

Anlagestiftung Swiss Life BVG-Mix 45

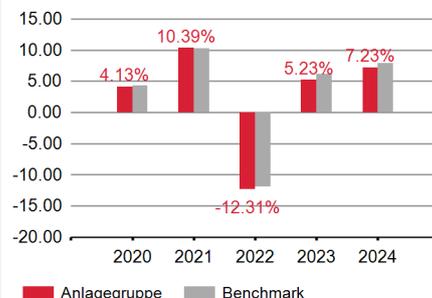


Nettovermögen (NAV) in Mio. CHF: 820.96
Nettovermögen pro Anspruch in CHF: 226.92

Anlagestrategie

Anlagen in alle vom BVG zugelassenen Anlagekategorien (strategischer Aktienanteil: 45%). Aktive Asset Allocation. Begrenzung für Beteiligungspapiere: 50%. Begrenzung für Fremdwährungen: 30%. Durchschnittliche Ratingqualität der Obligationen: mindestens BBB+. Umsetzung mittels Einsatz artreiner Kollektivanlagen. Empfohlene Schwankungsreserven: über 20%.

Performance



Wertentwicklung in Referenzwährung (Basis 100)



Produktinformationen

Valorennummer: 1245607
ISIN: CH0012456072
LEI: 2549001XL79VZWJO5Q69
Bloomberg-Code: SWABM45 SW
Benchmark: Customized
Währung: CHF
Domizil: Schweiz
Aufgatedatum: 30/09/2001
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: 0.50%
ex post per: 30/09/2024 0.59%

Performance in Referenzwährung

	Kumulierte Performance				Annualisierte Performance			
	YTD	1 Monat	3 Monate	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Aufl.
Anlagegruppe	1.88%	0.70%	3.14%	1.97%	3.28%	3.30%	3.28%	3.50%
Benchmark	2.24%	0.70%	3.21%	2.65%	3.90%	3.80%	3.82%	4.15%

Statistische Angaben (annualisiert)

	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Aufl.
Volatilität Anlagegruppe (in %)	5.07	5.97	6.44	6.27	6.40
Volatilität Benchmark (in %)	4.84	6.16	6.59	6.37	6.38
Tracking Error ex post (in %)	0.43	0.44	0.49	0.55	0.66
Information Ratio	-1.59	-1.39	-1.03	-0.97	-0.98
Sharpe Ratio	0.27	0.38	0.45	0.55	0.50
Korrelation	1.00	1.00	1.00	1.00	0.99
Beta	1.05	0.97	0.97	0.98	1.00
Jensen-Alpha	-0.78	-0.52	-0.41	-0.46	-0.65
Maximum Drawdown (in %)	-8.21	-8.21	-14.55	-16.22	-28.27
Recovery Period (Jahre)	-	-	2.28	0.67	3.76

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	2.86%	4.00%	-
Hypotheken Schweiz	3.66%	4.00%	-
Obligationen CHF Inland	15.07%	16.00%	-
Obligationen Fremdwährungen (CHF hedged)	15.68%	16.00%	-
Aktien Schweiz	18.61%	18.00%	-
Aktien Ausland	10.96%	10.00%	-
Aktien Ausland (CHF hedged)	18.21%	17.00%	-
Immobilien Schweiz	10.80%	10.00%	30.00%
Immobilien Ausland (CHF hedged)	2.05%	2.00%	10.00%
Alternative Anlagen (CHF hedged)	2.10%	3.00%	15.00%
Infrastruktur	-	-	-
Total Aktien (In- und Ausland)	47.77%	45.00%	50.00%
Total Fremdwährungen	10.96%	22.00%	30.00%

Grösste Aktienpositionen

NOVARTIS AG-REG	2.18%
NESTLE SA-REG	2.16%
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	2.13%
NVIDIA CORP	1.38%
MICROSOFT CORP	1.20%
UBS GROUP AG-REG	1.08%
ABB LTD-REG	1.00%
APPLE INC	0.99%
ZURICH INSURANCE GROUP AG	0.96%
CIE FINANCIERE RICHEMO-A REG	0.85%

Benchmarkzusammensetzung

1M Saron	4.00%
SBI Domestic AAA-A 1-3Y Total Return	4.00%
SBI AAA-BBB Total Return	16.00%
Bloomberg Gl. Agg. Treas. ex CH (CHF hedged)	6.00%
Bloomberg Gl. Agg. Corp. (CHF hedged)	2.00%
Bloomberg Gl. Agg. Corp. Short Term (CHF hedged)	2.00%
JP Morgan CEMBI Broad Diversified IG Index (CHF hedged)	6.00%
SPI® Total Return	18.00%
MSCI World ex Switzerland Net Return	10.00%
MSCI World ex Switzerland Net Return (CHF hedged)	17.00%
KGAST Immo-Index	10.00%
SL REF (LUX) ESG German Core Real Estate (CHF hedged)	1.20%
Anlagestiftung Swiss Life Immobilien Europa Industrie und Logistik ESG (EUR), CHF hedged	0.80%
HFRX Global Hedge Funds (CHF hedged)	3.00%
Anlagestiftung Swiss Life Infrastruktur Global ESG (EUR)	-

Portfoliostruktur nach Währungen

CHF	89.05%
USD	6.02%
EUR	1.50%
JPY	0.29%
Übrige	3.14%

Eigenschaften der festverzinslichen Anlagen

Modified Duration	5.59
Durchschnittliches Rating	A+