

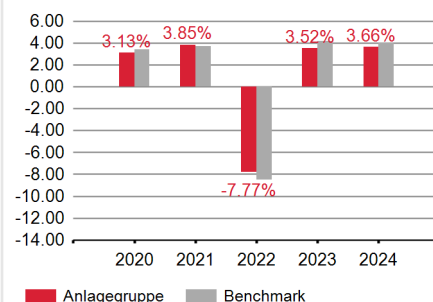
Anlagestiftung Swiss Life BVG-Mix 15

Nettovermögen (NAV) in Mio. CHF: 218.09
Nettovermögen pro Anspruch in CHF: 176.55

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)



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

Asset Management: Strategische und taktische Asset Allocation durch Swiss Life Asset Management AG
Eingesetzte artreine Anlagegruppen: Diverse gemäss Swiss Life Best Select Invest Plus © Ansatz

Externe Beratung: Überwachung der Anlageresultate der eingesetzten Anlagegruppen sowie Beratung zu geeigneter Mandatsstruktur und bei der Selektion geeigneter Asset Managers durch PPCmetrics

Kurspublikationen: Bloomberg: ASSL
www.swisslife.ch/anlagestiftung

Betriebsaufwandquote TER KGAST
ex ante: 0.55%
ex post per: 30/09/2024 0.60%

Performance in Referenzwährung

	Kumulierte Performance				Annualisierte Performance			
	YTD	1 Monat	3 Monate	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Aufl.
Anlagegruppe	0.62%	0.78%	-0.57%	2.66%	1.57%	1.47%	1.79%	2.63%
Benchmark	0.86%	0.78%	-0.27%	3.21%	1.89%	1.56%	1.97%	2.94%

Statistische Angaben (annualisiert)

	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Aufl.
Volatilität Anlagegruppe (in %)	2.34	3.41	3.20	3.10	2.81
Volatilität Benchmark (in %)	2.23	3.86	3.52	3.24	2.86
Tracking Error ex post (in %)	0.45	0.64	0.56	0.53	0.57
Information Ratio	-1.23	-0.51	-0.16	-0.34	-0.53
Sharpe Ratio	0.79	0.17	0.36	0.65	0.87
Korrelation	0.98	0.99	0.99	0.99	0.98
Beta	1.03	0.87	0.90	0.95	0.97
Jensen-Alpha	-0.62	-0.21	0.03	-0.06	-0.22
Maximum Drawdown (in %)	-3.17	-4.21	-9.12	-9.12	-9.12
Recovery Period (Jahre)	-	1.17	2.34	2.34	2.34

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	3.40%	2.00%	-
Hypotheken Schweiz	6.57%	13.00%	-
Obligationen CHF Inland	19.48%	13.00%	-
Obligationen CHF Ausland	8.34%	6.00%	-
Obligationen Fremdwährungen (CHF hedged)	24.77%	28.00%	-
Aktien Schweiz	6.99%	8.00%	-
Aktien Ausland	4.28%	7.00%	-
Aktien Ausland (CHF hedged)	3.98%	-	-
Immobilien Schweiz	16.32%	15.00%	30.00%
Immobilien Ausland (CHF hedged)	3.41%	3.00%	10.00%
Alternative Anlagen (CHF hedged)	2.46%	5.00%	15.00%
Total Aktien (In- und Ausland)	15.24%	15.00%	50.00%
Total Fremdwährungen	4.28%	7.00%	30.00%

Grösste Aktienpositionen

NESTLE SA-REG	0.99%
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	0.80%
NOVARTIS AG-REG	0.79%
ZURICH INSURANCE GROUP AG	0.36%
CIE FINANCIERE RICHEMO-A REG	0.36%
UBS GROUP AG-REG	0.36%
ABB LTD-REG	0.32%
NVIDIA CORP	0.30%
MICROSOFT CORP	0.30%
APPLE INC	0.28%

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%
SPI® Total Return	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	95.72%
USD	1.85%
JPY	0.77%
EUR	0.64%
Übrige	1.02%

Eigenschaften der festverzinslichen Anlagen

Modified Duration	5.61
Durchschnittliches Rating	A+