

# Anlagestiftung Swiss Life BVG-Mix 25

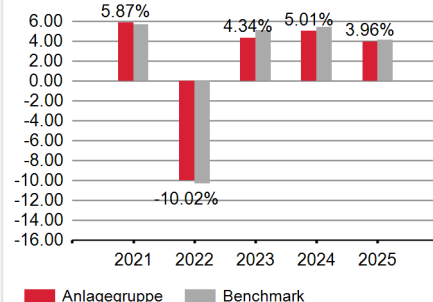


**Nettovermögen (NAV) in Mio. CHF: 689.74**  
**Nettovermögen pro Anspruch in CHF: 211.43**

## 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%.

## Performance



## Wertentwicklung in Referenzwährung (Basis 100)



Die in der Vergangenheit erzielte Wertentwicklung ist kein Indikator für die zukünftige Wertentwicklung.

## 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  
**Verwässerungsschutz:** Ausgabe- / Rücknahmekommission zugunsten der Anlagegruppe gemäss Konditionenübersicht.

**Asset Management:** Strategische und taktische Asset Allocation durch Swiss Life Asset Management AG  
**Eingesetzte artreine Anlagegruppen:** Diverse gemäss Swiss Life Best Select Invest Plus © Ansatz

**Externe Beratung:** Überwachung der Anlageresultate der eingesetzten Anlagegruppen sowie Beratung zu geeigneter Mandatsstruktur und bei der Selektion geeigneter Asset Managers durch PPCmetrics

**Kurspublikationen:** Bloomberg: ASSL  
[www.swisslife.ch/anlagestiftung](http://www.swisslife.ch/anlagestiftung)

**Betriebsaufwandquote TER KGAST**  
**ex ante:** 0.47%  
**ex post per:** 30/09/2025 0.53%

## Performance in Referenzwährung

	Kumulierte Performance				Annualisierte Performance			
	YTD	1 Monat	3 Monate	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Aufl.
Anlagegruppe	1.80%	1.36%	1.89%	4.12%	4.61%	2.04%	2.87%	3.11%
Benchmark	1.45%	1.10%	1.54%	3.93%	4.83%	2.12%	3.06%	3.57%

## Statistische Angaben (annualisiert)

	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Aufl.
Volatilität Anlagegruppe (in %)	2.67	2.85	4.21	4.09	4.03
Volatilität Benchmark (in %)	2.41	2.91	4.45	4.28	4.02
Tracking Error ex post (in %)	0.49	0.39	0.51	0.49	0.57
Information Ratio	0.39	-0.56	-0.17	-0.38	-0.79
Sharpe Ratio	1.50	1.27	0.38	0.74	0.71
Korrelation	0.99	0.99	0.99	0.99	0.99
Beta	1.09	0.97	0.94	0.95	0.99
Jensen-Alpha	-0.16	-0.10	0.02	-0.03	-0.43
Maximum Drawdown (in %)	-4.55	-4.81	-11.75	-11.75	-14.16
Recovery Period (Jahre)	0.34	0.37	2.34	2.34	0.98

**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](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	2.68%	4.00%	-
Hypotheken Schweiz	6.31%	6.00%	-
Obligationen CHF Inland	20.50%	23.00%	-
Obligationen Fremdwährungen (CHF hedged)	20.31%	23.00%	-
Aktien Schweiz	13.03%	11.00%	-
Aktien Ausland	7.73%	6.00%	-
Aktien Ausland (CHF hedged)	8.31%	8.00%	-
Immobilien Schweiz	17.16%	14.00%	30.00%
Immobilien Ausland (CHF hedged)	2.18%	2.00%	10.00%
Alternative Anlagen (CHF hedged)	1.80%	3.00%	15.00%
Infrastruktur	-	-	-
Total Aktien (In- und Ausland)	29.07%	25.00%	50.00%
Total Fremdwährungen	7.73%	12.00%	30.00%

## Grösste Aktienpositionen

ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	1.84%
NOVARTIS AG-REG	1.83%
NESTLE SA-REG	1.54%
ABB LTD-REG	0.81%
UBS GROUP AG-REG	0.67%
ZURICH INSURANCE GROUP AG	0.61%
CIE FINANCIERE RICHEMO-A REG	0.60%
NVIDIA CORP	0.59%
APPLE INC	0.54%
MICROSOFT CORP	0.38%

## Benchmarkzusammensetzung

1M Saron	4.00%
SBI Domestic AAA-A 1-3Y Total Return	6.00%
SBI AAA-BBB Total Return	23.00%
Bloomberg Gl. Agg. Treas. ex CH (CHF hedged)	11.00%
Bloomberg Gl. Agg. Corp. (CHF hedged)	4.00%
Bloomberg Gl. Agg. Corp. Short Term (CHF hedged)	3.00%
JP Morgan CEMBI Broad Diversified IG Index (CHF hedged)	5.00%
SPI® Total Return	11.00%
MSCI World ex Switzerland Net Return	6.00%
MSCI World ex Switzerland Net Return (CHF hedged)	8.00%
KGAST Immo-Index	14.00%
SL REF (LUX) ESG German Core Real Estate (CHF hedged)	1.40%
Anlagestiftung Swiss Life Immobilien Europa Industrie und Logistik ESG (EUR), CHF hedged	0.60%
HFRX Global Hedge Funds (CHF hedged)	3.00%
Anlagestiftung Swiss Life Infrastruktur Global ESG (EUR)	-

## Portfoliostruktur nach Währungen

CHF	92.27%
USD	4.03%
JPY	1.22%
EUR	0.72%
Übrige	1.76%

## Eigenschaften der festverzinslichen Anlagen

Modified Duration	5.66
Durchschnittliches Rating	A+