

# Anlagestiftung Swiss Life BVG-Mix 25

**Nettovermögen (NAV) in Mio. CHF: 740.78**  
**Nettovermögen pro Anspruch in CHF: 199.62**

## Anlagestrategie

Anlagen in alle vom BVG zugelassenen Anlagekategorien (strategischer Aktienanteil: 25%). Aktive Asset Allocation. Begrenzung für Beteiligungspapiere: 35%. Begrenzung für Fremdwährungen: 30%. Durchschnittliche Ratingqualität der Obligationen: mindestens BBB+. Umsetzung mittels Einsatz artreiner Kollektivanlagen. Empfohlene Schwankungsreserven: über 10%.

## Wertentwicklung in Referenzwährung (Basis 100)



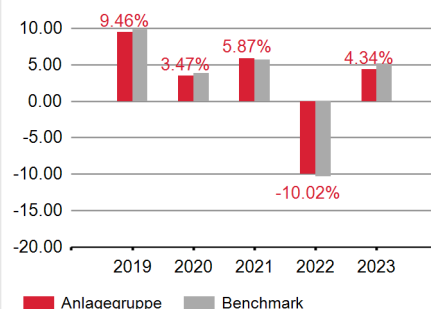
## Performance in Referenzwährung

	Kumulierte Performance				Annualisierte Performance			
	YTD	1 Monat	3 Monate	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Aufl.
Anlagegruppe	4.93%	0.32%	2.08%	6.54%	-0.38%	1.78%	2.54%	3.06%
Benchmark	5.07%	0.25%	2.09%	6.80%	-0.22%	1.91%	2.86%	3.54%

## Statistische Angaben (annualisiert)

	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Aufl.
Volatilität Anlagegruppe (in %)	3.63	4.89	5.10	4.29	4.10
Volatilität Benchmark (in %)	3.97	5.29	5.46	4.42	4.10
Tracking Error ex post (in %)	0.42	0.58	0.55	0.52	0.58
Information Ratio	-0.61	-0.28	-0.24	-0.60	-0.82
Sharpe Ratio	1.32	-0.21	0.32	0.66	0.69
Korrelation	1.00	1.00	1.00	0.99	0.99
Beta	0.91	0.92	0.93	0.96	0.99
Jensen-Alpha	0.19	-0.23	0.00	-0.20	-0.45
Maximum Drawdown (in %)	-2.34	-11.75	-11.75	-11.75	-14.16
Recovery Period (Jahre)	0.11	-	-	-	0.98

## Performance



## Produktinformationen

**Valorennummer:** 1245601

**ISIN:** CH0012456015

**LEI:** 5493000KUC3Z24U77V93

**Bloomberg-Code:** SWABM25 SW

**Benchmark:** Customized

**Währung:** CHF

**Domizil:** Schweiz

**Aufgagedatum:** 30/09/2001

**Erstausgabepreis:** 100.00

**Jahresabschluss:** 30.09

**Ausgabe/Rücknahme:** Täglich

**Annahmeschluss:** 12.00 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](http://www.swisslife.ch/anlagestiftung)

**Betriebsaufwandquote TER KGAST**

**ex ante:** 0.56%

**ex post per:** 30/09/2023 0.58%

**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	3.38%	2.00%	-
Hypotheken Schweiz	0.85%	-	-
Obligationen CHF Inland	14.94%	16.00%	-
Obligationen CHF Ausland	8.97%	9.00%	-
Obligationen Fremdwährungen (CHF hedged)	26.82%	28.00%	-
Aktien Schweiz	13.16%	13.00%	-
Aktien Ausland	11.97%	12.00%	-
Aktien Ausland (CHF hedged)	-	-	-
Immobilien Schweiz	14.50%	13.00%	30.00%
Immobilien Ausland (CHF hedged)	3.06%	2.00%	10.00%
Alternative Anlagen (CHF hedged)	2.34%	5.00%	15.00%
Total Aktien (In- und Ausland)	25.13%	25.00%	50.00%
Total Fremdwährungen	11.97%	12.00%	30.00%

## Grösste Aktienpositionen

NESTLE SA-REG	1.91%
NOVARTIS AG-REG	1.67%
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	1.61%
MICROSOFT CORP	0.70%
NVIDIA CORP	0.69%
UBS GROUP AG-REG	0.67%
ABB LTD-REG	0.62%
CIE FINANCIERE RICHEMO-A REG	0.57%
ZURICH INSURANCE GROUP AG	0.57%
ALPHABET INC	0.42%

## Benchmarkzusammensetzung

1M Saron	2.00%
SBI Domestic AAA-BBB	16.00%
SBI Foreign AAA-BBB	9.00%
Bloomberg Gl. Agg. Treas. ex CH TR (CHF hedged)	4.00%
Bloomberg Gl. Agg. Corp. TR (CHF hedged)	9.00%
Bloomberg Gl. Agg. Corp. Short Term TR (CHF hedged)	9.00%
JP Morgan CEMBI Broad Div IG Index (CHF hedged)	6.00%
Swiss Performance Index	13.00%
MSCI World ex CH ESG Leaders, in CHF	9.60%
MSCI AC World Small Cap, in CHF	1.80%
MSCI Emerging Markets, in CHF	0.60%
KGAST Immo-Index	13.00%
SL REF (LUX) German Core Real Estate (CHF hedged)	2.00%
HFRX Global Hedge Funds (CHF hedged)	5.00%

## Portfoliostruktur nach Währungen

CHF	88.04%
USD	8.07%
EUR	0.89%
JPY	0.77%
Übrige	2.23%

## Eigenschaften der festverzinslichen Anlagen

Modified Duration	5.73
Durchschnittliches Rating	A