

Anlagestiftung Swiss Life BVG-Mix 35

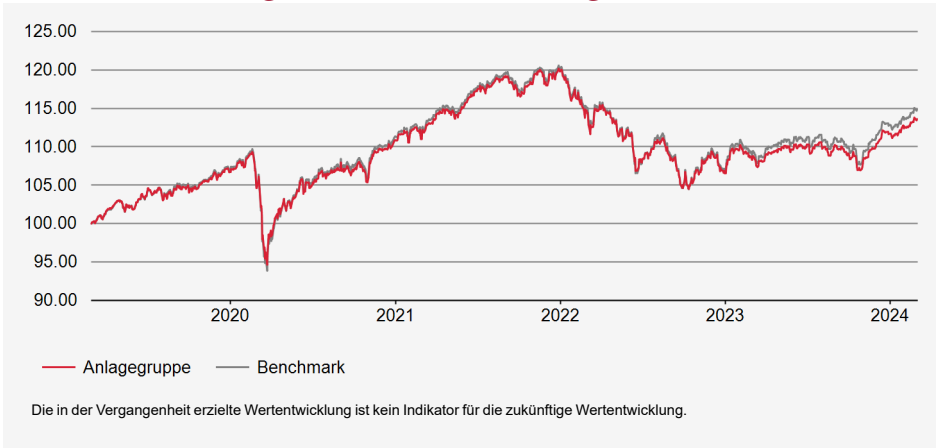


Nettovermögen (NAV) in Mio. CHF: 371.80
Nettovermögen pro Anspruch in CHF: 203.98

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%.

Wertentwicklung in Referenzwährung (Basis 100)



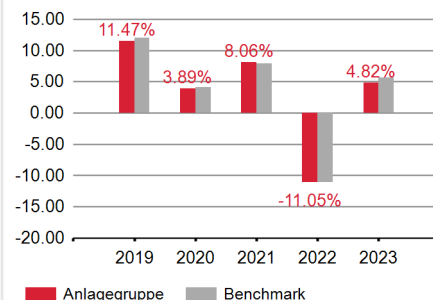
Performance in Referenzwährung

	Kumulierte Performance				Annualisierte Performance			
	YTD	1 Monat	3 Monate	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Aufl.
Anlagegruppe	1.72%	1.10%	3.30%	4.80%	0.78%	2.58%	3.17%	3.23%
Benchmark	1.81%	1.21%	3.44%	5.38%	1.02%	2.81%	3.53%	3.77%

Statistische Angaben (annualisiert)

	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Aufl.
Volatilität Anlagegruppe (in %)	3.73	5.86	6.07	5.24	5.24
Volatilität Benchmark (in %)	4.04	6.23	6.45	5.36	5.23
Tracking Error ex post (in %)	0.36	0.58	0.61	0.58	0.64
Information Ratio	-1.61	-0.42	-0.37	-0.63	-0.84
Sharpe Ratio	0.84	0.08	0.44	0.67	0.57
Korrelation	1.00	1.00	1.00	0.99	0.99
Beta	0.92	0.94	0.94	0.97	0.99
Jensen-Alpha	-0.28	-0.20	-0.05	-0.25	-0.52
Maximum Drawdown (in %)	-3.29	-13.03	-13.41	-13.41	-21.36
Recovery Period (Jahre)	0.11	-	0.65	0.65	3.00

Performance



Produktinformationen

Valorennummer: 1245606

ISIN: CH0012456064

LEI: 254900SR5GM6HP44F130

Bloomberg-Code: SWABM35 SW

Benchmark: Customized

Währung: CHF

Domizil: Schweiz

Aufgagedatum: 30/09/2001

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: 0.58%

ex post per: 30/09/2023 0.59%

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.

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	3.27%	2.00%	-
Hypotheken Schweiz	0.64%	-	-
Obligationen CHF Inland	14.27%	14.00%	-
Obligationen CHF Ausland	7.11%	7.00%	-
Obligationen Fremdwährungen (CHF hedged)	22.72%	24.00%	-
Aktien Schweiz	18.05%	18.00%	-
Aktien Ausland	16.50%	17.00%	-
Aktien Ausland (CHF hedged)	0.56%	-	-
Immobilien Schweiz	12.27%	11.00%	30.00%
Immobilien Ausland (CHF hedged)	2.33%	2.00%	10.00%
Alternative Anlagen (CHF hedged)	2.28%	5.00%	15.00%
Total Aktien (In- und Ausland)	35.10%	35.00%	50.00%
Total Fremdwährungen	16.50%	17.00%	30.00%

Grösste Aktienpositionen

NESTLE SA-REG	2.87%
NOVARTIS AG-REG	2.21%
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	1.91%
MICROSOFT CORP.	1.21%
UBS GROUP AG-REG	0.90%
CIE FINANCIERE RICHEMONT-REG	0.88%
NVIDIA CORP	0.81%
ZURICH INSURANCE GROUP AG	0.80%
ABB LTD-REG	0.77%
ALPHABET INC	0.64%

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	81.97%
USD	11.21%
EUR	1.31%
JPY	1.11%
Übrige	4.40%

Eigenschaften der festverzinslichen Anlagen

Modified Duration	5.57
Durchschnittliches Rating	A+