

Anlagestiftung Swiss Life BVG-Mix 45

Nettovermögen (NAV) in Mio. CHF: 755.94
Nettovermögen pro Anspruch in CHF: 220.31

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)



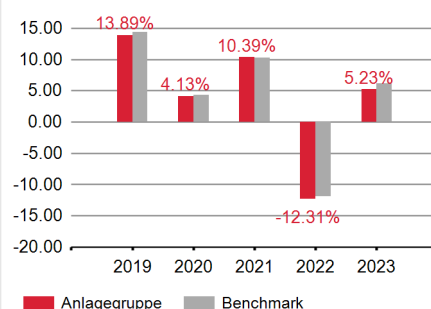
Performance in Referenzwährung

	Kumulierte Performance				Annualisierte Performance			
	YTD	1 Monat	3 Monate	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Aufl.
Anlagegruppe	6.06%	0.69%	1.21%	7.17%	0.17%	3.13%	3.72%	3.53%
Benchmark	6.43%	0.74%	1.38%	7.70%	0.74%	3.55%	4.24%	4.19%

Statistische Angaben (annualisiert)

	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Aufl.
Volatilität Anlagegruppe (in %)	5.42	6.85	7.20	6.42	6.47
Volatilität Benchmark (in %)	5.61	7.18	7.52	6.48	6.46
Tracking Error ex post (in %)	0.30	0.55	0.57	0.58	0.67
Information Ratio	-1.74	-1.03	-0.73	-0.90	-0.97
Sharpe Ratio	0.98	-0.06	0.42	0.62	0.51
Korrelation	1.00	1.00	1.00	1.00	0.99
Beta	0.97	0.95	0.96	0.99	1.00
Jensen-Alpha	-0.32	-0.56	-0.26	-0.46	-0.65
Maximum Drawdown (in %)	-4.14	-14.55	-16.22	-16.22	-28.27
Recovery Period (Jahre)	0.11	-	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

Erstausgabepreis: 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: 0.59%

ex post per: 30/09/2023 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.

Tracking Error ex ante: Der erwartete Tracking Error für die nächsten 12 Monate entspricht dem ex post 3 Jahres Tracking Error.

Portfoliostruktur nach Anlagekategorien

	Anlagegruppe	Benchmark	max. BVV2
Liquidität	4.04%	2.00%	-
Hypotheken Schweiz	0.52%	-	-
Obligationen CHF Inland	10.84%	12.00%	-
Obligationen CHF Ausland	4.82%	5.00%	-
Obligationen Fremdwährungen (CHF hedged)	20.62%	20.00%	-
Aktien Schweiz	22.90%	23.00%	-
Aktien Ausland	22.22%	22.00%	-
Aktien Ausland (CHF hedged)	-	-	-
Immobilien Schweiz	10.12%	9.00%	30.00%
Immobilien Ausland (CHF hedged)	1.66%	2.00%	10.00%
Alternative Anlagen (CHF hedged)	2.27%	5.00%	15.00%
Total Aktien (In- und Ausland)	45.12%	45.00%	50.00%
Total Fremdwährungen	22.22%	22.00%	30.00%

Grösste Aktienpositionen

NESTLE SA-REG	3.46%
NOVARTIS AG-REG	2.83%
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	2.52%
MICROSOFT CORP	1.63%
NVIDIA CORP	1.59%
UBS GROUP AG-REG	1.23%
ABB LTD-REG	1.15%
CIE FINANCIERE RICHEMO-A REG	1.09%
ALPHABET INC	1.03%
ZURICH INSURANCE GROUP AG	1.01%

Benchmarkzusammensetzung

1M Saron	2.00%
SBI Domestic AAA-BBB	12.00%
SBI Foreign AAA-BBB	5.00%
Bloomberg Gl. Agg. Treas. ex CH TR (CHF hedged)	2.50%
Bloomberg Gl. Agg. Corp. TR (CHF hedged)	6.50%
Bloomberg 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 ESG Leaders, 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%

Portfoliostruktur nach Währungen

CHF	75.91%
USD	15.33%
EUR	1.64%
JPY	1.34%
Übrige	5.78%

Eigenschaften der festverzinslichen Anlagen

Modified Duration	5.82
Durchschnittliches Rating	A