

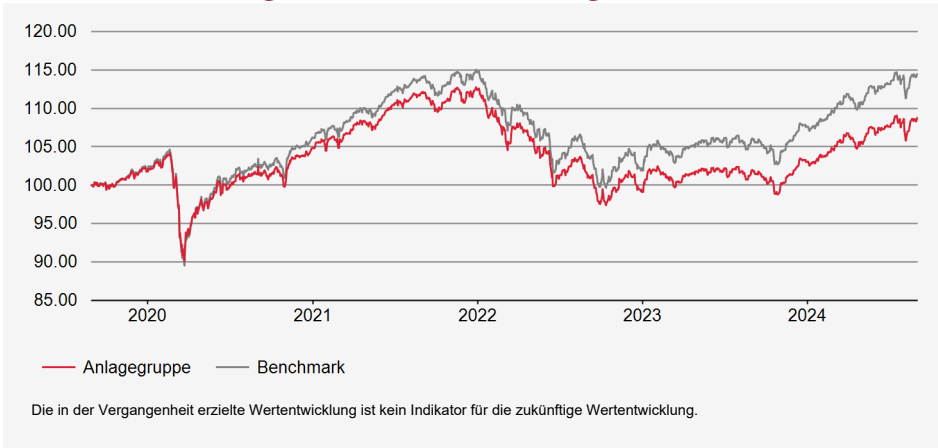
Anlagestiftung Swiss Life BVG-Mix 35 P

Nettovermögen (NAV) in Mio. CHF: 403.91
Nettovermögen pro Anspruch in CHF: 185.27

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)



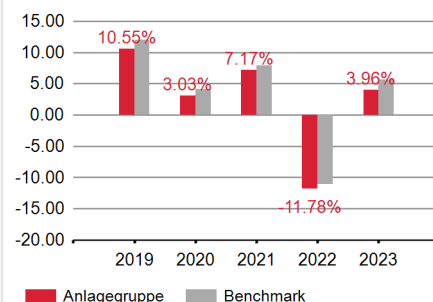
Performance in Referenzwährung

| | Kumulierte Performance | | | | Annualisierte Performance | | | |
|--------------|------------------------|---------|----------|--------|---------------------------|---------|----------|-------|
| | YTD | 1 Monat | 3 Monate | 1 Jahr | 3 Jahre | 5 Jahre | 10 Jahre | Aufl. |
| Anlagegruppe | 5.52% | 0.15% | 1.77% | 6.64% | -0.96% | 1.69% | 2.29% | 2.85% |
| Benchmark | 6.32% | 0.16% | 1.96% | 7.88% | 0.15% | 2.74% | 3.51% | 4.25% |

Statistische Angaben (annualisiert)

| | 1 Jahr | 3 Jahre | 5 Jahre | 10 Jahre | Aufl. |
|---------------------------------|--------|---------|---------|----------|--------|
| Volatilität Anlagegruppe (in %) | 4.44 | 5.81 | 6.06 | 5.27 | 5.17 |
| Volatilität Benchmark (in %) | 4.72 | 6.19 | 6.46 | 5.40 | 5.17 |
| Tracking Error ex post (in %) | 0.37 | 0.58 | 0.60 | 0.58 | 0.66 |
| Information Ratio | -3.42 | -1.92 | -1.73 | -2.12 | -2.15 |
| Sharpe Ratio | 1.10 | -0.28 | 0.26 | 0.49 | 0.51 |
| Korrelation | 1.00 | 1.00 | 1.00 | 0.99 | 0.99 |
| Beta | 0.94 | 0.93 | 0.94 | 0.97 | 0.99 |
| Jensen-Alpha | -0.87 | -1.14 | -0.87 | -1.11 | -1.38 |
| Maximum Drawdown (in %) | -3.12 | -13.60 | -13.60 | -13.60 | -22.51 |
| Recovery Period (Jahre) | 0.11 | - | - | - | 3.44 |

Performance



Produktinformationen

Valorennummer: 1436916

ISIN: CH0014369166

LEI: 254900SR5GM6HP44F130

Bloomberg-Code: SLVOR35 SW

Benchmark: Customized

Währung: CHF

Domizil: Schweiz

Aufgagedatum: 30/09/2002

Erstausgabepreis: 100.00

Jahresabschluss: 30.09

Ausgabe/Rücknahme: Täglich

Annahmeschluss: 12.00 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: 1.41%

ex post per: 30/09/2023 1.41%

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.

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 | 3.61% | 2.00% | - |
| Hypotheken Schweiz | 0.60% | - | - |
| Obligationen CHF Inland | 13.00% | 14.00% | - |
| Obligationen CHF Ausland | 7.08% | 7.00% | - |
| Obligationen Fremdwährungen (CHF hedged) | 24.76% | 24.00% | - |
| Aktien Schweiz | 18.25% | 18.00% | - |
| Aktien Ausland | 16.64% | 17.00% | - |
| Aktien Ausland (CHF hedged) | - | - | - |
| Immobilien Schweiz | 11.72% | 11.00% | 30.00% |
| Immobilien Ausland (CHF hedged) | 2.06% | 2.00% | 10.00% |
| Alternative Anlagen (CHF hedged) | 2.28% | 5.00% | 15.00% |
| Total Aktien (In- und Ausland) | 34.89% | 35.00% | 50.00% |
| Total Fremdwährungen | 16.64% | 17.00% | 30.00% |

Grösste Aktienpositionen

| | |
|------------------------------|-------|
| NESTLE SA-REG | 2.64% |
| NOVARTIS AG-REG | 2.31% |
| ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN | 2.23% |
| MICROSOFT CORP | 0.97% |
| NVIDIA CORP | 0.96% |
| UBS GROUP AG-REG | 0.93% |
| ABB LTD-REG | 0.86% |
| CIE FINANCIERE RICHEMO-A REG | 0.80% |
| ZURICH INSURANCE GROUP AG | 0.80% |
| ALPHABET INC | 0.59% |

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% |
| Swiss Performance Index | 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 | 83.37% |
| USD | 11.22% |
| EUR | 1.24% |
| JPY | 1.07% |
| Übrige | 3.10% |

Eigenschaften der festverzinslichen Anlagen

| | |
|---------------------------|------|
| Modified Duration | 5.57 |
| Durchschnittliches Rating | A |