

31. Mai 2025

Anlagestiftung Swiss Life BVG-Mix 25

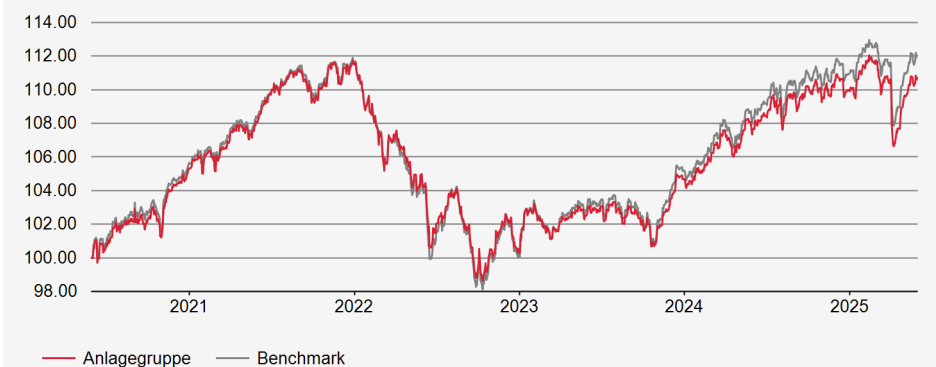


Nettovermögen (NAV) in Mio. CHF: 742.04
Nettovermögen pro Anspruch in CHF: 201.22

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)



Die in der Vergangenheit erzielte Wertentwicklung ist kein Indikator für die zukünftige Wertentwicklung.

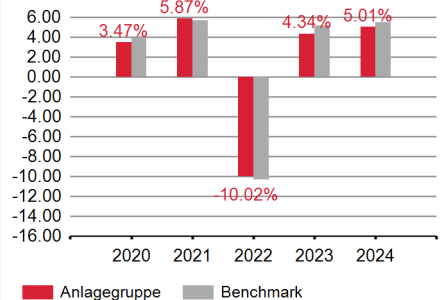
Performance in Referenzwährung

	Kumulierte Performance				Annualisierte Performance			
	YTD	1 Monat	3 Monate	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Aufl.
Anlagegruppe	0.72%	1.24%	-0.91%	2.89%	1.93%	2.06%	2.19%	3.00%
Benchmark	0.99%	1.23%	-0.64%	3.49%	2.43%	2.30%	2.55%	3.49%

Statistische Angaben (annualisiert)

	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Aufl.
Volatilität Anlagegruppe (in %)	3.20	4.66	4.40	4.31	4.08
Volatilität Benchmark (in %)	3.11	5.05	4.66	4.46	4.07
Tracking Error ex post (in %)	0.36	0.55	0.50	0.51	0.57
Information Ratio	-1.65	-0.90	-0.49	-0.71	-0.85
Sharpe Ratio	0.65	0.20	0.39	0.56	0.67
Korrelation	0.99	1.00	1.00	0.99	0.99
Beta	1.02	0.92	0.94	0.96	0.99
Jensen-Alpha	-0.65	-0.38	-0.13	-0.25	-0.47
Maximum Drawdown (in %)	-4.81	-5.66	-11.75	-11.75	-14.16
Recovery Period (Jahre)	-	1.17	2.34	2.34	0.98

Performance



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.

Asset Management:

Strategische und taktische Asset Allocation

durch Swiss Life Asset Management AG

Eingesetzte artreine Anlagegruppen:

Diverse gemäss Swiss Life Best Select Invest Plus © Ansatz

Externe Beratung:

Überwachung der Anlageresultate der eingesetzten Anlagegruppen sowie Beratung zu geeigneter Mandatsstruktur und bei der Selektion geeigneter Asset Managers durch PPCmetrics

Kurspublikationen: Bloomberg: ASSL
www.swisslife.ch/anlagestiftung

Betriebsaufwandquote TER KGAST

ex ante: 0.54%

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.

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	3.64%	2.00%	-
Hypotheken Schweiz	1.40%	-	-
Obligationen CHF Inland	15.61%	16.00%	-
Obligationen CHF Ausland	8.56%	9.00%	-
Obligationen Fremdwährungen (CHF hedged)	26.01%	28.00%	-
Aktien Schweiz	11.03%	13.00%	-
Aktien Ausland	6.46%	12.00%	-
Aktien Ausland (CHF hedged)	7.39%	-	-
Immobilien Schweiz	15.49%	13.00%	30.00%
Immobilien Ausland (CHF hedged)	2.92%	2.00%	10.00%
Alternative Anlagen (CHF hedged)	1.49%	5.00%	15.00%
Total Aktien (In- und Ausland)	24.88%	25.00%	50.00%
Total Fremdwährungen	6.46%	12.00%	30.00%

Grösste Aktienpositionen

NESTLE SA-REG	1.56%
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	1.26%
NOVARTIS AG-REG	1.25%
ZURICH INSURANCE GROUP AG	0.57%
CIE FINANCIERE RICHEMO-A REG	0.56%
UBS GROUP AG-REG	0.56%
NVIDIA CORP	0.51%
ABB LTD-REG	0.50%
MICROSOFT CORP	0.50%
APPLE INC	0.46%

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	93.54%
USD	2.57%
JPY	1.25%
EUR	0.93%
Übrige	1.71%

Eigenschaften der festverzinslichen Anlagen

Modified Duration	5.64
Durchschnittliches Rating	A