

Anlagestiftung Swiss Life BVG-Mix 15

Nettovermögen (NAV) in Mio. CHF: 217.26
Nettovermögen pro Anspruch in CHF: 176.18

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)



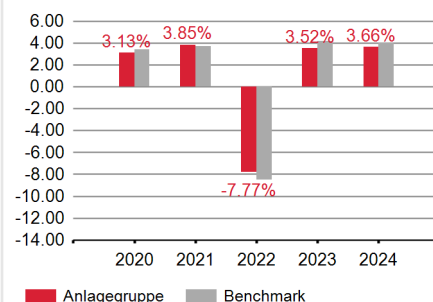
Performance in Referenzwährung

	Kumulierte Performance				Annualisierte Performance			
	YTD	1 Monat	3 Monate	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Aufl.
Anlagegruppe	0.40%	-0.78%	0.40%	2.29%	0.87%	2.08%	1.76%	2.64%
Benchmark	0.31%	-0.82%	0.31%	2.52%	1.01%	2.16%	1.92%	2.93%

Statistische Angaben (annualisiert)

	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Aufl.
Volatilität Anlagegruppe (in %)	2.38	3.48	3.33	3.09	2.82
Volatilität Benchmark (in %)	2.42	3.97	3.68	3.24	2.86
Tracking Error ex post (in %)	0.31	0.63	0.55	0.52	0.57
Information Ratio	-0.73	-0.23	-0.15	-0.32	-0.51
Sharpe Ratio	0.54	-0.02	0.53	0.65	0.87
Korrelation	0.99	0.99	0.99	0.99	0.98
Beta	0.98	0.87	0.90	0.94	0.97
Jensen-Alpha	-0.19	-0.13	0.11	-0.04	-0.21
Maximum Drawdown (in %)	-1.46	-6.22	-9.12	-9.12	-9.12
Recovery Period (Jahre)	-	1.46	2.34	2.34	2.34

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

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: 0.55%
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.

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	1.37%	2.00%	-
Hypotheken Schweiz	12.95%	13.00%	-
Obligationen CHF Inland	12.23%	13.00%	-
Obligationen CHF Ausland	5.08%	6.00%	-
Obligationen Fremdwährungen (CHF hedged)	25.38%	28.00%	-
Aktien Schweiz	8.97%	8.00%	-
Aktien Ausland	8.11%	7.00%	-
Aktien Ausland (CHF hedged)	0.41%	-	-
Immobilien Schweiz	19.50%	15.00%	30.00%
Immobilien Ausland (CHF hedged)	3.42%	3.00%	10.00%
Alternative Anlagen (CHF hedged)	2.58%	5.00%	15.00%
Total Aktien (In- und Ausland)	17.49%	15.00%	50.00%
Total Fremdwährungen	8.11%	7.00%	30.00%

Grösste Aktienpositionen

NESTLE SA-REG	1.28%
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	1.11%
NOVARTIS AG-REG	1.05%
ZURICH INSURANCE GROUP AG	0.49%
UBS GROUP AG-REG	0.47%
CIE FINANCIERE RICHEMO-A REG	0.45%
NVIDIA CORP	0.44%
MICROSOFT CORP	0.44%
ABB LTD-REG	0.39%
HOLCIM LTD	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	91.49%
USD	5.47%
JPY	0.47%
EUR	0.09%
Übrige	2.08%

Eigenschaften der festverzinslichen Anlagen

Modified Duration	4.54
Durchschnittliches Rating	A+