

30. April 2024

Anlagestiftung Swiss Life BVG-Mix 45

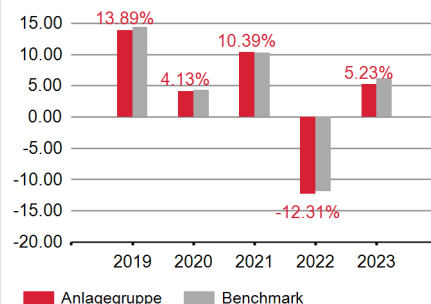


Nettovermögen (NAV) in Mio. CHF: 726.64
Nettovermögen pro Anspruch in CHF: 214.69

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)



Produktinformationen

Valorennummer: 1245607
ISIN: CH0012456072
LEI: 2549001XL79VZWJO5Q69
Bloomberg-Code: SWABM45 SW
Benchmark: Customized
Währung: CHF
Domizil: Schweiz
Aufgatedatum: 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®

Performance in Referenzwährung

	Kumulierte Performance				Annualisierte Performance			
	YTD	1 Monat	3 Monate	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Aufl.
Anlagegruppe	3.36%	-1.37%	2.51%	5.12%	0.32%	2.66%	3.65%	3.44%
Benchmark	3.59%	-1.32%	2.75%	5.72%	0.84%	3.04%	4.16%	4.09%

Statistische Angaben (annualisiert)

	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Aufl.
Volatilität Anlagegruppe (in %)	5.27	6.89	7.26	6.42	6.49
Volatilität Benchmark (in %)	5.45	7.20	7.57	6.48	6.47
Tracking Error ex post (in %)	0.32	0.56	0.58	0.59	0.67
Information Ratio	-1.92	-0.92	-0.66	-0.88	-0.97
Sharpe Ratio	0.64	-0.02	0.37	0.61	0.49
Korrelation	1.00	1.00	1.00	1.00	0.99
Beta	0.97	0.95	0.96	0.99	1.00
Jensen-Alpha	-0.46	-0.50	-0.25	-0.46	-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

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%

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	4.51%	2.00%	-
Hypotheken Schweiz	0.54%	-	-
Obligationen CHF Inland	10.96%	12.00%	-
Obligationen CHF Ausland	4.94%	5.00%	-
Obligationen Fremdwährungen (CHF hedged)	19.28%	20.00%	-
Aktien Schweiz	22.56%	23.00%	-
Aktien Ausland	22.16%	22.00%	-
Aktien Ausland (CHF hedged)	0.58%	-	-
Immobilien Schweiz	10.46%	9.00%	30.00%
Immobilien Ausland (CHF hedged)	1.72%	2.00%	10.00%
Alternative Anlagen (CHF hedged)	2.27%	5.00%	15.00%
Total Aktien (In- und Ausland)	45.30%	45.00%	50.00%
Total Fremdwährungen	22.16%	22.00%	30.00%

Grösste Aktienpositionen

NESTLE SA-REG	3.65%
NOVARTIS AG-REG	2.71%
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	2.30%
MICROSOFT CORP.	1.55%
NVIDIA CORP	1.20%
UBS GROUP AG-REG	1.16%
ABB LTD-REG	1.08%
CIE FINANCIERE RICHEMONT-REG	1.02%
ALPHABET INC	1.02%
ZURICH INSURANCE GROUP AG	0.96%

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	75.57%
USD	14.96%
EUR	1.79%
JPY	1.46%
Übrige	6.21%

Eigenschaften der festverzinslichen Anlagen

Modified Duration	5.55
Durchschnittliches Rating	A