

31. März 2024

# Anlagestiftung Swiss Life BVG-Mix 35

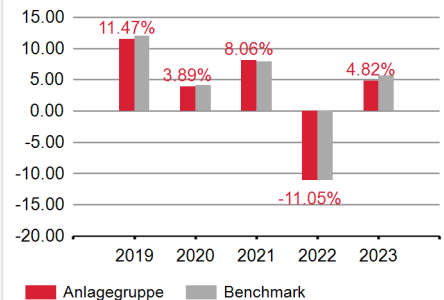


**Nettovermögen (NAV) in Mio. CHF: 382.91**  
**Nettovermögen pro Anspruch in CHF: 208.12**

## 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%.

## Performance



## Wertentwicklung in Referenzwährung (Basis 100)



## 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®

## Performance in Referenzwährung

	Kumulierte Performance				Annualisierte Performance			
	YTD	1 Monat	3 Monate	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Aufl.
Anlagegruppe	3.78%	2.03%	3.78%	6.36%	0.67%	2.74%	3.33%	3.31%
Benchmark	3.90%	2.05%	3.90%	6.84%	0.90%	2.98%	3.71%	3.85%

## Statistische Angaben (annualisiert)

	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Aufl.
Volatilität Anlagegruppe (in %)	4.07	5.82	6.10	5.26	5.24
Volatilität Benchmark (in %)	4.34	6.18	6.49	5.39	5.23
Tracking Error ex post (in %)	0.35	0.58	0.61	0.58	0.64
Information Ratio	-1.38	-0.41	-0.40	-0.64	-0.84
Sharpe Ratio	1.12	0.05	0.45	0.69	0.59
Korrelation	1.00	1.00	1.00	0.99	0.99
Beta	0.94	0.94	0.94	0.97	0.99
Jensen-Alpha	-0.15	-0.21	-0.06	-0.26	-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

**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	3.09%	2.00%	-
Hypotheken Schweiz	0.62%	-	-
Obligationen CHF Inland	14.16%	14.00%	-
Obligationen CHF Ausland	7.01%	7.00%	-
Obligationen Fremdwährungen (CHF hedged)	22.68%	24.00%	-
Aktien Schweiz	18.32%	18.00%	-
Aktien Ausland	17.06%	17.00%	-
Aktien Ausland (CHF hedged)	0.56%	-	-
Immobilien Schweiz	11.96%	11.00%	30.00%
Immobilien Ausland (CHF hedged)	2.24%	2.00%	10.00%
Alternative Anlagen (CHF hedged)	2.30%	5.00%	15.00%
Total Aktien (In- und Ausland)	35.94%	35.00%	50.00%
Total Fremdwährungen	17.06%	17.00%	30.00%

## Grösste Aktienpositionen

NESTLE SA-REG	2.96%
NOVARTIS AG-REG	2.07%
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	1.87%
MICROSOFT CORP.	1.23%
UBS GROUP AG-REG	1.04%
NVIDIA CORP	0.93%
CIE FINANCIERE RICHEMONT-REG	0.86%
ZURICH INSURANCE GROUP AG	0.83%
ABB LTD-REG	0.79%
ALPHABET INC	0.70%

## 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	81.55%
USD	11.63%
EUR	1.34%
JPY	1.14%
Übrige	4.33%

## Eigenschaften der festverzinslichen Anlagen

Modified Duration	5.60
Durchschnittliches Rating	A