

Anlagestiftung Swiss Life BVG-Mix 35

Nettovermögen (NAV) in Mio. CHF: 403.62
Nettovermögen pro Anspruch in CHF: 213.34

Anlagestrategie

Anlagen in alle vom BVG zugelassenen Anlagekategorien (strategischer Aktienanteil: 35%). Aktive Asset Allocation. Begrenzung für Beteiligungspapiere: 45%. Begrenzung für Fremdwährungen: 30%. Durchschnittliche Ratingqualität der Obligationen: mindestens BBB+. Umsetzung mittels Einsatz artreiner Kollektivanlagen. Empfohlene Schwankungsreserven: über 15%.

Wertentwicklung in Referenzwährung (Basis 100)



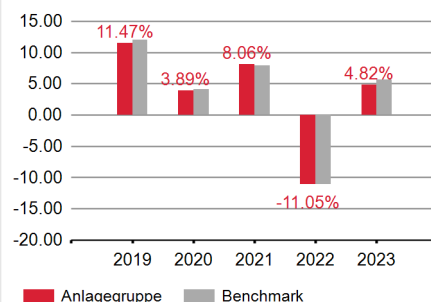
Performance in Referenzwährung

	Kumulierte Performance True				Annualisierte Performance			
	YTD	1 Monat	3 Monate	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Aufl.
Anlagegruppe	6.38%	0.25%	1.48%	8.88%	0.54%	2.51%	3.12%	3.35%
Benchmark	6.76%	0.42%	1.58%	9.49%	0.86%	2.75%	3.53%	3.89%

Statistische Angaben (annualisiert)

	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Aufl.
Volatilität Anlagegruppe (in %)	4.11	5.72	6.06	5.27	5.20
Volatilität Benchmark (in %)	4.35	6.11	6.46	5.40	5.19
Tracking Error ex post (in %)	0.38	0.59	0.61	0.58	0.63
Information Ratio	-1.64	-0.55	-0.40	-0.71	-0.84
Sharpe Ratio	1.71	-0.03	0.38	0.64	0.59
Korrelation	1.00	1.00	1.00	0.99	0.99
Beta	0.94	0.93	0.94	0.97	0.99
Jensen-Alpha	-0.15	-0.31	-0.07	-0.30	-0.52
Maximum Drawdown (in %)	-2.93	-13.03	-13.41	-13.41	-21.36
Recovery Period (Jahre)	0.14	-	0.65	0.65	3.00

Performance



Produktinformationen

Valorennummer: 1245606

ISIN: CH0012456064

LEI: 254900SR5GM6HP44F130

Bloomberg-Code: SWABM35 SW

Benchmark: Customized

Währung: CHF

Domizil: Schweiz

Aufledgedatum: 30/09/2001

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 0.57%

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	3.26%	2.00%	-
Hypotheken Schweiz	0.60%	-	-
Obligationen CHF Inland	13.10%	14.00%	-
Obligationen CHF Ausland	7.13%	7.00%	-
Obligationen Fremdwährungen (CHF hedged)	24.95%	24.00%	-
Aktien Schweiz	17.88%	18.00%	-
Aktien Ausland	16.98%	17.00%	-
Aktien Ausland (CHF hedged)	-	-	-
Immobilien Schweiz	11.74%	11.00%	30.00%
Immobilien Ausland (CHF hedged)	2.06%	2.00%	10.00%
Alternative Anlagen (CHF hedged)	2.29%	5.00%	15.00%
Total Aktien (In- und Ausland)	34.87%	35.00%	50.00%
Total Fremdwährungen	16.98%	17.00%	30.00%

Grösste Aktienpositionen

NESTLE SA-REG	2.46%
NOVARTIS AG-REG	2.20%
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	2.10%
MICROSOFT CORP	1.00%
NVIDIA CORP	0.98%
UBS GROUP AG-REG	0.93%
ABB LTD-REG	0.87%
ZURICH INSURANCE GROUP AG	0.83%
CIE FINANCIERE RICHEMO-A REG	0.80%
ALPHABET INC	0.60%

Benchmarkzusammensetzung

1M Saron	2.00%
SBI Domestic AAA-BBB	14.00%
SBI Foreign AAA-BBB	7.00%
Bloomberg Gl. Agg. Treas. ex CH TR (CHF hedged)	3.50%
Bloomberg Gl. Agg. Corp. TR (CHF hedged)	7.50%
Bloomberg Gl. Agg. Corp. Short Term TR (CHF hedged)	8.00%
JP Morgan CEMBI Broad Div IG Index (CHF hedged)	5.00%
Swiss Performance Index	18.00%
MSCI World ex CH ESG Leaders, in CHF	13.60%
MSCI AC World Small Cap, in CHF	2.55%
MSCI Emerging Markets, in CHF	0.85%
KGAST Immo-Index	11.00%
SL REF (LUX) German Core Real Estate (CHF hedged)	2.00%
HFRX Global Hedge Funds (CHF hedged)	5.00%

Portfoliostruktur nach Währungen

CHF	83.02%
USD	11.53%
EUR	1.26%
JPY	1.07%
Übrige	3.12%

Eigenschaften der festverzinslichen Anlagen

Modified Duration	5.68
Durchschnittliches Rating	A