

31. März 2024

Anlagestiftung Swiss Life BVG-Mix 75



(Aktien- und Fremdwährungsquote gemäss BVV2 überschritten)

Nettovermögen (NAV) in Mio. CHF: 221.12
Nettovermögen pro Anspruch in CHF: 136.80

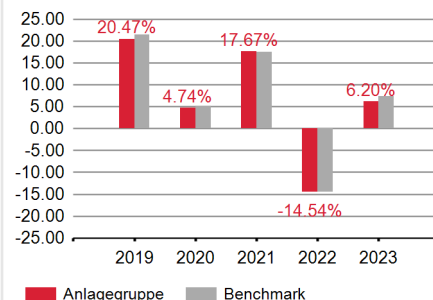
Anlagestrategie

Anlagen in alle vom BVG zugelassenen Anlagekategorien (strategischer Aktienanteil: 75%). Aktive Asset Allocation. Begrenzung für Beteiligungspapiere: 85%. Begrenzung für Fremdwährungen: 50%. Durchschnittliche Ratingqualität der Obligationen: mindestens BBB. Umsetzung mittels Einsatz artreiner Kollektivanlagen. Aufgrund des erhöhten Aktien- und Fremdwährungsanteils beinhaltet diese Anlagegruppe ein höheres Risiko im Vergleich zu einem BVG-Mix mit maximal 50% Aktien- bzw. maximal 30% Fremdwährungsanteil.

Wertentwicklung in Referenzwährung (Basis 100)



Performance



Performance in Referenzwährung

	Kumulierte Performance				Annualisierte Performance			
	YTD	1 Monat	3 Monate	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Aufl.
Anlagegruppe	8.00%	3.68%	8.00%	10.07%	2.66%	5.70%	-	5.96%
Benchmark	8.24%	3.76%	8.24%	11.09%	3.21%	6.18%	-	6.51%

Statistische Angaben (annualisiert)

	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Aufl.
Volatilität Anlagegruppe (in %)	7.40	9.80	10.57	-	10.80
Volatilität Benchmark (in %)	7.58	10.25	11.08	-	11.27
Tracking Error ex post (in %)	0.29	0.70	0.86	-	0.84
Information Ratio	-3.52	-0.79	-0.55	-	-0.65
Sharpe Ratio	1.08	0.23	0.53	-	0.55
Korrelation	1.00	1.00	1.00	-	1.00
Beta	0.98	0.96	0.95	-	0.96
Jensen-Alpha	-0.79	-0.43	-0.17	-	-0.25
Maximum Drawdown (in %)	-6.81	-17.76	-23.54	-	-23.54
Recovery Period (Jahre)	0.13	-	0.74	-	0.74

Produktinformationen

Valorennummer: 43583002
ISIN: CH0435830028
LEI: 2549007MI5RG5X8NMB06
Bloomberg-Code: SWABM75 SW
Benchmark: Customized
Währung: CHF
Domizil: Schweiz
Aufgatedatum: 31/10/2018
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: ASSL
www.swisslife.ch/anlagestiftung
Betriebsaufwandquote TER KGAST
ex ante: 0.64%
ex post per: 30/09/2023 0.64%

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.

(Aktien- und Fremdwährungsquote gemäss BVV2 überschritten)

Portfoliostruktur nach Anlagekategorien

	Anlagegruppe	Benchmark	max. BVV2
Liquidität	3.50%	2.00%	-
Hypotheken Schweiz	0.31%	-	-
Obligationen Fremdwährungen (CHF hedged)	11.40%	13.00%	-
Aktien Schweiz	37.45%	38.00%	-
Aktien Ausland	36.67%	37.00%	-
Aktien Ausland (CHF hedged)	2.05%	-	-
Immobilien Schweiz	6.00%	5.00%	30.00%
Immobilien Ausland (CHF hedged)	0.33%	-	10.00%
Alternative Anlagen (CHF hedged)	2.28%	5.00%	15.00%
Total Aktien (In- und Ausland)	76.18%	75.00%	50.00%
Total Fremdwährungen	36.67%	37.00%	30.00%

Grösste Aktienpositionen

NESTLE SA-REG	6.06%
NOVARTIS AG-REG	4.24%
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	3.82%
MICROSOFT CORP.	2.66%
UBS GROUP AG-REG	2.12%
NVIDIA CORP	2.00%
CIE FINANCIERE RICHEMONT-REG	1.75%
ZURICH INSURANCE GROUP AG	1.69%
ABB LTD-REG	1.61%
ALPHABET INC	1.50%

Benchmarkzusammensetzung

1M Saron	2.00%
Bloomberg Gl. Agg. Treas. ex CH TR (CHF hedged)	2.00%
Bloomberg Gl. Agg. Corp. TR (CHF hedged)	4.00%
Bloomberg Gl. Agg. Corp. Short Term TR (CHF hedged)	4.00%
JP Morgan CEMBI Broad Div IG Index (CHF hedged)	3.00%
Swiss Performance Index	38.00%
MSCI World ex CH ESG Leaders, in CHF	29.60%
MSCI AC World Small Cap, in CHF	5.55%
MSCI Emerging Markets, in CHF	1.85%
KGAST Immo-Index	5.00%
HFRX Global Hedge Funds (CHF hedged)	5.00%

Portfoliostruktur nach Währungen

CHF	61.85%
USD	25.02%
EUR	2.89%
JPY	2.46%
Übrige	7.79%

Eigenschaften der festverzinslichen Anlagen

Modified Duration	4.65
Durchschnittliches Rating	A-