

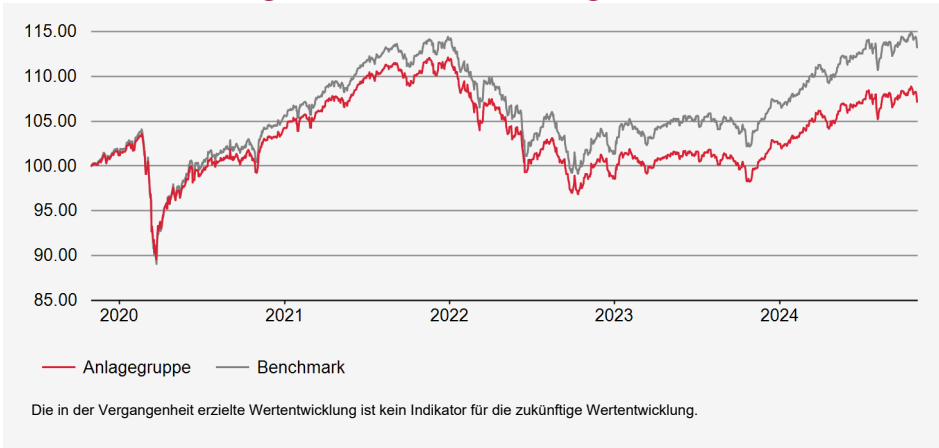
# Anlagestiftung Swiss Life BVG-Mix 35 P

**Nettovermögen (NAV) in Mio. CHF: 381.61**  
**Nettovermögen pro Anspruch in CHF: 183.55**

## Anlagestrategie

Die Anlagegruppe BVG-Mix 35 P investiert im Durchschnitt ca. 35% in Aktien. Etwas über die Hälfte des Aktienanteils wird in schweizerische Dividendenpapiere angelegt, der Rest entfällt auf ausländische Gesellschaften. Durchschnittlich sind rund 45% des Vermögens in Obligationen investiert. Es gelten folgende Höchstgrenzen: 45% Aktien, 30% Fremdwährungen. BVG-Mix 35 P eignet sich für Anleger, die bereit sind, mittlere Kursschwankungen in Kauf zu nehmen. Wir empfehlen einen Anlagehorizont von über sieben Jahren.

## Wertentwicklung in Referenzwährung (Basis 100)



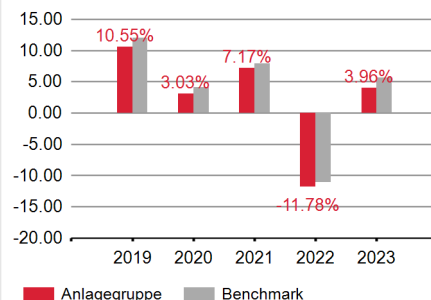
## Performance in Referenzwährung

	Kumulierte Performance				Annualisierte Performance			
	YTD	1 Monat	3 Monate	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Aufl.
Anlagegruppe	4.55%	-1.10%	-0.78%	8.60%	-0.98%	1.39%	2.11%	2.79%
Benchmark	5.73%	-0.96%	-0.39%	10.35%	0.19%	2.51%	3.37%	4.19%

## Statistische Angaben (annualisiert)

	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Aufl.
Volatilität Anlagegruppe (in %)	3.78	5.72	6.08	5.29	5.16
Volatilität Benchmark (in %)	3.91	6.11	6.48	5.42	5.15
Tracking Error ex post (in %)	0.33	0.58	0.60	0.58	0.65
Information Ratio	-5.33	-2.02	-1.87	-2.19	-2.17
Sharpe Ratio	1.81	-0.30	0.20	0.45	0.50
Korrelation	1.00	1.00	1.00	0.99	0.99
Beta	0.96	0.93	0.94	0.97	0.99
Jensen-Alpha	-1.41	-1.21	-0.98	-1.16	-1.38
Maximum Drawdown (in %)	-2.97	-13.60	-13.60	-13.60	-22.51
Recovery Period (Jahre)	0.19	-	-	-	3.44

## Performance



## Produktinformationen

**Valorennummer:** 1436916

**ISIN:** CH0014369166

**LEI:** 254900SR5GM6HP44F130

**Bloomberg-Code:** SLVOR35 SW

**Benchmark:** Customized

**Währung:** CHF

**Domizil:** Schweiz

**Aufledgedatum:** 30/09/2002

**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](http://www.swisslife.ch/anlagestiftung)

**Betriebsaufwandquote TER KGAST**

**ex ante:** 1.40%

**ex post per:** 30/09/2024 1.40%

**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](http://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	2.72%	2.00%	-
Hypotheken Schweiz	0.64%	-	-
Obligationen CHF Inland	13.15%	14.00%	-
Obligationen CHF Ausland	7.17%	7.00%	-
Obligationen Fremdwährungen (CHF hedged)	24.96%	24.00%	-
Aktien Schweiz	17.63%	18.00%	-
Aktien Ausland	17.15%	17.00%	-
Aktien Ausland (CHF hedged)	-	-	-
Immobilien Schweiz	12.04%	11.00%	30.00%
Immobilien Ausland (CHF hedged)	2.18%	2.00%	10.00%
Alternative Anlagen (CHF hedged)	2.36%	5.00%	15.00%
Total Aktien (In- und Ausland)	34.78%	35.00%	50.00%
Total Fremdwährungen	17.15%	17.00%	30.00%

## Grösste Aktienpositionen

NESTLE SA-REG	2.40%
NOVARTIS AG-REG	2.16%
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	2.12%
NVIDIA CORP	1.11%
MICROSOFT CORP	0.98%
UBS GROUP AG-REG	0.96%
ABB LTD-REG	0.86%
ZURICH INSURANCE GROUP AG	0.84%
CIE FINANCIERE RICHEMO-A REG	0.76%
ALPHABET INC	0.64%

## 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	82.85%
USD	11.79%
EUR	1.21%
JPY	1.05%
Übrige	3.10%

## Eigenschaften der festverzinslichen Anlagen

Modified Duration	5.75
Durchschnittliches Rating	A