

Anlagestiftung Swiss Life BVG-Mix 45 P

Nettovermögen (NAV) in Mio. CHF: 816.11
Nettovermögen pro Anspruch in CHF: 201.37

Anlagestrategie

Die Anlagegruppe BVG-Mix 45 P investiert im Durchschnitt ca. 45% in Aktien. Etwas über die Hälfte des Aktienanteils wird in schweizerische Dividendenpapiere angelegt, der Rest entfällt auf ausländische Gesellschaften. Durchschnittlich sind rund 37% des Vermögens in Obligationen investiert. Es gelten folgende Höchstgrenzen: 50% Aktien, 30% Fremdwährungen. BVG-Mix 45 P eignet sich für Anleger, die bereit sind, grössere Kursschwankungen in Kauf zu nehmen. Wir empfehlen einen Anlagehorizont von über zehn Jahren.

Wertentwicklung in Referenzwährung (Basis 100)



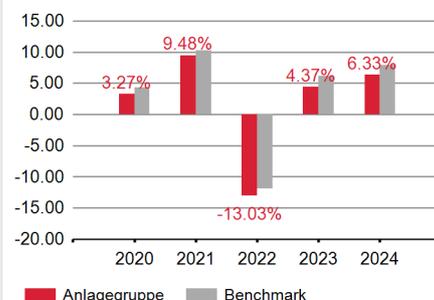
Performance in Referenzwährung

	Kumulierte Performance				Annualisierte Performance			
	YTD	1 Monat	3 Monate	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Aufl.
Anlagegruppe	0.78%	0.27%	0.31%	1.45%	3.18%	2.46%	2.66%	3.12%
Benchmark	1.53%	0.37%	0.95%	2.97%	4.86%	3.81%	4.04%	4.65%

Statistische Angaben (annualisiert)

	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Aufl.
Volatilität Anlagegruppe (in %)	5.13	6.15	6.44	6.32	6.32
Volatilität Benchmark (in %)	4.88	6.41	6.59	6.41	6.30
Tracking Error ex post (in %)	0.43	0.52	0.49	0.56	0.67
Information Ratio	-3.53	-3.26	-2.77	-2.49	-2.28
Sharpe Ratio	0.15	0.35	0.33	0.45	0.46
Korrelation	1.00	1.00	1.00	1.00	0.99
Beta	1.05	0.96	0.97	0.98	1.00
Jensen-Alpha	-1.63	-1.52	-1.26	-1.31	-1.52
Maximum Drawdown (in %)	-8.32	-8.32	-15.10	-16.28	-29.17
Recovery Period (Jahre)	-	-	-	0.74	3.98

Performance



Produktinformationen

Valorennummer: 1436925

ISIN: CH0014369257

LEI: 2549001XL79VZWJO5Q69

Bloomberg-Code: SLVOR45 SW

Benchmark: Customized

Währung: CHF

Domizil: Schweiz

Aufgatedatum: 30/09/2002

Erstausgabepreis: 100.00

Jahresabschluss: 30.09

Ausgabe/Rücknahme: Täglich

Annahmeschluss: 12.00 Uhr

Verwässerungsschutz:

Ausgabe- / Rücknahmekommission zugunsten der Anlagegruppe gemäss Konditionenübersicht.

Asset Management:

Strategische und taktische Asset Allocation durch Swiss Life Asset Management AG

Eingesetzte artreine Anlagegruppen: Diverse gemäss Swiss Life Best Select Invest Plus © Ansatz

Externe Beratung:

Überwachung der Anlageresultate der eingesetzten Anlagegruppen sowie Beratung zu geeigneter Mandatsstruktur und bei der Selektion geeigneter Asset Managers durch PPCmetrics

Kurspublikationen: Bloomberg: ASSL
www.swisslife.ch/anlagestiftung

Betriebsaufwandquote TER KGAST

ex ante: 1.33%

ex post per: 30/09/2024 1.42%

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.

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	3.81%	2.00%	-
Hypotheken Schweiz	3.69%	4.00%	-
Obligationen CHF Inland	15.10%	16.00%	-
Obligationen Fremdwährungen (CHF hedged)	16.09%	16.00%	-
Aktien Schweiz	17.65%	18.00%	-
Aktien Ausland	10.38%	10.00%	-
Aktien Ausland (CHF hedged)	17.90%	17.00%	-
Immobilien Schweiz	10.44%	10.00%	30.00%
Immobilien Ausland (CHF hedged)	2.06%	2.00%	10.00%
Alternative Anlagen (CHF hedged)	2.86%	3.00%	15.00%
Infrastruktur	-	2.00%	-
Total Aktien (In- und Ausland)	45.93%	45.00%	50.00%
Total Fremdwährungen	10.38%	22.00%	30.00%

Grösste Aktienpositionen

NESTLE SA-REG	2.26%
NOVARTIS AG-REG	2.10%
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	2.02%
NVIDIA CORP	1.20%
MICROSOFT CORP	1.10%
APPLE INC	0.96%
ZURICH INSURANCE GROUP AG	0.90%
UBS GROUP AG-REG	0.90%
CIE FINANCIERE RICHEMO-A REG	0.89%
ABB LTD-REG	0.83%

Benchmarkzusammensetzung

1M Saron	4.00%
SBI Domestic AAA-A 1-3Y Total Return	4.00%
SBI AAA-BBB Total Return	16.00%
Bloomberg Gl. Agg. Treas. ex CH (CHF hedged)	6.00%
Bloomberg Gl. Agg. Corp. (CHF hedged)	2.00%
Bloomberg Gl. Agg. Corp. Short Term (CHF hedged)	2.00%
JP Morgan CEMBI Broad Diversified IG Index (CHF hedged)	6.00%
SPI® Total Return	18.00%
MSCI World ex Switzerland Net Return	10.00%
MSCI World ex Switzerland Net Return (CHF hedged)	17.00%
KGAST Immo-Index	10.00%
SL REF (LUX) ESG German Core Real Estate (CHF hedged)	1.20%
Anlagestiftung Swiss Life Immobilien Europa Industrie und Logistik ESG (EUR), CHF hedged	0.80%
HFRX Global Hedge Funds (CHF hedged)	3.00%
Anlagestiftung Swiss Life Infrastruktur Global ESG (EUR)	-

Portfoliostruktur nach Währungen

CHF	89.62%
USD	3.76%
JPY	2.12%
EUR	1.47%
Übrige	3.03%

Eigenschaften der festverzinslichen Anlagen

Modified Duration	5.73
Durchschnittliches Rating	A+