

Anlagestiftung Swiss Life

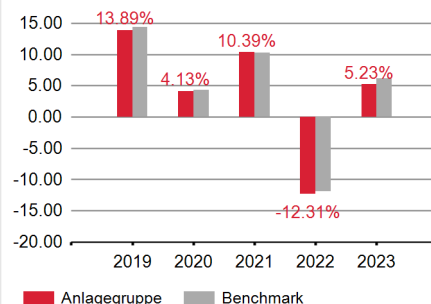
BVG-Mix 45

Nettovermögen (NAV) in Mio. CHF: 773.09
Nettovermögen pro Anspruch in CHF: 222.82

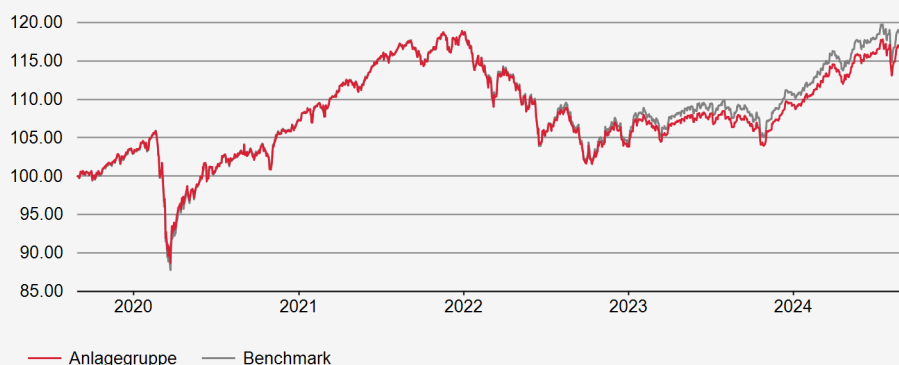
Anlagestrategie

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%.

Performance



Wertentwicklung in Referenzwährung (Basis 100)



Die in der Vergangenheit erzielte Wertentwicklung ist kein Indikator für die zukünftige Wertentwicklung.

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: 12.00 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: 0.59%
ex post per: 30/09/2023 0.60%

Performance in Referenzwährung

	Kumulierte Performance				Annualisierte Performance			
	YTD	1 Monat	3 Monate	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Aufl.
Anlagegruppe	7.27%	0.13%	1.83%	8.57%	-0.04%	3.23%	3.66%	3.56%
Benchmark	7.58%	0.07%	1.83%	8.98%	0.50%	3.56%	4.16%	4.21%

Statistische Angaben (annualisiert)

	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Aufl.
Volatilität Anlagegruppe (in %)	5.33	6.83	7.20	6.41	6.45
Volatilität Benchmark (in %)	5.53	7.15	7.52	6.47	6.43
Tracking Error ex post (in %)	0.32	0.55	0.56	0.58	0.67
Information Ratio	-1.30	-0.98	-0.59	-0.87	-0.96
Sharpe Ratio	1.25	-0.10	0.43	0.61	0.51
Korrelation	1.00	1.00	1.00	1.00	0.99
Beta	0.96	0.95	0.96	0.99	1.00
Jensen-Alpha	-0.14	-0.55	-0.18	-0.45	-0.64
Maximum Drawdown (in %)	-3.98	-14.55	-16.22	-16.22	-28.27
Recovery Period (Jahre)	-	-	0.67	0.67	3.76

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	3.63%	2.00%	-
Hypotheken Schweiz	0.52%	-	-
Obligationen CHF Inland	10.83%	12.00%	-
Obligationen CHF Ausland	4.80%	5.00%	-
Obligationen Fremdwährungen (CHF hedged)	21.42%	20.00%	-
Aktien Schweiz	23.38%	23.00%	-
Aktien Ausland	21.26%	22.00%	-
Aktien Ausland (CHF hedged)	-	-	-
Immobilien Schweiz	10.33%	9.00%	30.00%
Immobilien Ausland (CHF hedged)	1.58%	2.00%	10.00%
Alternative Anlagen (CHF hedged)	2.25%	5.00%	15.00%
Total Aktien (In- und Ausland)	44.65%	45.00%	50.00%
Total Fremdwährungen	21.26%	22.00%	30.00%

Grösste Aktienpositionen

NESTLE SA-REG	3.38%
NOVARTIS AG-REG	2.96%
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	2.86%
MICROSOFT CORP	1.24%
NVIDIA CORP	1.23%
UBS GROUP AG-REG	1.19%
ABB LTD-REG	1.10%
CIE FINANCIERE RICHEMO-A REG	1.02%
ZURICH INSURANCE GROUP AG	1.02%
ALPHABET INC	0.75%

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	78.75%
USD	14.34%
EUR	1.58%
JPY	1.37%
Übrige	3.97%

Eigenschaften der festverzinslichen Anlagen

Modified Duration	5.65
Durchschnittliches Rating	A