

Nettovermögen (NAV) in Mio. CHF: 391.96
Nettovermögen pro Anspruch in CHF: 182.63

Anlagestrategie

Die Anlagegruppe BVG-Mix 35 P investiert im Durchschnitt ca. 35% in Aktien. Etwas über die Hälfte des Aktienanteils wird in schweizerische Dividendenpapiere angelegt, der Rest entfällt auf ausländische Gesellschaften. Durchschnittlich sind rund 45% des Vermögens in Obligationen investiert. Es gelten folgende Höchstgrenzen: 45% Aktien, 30% Fremdwährungen. BVG-Mix 35 P eignet sich für Anleger, die bereit sind, mittlere Kursschwankungen in Kauf zu nehmen. Wir empfehlen einen Anlagehorizont von über sieben Jahren.

Wertentwicklung in Referenzwährung (Basis 100)



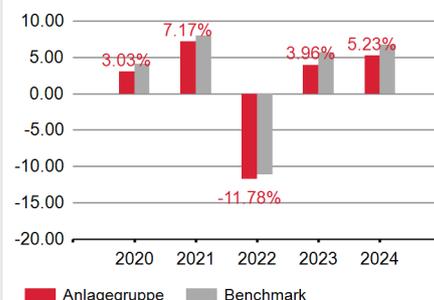
Performance in Referenzwährung

	Kumulierte Performance				Annualisierte Performance			
	YTD	1 Monat	3 Monate	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Aufl.
Anlagegruppe	-1.15%	-1.49%	-3.02%	1.71%	0.39%	1.89%	1.75%	2.70%
Benchmark	-0.58%	-1.05%	-2.42%	3.30%	1.84%	3.13%	3.05%	4.11%

Statistische Angaben (annualisiert)

	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Aufl.
Volatilität Anlagegruppe (in %)	4.10	5.62	5.38	5.26	5.15
Volatilität Benchmark (in %)	3.93	5.99	5.60	5.40	5.14
Tracking Error ex post (in %)	0.42	0.58	0.51	0.57	0.65
Information Ratio	-3.78	-2.51	-2.44	-2.29	-2.19
Sharpe Ratio	0.20	-0.10	0.29	0.38	0.48
Korrelation	1.00	1.00	1.00	0.99	0.99
Beta	1.04	0.94	0.96	0.97	1.00
Jensen-Alpha	-1.69	-1.40	-1.12	-1.19	-1.39
Maximum Drawdown (in %)	-6.66	-8.16	-13.60	-13.60	-22.51
Recovery Period (Jahre)	-	1.44	-	-	3.44

Performance



Produktinformationen

Valorennummer: 1436916

ISIN: CH0014369166

LEI: 254900SR5GM6HP44F130

Bloomberg-Code: SLVOR35 SW

Benchmark: Customized

Währung: CHF

Domizil: Schweiz

Aufgatedatum: 30/09/2002

Erstausgabepreis: 100.00

Jahresabschluss: 30.09

Ausgabe/Rücknahme: Täglich

Annahmeschluss: 12.00 Uhr

Verwässerungsschutz:

Ausgabe- / Rücknahmekommission zugunsten der Anlagegruppe gemäss Konditionenübersicht.

Ausschüttungspraxis: Thesaurierung

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: 1.32%

ex post per: 30/09/2024 1.40%

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.

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	2.31%	2.00%	-
Hypotheken Schweiz	0.62%	-	-
Obligationen CHF Inland	13.49%	14.00%	-
Obligationen CHF Ausland	7.06%	7.00%	-
Obligationen Fremdwährungen (CHF hedged)	23.22%	24.00%	-
Aktien Schweiz	18.42%	18.00%	-
Aktien Ausland	17.55%	17.00%	-
Aktien Ausland (CHF hedged)	0.73%	-	-
Immobilien Schweiz	12.67%	11.00%	30.00%
Immobilien Ausland (CHF hedged)	2.04%	2.00%	10.00%
Alternative Anlagen (CHF hedged)	2.63%	5.00%	15.00%
Total Aktien (In- und Ausland)	36.70%	35.00%	50.00%
Total Fremdwährungen	17.55%	17.00%	30.00%

Grösste Aktienpositionen

NESTLE SA-REG	2.65%
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	2.18%
NOVARTIS AG-REG	2.13%
ZURICH INSURANCE GROUP AG	0.98%
UBS GROUP AG-REG	0.91%
CIE FINANCIERE RICHEMO-A REG	0.90%
MICROSOFT CORP	0.90%
NVIDIA CORP	0.86%
ABB LTD-REG	0.80%
HOLCIM LTD	0.57%

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%
SPI® Total Return	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	83.94%
USD	10.50%
EUR	1.95%
JPY	0.90%
Übrige	2.70%

Eigenschaften der festverzinslichen Anlagen

Modified Duration	5.62
Durchschnittliches Rating	A