

Anlagestiftung Swiss Life BVG-Mix 25



Nettovermögen (NAV) in Mio. CHF: 726.98
Nettovermögen pro Anspruch in CHF: 192.41

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)



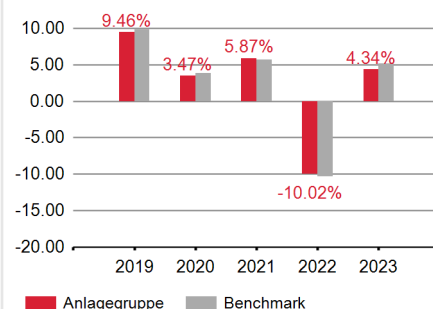
Performance in Referenzwährung

	Kumulierte Performance				Annualisierte Performance			
	YTD	1 Monat	3 Monate	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Aufl.
Anlagegruppe	1.14%	0.72%	2.66%	4.19%	0.23%	1.93%	2.59%	2.96%
Benchmark	1.18%	0.81%	2.72%	4.70%	0.32%	2.08%	2.89%	3.45%

Statistische Angaben (annualisiert)

	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Aufl.
Volatilität Anlagegruppe (in %)	3.09	4.90	5.10	4.26	4.12
Volatilität Benchmark (in %)	3.43	5.28	5.45	4.40	4.12
Tracking Error ex post (in %)	0.42	0.59	0.56	0.52	0.58
Information Ratio	-1.23	-0.16	-0.26	-0.57	-0.82
Sharpe Ratio	0.82	-0.02	0.40	0.69	0.67
Korrelation	1.00	1.00	1.00	0.99	0.99
Beta	0.90	0.92	0.93	0.96	0.99
Jensen-Alpha	-0.19	-0.09	0.00	-0.18	-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

Aufgagedatum: 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	3.12%	2.00%	-
Hypotheken Schweiz	0.85%	-	-
Obligationen CHF Inland	15.95%	16.00%	-
Obligationen CHF Ausland	8.92%	9.00%	-
Obligationen Fremdwährungen (CHF hedged)	24.71%	28.00%	-
Aktien Schweiz	12.37%	13.00%	-
Aktien Ausland	12.09%	12.00%	-
Aktien Ausland (CHF hedged)	0.65%	-	-
Immobilien Schweiz	15.80%	13.00%	30.00%
Immobilien Ausland (CHF hedged)	3.24%	2.00%	10.00%
Alternative Anlagen (CHF hedged)	2.30%	5.00%	15.00%
Total Aktien (In- und Ausland)	25.11%	25.00%	50.00%
Total Fremdwährungen	12.09%	12.00%	30.00%

Grösste Aktienpositionen

NESTLE SA-REG	1.96%
NOVARTIS AG-REG	1.52%
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	1.31%
MICROSOFT CORP.	0.89%
UBS GROUP AG-REG	0.62%
CIE FINANCIERE RICHEMONT-REG	0.61%
NVIDIA CORP	0.59%
ZURICH INSURANCE GROUP AG	0.55%
ABB LTD-REG	0.53%
ALPHABET INC	0.47%

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	85.58%
USD	8.22%
EUR	0.96%
JPY	0.81%
Übrige	4.43%

Eigenschaften der festverzinslichen Anlagen

Modified Duration	5.62
Durchschnittliches Rating	A+