

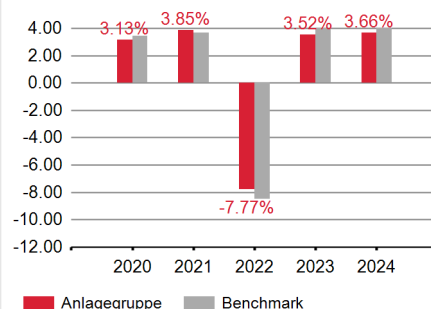
Anlagestiftung Swiss Life BVG-Mix 15

Nettovermögen (NAV) in Mio. CHF: 223.38
Nettovermögen pro Anspruch in CHF: 175.47

Anlagestrategie

Anlagen in alle vom BVG zugelassenen Anlagekategorien (strategischer Aktienanteil: 15%). Aktive Asset Allocation. Begrenzung für Beteiligungspapiere: 20%. Begrenzung für Fremdwährungen: 30%. Durchschnittliche Ratingqualität der Obligationen: mindestens BBB+. Umsetzung mittels Einsatz artreiner Kollektivanlagen. Empfohlene Schwankungsreserven: über 6.5%.

Performance



Wertentwicklung in Referenzwährung (Basis 100)



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

Produktinformationen

Valorennummer: 1564965
ISIN: CH0015649657
LEI: 254900RW4KJYAQTH6Y97
Bloomberg-Code: SWABM15 SW
Benchmark: Customized
Währung: CHF
Domizil: Schweiz
Aufgedatum: 30/06/2003
Erstausgabepreis: 100.00
Jahresabschluss: 30.09

Ausgabe/Rücknahme: Täglich
Annaheschluss: 12.00 Uhr
Verwässerungsschutz: Ausgabe- / Rücknahmekommission zugunsten der Anlagegruppe gemäss Konditionenübersicht.

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: 0.55%
ex post per: 30/09/2024 0.58%

Performance in Referenzwährung

	Kumulierte Performance				Annualisierte Performance			
	YTD	1 Monat	3 Monate	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Aufl.
Anlagegruppe	3.66%	-0.50%	-0.36%	3.66%	-0.34%	1.17%	1.88%	2.65%
Benchmark	3.99%	-0.38%	-0.06%	3.99%	-0.30%	1.22%	2.04%	2.95%

Statistische Angaben (annualisiert)

	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Aufl.
Volatilität Anlagegruppe (in %)	2.20	3.61	3.79	3.09	2.82
Volatilität Benchmark (in %)	2.27	4.12	4.13	3.23	2.87
Tracking Error ex post (in %)	0.28	0.65	0.56	0.52	0.57
Information Ratio	-1.16	-0.07	-0.09	-0.30	-0.52
Sharpe Ratio	1.05	-0.32	0.25	0.69	0.87
Korrelation	0.99	0.99	0.99	0.99	0.98
Beta	0.96	0.87	0.91	0.95	0.97
Jensen-Alpha	-0.22	-0.20	0.03	-0.03	-0.21
Maximum Drawdown (in %)	-1.07	-8.99	-9.12	-9.12	-9.12
Recovery Period (Jahre)	0.07	-	-	-	-

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.

Verwässerungsschutz: Konditionenübersicht abrufbar unter: www.swisslife.ch/anlagestiftung, «Rechtliche Dokumente» (Änderungen jederzeit ohne Vorankündigung möglich).

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	2.49%	2.00%	-
Hypotheken Schweiz	12.61%	13.00%	-
Obligationen CHF Inland	12.09%	13.00%	-
Obligationen CHF Ausland	5.85%	6.00%	-
Obligationen Fremdwährungen (CHF hedged)	25.93%	28.00%	-
Aktien Schweiz	7.93%	8.00%	-
Aktien Ausland	8.71%	7.00%	-
Aktien Ausland (CHF hedged)	-	-	-
Immobilien Schweiz	18.75%	15.00%	30.00%
Immobilien Ausland (CHF hedged)	3.36%	3.00%	10.00%
Alternative Anlagen (CHF hedged)	2.29%	5.00%	15.00%
Total Aktien (In- und Ausland)	16.64%	15.00%	50.00%
Total Fremdwährungen	8.71%	7.00%	30.00%

Grösste Aktienpositionen

NESTLE SA-REG	1.01%
NOVARTIS AG-REG	0.93%
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	0.93%
NVIDIA CORP	0.55%
MICROSOFT CORP	0.49%
UBS GROUP AG-REG	0.44%
ZURICH INSURANCE GROUP AG	0.41%
ABB LTD-REG	0.40%
CIE FINANCIERE RICHEMO-A REG	0.38%
HOLCIM LTD	0.24%

Benchmarkzusammensetzung

1M Saron	2.00%
SBI Domestic AAA-A 1-3Y	13.00%
SBI Domestic AAA-BBB	13.00%
SBI Foreign AAA-BBB	6.00%
Bloomberg Gl. Agg. Treas. ex CH TR (CHF hedged)	5.00%
Bloomberg Gl. Agg. Corp. TR (CHF hedged)	12.00%
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	8.00%
MSCI World ex CH ESG Leaders, in CHF	5.60%
MSCI AC World Small Cap, in CHF	1.05%
MSCI Emerging Markets, in CHF	0.35%
KGAST Immo-Index	15.00%
SL REF (LUX) German Core Real Estate (CHF hedged)	3.00%
HFRX Global Hedge Funds (CHF hedged)	5.00%

Portfoliostruktur nach Währungen

CHF	91.31%
USD	6.08%
JPY	0.52%
EUR	0.15%
Übrige	1.96%

Eigenschaften der festverzinslichen Anlagen

Modified Duration	4.71
Durchschnittliches Rating	A+