

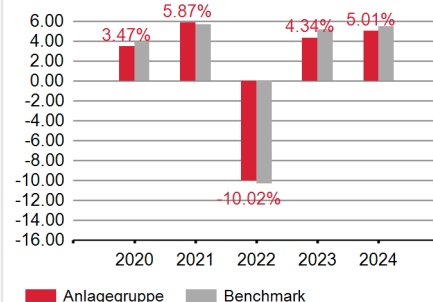
Anlagestiftung Swiss Life BVG-Mix 25

Nettovermögen (NAV) in Mio. CHF: 746.13
Nettovermögen pro Anspruch in CHF: 200.60

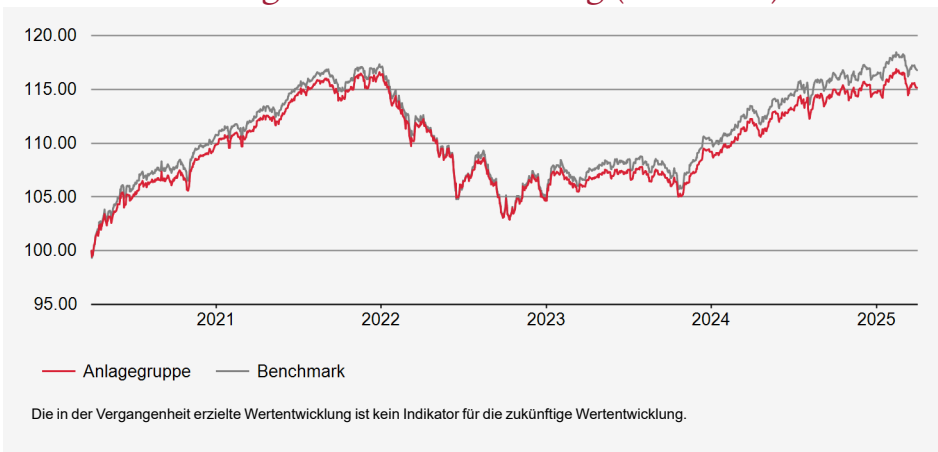
Anlagestrategie

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: 12.00 Uhr
Verwässerungsschutz: Ausgabe- / Rücknahmekommission zugunsten der Anlagegruppe gemäss Konditionenübersicht.

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: 0.54%
ex post per: 30/09/2024 0.59%

Performance in Referenzwährung

	Kumulierte Performance				Annualisierte Performance			
	YTD	1 Monat	3 Monate	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Aufl.
Anlagegruppe	0.41%	-1.21%	0.41%	2.59%	0.99%	2.86%	2.15%	3.01%
Benchmark	0.37%	-1.25%	0.37%	2.95%	1.38%	3.15%	2.50%	3.48%

Statistische Angaben (annualisiert)

	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Aufl.
Volatilität Anlagegruppe (in %)	3.15	4.71	4.55	4.29	4.08
Volatilität Benchmark (in %)	3.23	5.12	4.86	4.44	4.08
Tracking Error ex post (in %)	0.23	0.54	0.51	0.51	0.57
Information Ratio	-1.57	-0.72	-0.57	-0.68	-0.83
Sharpe Ratio	0.50	0.01	0.56	0.56	0.67
Korrelation	1.00	1.00	1.00	0.99	0.99
Beta	0.97	0.91	0.93	0.96	0.99
Jensen-Alpha	-0.31	-0.35	-0.10	-0.23	-0.45
Maximum Drawdown (in %)	-2.08	-8.32	-11.75	-11.75	-14.16
Recovery Period (Jahre)	-	1.46	2.34	2.34	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.

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	1.89%	2.00%	-
Hypotheken Schweiz	1.38%	-	-
Obligationen CHF Inland	15.22%	16.00%	-
Obligationen CHF Ausland	8.40%	9.00%	-
Obligationen Fremdwährungen (CHF hedged)	24.79%	28.00%	-
Aktien Schweiz	14.21%	13.00%	-
Aktien Ausland	13.33%	12.00%	-
Aktien Ausland (CHF hedged)	0.60%	-	-
Immobilien Schweiz	14.80%	13.00%	30.00%
Immobilien Ausland (CHF hedged)	2.90%	2.00%	10.00%
Alternative Anlagen (CHF hedged)	2.47%	5.00%	15.00%
Total Aktien (In- und Ausland)	28.15%	25.00%	50.00%
Total Fremdwährungen	13.33%	12.00%	30.00%

Grösste Aktienpositionen

NESTLE SA-REG	2.02%
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	1.76%
NOVARTIS AG-REG	1.67%
ZURICH INSURANCE GROUP AG	0.78%
UBS GROUP AG-REG	0.74%
NVIDIA CORP	0.73%
MICROSOFT CORP	0.73%
CIE FINANCIERE RICHEMO-A REG	0.71%
ABB LTD-REG	0.62%
HOLCIM LTD	0.44%

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%
SPI® Total Return	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	86.08%
USD	8.97%
JPY	0.77%
EUR	0.16%
Übrige	3.43%

Eigenschaften der festverzinslichen Anlagen

Modified Duration	5.48
Durchschnittliches Rating	A