

30. April 2022

Anlagestiftung Swiss Life BVG-Mix 35

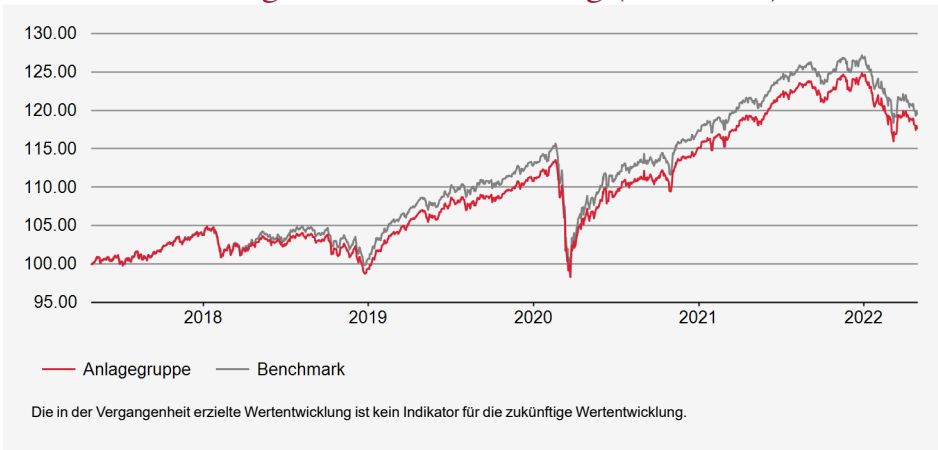


Nettovermögen (NAV) in Mio. CHF: 315.02
Nettovermögen pro Anspruch in CHF: 203.36

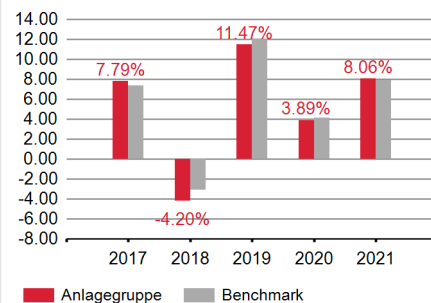
Anlagestrategie

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%.

Wertentwicklung in Referenzwährung (Basis 100)



Performance



Performance in Referenzwährung

	KUMULIERTE PERFORMANCE				ANNUALISIERTE PERFORMANCE			
	YTD	1 MONAT	3 MONATE	1 JAHR	3 JAHRE	5 JAHRE	10 JAHRE	AUFL.
ANLAGEGRUPPE	-5.44%	-1.39%	-3.22%	-0.95%	3.20%	3.30%	4.63%	3.51%
BENCHMARK	-5.72%	-1.45%	-3.48%	-1.27%	3.22%	3.62%	4.88%	4.05%

Statistische Angaben (annualisiert)

	1 JAHR	3 JAHRE	5 JAHRE	10 JAHRE	AUFL.
Volatilität Anlagegruppe (in %)	5.03	6.01	5.27	4.75	5.13
Volatilität Benchmark (in %)	4.92	6.30	5.46	4.71	5.06
Tracking Error ex post (in %)	0.38	0.59	0.55	0.54	0.64
Information Ratio	0.83	-0.03	-0.59	-0.47	-0.85
Sharpe Ratio	-0.06	0.64	0.76	1.07	0.65
Korrelation	1.00	1.00	1.00	0.99	0.99
Beta	1.02	0.95	0.96	1.00	1.01
Jensen-Alpha	0.33	0.17	-0.15	-0.27	-0.56
Maximum Drawdown (in %)	-7.09	-13.41	-13.41	-13.41	-21.36
Recovery Period (Jahre)	-	0.65	0.65	0.65	3.00

Produktinformationen

Valorennummer: 1245606
ISIN: CH0012456064
LEI: 254900SR5GM6HP44F130
Bloomberg-Code: SWABM35 SW
Benchmark: Customized
Währung: CHF
Domizil: Schweiz
Aufledgedatum: 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: 0.58%
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	6.26%	2.00%	-
Hypotheken Schweiz	0.75%	-	-
Obligationen CHF Inland	8.88%	14.00%	-
Obligationen CHF Ausland	4.39%	7.00%	-
Obligationen Fremdwährungen (CHF hedged)	27.60%	24.00%	-
Aktien Schweiz	18.43%	18.00%	-
Aktien Ausland	15.85%	17.00%	-
Aktien Ausland (CHF hedged)	1.52%	-	-
Immobilien Schweiz	11.49%	11.00%	30.00%
Immobilien Ausland (CHF hedged)	2.74%	2.00%	10.00%
Alternative Anlagen (CHF hedged)	2.09%	5.00%	15.00%
Total Aktien (In- und Ausland)	35.80%	35.00%	50.00%
Total Fremdwährungen	15.85%	17.00%	30.00%

Portfoliostruktur nach Währungen

CHF	84.15%
USD	11.00%
EUR	1.81%
JPY	1.05%
ÜBRIGE	1.99%

Benchmarkzusammensetzung

1M SARON	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	5.29
Durchschnittliches Rating	A