

Anlagestiftung Swiss Life BVG-Mix 35 P

Anlagestrategie

- Die Anlagegruppe BVG-Mix 35 P investiert im Durchschnitt ca. 35% in Aktien. Etwas über die Hälfte des Aktienanteils wird in schweizerische Dividendenpapiere angelegt, der Rest entfällt auf ausländische Gesellschaften. Durchschnittlich sind rund 45% des Vermögens in Obligationen investiert.
- Es gelten folgende Höchstgrenzen: 45% Aktien, 30% Fremdwährungen.
- BVG-Mix 35 P eignet sich für Anleger, die bereit sind, mittlere Kursschwankungen in Kauf zu nehmen. Wir empfehlen einen Anlagehorizont von über sieben Jahren.

Produkteinformationen

Valorennummer	1436916
ISIN	CH0014369166
LEI	254900SR5GM6HP44F130
Bloomberg Ticker	SLVOR35 SW
Benchmark	customized
Währung	CHF
Lancierungsdatum	30.09.2002
Lancierungspreis	100.00
Jahresabschluss	30.09.
Ausgabe/Rücknahme	täglich
Annahmeschluss	14.00 Uhr

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 1.38%

- ex post per 30.09.2020 1.42%

Ausgabe-/Rücknahmekommission keine

Ausschüttungspraxis Thesaurierung

* 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

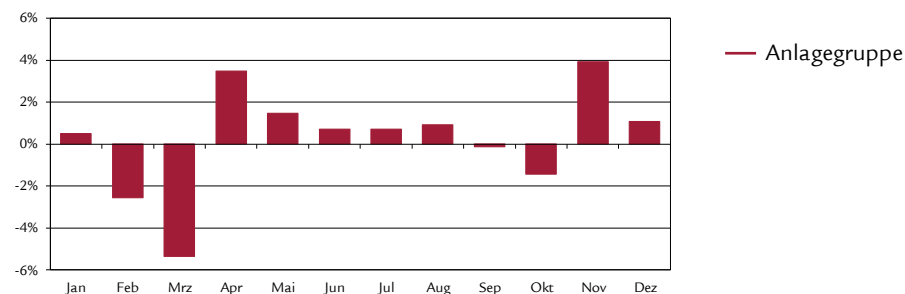
** Die Betriebsaufwandquote TER_{KGAST} deckt sämtliche Kosten mit Ausnahme der Transaktionskosten und der transaktionsbezogenen steuerlichen Abgaben ab

Indizierte Wertentwicklung und Performances



Performance	1M	3M	1J	3J	5J	10J	seit 30.09.02
Anlagegruppe (in %)	1.08	3.54	3.03	8.21	18.03	48.10	78.62
	YTD	2019	2018	2017	2016	2015	2014
Anlagegruppe (in %)	3.03	10.55	-5.00	6.90	2.04	0.09	8.11

Monatliche Performance 2020



Statistische Angaben (annualisiert)

	1J	3J	5J	10J	seit 30.09.02
Volatilität Anlagegruppe (in %)	8.72	5.96	4.92	4.64	5.09
Volatilität Benchmark (in %)	9.38	6.26	5.09	4.58	5.02
Tracking Error ex post (in %)	0.87	0.64	0.58	0.55	0.66
Tracking Error ex ante (in %)	0.60				
Information Ratio	-1.29	-2.41	-2.18	-2.17	-2.25
Sharpe Ratio	0.42	0.56	0.82	0.94	0.57
Korrelation	1.00	1.00	0.99	0.99	0.99
Beta	0.93	0.95	0.96	1.01	1.01
Jensen-Alpha	-0.74	-1.24	-1.01	-1.18	-1.45
Maximum Drawdown (in %)	-13.47	-13.47	-13.47	-13.47	-22.51
Recovery Period (Jahre)	0.73	0.73	0.73	0.73	3.44

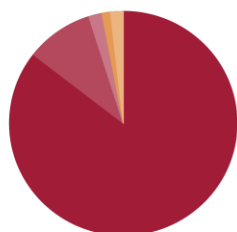
Kennzahlen

	31.12.2019	31.12.2020
Vermögen in Mio. CHF	214.2	244.6
Nettoinventarwert pro Anspruch in CHF	173.37	178.62

Portfeuillestruktur nach Anlagekategorien

	Anlagegruppe	Benchmark	BW2-Max.
Liquide Mittel	2.7%	2%	
Obligationen CHF Inland	8.9%	14%	
Obligationen CHF Ausland	4.3%	7%	
Obligationen Fremdwährungen (CHF hedged)	28.9%	24%	
Aktien Schweiz	17.2%	18%	
Aktien Ausland	14.5%	17%	
Aktien Ausland (CHF hedged)	7.9%	0%	
Immobilien Schweiz	11.5%	11%	30%
Immobilien Ausland (CHF hedged)	2.1%	2%	10%
Alternative Anlagen (CHF hedged)	2.0%	5%	15%
Total	100.0%	100%	
<hr/>			
Total Aktien (In- und Ausland)	39.6%	35%	50%
Total Fremdwährungen	14.5%	17%	30%

Portfeuillestruktur nach Währungen



■	CHF	85.5%
■	USD	9.6%
■	EUR	1.9%
■	JPY	1.2%
■	Übrige	1.8%

Grösste Aktienpositionen

	Anlagegruppe
Nestlé	3.4%
Roche GS	2.5%
Novartis	2.3%
Zurich Insurance Group	0.6%
Apple Inc.	0.6%
ABB	0.5%
UBS	0.5%
Lonza Group AG	0.5%
Cie Fin Richemont	0.5%
Microsoft Corp.	0.4%

Eigenschaften der festverzinslichen Anlagen

Modified Duration	5.68
Durchschnittliches Rating	A

Haftungsausschluss

Die vorliegende Publikation begründet weder eine Aufforderung noch eine Empfehlung zum Erwerb oder Verkauf von Anlageinstrumenten, sondern dient lediglich zu Informationszwecken. Sämtliche Dokumente, welche die rechtliche Grundlage für eine allfällige Investition bilden, können kostenlos bei der Anlagestiftung Swiss Life, c/o Swiss Life AG, Postfach, 8022 Zürich, Tel. 043 284 79 79, der Freizügigkeitsstiftung Swiss Life oder der Vorsorgestiftung 3a Swiss Life, beide c/o Swiss Life AG, Service Center LPZ, Postfach, 8022 Zürich, Tel. 0800 378 378 bezogen werden. Der Kreis der Anleger ist beschränkt auf Einrichtungen der 2. Säule und der Säule 3a sowie sonstige steuerbefreite Einrichtungen mit Sitz in der Schweiz, die ihrem Zweck nach der beruflichen Vorsorge dienen und Personen, die kollektive Anlagen für diese Einrichtungen verwalten, von der Eidgenössischen Finanzmarktaufsicht (FINMA) beaufsichtigt werden und bei der Stiftung ausschliesslich Gelder für diese Einrichtungen anlegen. Die vergangene Performance stellt keinen Indikator für die laufende und zukünftige Entwicklung dar.