

Anlagestiftung Swiss Life BVG-Mix 25

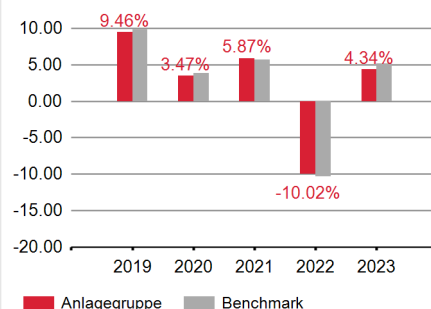


Nettovermögen (NAV) in Mio. CHF: 734.44
Nettovermögen pro Anspruch in CHF: 195.53

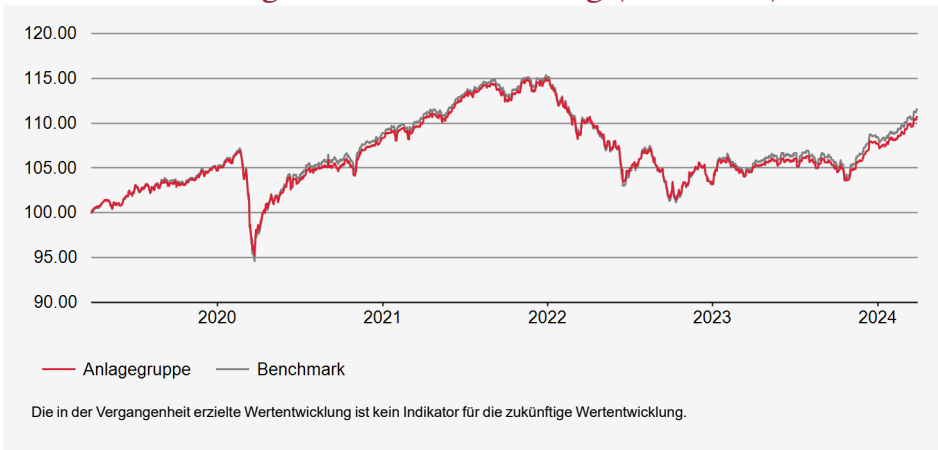
Anlagestrategie

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)



Produktinformationen

Valorennummer: 1245601
ISIN: CH0012456015
LEI: 5493000KUC3Z24U77V93
Bloomberg-Code: SWABM25 SW
Benchmark: Customized
Währung: CHF
Domizil: Schweiz
Aufgatedatum: 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%

Performance in Referenzwährung

	Kumulierte Performance				Annualisierte Performance			
	YTD	1 Monat	3 Monate	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Aufl.
Anlagegruppe	2.78%	1.62%	2.78%	5.37%	0.19%	2.01%	2.72%	3.02%
Benchmark	2.83%	1.63%	2.83%	5.73%	0.28%	2.18%	3.03%	3.51%

Statistische Angaben (annualisiert)

	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Aufl.
Volatilität Anlagegruppe (in %)	3.34	4.89	5.12	4.29	4.12
Volatilität Benchmark (in %)	3.64	5.27	5.47	4.42	4.12
Tracking Error ex post (in %)	0.40	0.59	0.56	0.52	0.58
Information Ratio	-0.91	-0.16	-0.30	-0.58	-0.82
Sharpe Ratio	1.08	-0.04	0.40	0.71	0.68
Korrelation	1.00	1.00	1.00	0.99	0.99
Beta	0.91	0.92	0.93	0.96	0.99
Jensen-Alpha	0.00	-0.10	-0.01	-0.18	-0.46
Maximum Drawdown (in %)	-2.56	-11.75	-11.75	-11.75	-14.16
Recovery Period (Jahre)	0.11	-	-	-	0.98

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	2.95%	2.00%	-
Hypotheken Schweiz	0.84%	-	-
Obligationen CHF Inland	15.81%	16.00%	-
Obligationen CHF Ausland	8.83%	9.00%	-
Obligationen Fremdwährungen (CHF hedged)	24.45%	28.00%	-
Aktien Schweiz	12.66%	13.00%	-
Aktien Ausland	12.61%	12.00%	-
Aktien Ausland (CHF hedged)	0.66%	-	-
Immobilien Schweiz	15.71%	13.00%	30.00%
Immobilien Ausland (CHF hedged)	3.17%	2.00%	10.00%
Alternative Anlagen (CHF hedged)	2.32%	5.00%	15.00%
Total Aktien (In- und Ausland)	25.93%	25.00%	50.00%
Total Fremdwährungen	12.61%	12.00%	30.00%

Grösste Aktienpositionen

NESTLE SA-REG	2.05%
NOVARTIS AG-REG	1.43%
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	1.29%
MICROSOFT CORP.	0.91%
UBS GROUP AG-REG	0.72%
NVIDIA CORP	0.69%
CIE FINANCIERE RICHEMONT-REG	0.59%
ZURICH INSURANCE GROUP AG	0.57%
ABB LTD-REG	0.54%
ALPHABET INC	0.52%

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	85.71%
USD	8.60%
EUR	0.99%
JPY	0.84%
Übrige	3.85%

Eigenschaften der festverzinslichen Anlagen

Modified Duration	5.64
Durchschnittliches Rating	A