

Anlagestiftung Swiss Life BVG-Mix 15

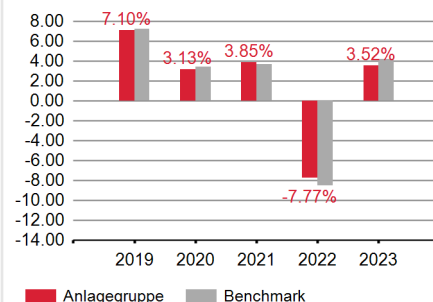


Nettovermögen (NAV) in Mio. CHF: 227.18
Nettovermögen pro Anspruch in CHF: 170.30

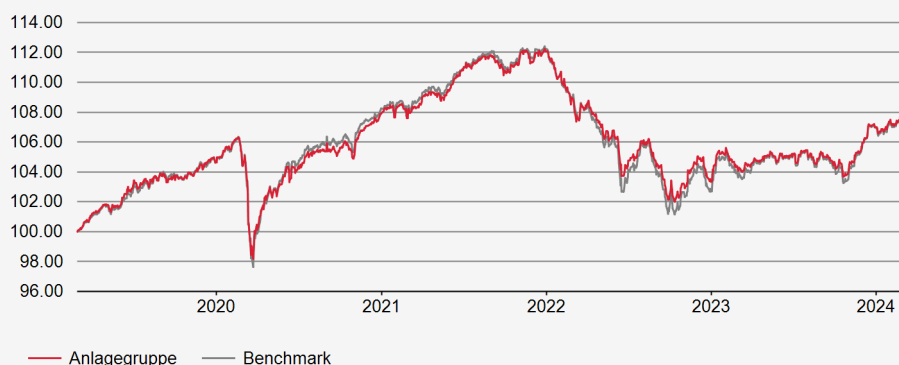
Anlagestrategie

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

Aufgatedatum: 30/06/2003

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: 0.57%

ex post per: 30/09/2023 0.59%

Performance in Referenzwährung

	Kumulierte Performance				Annualisierte Performance			
	YTD	1 Monat	3 Monate	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Aufl.
Anlagegruppe	0.60%	0.31%	1.87%	3.29%	0.01%	1.48%	2.08%	2.61%
Benchmark	0.59%	0.40%	1.95%	3.69%	-0.09%	1.48%	2.21%	2.91%

Statistische Angaben (annualisiert)

	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Aufl.
Volatilität Anlagegruppe (in %)	2.27	3.58	3.74	3.05	2.84
Volatilität Benchmark (in %)	2.71	4.05	4.08	3.19	2.89
Tracking Error ex post (in %)	0.53	0.66	0.58	0.53	0.58
Information Ratio	-0.76	0.15	0.01	-0.26	-0.50
Sharpe Ratio	0.74	-0.09	0.42	0.80	0.87
Korrelation	0.99	0.99	0.99	0.99	0.98
Beta	0.83	0.88	0.91	0.95	0.97
Jensen-Alpha	-0.04	0.05	0.14	0.00	-0.21
Maximum Drawdown (in %)	-1.68	-9.12	-9.12	-9.12	-9.12
Recovery Period (Jahre)	0.11	-	-	-	-

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	2.09%	2.00%	-
Hypotheken Schweiz	12.02%	13.00%	-
Obligationen CHF Inland	13.10%	13.00%	-
Obligationen CHF Ausland	6.01%	6.00%	-
Obligationen Fremdwährungen (CHF hedged)	27.83%	28.00%	-
Aktien Schweiz	7.92%	8.00%	-
Aktien Ausland	6.91%	7.00%	-
Aktien Ausland (CHF hedged)	0.29%	-	-
Immobilien Schweiz	17.96%	15.00%	30.00%
Immobilien Ausland (CHF hedged)	3.57%	3.00%	10.00%
Alternative Anlagen (CHF hedged)	2.30%	5.00%	15.00%
Total Aktien (In- und Ausland)	15.12%	15.00%	50.00%
Total Fremdwährungen	6.91%	7.00%	30.00%

Grösste Aktienpositionen

NESTLE SA-REG	1.26%
NOVARTIS AG-REG	0.97%
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	0.84%
MICROSOFT CORP.	0.51%
UBS GROUP AG-REG	0.40%
CIE FINANCIERE RICHEMONT-REG	0.39%
ZURICH INSURANCE GROUP AG	0.35%
NVIDIA CORP	0.34%
ABB LTD-REG	0.34%
ALPHABET INC	0.27%

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	92.11%
USD	4.70%
EUR	0.55%
JPY	0.47%
Übrige	2.18%

Eigenschaften der festverzinslichen Anlagen

Modified Duration	4.44
Durchschnittliches Rating	A+