

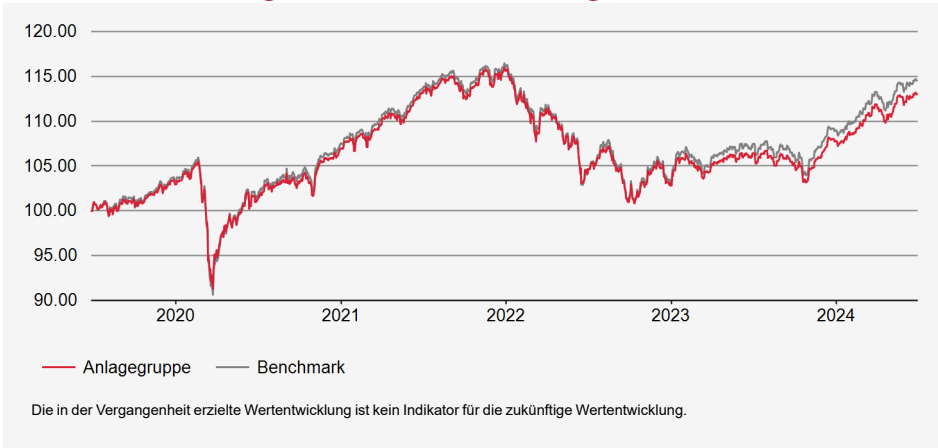
# Anlagestiftung Swiss Life BVG-Mix 35

**Nettovermögen (NAV) in Mio. CHF: 396.65**  
**Nettovermögen pro Anspruch in CHF: 210.23**

## 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)



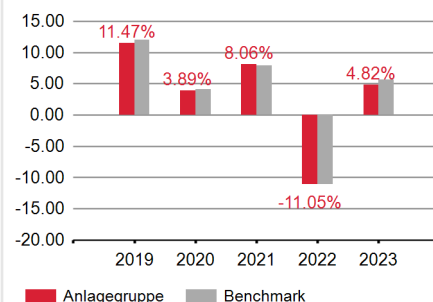
## Performance in Referenzwährung

	Kumulierte Performance				Annualisierte Performance			
	YTD	1 Monat	3 Monate	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Aufl.
Anlagegruppe	4.83%	0.75%	1.01%	6.18%	-0.04%	2.47%	3.18%	3.32%
Benchmark	5.10%	0.79%	1.15%	6.61%	0.28%	2.75%	3.57%	3.86%

## Statistische Angaben (annualisiert)

	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Aufl.
Volatilität Anlagegruppe (in %)	4.50	5.82	6.05	5.28	5.23
Volatilität Benchmark (in %)	4.78	6.20	6.45	5.41	5.22
Tracking Error ex post (in %)	0.35	0.58	0.61	0.58	0.64
Information Ratio	-1.24	-0.54	-0.46	-0.68	-0.84
Sharpe Ratio	0.97	-0.10	0.40	0.66	0.59
Korrelation	1.00	1.00	1.00	0.99	0.99
Beta	0.94	0.93	0.94	0.97	0.99
Jensen-Alpha	-0.14	-0.33	-0.10	-0.28	-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](http://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	3.67%	2.00%	-
Hypotheken Schweiz	0.60%	-	-
Obligationen CHF Inland	13.37%	14.00%	-
Obligationen CHF Ausland	7.09%	7.00%	-
Obligationen Fremdwährungen (CHF hedged)	24.17%	24.00%	-
Aktien Schweiz	17.85%	18.00%	-
Aktien Ausland	17.20%	17.00%	-
Aktien Ausland (CHF hedged)	-	-	-
Immobilien Schweiz	11.60%	11.00%	30.00%
Immobilien Ausland (CHF hedged)	2.17%	2.00%	10.00%
Alternative Anlagen (CHF hedged)	2.28%	5.00%	15.00%
Total Aktien (In- und Ausland)	35.05%	35.00%	50.00%
Total Fremdwährungen	17.20%	17.00%	30.00%

## Grösste Aktienpositionen

NESTLE SA-REG	2.70%
NOVARTIS AG-REG	2.21%
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	1.97%
MICROSOFT CORP	1.26%
NVIDIA CORP	1.23%
UBS GROUP AG-REG	0.96%
ABB LTD-REG	0.89%
CIE FINANCIERE RICHEMO-A REG	0.85%
ALPHABET INC	0.80%
ZURICH INSURANCE GROUP AG	0.79%

## 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	81.25%
USD	11.87%
EUR	1.27%
JPY	1.04%
Übrige	4.58%

## Eigenschaften der festverzinslichen Anlagen

Modified Duration	5.78
Durchschnittliches Rating	A