

Anlagestiftung Swiss Life BVG-Mix 45

Nettovermögen (NAV) in Mio. CHF: 715.06
Nettovermögen pro Anspruch in CHF: 228.46

Anlagestrategie

Anlagen in alle vom BVG zugelassenen Anlagekategorien (strategischer Aktienanteil: 45%). Aktive Asset Allocation. Begrenzung für Beteiligungspapiere: 50%. Begrenzung für Fremdwährungen: 30%. Durchschnittliche Ratingqualität der Obligationen: mindestens BBB+. Umsetzung mittels Einsatz artreiner Kollektivanlagen. Empfohlene Schwankungsreserven: über 20%.

Wertentwicklung in Referenzwährung (Basis 100)



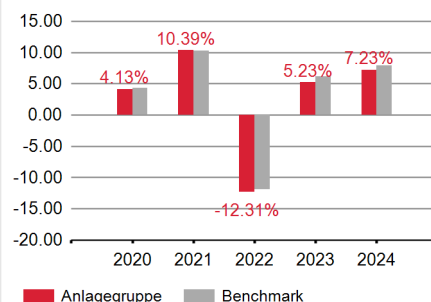
Performance in Referenzwährung

| | Kumulierte Performance | | | | Annualisierte Performance | | | |
|--------------|------------------------|---------|----------|--------|---------------------------|---------|----------|-------|
| | YTD | 1 Monat | 3 Monate | 1 Jahr | 3 Jahre | 5 Jahre | 10 Jahre | Aufl. |
| Anlagegruppe | 2.57% | 2.57% | 3.54% | 9.08% | 1.42% | 3.05% | 3.94% | 3.60% |
| Benchmark | 2.43% | 2.43% | 3.60% | 9.66% | 2.02% | 3.47% | 4.42% | 4.25% |

Statistische Angaben (annualisiert)

| | 1 Jahr | 3 Jahre | 5 Jahre | 10 Jahre | Aufl. |
|---------------------------------|--------|---------|---------|----------|--------|
| Volatilität Anlagegruppe (in %) | 4.65 | 6.64 | 7.32 | 6.38 | 6.43 |
| Volatilität Benchmark (in %) | 4.55 | 6.98 | 7.62 | 6.46 | 6.41 |
| Tracking Error ex post (in %) | 0.27 | 0.56 | 0.55 | 0.57 | 0.66 |
| Information Ratio | -2.16 | -1.08 | -0.75 | -0.85 | -0.97 |
| Sharpe Ratio | 1.61 | 0.08 | 0.38 | 0.65 | 0.52 |
| Korrelation | 1.00 | 1.00 | 1.00 | 1.00 | 0.99 |
| Beta | 1.02 | 0.95 | 0.96 | 0.99 | 1.00 |
| Jensen-Alpha | -0.76 | -0.54 | -0.28 | -0.41 | -0.64 |
| Maximum Drawdown (in %) | -3.98 | -12.18 | -16.22 | -16.22 | -28.27 |
| Recovery Period (Jahre) | 0.19 | 1.60 | 0.67 | 0.67 | 3.76 |

Performance



Produktinformationen

Valorennummer: 1245607
ISIN: CH0012456072
LEI: 2549001XL79VZWJO5Q69
Bloomberg-Code: SWABM45 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: 0.56%
ex post per: 30/09/2024 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.

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 | 2.28% | 2.00% | - |
| Hypotheken Schweiz | 0.57% | - | - |
| Obligationen CHF Inland | 10.88% | 12.00% | - |
| Obligationen CHF Ausland | 4.86% | 5.00% | - |
| Obligationen Fremdwährungen (CHF hedged) | 19.43% | 20.00% | - |
| Aktien Schweiz | 24.29% | 23.00% | - |
| Aktien Ausland | 23.03% | 22.00% | - |
| Aktien Ausland (CHF hedged) | 0.47% | - | - |
| Immobilien Schweiz | 10.22% | 9.00% | 30.00% |
| Immobilien Ausland (CHF hedged) | 1.64% | 2.00% | 10.00% |
| Alternative Anlagen (CHF hedged) | 2.33% | 5.00% | 15.00% |
| Total Aktien (In- und Ausland) | 47.79% | 45.00% | 50.00% |
| Total Fremdwährungen | 23.03% | 22.00% | 30.00% |

Grösste Aktienpositionen

| | |
|------------------------------|-------|
| NESTLE SA-REG | 2.97% |
| ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN | 2.94% |
| NOVARTIS AG-REG | 2.86% |
| UBS GROUP AG-REG | 1.45% |
| CIE FINANCIERE RICHEMO-A REG | 1.39% |
| NVIDIA CORP | 1.25% |
| MICROSOFT CORP | 1.25% |
| ZURICH INSURANCE GROUP AG | 1.18% |
| ABB LTD-REG | 1.16% |
| HOLCIM LTD | 0.73% |

Benchmarkzusammensetzung

| | |
|---|--------|
| 1M Saron | 2.00% |
| SBI Domestic AAA-BBB | 12.00% |
| SBI Foreign AAA-BBB | 5.00% |
| Bloomberg Gl. Agg. Treas. ex CH TR (CHF hedged) | 2.50% |
| Bloomberg Gl. Agg. Corp. TR (CHF hedged) | 6.50% |
| 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 | 23.00% |
| MSCI World ex CH ESG Leaders, in CHF | 17.60% |
| MSCI AC World Small Cap, in CHF | 3.30% |
| MSCI Emerging Markets, in CHF | 1.10% |
| KGAST Immo-Index | 9.00% |
| SL REF (LUX) German Core Real Estate (CHF hedged) | 2.00% |
| HFRX Global Hedge Funds (CHF hedged) | 5.00% |

Portfoliostruktur nach Währungen

| | |
|--------|--------|
| CHF | 76.53% |
| USD | 16.06% |
| JPY | 1.39% |
| EUR | 0.40% |
| Übrige | 5.63% |

Eigenschaften der festverzinslichen Anlagen

| | |
|---------------------------|------|
| Modified Duration | 5.65 |
| Durchschnittliches Rating | A |