

# Anlagestiftung Swiss Life BVG-Mix 25

**Nettovermögen (NAV) in Mio. CHF: 703.90**  
**Nettovermögen pro Anspruch in CHF: 200.31**

## 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)



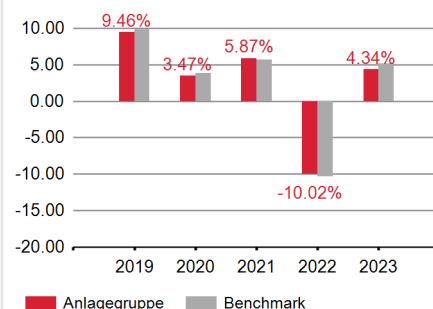
## Performance in Referenzwährung

	Kumulierte Performance True				Annualisierte Performance			
	YTD	1 Monat	3 Monate	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Aufl.
Anlagegruppe	5.29%	0.35%	1.63%	7.84%	0.22%	1.84%	2.55%	3.06%
Benchmark	5.58%	0.49%	1.73%	8.39%	0.40%	1.99%	2.89%	3.55%

## Statistische Angaben (annualisiert)

	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Aufl.
Volatilität Anlagegruppe (in %)	3.31	4.81	5.10	4.29	4.09
Volatilität Benchmark (in %)	3.60	5.24	5.46	4.42	4.09
Tracking Error ex post (in %)	0.41	0.59	0.55	0.52	0.58
Information Ratio	-1.33	-0.31	-0.28	-0.67	-0.83
Sharpe Ratio	1.83	-0.10	0.33	0.66	0.69
Korrelation	1.00	1.00	1.00	0.99	0.99
Beta	0.92	0.91	0.93	0.96	0.99
Jensen-Alpha	0.04	-0.21	-0.03	-0.23	-0.46
Maximum Drawdown (in %)	-1.88	-11.75	-11.75	-11.75	-14.16
Recovery Period (Jahre)	0.04	-	-	-	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

**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:** 30/09/2024 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.

**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	1.96%	2.00%	-
Hypotheken Schweiz	0.89%	-	-
Obligationen CHF Inland	15.00%	16.00%	-
Obligationen CHF Ausland	9.07%	9.00%	-
Obligationen Fremdwährungen (CHF hedged)	26.85%	28.00%	-
Aktien Schweiz	13.23%	13.00%	-
Aktien Ausland	12.02%	12.00%	-
Aktien Ausland (CHF hedged)	-	-	-
Immobilien Schweiz	15.28%	13.00%	30.00%
Immobilien Ausland (CHF hedged)	3.22%	2.00%	10.00%
Alternative Anlagen (CHF hedged)	2.47%	5.00%	15.00%
<b>Total Aktien (In- und Ausland)</b>	<b>25.25%</b>	<b>25.00%</b>	<b>50.00%</b>
<b>Total Fremdwährungen</b>	<b>12.02%</b>	<b>12.00%</b>	<b>30.00%</b>

## Grösste Aktienpositionen

NESTLE SA-REG	1.82%
NOVARTIS AG-REG	1.63%
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	1.56%
MICROSOFT CORP	0.71%
NVIDIA CORP	0.70%
UBS GROUP AG-REG	0.69%
ABB LTD-REG	0.64%
ZURICH INSURANCE GROUP AG	0.61%
CIE FINANCIERE RICHEMO-A REG	0.59%
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	87.98%
USD	8.16%
EUR	0.89%
JPY	0.76%
Übrige	2.21%

## Eigenschaften der festverzinslichen Anlagen

Modified Duration	5.82
Durchschnittliches Rating	A