

Nettovermögen (NAV) in Mio. CHF: 406.54
Nettovermögen pro Anspruch in CHF: 223.11

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%.

Wertentwicklung in Referenzwährung (Basis 100)



Performance in Referenzwährung

	KUMULIERTE PERFORMANCE			ANNUALISIERTE PERFORMANCE			
	YTD	1 MONAT	1 JAHR	3 JAHRE	5 JAHRE	10 JAHRE	AUFL.
ANLAGEGRUPPE	9.41%	1.33%	14.11%	7.18%	6.16%	6.93%	4.11%
BENCHMARK	9.26%	1.35%	14.08%	7.52%	6.57%	7.27%	4.77%

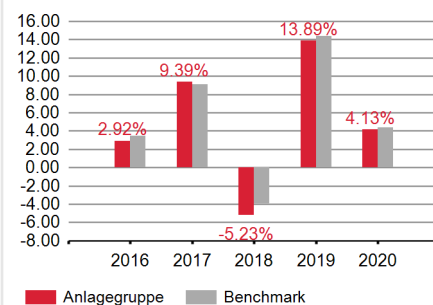
Statistische Angaben (annualisiert)

	1 JAHR	3 JAHRE	5 JAHRE	10 JAHRE	AUFL.
Volatilität Anlagegruppe (in %)	5.90	7.36	6.05	5.63	6.39
Volatilität Benchmark (in %)	5.85	7.56	6.19	5.53	6.32
Tracking Error ex post (in %)	0.24	0.55	0.55	0.56	0.68
Tracking Error ex ante (in %)	0.60				
Information Ratio	0.15	-0.63	-0.75	-0.60	-0.98
Sharpe Ratio	2.35	1.04	1.12	1.28	0.61
Korrelation	1.00	1.00	1.00	1.00	0.99
Beta	1.01	0.97	0.97	1.01	1.01
Jensen-Alpha	-0.09	-0.10	-0.23	-0.45	-0.69
Maximum Drawdown (in %)	-3.14	-16.22	-16.22	-16.22	-28.27
Recovery Period (Jahre)	0.03	0.67	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.

Performance



Produktinformationen

Valorennummer: 1245607

ISIN: CH0012456072

LEI: 2549001XL79VZWJO5Q69

Bloomberg-Code: SWABM45 SW

Benchmark: Customized

Währung: CHF

Domizil: Schweiz

Aufgagedatum: 30/09/2001

Ausgabepreis: 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: 0.56%

ex post per: 30/09/2020 0.60%

Portfoliostruktur nach Anlagekategorien

	Anlagegruppe	Benchmark	max. BVV2
Liquidität	3.97%	2.00%	-
Obligationen CHF Inland	5.66%	12.00%	-
Obligationen CHF Ausland	3.92%	5.00%	-
Obligationen Fremdwährungen (CHF hedged)	23.94%	20.00%	-
Aktien Schweiz	23.50%	23.00%	-
Aktien Ausland	23.29%	22.00%	-
Aktien Ausland (CHF hedged)	2.09%	-	-
Immobilien Schweiz	9.87%	9.00%	30.00%
Immobilien Ausland (CHF hedged)	1.66%	2.00%	10.00%
Alternative Anlagen (CHF hedged)	2.11%	5.00%	15.00%
Total Aktien (In- und Ausland)	48.88%	45.00%	50.00%
Total Fremdwährungen	23.29%	22.00%	30.00%

Portfoliostruktur nach Währungen

CHF	76.71%
USD	16.18%
EUR	2.78%
JPY	1.58%
ÜBRIGE	2.75%

Benchmarkzusammensetzung

CITIGROUP CHF 1 M EURO DEPO	2.00%
SBI DOMESTIC AAA-BBB	12.00%
SBI FOREIGN AAA-BBB	5.00%
BB* GL. AGG. TREAS. EX CH TR (CHF HEDGED)	2.50%
BB* GL. AGG. CORP. TR (CHF HEDGED)	6.50%
BB* 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, 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%

* Bloomberg Barclays

Eigenschaften der festverzinslichen Anlagen

Modified Duration	5.69
Durchschnittliches Rating	A-