

Anlagestiftung Swiss Life BVG-Mix 45

Nettovermögen (NAV) in Mio. CHF: 731.06
Nettovermögen pro Anspruch in CHF: 217.68

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)



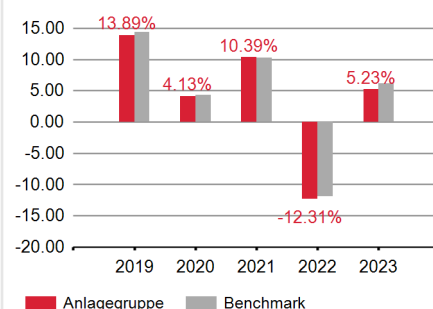
Performance in Referenzwährung

	Kumulierte Performance				Annualisierte Performance			
	YTD	1 Monat	3 Monate	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Aufl.
Anlagegruppe	4.79%	2.44%	4.79%	7.34%	1.03%	3.41%	3.88%	3.52%
Benchmark	4.98%	2.48%	4.98%	7.97%	1.52%	3.79%	4.38%	4.17%

Statistische Angaben (annualisiert)

	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Aufl.
Volatilität Anlagegruppe (in %)	4.89	6.85	7.28	6.40	6.49
Volatilität Benchmark (in %)	5.09	7.16	7.59	6.46	6.47
Tracking Error ex post (in %)	0.32	0.56	0.58	0.59	0.67
Information Ratio	-1.99	-0.86	-0.64	-0.86	-0.96
Sharpe Ratio	1.12	0.09	0.47	0.65	0.50
Korrelation	1.00	1.00	1.00	1.00	0.99
Beta	0.96	0.95	0.96	0.99	1.00
Jensen-Alpha	-0.37	-0.44	-0.21	-0.44	-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

Aufgagedatum: 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: ASL

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	3.03%	2.00%	-
Hypotheken Schweiz	0.54%	-	-
Obligationen CHF Inland	11.82%	12.00%	-
Obligationen CHF Ausland	4.87%	5.00%	-
Obligationen Fremdwährungen (CHF hedged)	19.25%	20.00%	-
Aktien Schweiz	22.98%	23.00%	-
Aktien Ausland	22.37%	22.00%	-
Aktien Ausland (CHF hedged)	0.73%	-	-
Immobilien Schweiz	10.44%	9.00%	30.00%
Immobilien Ausland (CHF hedged)	1.70%	2.00%	10.00%
Alternative Anlagen (CHF hedged)	2.27%	5.00%	15.00%
Total Aktien (In- und Ausland)	46.08%	45.00%	50.00%
Total Fremdwährungen	22.37%	22.00%	30.00%

Grösste Aktienpositionen

NESTLE SA-REG	3.72%
NOVARTIS AG-REG	2.60%
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	2.35%
MICROSOFT CORP.	1.62%
UBS GROUP AG-REG	1.30%
NVIDIA CORP	1.22%
CIE FINANCIERE RICHEMONT-REG	1.07%
ZURICH INSURANCE GROUP AG	1.04%
ABB LTD-REG	0.99%
ALPHABET INC	0.92%

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	76.33%
USD	15.26%
EUR	1.76%
JPY	1.50%
Übrige	5.14%

Eigenschaften der festverzinslichen Anlagen

Modified Duration	5.64
Durchschnittliches Rating	A