

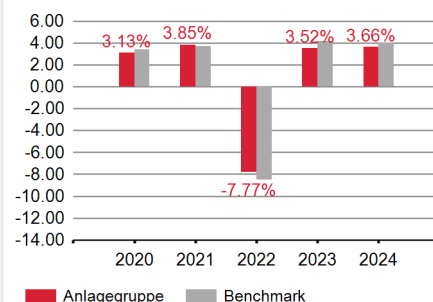
Anlagestiftung Swiss Life BVG-Mix 15

Nettovermögen (NAV) in Mio. CHF: 228.71
Nettovermögen pro Anspruch in CHF: 177.15

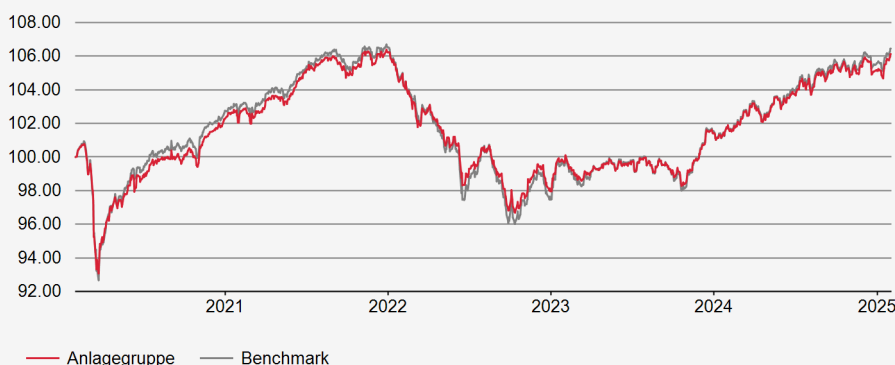
Anlagestrategie

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)



Die in der Vergangenheit erzielte Wertentwicklung ist kein Indikator für die zukünftige Wertentwicklung.

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.

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%

Performance in Referenzwährung

	Kumulierte Performance				Annualisierte Performance			
	YTD	1 Monat	3 Monate	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Aufl.
Anlagegruppe	0.96%	0.96%	1.32%	4.35%	0.43%	1.20%	2.01%	2.68%
Benchmark	0.82%	0.82%	1.46%	4.64%	0.50%	1.26%	2.14%	2.98%

Statistische Angaben (annualisiert)

	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Aufl.
Volatilität Anlagegruppe (in %)	2.30	3.56	3.80	3.10	2.82
Volatilität Benchmark (in %)	2.31	4.05	4.14	3.24	2.86
Tracking Error ex post (in %)	0.31	0.65	0.56	0.52	0.57
Information Ratio	-0.96	-0.10	-0.11	-0.25	-0.51
Sharpe Ratio	1.34	-0.12	0.25	0.73	0.88
Korrelation	0.99	0.99	0.99	0.99	0.98
Beta	0.99	0.87	0.91	0.95	0.97
Jensen-Alpha	-0.25	-0.11	0.03	0.00	-0.21
Maximum Drawdown (in %)	-1.18	-7.87	-9.12	-9.12	-9.12
Recovery Period (Jahre)	0.04	1.85	-	-	-

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	1.64%	2.00%	-
Hypotheken Schweiz	12.31%	13.00%	-
Obligationen CHF Inland	12.47%	13.00%	-
Obligationen CHF Ausland	5.49%	6.00%	-
Obligationen Fremdwährungen (CHF hedged)	26.79%	28.00%	-
Aktien Schweiz	8.54%	8.00%	-
Aktien Ausland	8.79%	7.00%	-
Aktien Ausland (CHF hedged)	0.17%	-	-
Immobilien Schweiz	18.30%	15.00%	30.00%
Immobilien Ausland (CHF hedged)	3.31%	3.00%	10.00%
Alternative Anlagen (CHF hedged)	2.22%	5.00%	15.00%
Total Aktien (In- und Ausland)	17.50%	15.00%	50.00%
Total Fremdwährungen	8.79%	7.00%	30.00%

Grösste Aktienpositionen

NESTLE SA-REG	1.04%
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	1.03%
NOVARTIS AG-REG	1.00%
UBS GROUP AG-REG	0.51%
CIE FINANCIERE RICHEMO-A REG	0.49%
NVIDIA CORP	0.47%
MICROSOFT CORP	0.47%
ZURICH INSURANCE GROUP AG	0.42%
ABB LTD-REG	0.41%
HOLCIM LTD	0.26%

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%
Swiss Performance Index	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	91.05%
USD	6.15%
JPY	0.53%
EUR	0.15%
Übrige	2.13%

Eigenschaften der festverzinslichen Anlagen

Modified Duration	4.73
Durchschnittliches Rating	A+