

31. Mai 2025

Anlagestiftung Swiss Life BVG-Mix 45

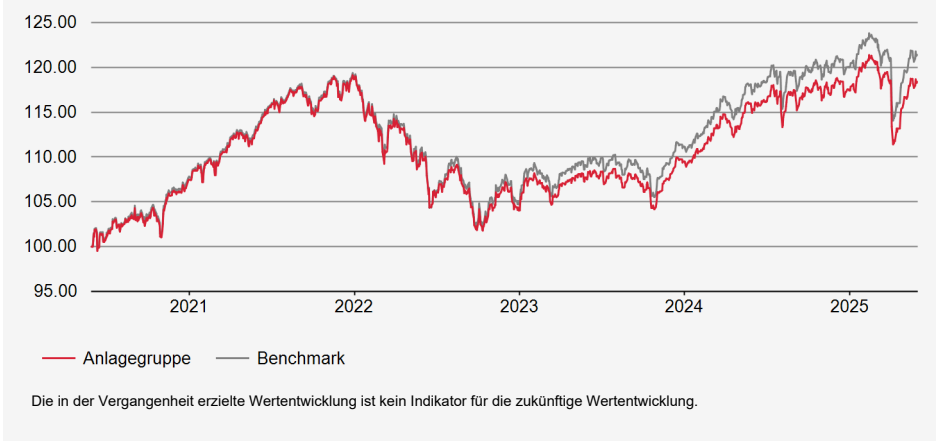


Nettovermögen (NAV) in Mio. CHF: 815.33
Nettovermögen pro Anspruch in CHF: 224.61

Anlagestrategie

Anlagen in alle vom BVG zugelassenen Anlagekategorien (strategischer Aktienanteil: 45%). Aktive Asset Allocation. Begrenzung für Beteiligungspapiere: 50%. Begrenzung für Fremdwährungen: 30%. Durchschnittliche Ratingqualität der Obligationen: mindestens BBB+. Umsetzung mittels Einsatz artreiner Kollektivanlagen. Empfohlene Schwankungsreserven: über 20%.

Wertentwicklung in Referenzwährung (Basis 100)



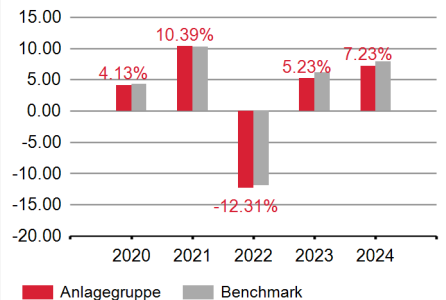
Performance in Referenzwährung

	Kumulierte Performance				Annualisierte Performance			
	YTD	1 Monat	3 Monate	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Aufl.
Anlagegruppe	0.84%	2.09%	-1.86%	2.65%	2.48%	3.43%	3.22%	3.48%
Benchmark	1.16%	2.12%	-1.48%	3.35%	3.18%	3.95%	3.77%	4.13%

Statistische Angaben (annualisiert)

	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Aufl.
Volatilität Anlagegruppe (in %)	5.14	6.67	6.44	6.39	6.42
Volatilität Benchmark (in %)	4.91	7.00	6.60	6.46	6.40
Tracking Error ex post (in %)	0.43	0.57	0.49	0.56	0.66
Information Ratio	-1.62	-1.22	-1.05	-0.99	-0.99
Sharpe Ratio	0.36	0.22	0.48	0.53	0.50
Korrelation	1.00	1.00	1.00	1.00	0.99
Beta	1.05	0.95	0.97	0.98	1.00
Jensen-Alpha	-0.81	-0.58	-0.42	-0.49	-0.65
Maximum Drawdown (in %)	-8.21	-8.21	-14.55	-16.22	-28.27
Recovery Period (Jahre)	-	-	2.28	0.67	3.76

Performance



Produktinformationen

Valorennummer: 1245607

ISIN: CH0012456072

LEI: 2549001XL79VZWJO5Q69

Bloomberg-Code: SWABM45 SW

Benchmark: Customized

Währung: CHF

Domizil: Schweiz

Aufgagedatum: 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: 0.56%

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.

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	4.44%	2.00%	-
Hypotheken Schweiz	2.22%	-	-
Obligationen CHF Inland	10.73%	12.00%	-
Obligationen CHF Ausland	4.54%	5.00%	-
Obligationen Fremdwährungen (CHF hedged)	18.30%	20.00%	-
Aktien Schweiz	18.03%	23.00%	-
Aktien Ausland	10.81%	22.00%	-
Aktien Ausland (CHF hedged)	16.22%	-	-
Immobilien Schweiz	10.43%	9.00%	30.00%
Immobilien Ausland (CHF hedged)	1.43%	2.00%	10.00%
Alternative Anlagen (CHF hedged)	2.85%	5.00%	15.00%
Total Aktien (In- und Ausland)	45.05%	45.00%	50.00%
Total Fremdwährungen	10.81%	22.00%	30.00%

Grösste Aktienpositionen

NESTLE SA-REG	2.54%
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	2.06%
NOVARTIS AG-REG	2.05%
NVIDIA CORP	1.01%
MICROSOFT CORP	0.99%
ZURICH INSURANCE GROUP AG	0.93%
APPLE INC	0.92%
CIE FINANCIERE RICHEMO-A REG	0.92%
UBS GROUP AG-REG	0.92%
ABB LTD-REG	0.82%

Benchmarkzusammensetzung

1M Saron	2.00%
SBI Domestic AAA-BBB	12.00%
SBI Foreign AAA-BBB	5.00%
Bloomberg Gl. Agg. Treas. ex CH TR (CHF hedged)	2.50%
Bloomberg Gl. Agg. Corp. TR (CHF hedged)	6.50%
Bloomberg Gl. Agg. Corp. Short Term TR (CHF hedged)	7.00%
JP Morgan CEMBI Broad Div IG Index (CHF hedged)	4.00%
SPI® Total Return	23.00%
MSCI World ex CH ESG Leaders, in CHF	17.60%
MSCI AC World Small Cap, in CHF	3.30%
MSCI Emerging Markets, in CHF	1.10%
KGAST Immo-Index	9.00%
SL REF (LUX) German Core Real Estate (CHF hedged)	2.00%
HFRX Global Hedge Funds (CHF hedged)	5.00%

Portfoliostruktur nach Währungen

CHF	89.19%
USD	3.97%
JPY	2.19%
EUR	1.50%
Übrige	3.15%

Eigenschaften der festverzinslichen Anlagen

Modified Duration	5.57
Durchschnittliches Rating	A+