

Anlagestiftung Swiss Life BVG-Mix 45

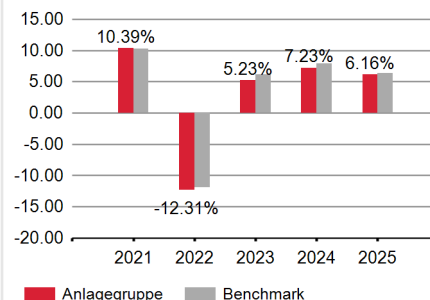


Nettovermögen (NAV) in Mio. CHF: 900.65
Nettovermögen pro Anspruch in CHF: 242.30

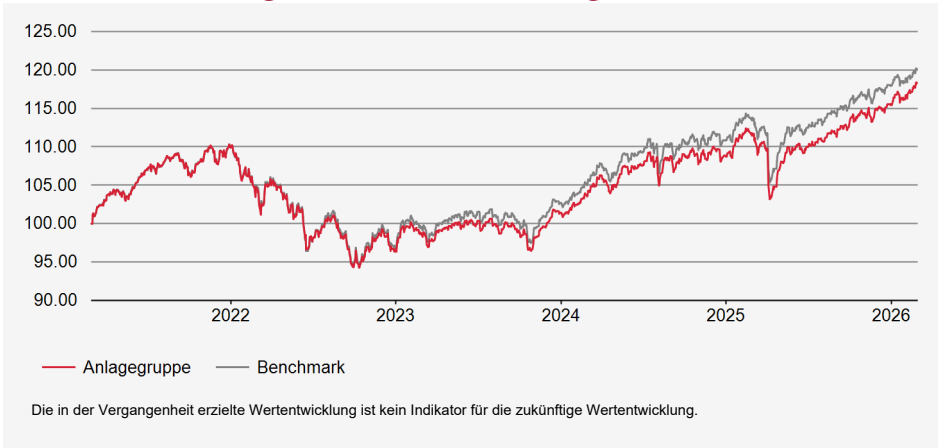
Anlagestrategie

Anlagen in alle vom BVG zugelassenen Anlagekategorien (strategischer Aktienanteil: 45%). Aktive Asset Allocation. Begrenzung für Beteiligungspapiere: 50%. Begrenzung für Fremdwährungen: 30%. Durchschnittliche Ratingqualität der Obligationen: mindestens BBB+. Umsetzung mittels Einsatz artreiner Kollektivanlagen. Empfohlene Schwankungsreserven: über 20%.

Performance



Wertentwicklung in Referenzwährung (Basis 100)



Produktinformationen

Valorennummer: 1245607
ISIN: CH0012456072
LEI: 2549001XL79VZWJO5Q69
Bloomberg-Code: SWABM45 SW
Benchmark: Customized
Währung: CHF
Domizil: Schweiz
Aufgatedatum: 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

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	2.47%	1.83%	2.89%	5.87%	6.32%	3.41%	4.48%	3.69%
Benchmark	1.84%	1.45%	2.23%	5.55%	6.57%	3.73%	4.81%	4.30%

Statistische Angaben (annualisiert)

	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Aufl.
Volatilität Anlagegruppe (in %)	4.36	4.36	6.05	5.98	6.34
Volatilität Benchmark (in %)	4.03	4.30	6.19	6.12	6.31
Tracking Error ex post (in %)	0.66	0.45	0.54	0.55	0.66
Information Ratio	0.48	-0.54	-0.58	-0.61	-0.91
Sharpe Ratio	1.30	1.20	0.49	0.76	0.54
Korrelation	0.99	0.99	1.00	1.00	0.99
Beta	1.07	1.01	0.97	0.97	1.00
Jensen-Alpha	-0.08	-0.31	-0.23	-0.20	-0.60
Maximum Drawdown (in %)	-7.66	-8.21	-14.55	-16.22	-28.27
Recovery Period (Jahre)	0.35	0.43	2.28	0.67	3.76

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	3.76%	4.00%	-
Hypotheken Schweiz	3.36%	4.00%	-
Obligationen CHF Inland	13.26%	16.00%	-
Obligationen Fremdwährungen (CHF hedged)	15.91%	16.00%	-
Aktien Schweiz	20.04%	18.00%	-
Aktien Ausland	11.65%	10.00%	-
Aktien Ausland (CHF hedged)	17.54%	17.00%	-
Immobilien Schweiz	10.55%	10.00%	30.00%
Immobilien Ausland (CHF hedged)	1.81%	2.00%	10.00%
Alternative Anlagen (CHF hedged)	2.12%	3.00%	15.00%
Infrastruktur	-	-	-
Total Aktien (In- und Ausland)	49.23%	45.00%	50.00%
Total Fremdwährungen	11.65%	22.00%	30.00%

Grösste Aktienpositionen

ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	2.82%
NOVARTIS AG-REG	2.81%
NESTLE SA-REG	2.37%
ABB LTD-REG	1.24%
NVIDIA CORP	1.10%
UBS GROUP AG-REG	1.03%
APPLE INC	0.99%
ZURICH INSURANCE GROUP AG	0.93%
CIE FINANCIERE RICHEMO-A REG	0.93%
MICROSOFT CORP	0.71%

Benchmarkzusammensetzung

1M Saron	4.00%
SBI Domestic AAA-A 1-3Y Total Return	4.00%
SBI AAA-BBB Total Return	16.00%
Bloomberg Gl. Agg. Treas. ex CH (CHF hedged)	6.00%
Bloomberg Gl. Agg. Corp. (CHF hedged)	2.00%
Bloomberg Gl. Agg. Corp. Short Term (CHF hedged)	2.00%
JP Morgan CEMBI Broad Diversified IG Index (CHF hedged)	6.00%
SPI® Total Return	18.00%
MSCI World ex Switzerland Net Return	10.00%
MSCI World ex Switzerland Net Return (CHF hedged)	17.00%
KGAST Immo-Index	10.00%
SL REF (LUX) ESG German Core Real Estate (CHF hedged)	1.20%
Anlagestiftung Swiss Life Immobilien Europa Industrie und Logistik ESG (EUR), CHF hedged	0.80%
HFRX Global Hedge Funds (CHF hedged)	3.00%
Anlagestiftung Swiss Life Infrastruktur Global ESG (EUR)	-

Portfoliostruktur nach Währungen

CHF	88.35%
USD	5.21%
JPY	2.23%
EUR	0.85%
Übrige	3.37%

Eigenschaften der festverzinslichen Anlagen

Modified Duration	5.54
Durchschnittliches Rating	A+