

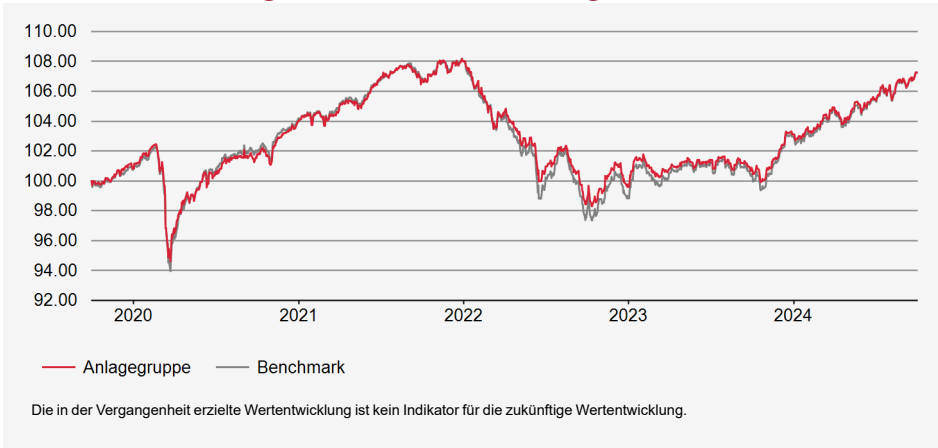
Anlagestiftung Swiss Life BVG-Mix 15

Nettovermögen (NAV) in Mio. CHF: 229.47
Nettovermögen pro Anspruch in CHF: 176.11

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%.

Wertentwicklung in Referenzwährung (Basis 100)



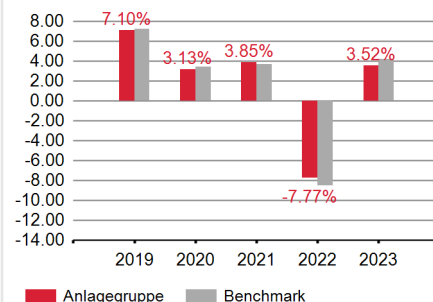
Performance in Referenzwährung

	Kumulierte Performance True				Annualisierte Performance			
	YTD	1 Monat	3 Monate	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Aufl.
Anlagegruppe	4.03%	0.40%	1.70%	6.35%	0.16%	1.41%	2.07%	2.70%
Benchmark	4.15%	0.51%	1.72%	6.74%	0.13%	1.41%	2.24%	3.00%

Statistische Angaben (annualisiert)

	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Aufl.
Volatilität Anlagegruppe (in %)	2.43	3.57	3.75	3.07	2.82
Volatilität Benchmark (in %)	2.78	4.08	4.10	3.21	2.87
Tracking Error ex post (in %)	0.46	0.65	0.56	0.52	0.57
Information Ratio	-0.85	0.04	0.01	-0.33	-0.51
Sharpe Ratio	1.92	-0.15	0.33	0.76	0.89
Korrelation	0.99	0.99	0.99	0.99	0.98
Beta	0.87	0.87	0.91	0.94	0.97
Jensen-Alpha	0.31	-0.05	0.12	-0.03	-0.20
Maximum Drawdown (in %)	-1.09	-9.12	-9.12	-9.12	-9.12
Recovery Period (Jahre)	0.07	-	-	-	-

Performance



Produktinformationen

Valorennummer: 1564965

ISIN: CH0015649657

LEI: 254900RW4KJYAQTH6Y97

Bloomberg-Code: SWABM15 SW

Benchmark: Customized

Währung: CHF

Domizil: Schweiz

Aufledgedatum: 30/06/2003

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: 0.57%

ex post per: 30/09/2024 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	2.03%	2.00%	-
Hypotheken Schweiz	12.15%	13.00%	-
Obligationen CHF Inland	11.08%	13.00%	-
Obligationen CHF Ausland	5.70%	6.00%	-
Obligationen Fremdwährungen (CHF hedged)	30.20%	28.00%	-
Aktien Schweiz	8.08%	8.00%	-
Aktien Ausland	6.97%	7.00%	-
Aktien Ausland (CHF hedged)	-	-	-
Immobilien Schweiz	18.08%	15.00%	30.00%
Immobilien Ausland (CHF hedged)	3.39%	3.00%	10.00%
Alternative Anlagen (CHF hedged)	2.33%	5.00%	15.00%
Total Aktien (In- und Ausland)	15.04%	15.00%	50.00%
Total Fremdwährungen	6.97%	7.00%	30.00%

Grösste Aktienpositionen

NESTLE SA-REG	1.11%
NOVARTIS AG-REG	0.99%
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	0.95%
UBS GROUP AG-REG	0.42%
MICROSOFT CORP	0.41%
NVIDIA CORP	0.40%
ABB LTD-REG	0.39%
ZURICH INSURANCE GROUP AG	0.37%
CIE FINANCIERE RICHEMO-A REG	0.36%
ALPHABET INC	0.25%

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	93.04%
USD	4.73%
EUR	0.52%
JPY	0.44%
Übrige	1.28%

Eigenschaften der festverzinslichen Anlagen

Modified Duration	4.72
Durchschnittliches Rating	A+