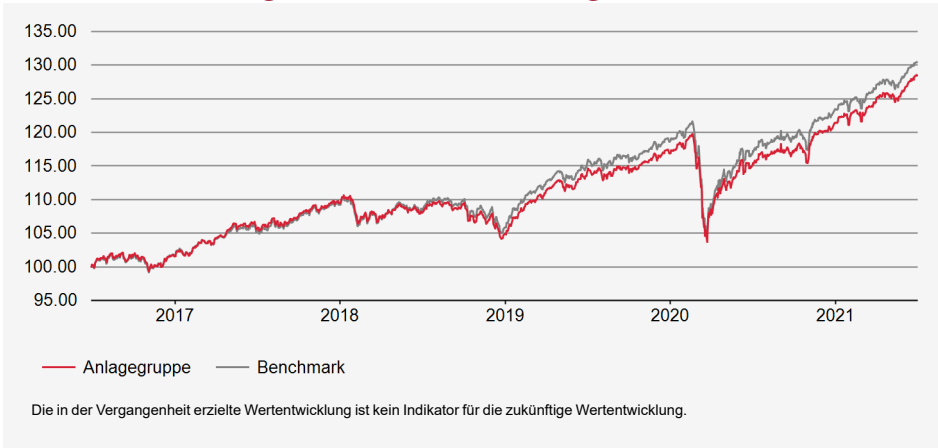
Anlagestrategie

Anlagen in alle vom BVG zugelassenen Anlagekategorien (strategischer Aktienanteil: 35%). Aktive Asset Allocation. Begrenzung für Beteiligungspapiere: 45%. Begrenzung für Fremdwährungen: 30%. Durchschnittliche Ratingqualität der Obligationen: mindestens BBB+. Umsetzung mittels Einsatz artreiner Kollektivanlagen. Empfohlene Schwankungsreserven: über 15%.

Performance



Wertentwicklung in Referenzwährung (Basis 100)



Produktinformationen

Valorennummer: 1245606
ISIN: CH0012456064
LEI: 254900SR5GM6HP44F130
Bloomberg-Code: SWABM35 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: ASSE
www.swisslife.ch/anlagestiftung
Betriebsaufwandquote TER KGAST
ex ante: 0.55%
ex post per: 30/09/2020 0.59%

Performance in Referenzwährung

	KUMULIERTE PERFORMANCE			ANNUALISIERTE PERFORMANCE			
	YTD	1 MONAT	1 JAHR	3 JAHRE	5 JAHRE	10 JAHRE	AUFL.
ANLAGEGRUPPE	5.75%	1.87%	11.62%	5.87%	5.13%	5.45%	3.84%
BENCHMARK	5.63%	1.78%	11.65%	6.27%	5.45%	5.79%	4.42%

Statistische Angaben (annualisiert)

	1 JAHR	3 JAHRE	5 JAHRE	10 JAHRE	AUFL.
Volatilität Anlagegruppe (in %)	4.69	6.02	4.95	4.68	5.13
Volatilität Benchmark (in %)	4.65	6.31	5.14	4.60	5.05
Tracking Error ex post (in %)	0.30	0.60	0.57	0.57	0.64
Tracking Error ex ante (in %)	0.70				
Information Ratio	-0.09	-0.66	-0.57	-0.59	-0.90
Sharpe Ratio	2.48	1.07	1.17	1.24	0.71
Korrelation	1.00	1.00	0.99	0.99	0.99
Beta	1.01	0.95	0.96	1.01	1.01
Jensen-Alpha	-0.12	-0.05	-0.07	-0.40	-0.61
Maximum Drawdown (in %)	-2.46	-13.41	-13.41	-13.41	-21.36
Recovery Period (Jahre)	0.03	0.65	0.65	0.65	3.00

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	4.59%	2.00%	-
Obligationen CHF Inland	8.34%	14.00%	-
Obligationen CHF Ausland	4.13%	7.00%	-
Obligationen Fremdwährungen (CHF hedged)	27.34%	24.00%	-
Aktien Schweiz	18.09%	18.00%	-
Aktien Ausland	17.03%	17.00%	-
Aktien Ausland (CHF hedged)	3.91%	-	-
Immobilien Schweiz	12.28%	11.00%	30.00%
Immobilien Ausland (CHF hedged)	2.14%	2.00%	10.00%
Alternative Anlagen (CHF hedged)	2.14%	5.00%	15.00%
Total Aktien (In- und Ausland)	39.04%	35.00%	50.00%
Total Fremdwährungen	17.03%	17.00%	30.00%

Portfoliostruktur nach Währungen

CHF	82.97%
USD	11.82%
EUR	2.00%
JPY	1.16%
ÜBRIGE	2.05%

Benchmarkzusammensetzung

CITIGROUP CHF 1 M EURO DEPO	2.00%
SBI DOMESTIC AAA-BBB	14.00%
SBI FOREIGN AAA-BBB	7.00%
BB* GL. AGG. TREAS. EX CH TR (CHF HEDGED)	3.50%
BB* GL. AGG. CORP. TR (CHF HEDGED)	7.50%
BB* GL. AGG. CORP. SHORT TERM TR (CHF HEDGED)	8.00%
JP MORGAN CEMBI BROAD DIV IG INDEX (CHF HEDGED)	5.00%
SWISS PERFORMANCE INDEX	18.00%
MSCI WORLD EX CH, IN CHF	13.60%
MSCI AC WORLD SMALL CAP, IN CHF	2.55%
MSCI EMERGING MARKETS, IN CHF	0.85%
KGAST IMMO-INDEX	11.00%
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	5.67
Durchschnittliches Rating	A-