

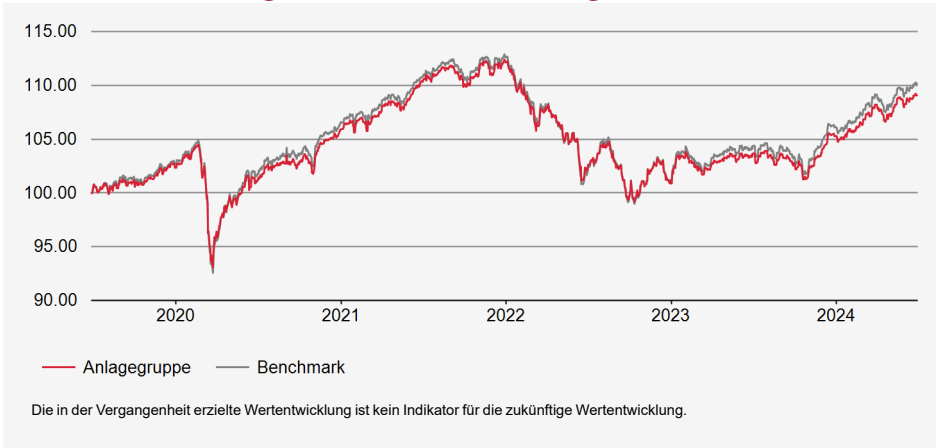
Anlagestiftung Swiss Life BVG-Mix 25

Nettovermögen (NAV) in Mio. CHF: 733.32
Nettovermögen pro Anspruch in CHF: 197.09

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)



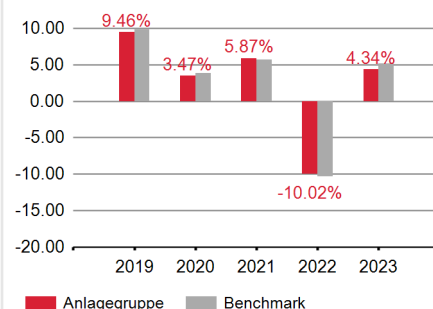
Performance in Referenzwährung

	Kumulierte Performance				Annualisierte Performance			
	YTD	1 Monat	3 Monate	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Aufl.
Anlagegruppe	3.60%	0.78%	0.80%	5.23%	-0.38%	1.75%	2.57%	3.03%
Benchmark	3.78%	0.84%	0.93%	5.55%	-0.20%	1.95%	2.90%	3.51%

Statistische Angaben (annualisiert)

	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Aufl.
Volatilität Anlagegruppe (in %)	3.67	4.88	5.09	4.29	4.11
Volatilität Benchmark (in %)	4.00	5.29	5.46	4.43	4.11
Tracking Error ex post (in %)	0.41	0.58	0.56	0.52	0.58
Information Ratio	-0.76	-0.32	-0.36	-0.63	-0.83
Sharpe Ratio	0.95	-0.19	0.33	0.67	0.68
Korrelation	1.00	1.00	1.00	0.99	0.99
Beta	0.92	0.92	0.93	0.96	0.99
Jensen-Alpha	0.02	-0.25	-0.07	-0.21	-0.46
Maximum Drawdown (in %)	-2.56	-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

Aufledgedatum: 30/09/2001

Erstausgabepreis: 100.00

Jahresabschluss: 30.09

Ausgabe/Rücknahme: Täglich

Annahmeschluss: 14.00 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

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	3.75%	2.00%	-
Hypotheken Schweiz	0.84%	-	-
Obligationen CHF Inland	14.79%	16.00%	-
Obligationen CHF Ausland	8.92%	9.00%	-
Obligationen Fremdwährungen (CHF hedged)	25.38%	28.00%	-
Aktien Schweiz	12.98%	13.00%	-
Aktien Ausland	12.00%	12.00%	-
Aktien Ausland (CHF hedged)	-	-	-
Immobilien Schweiz	15.82%	13.00%	30.00%
Immobilien Ausland (CHF hedged)	3.19%	2.00%	10.00%
Alternative Anlagen (CHF hedged)	2.33%	5.00%	15.00%
Total Aktien (In- und Ausland)	24.98%	25.00%	50.00%
Total Fremdwährungen	12.00%	12.00%	30.00%

Grösste Aktienpositionen

NESTLE SA-REG	1.96%
NOVARTIS AG-REG	1.61%
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	1.43%
MICROSOFT CORP	0.88%
NVIDIA CORP	0.86%
UBS GROUP AG-REG	0.70%
ABB LTD-REG	0.65%
CIE FINANCIERE RICHEMO-A REG	0.62%
ZURICH INSURANCE GROUP AG	0.57%
ALPHABET INC	0.56%

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	86.02%
USD	8.28%
EUR	0.88%
JPY	0.72%
Übrige	4.09%

Eigenschaften der festverzinslichen Anlagen

Modified Duration	5.79
Durchschnittliches Rating	A+