

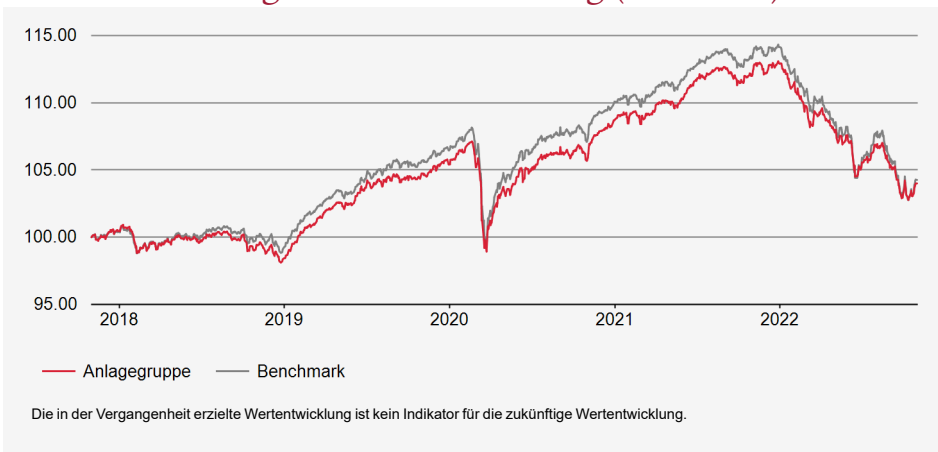
Anlagestiftung Swiss Life BVG-Mix 15

Nettovermögen (NAV) in Mio. CHF: 219.17
Nettovermögen pro Anspruch in CHF: 163.32

Anlagestrategie

Anlagen in alle vom BVG zugelassenen Anlagekategorien (strategischer Aktienanteil: 15%). Aktive Asset Allocation. Begrenzung für Beteiligungspapiere: 20%. Begrenzung für Fremdwährungen: 30%. Durchschnittliche Ratingqualität der Obligationen: mindestens BBB+. Umsetzung mittels Einsatz artreiner Kollektivanlagen. Empfohlene Schwankungsreserven: über 6.5%.

Wertentwicklung in Referenzwährung (Basis 100)



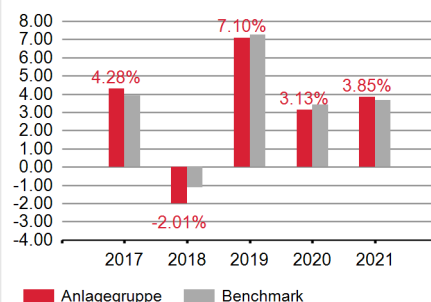
Performance in Referenzwährung

	KUMULIERTE PERFORMANCE				ANNUALISIERTE PERFORMANCE			
	YTD	1 MONAT	3 MONATE	1 JAHR	3 JAHRE	5 JAHRE	10 JAHRE	AUFL.
ANLAGEGRUPPE	-7.88%	0.80%	-2.68%	-7.14%	-0.23%	0.79%	2.25%	2.57%
BENCHMARK	-8.65%	0.97%	-3.17%	-7.97%	-0.44%	0.84%	2.32%	2.85%

Statistische Angaben (annualisiert)

	1 JAHR	3 JAHRE	5 JAHRE	10 JAHRE	AUFL.
Volatilität Anlagegruppe (in %)	4.10	4.26	3.56	2.96	2.83
Volatilität Benchmark (in %)	-	4.63	3.80	3.03	2.85
Tracking Error ex post (in %)	0.93	0.63	0.56	0.51	0.59
Information Ratio	0.91	0.34	-0.09	-0.14	-0.47
Sharpe Ratio	-1.69	0.08	0.42	0.94	0.89
Korrelation	0.99	0.99	0.99	0.99	0.98
Beta	0.84	0.92	0.93	0.96	0.97
Jensen-Alpha	-0.39	0.22	0.06	0.03	-0.22
Maximum Drawdown (in %)	-9.12	-9.12	-9.12	-9.12	-9.12
Recovery Period (Jahre)	-	-	-	-	-

Performance



Produktinformationen

Valorennummer: 1564965
ISIN: CH0015649657
LEI: 254900RW4KJYAQTH6Y97
Bloomberg-Code: SWABM15 SW
Benchmark: Customized
Währung: CHF
Domizil: Schweiz
Aufgagedatum: 30/06/2003
Ausgabepreis: 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: 0.57%
ex post per: 30/09/2022 0.60%

Portfoliostruktur nach Anlagekategorien

	Anlagegruppe	Benchmark	max. BVV2
Liquidität	4.65%	2.00%	-
Hypotheken Schweiz	12.03%	13.00%	-
Obligationen CHF Inland	10.19%	13.00%	-
Obligationen CHF Ausland	3.95%	6.00%	-
Obligationen Fremdwährungen (CHF hedged)	29.77%	28.00%	-
Aktien Schweiz	7.56%	8.00%	-
Aktien Ausland	5.60%	7.00%	-
Aktien Ausland (CHF hedged)	1.54%	-	-
Immobilien Schweiz	18.47%	15.00%	30.00%
Immobilien Ausland (CHF hedged)	3.91%	3.00%	10.00%
Alternative Anlagen (CHF hedged)	2.33%	5.00%	15.00%
Total Aktien (In- und Ausland)	14.70%	15.00%	50.00%
Total Fremdwährungen	5.60%	7.00%	30.00%

Portfoliostruktur nach Währungen

CHF	94.40%
USD	4.04%
EUR	0.59%
JPY	0.33%
ÜBRIGE	0.65%

Benchmarkzusammensetzung

1M SARON	2.00%
SBI DOMESTIC AAA-A 1-3Y	13.00%
SBI DOMESTIC AAA-BBB	13.00%
SBI FOREIGN AAA-BBB	6.00%
BLOOMBERG GL. AGG. TREAS. EX CH TR (CHF HEDGED)	5.00%
BLOOMBERG GL. AGG. CORP. TR (CHF HEDGED)	12.00%
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	8.00%
MSCI WORLD EX CH ESG LEADERS, IN CHF	5.60%
MSCI AC WORLD SMALL CAP, IN CHF	1.05%
MSCI EMERGING MARKETS, IN CHF	0.35%
KGAST IMMO-INDEX	15.00%
SL REF (LUX) GERMAN CORE REAL ESTATE (CHF HEDGED)	3.00%
HFRX GLOBAL HEDGE FUNDS (CHF HEDGED)	5.00%

Eigenschaften der festverzinslichen Anlagen

Modified Duration	3.99
Durchschnittliches Rating	A+