

Anlagestiftung Swiss Life BVG-Mix 25

Nettovermögen (NAV) in Mio. CHF: 684.04
Nettovermögen pro Anspruch in CHF: 202.56

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)



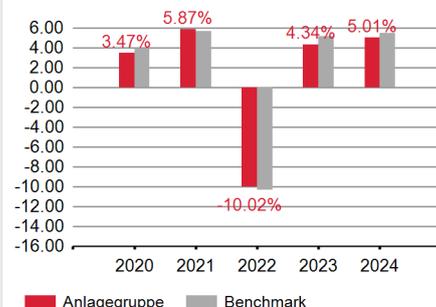
Performance in Referenzwährung

	Kumulierte Performance				Annualisierte Performance			
	YTD	1 Monat	3 Monate	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Aufl.
Anlagegruppe	1.39%	1.39%	2.01%	6.03%	0.63%	1.68%	2.55%	3.07%
Benchmark	1.34%	1.34%	2.16%	6.49%	0.92%	1.88%	2.86%	3.55%

Statistische Angaben (annualisiert)

	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Aufl.
Volatilität Anlagegruppe (in %)	3.01	4.78	5.16	4.31	4.08
Volatilität Benchmark (in %)	3.05	5.20	5.52	4.45	4.08
Tracking Error ex post (in %)	0.23	0.58	0.55	0.51	0.57
Information Ratio	-2.05	-0.50	-0.37	-0.60	-0.83
Sharpe Ratio	1.55	-0.05	0.27	0.65	0.69
Korrelation	1.00	1.00	1.00	0.99	0.99
Beta	0.99	0.92	0.93	0.96	0.99
Jensen-Alpha	-0.38	-0.29	-0.09	-0.19	-0.46
Maximum Drawdown (in %)	-1.88	-10.05	-11.75	-11.75	-14.16
Recovery Period (Jahre)	0.04	1.76	-	-	0.98

Performance



Produktinformationen

Valorennummer: 1245601

ISIN: CH0012456015

LEI: 5493000KUC3Z24U77V93

Bloomberg-Code: SWABM25 SW

Benchmark: Customized

Währung: CHF

Domizil: Schweiz

Aufledgedatum: 30/09/2001

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

Betriebsaufwandquote TER KGAST

ex ante: 0.54%

ex post per: 30/09/2024 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.

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	1.60%	2.00%	-
Hypotheken Schweiz	0.94%	-	-
Obligationen CHF Inland	15.16%	16.00%	-
Obligationen CHF Ausland	9.16%	9.00%	-
Obligationen Fremdwährungen (CHF hedged)	24.32%	28.00%	-
Aktien Schweiz	13.81%	13.00%	-
Aktien Ausland	13.33%	12.00%	-
Aktien Ausland (CHF hedged)	0.29%	-	-
Immobilien Schweiz	15.78%	13.00%	30.00%
Immobilien Ausland (CHF hedged)	3.18%	2.00%	10.00%
Alternative Anlagen (CHF hedged)	2.43%	5.00%	15.00%
Total Aktien (In- und Ausland)	27.43%	25.00%	50.00%
Total Fremdwährungen	13.33%	12.00%	30.00%

Grösste Aktienpositionen

NESTLE SA-REG	1.69%
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	1.67%
NOVARTIS AG-REG	1.62%
UBS GROUP AG-REG	0.82%
CIE FINANCIERE RICHEMO-A REG	0.79%
NVIDIA CORP	0.72%
MICROSOFT CORP	0.72%
ZURICH INSURANCE GROUP AG	0.67%
ABB LTD-REG	0.66%
HOLCIM LTD	0.41%

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	86.39%
USD	9.31%
JPY	0.80%
EUR	0.23%
Übrige	3.27%

Eigenschaften der festverzinslichen Anlagen

Modified Duration	5.74
Durchschnittliches Rating	A+