

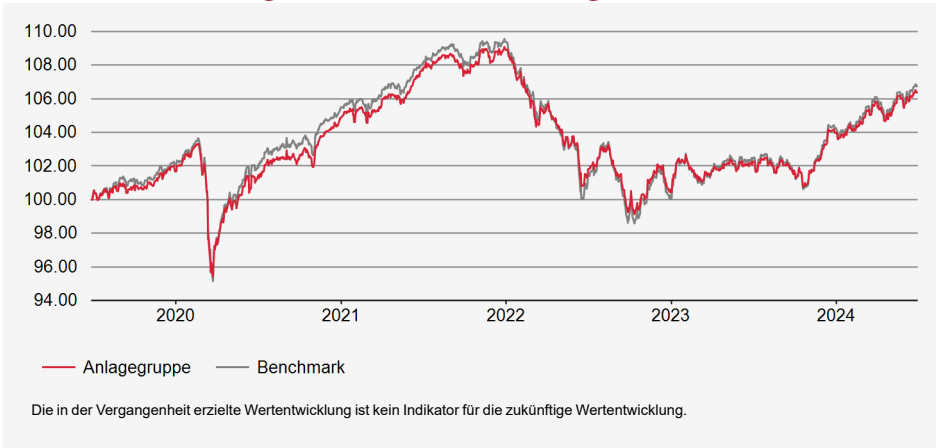
Anlagestiftung Swiss Life BVG-Mix 15

Nettovermögen (NAV) in Mio. CHF: 229.81
Nettovermögen pro Anspruch in CHF: 173.17

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)



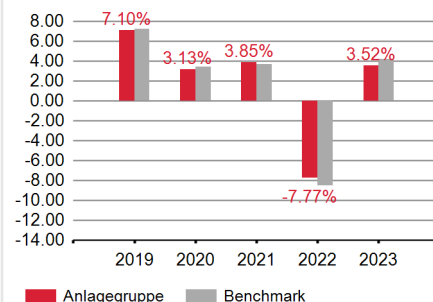
Performance in Referenzwährung

	Kumulierte Performance				Annualisierte Performance			
	YTD	1 Monat	3 Monate	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Aufl.
Anlagegruppe	2.30%	0.69%	0.54%	4.02%	-0.41%	1.24%	2.04%	2.65%
Benchmark	2.40%	0.76%	0.63%	4.18%	-0.41%	1.32%	2.20%	2.95%

Statistische Angaben (annualisiert)

	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Aufl.
Volatilität Anlagegruppe (in %)	2.69	3.57	3.74	3.07	2.83
Volatilität Benchmark (in %)	3.11	4.08	4.09	3.22	2.88
Tracking Error ex post (in %)	0.48	0.64	0.57	0.53	0.57
Information Ratio	-0.31	0.01	-0.13	-0.30	-0.51
Sharpe Ratio	0.87	-0.27	0.32	0.76	0.88
Korrelation	1.00	0.99	0.99	0.99	0.98
Beta	0.86	0.87	0.91	0.94	0.97
Jensen-Alpha	0.20	-0.12	0.04	-0.02	-0.21
Maximum Drawdown (in %)	-1.68	-9.12	-9.12	-9.12	-9.12
Recovery Period (Jahre)	0.11	-	-	-	-

Performance



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: 14.00 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: 0.57%
ex post per: 30/09/2023 0.59%

Portfoliostruktur nach Anlagekategorien

	Anlagegruppe	Benchmark	max. BVV2
Liquidität	3.98%	2.00%	-
Hypotheken Schweiz	11.99%	13.00%	-
Obligationen CHF Inland	11.63%	13.00%	-
Obligationen CHF Ausland	5.74%	6.00%	-
Obligationen Fremdwährungen (CHF hedged)	27.91%	28.00%	-
Aktien Schweiz	8.03%	8.00%	-
Aktien Ausland	7.05%	7.00%	-
Aktien Ausland (CHF hedged)	-	-	-
Immobilien Schweiz	17.91%	15.00%	30.00%
Immobilien Ausland (CHF hedged)	3.50%	3.00%	10.00%
Alternative Anlagen (CHF hedged)	2.28%	5.00%	15.00%
Total Aktien (In- und Ausland)	15.07%	15.00%	50.00%
Total Fremdwährungen	7.05%	7.00%	30.00%

Grösste Aktienpositionen

NESTLE SA-REG	1.21%
NOVARTIS AG-REG	0.99%
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	0.88%
MICROSOFT CORP	0.52%
NVIDIA CORP	0.50%
UBS GROUP AG-REG	0.43%
ABB LTD-REG	0.40%
CIE FINANCIERE RICHEMO-A REG	0.38%
ZURICH INSURANCE GROUP AG	0.35%
ALPHABET INC	0.33%

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	90.58%
USD	4.86%
EUR	0.52%
JPY	0.43%
Übrige	3.62%

Eigenschaften der festverzinslichen Anlagen

Modified Duration	4.64
Durchschnittliches Rating	A+