

Anlagestiftung Swiss Life BVG-Mix 35

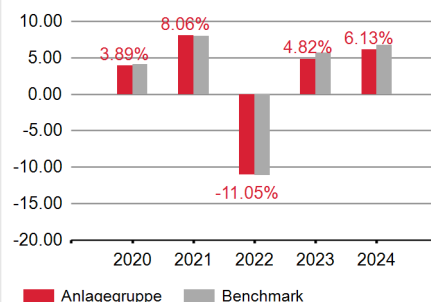


Nettovermögen (NAV) in Mio. CHF: 399.05
Nettovermögen pro Anspruch in CHF: 217.06

Anlagestrategie

Anlagen in alle vom BVG zugelassenen Anlagekategorien (strategischer Aktienanteil: 35%). Aktive Asset Allocation. Begrenzung für Beteiligungspapiere: 45%. Begrenzung für Fremdwährungen: 30%. Durchschnittliche Ratingqualität der Obligationen: mindestens BBB+. Umsetzung mittels Einsatz artreiner Kollektivanlagen. Empfohlene Schwankungsreserven: über 15%.

Performance



Wertentwicklung in Referenzwährung (Basis 100)



Produktinformationen

Valorennummer: 1245606
ISIN: CH0012456064
LEI: 254900SR5GM6HP44F130
Bloomberg-Code: SWABM35 SW
Benchmark: Customized
Währung: CHF
Domizil: Schweiz
Aufledgedatum: 30/09/2001
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 0.57%

Performance in Referenzwährung

	Kumulierte Performance				Annualisierte Performance			
	YTD	1 Monat	3 Monate	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Aufl.
Anlagegruppe	1.99%	1.99%	2.81%	7.58%	1.09%	2.41%	3.29%	3.37%
Benchmark	1.88%	1.88%	2.88%	8.07%	1.47%	2.68%	3.64%	3.91%

Statistische Angaben (annualisiert)

	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Aufl.
Volatilität Anlagegruppe (in %)	3.82	5.67	6.16	5.27	5.19
Volatilität Benchmark (in %)	3.77	6.06	6.53	5.41	5.18
Tracking Error ex post (in %)	0.24	0.58	0.60	0.57	0.63
Information Ratio	-2.07	-0.67	-0.44	-0.62	-0.84
Sharpe Ratio	1.60	0.04	0.35	0.67	0.60
Korrelation	1.00	1.00	1.00	0.99	0.99
Beta	1.01	0.93	0.94	0.97	1.00
Jensen-Alpha	-0.57	-0.34	-0.12	-0.23	-0.52
Maximum Drawdown (in %)	-2.93	-11.00	-13.41	-13.41	-21.36
Recovery Period (Jahre)	0.14	1.72	0.65	0.65	3.00

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	1.89%	2.00%	-
Hypotheken Schweiz	0.62%	-	-
Obligationen CHF Inland	13.15%	14.00%	-
Obligationen CHF Ausland	6.89%	7.00%	-
Obligationen Fremdwährungen (CHF hedged)	23.49%	24.00%	-
Aktien Schweiz	18.95%	18.00%	-
Aktien Ausland	18.83%	17.00%	-
Aktien Ausland (CHF hedged)	0.37%	-	-
Immobilien Schweiz	11.60%	11.00%	30.00%
Immobilien Ausland (CHF hedged)	2.00%	2.00%	10.00%
Alternative Anlagen (CHF hedged)	2.21%	5.00%	15.00%
Total Aktien (In- und Ausland)	38.15%	35.00%	50.00%
Total Fremdwährungen	18.83%	17.00%	30.00%

Grösste Aktienpositionen

NESTLE SA-REG	2.31%
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	2.29%
NOVARTIS AG-REG	2.23%
UBS GROUP AG-REG	1.13%
CIE FINANCIERE RICHEMO-A REG	1.09%
NVIDIA CORP	1.02%
MICROSOFT CORP	1.01%
ZURICH INSURANCE GROUP AG	0.92%
ABB LTD-REG	0.91%
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%
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	80.82%
USD	13.17%
JPY	1.13%
EUR	0.31%
Übrige	4.56%

Eigenschaften der festverzinslichen Anlagen

Modified Duration	5.58
Durchschnittliches Rating	A