

# Anlagestiftung Swiss Life BVG-Mix 45 P



## Anlagestrategie

- Die Anlagegruppe BVG-Mix 45 P investiert im Durchschnitt ca. 45% in Aktien. Etwas über die Hälfte des Aktienanteils wird in schweizerische Dividendenpapiere angelegt, der Rest entfällt auf ausländische Gesellschaften. Durchschnittlich sind rund 37% des Vermögens in Obligationen investiert.
- Es gelten folgende Höchstgrenzen: 50% Aktien, 30% Fremdwährungen.
- BVG-Mix 45 P eignet sich für Anleger, die bereit sind, grössere Kursschwankungen in Kauf zu nehmen. Wir empfehlen einen Anlagehorizont von über zehn Jahren.

## Produkteinformationen

|                   |                     |
|-------------------|---------------------|
| Valorennummer     | 1436925             |
| ISIN              | CH0014369257        |
| LEI               | 2549001XL79VZWO5Q69 |
| Bloomberg Ticker  | SLVOR45 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](http://www.swisslife.ch/anlagestiftung)

Betriebsaufwandquote TER<sub>KGAST</sub> \*\*

- ex ante 1.39%

- ex post per 30.09.2020 1.43%

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

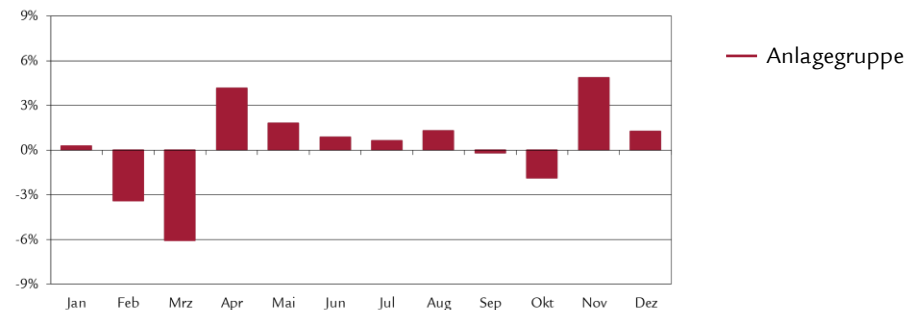
\*\* Die Betriebsaufwandquote TER<sub>KGAST</sub> deckt sämtliche Kosten mit Ausnahme der Transaktionskosten und der transaktionsbezogenen steuerlichen Abgaben ab

## Indexierte Wertentwicklung und Performances



| Performance         | 1M   | 3M    | 1J    | 3J   | 5J    | 10J   | p.a. seit 30.09.02 |
|---------------------|------|-------|-------|------|-------|-------|--------------------|
| Anlagegruppe (in %) | 1.29 | 4.22  | 3.27  | 9.62 | 21.37 | 55.90 | 89.12              |
|                     | YTD  | 2019  | 2018  | 2017 | 2016  | 2015  | 2014               |
| Anlagegruppe (in %) | 3.27 | 12.95 | -6.02 | 8.48 | 2.06  | -0.16 | 8.84               |

## Monatliche Performance 2020



## Statistische Angaben (annualisiert)

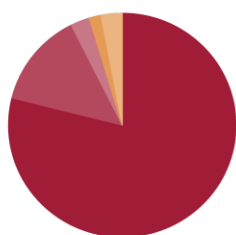
|                                 | 1J     | 3J     | 5J     | 10J    | seit 30.09.02 |
|---------------------------------|--------|--------|--------|--------|---------------|
| Volatilität Anlagegruppe (in %) | 10.43  | 7.29   | 6.06   | 5.75   | 6.31          |
| Volatilität Benchmark (in %)    | 10.98  | 7.53   | 6.18   | 5.64   | 6.25          |
| Tracking Error ex post (in %)   | 0.75   | 0.62   | 0.57   | 0.56   | 0.70          |
| Tracking Error ex ante (in %)   | 0.60   |        |        |        |               |
| Information Ratio               | -1.51  | -2.52  | -2.36  | -2.24  | -2.26         |
| Sharpe Ratio                    | 0.38   | 0.52   | 0.76   | 0.85   | 0.51          |
| Korrelation                     | 1.00   | 1.00   | 1.00   | 1.00   | 0.99          |
| Beta                            | 0.95   | 0.97   | 0.98   | 1.01   | 1.00          |
| Jensen-Alpha                    | -0.83  | -1.33  | -1.15  | -1.27  | -1.53         |
| Maximum Drawdown (in %)         | -16.28 | -16.28 | -16.28 | -16.28 | -29.17        |
| Recovery Period (Jahre)         | 0.73   | 0.73   | 0.73   | 0.73   | 3.98          |

## Kennzahlen

|                                       | 31.12.2019 | 31.12.2020 |
|---------------------------------------|------------|------------|
| Vermögen in Mio. CHF                  | 240.1      | 311.5      |
| Nettoinventarwert pro Anspruch in CHF | 183.13     | 189.12     |

**Portefeuillestruktur nach Anlagekategorien**

|  | Anlagegruppe  | Benchmark   | BVW2-Max. |
|--|---------------|-------------|-----------|
| Liquide Mittel                           | 2.6%          | 2%          |           |
| Obligationen CHF Inland                  | 5.7%          | 12%         |           |
| Obligationen CHF Ausland                 | 3.8%          | 5%          |           |
| Obligationen Fremdwährungen (CHF hedged) | 25.7%         | 20%         |           |
| Aktien Schweiz                           | 22.8%         | 23%         |           |
| Aktien Ausland                           | 21.1%         | 22%         |           |
| Aktien Ausland (CHF hedged)              | 4.9%          | 0%          |           |
| Immobilien Schweiz                       | 9.6%          | 9%          | 30%       |
| Immobilien Ausland (CHF hedged)          | 1.8%          | 2%          | 10%       |
| Alternative Anlagen (CHF hedged)         | 2.0%          | 5%          | 15%       |
| <b>Total</b>                             | <b>100.0%</b> | <b>100%</b> |           |
| <hr/>                                    |               |             |           |
| Total Aktien (In- und Ausland)           | 48.8%         | 45%         | 50%       |
| Total Fremdwährungen                     | 21.1%         | 22%         | 30%       |

**Portefeuillestruktur nach Währungen**


|   |        |       |
|---|--------|-------|
| ■ | CHF    | 78.9% |
| ■ | USD    | 13.7% |
| ■ | EUR    | 2.7%  |
| ■ | JPY    | 1.7%  |
| ■ | Übrige | 3.0%  |

**Grösste Aktienpositionen**

|                        | Anlagegruppe |
|------------------------|--------------|
| Nestlé                 | 4.5%         |
| Roche GS               | 3.2%         |
| Novartis               | 3.1%         |
| Zurich Insurance Group | 0.8%         |
| Apple Inc.             | 0.8%         |
| ABB                    | 0.7%         |
| UBS                    | 0.7%         |
| Lonza Group AG         | 0.6%         |
| Cie Fin Richemont      | 0.6%         |
| Microsoft Corp.        | 0.6%         |

**Eigenschaften der festverzinslichen Anlagen**

|                           |      |
|---------------------------|------|
| Modified Duration         | 5.46 |
| 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.