

30. April 2022

Anlagestiftung Swiss Life BVG-Mix 15

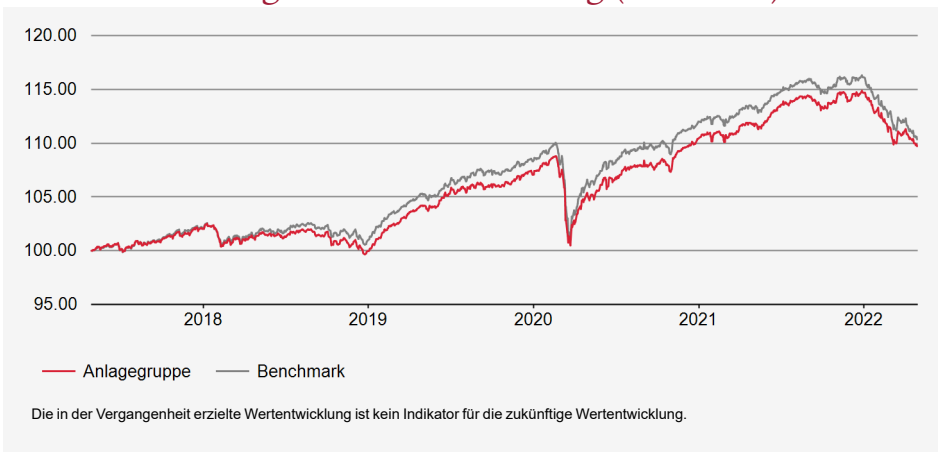


Nettovermögen (NAV) in Mio. CHF: 227.03
Nettovermögen pro Anspruch in CHF: 169.62

Anlagestrategie

Anlagen in alle vom BVG zugelassenen Anlagekategorien (strategischer Aktienanteil: 15%). Aktive Asset Allocation. Begrenzung für Beteiligungspapiere: 20%. Begrenzung für Fremdwährungen: 30%. Durchschnittliche Ratingqualität der Obligationen: mindestens BBB+. Umsetzung mittels Einsatz artreiner Kollektivanlagen. Empfohlene Schwankungsreserven: über 6.5%.

Wertentwicklung in Referenzwährung (Basis 100)



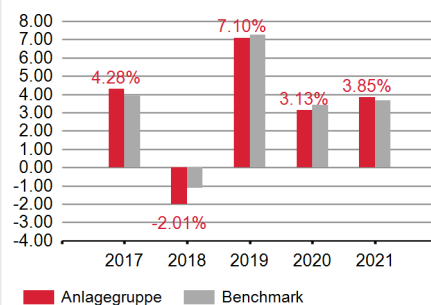
Performance in Referenzwährung

	KUMULIERTE PERFORMANCE				ANNUALISIERTE PERFORMANCE			
	YTD	1 MONAT	3 MONATE	1 JAHR	3 JAHRE	5 JAHRE	10 JAHRE	AUFL.
ANLAGEGRUPPE	-4.33%	-1.19%	-3.01%	-1.78%	1.73%	1.87%	2.97%	2.84%
BENCHMARK	-4.98%	-1.42%	-3.48%	-2.53%	1.57%	1.99%	3.02%	3.15%

Statistische Angaben (annualisiert)

	1 JAHR	3 JAHRE	5 JAHRE	10 JAHRE	AUFL.
Volatilität Anlagegruppe (in %)	3.08	3.72	3.13	2.71	2.71
Volatilität Benchmark (in %)	3.18	3.87	3.21	2.66	2.67
Tracking Error ex post (in %)	0.53	0.47	0.44	0.46	0.56
Information Ratio	1.40	0.33	-0.27	-0.11	-0.54
Sharpe Ratio	-0.38	0.65	0.83	1.28	1.02
Korrelation	0.99	0.99	0.99	0.99	0.98
Beta	0.96	0.95	0.97	1.01	1.00
Jensen-Alpha	0.66	0.26	-0.02	-0.07	-0.30
Maximum Drawdown (in %)	-4.48	-7.63	-7.63	-7.63	-7.63
Recovery Period (Jahre)	-	0.64	0.64	0.64	0.64

Performance



Produktinformationen

Valorennummer: 1564965
ISIN: CH0015649657
LEI: 254900RW4KJYAQTH6Y97
Bloomberg-Code: SWABM15 SW
Benchmark: Customized
Währung: CHF
Domizil: Schweiz
Aufledgedatum: 30/06/2003
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: 0.57%
ex post per: 30/09/2021 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	6.25%	2.00%	-
Hypotheken Schweiz	10.23%	13.00%	-
Obligationen CHF Inland	9.17%	13.00%	-
Obligationen CHF Ausland	3.91%	6.00%	-
Obligationen Fremdwährungen (CHF hedged)	31.82%	28.00%	-
Aktien Schweiz	8.21%	8.00%	-
Aktien Ausland	6.10%	7.00%	-
Aktien Ausland (CHF hedged)	1.47%	-	-
Immobilien Schweiz	17.11%	15.00%	30.00%
Immobilien Ausland (CHF hedged)	3.60%	3.00%	10.00%
Alternative Anlagen (CHF hedged)	2.12%	5.00%	15.00%
Total Aktien (In- und Ausland)	15.77%	15.00%	50.00%
Total Fremdwährungen	6.10%	7.00%	30.00%

Portfoliostruktur nach Währungen

CHF	93.90%
USD	4.32%
EUR	0.66%
JPY	0.38%
ÜBRIGE	0.73%

Benchmarkzusammensetzung

1M SARON	2.00%
SBI DOMESTIC AAA-A 1-3Y	13.00%
SBI DOMESTIC AAA-BBB	13.00%
SBI FOREIGN AAA-BBB	6.00%
BB* GL. AGG. TREAS. EX CH TR (CHF HEDGED)	5.00%
BB* GL. AGG. CORP. TR (CHF HEDGED)	12.00%
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	8.00%
MSCI WORLD EX CH, IN CHF	5.60%
MSCI AC WORLD SMALL CAP, IN CHF	1.05%
MSCI EMERGING MARKETS, IN CHF	0.35%
KGAST IMMO-INDEX	15.00%
SL REF (LUX) GERMAN CORE REAL ESTATE (CHF HEDGED)	3.00%
HFRX GLOBAL HEDGE FUNDS (CHF HEDGED)	5.00%

* Bloomberg Barclays

Eigenschaften der festverzinslichen Anlagen

Modified Duration	4.21
Durchschnittliches Rating	A+