

31. Mai 2025

Anlagestiftung Swiss Life BVG-Mix 75

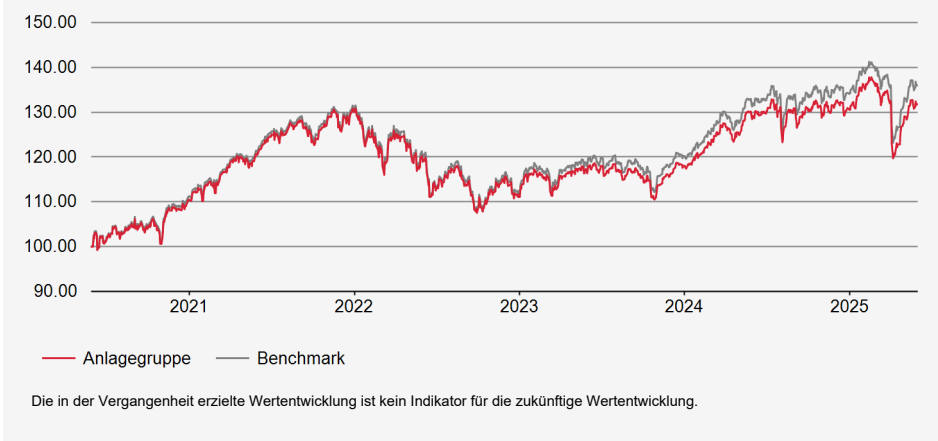
(Aktien- und Fremdwährungsquote gemäss BVV2 überschritten)

Nettovermögen (NAV) in Mio. CHF: 372.53
Nettovermögen pro Anspruch in CHF: 141.50

Anlagestrategie

Anlagen in alle vom BVG zugelassenen Anlagekategorien (strategischer Aktienanteil: 75%). Aktive Asset Allocation. Begrenzung für Beteiligungspapiere: 85%. Begrenzung für Fremdwährungen: 50%. Durchschnittliche Ratingqualität der Obligationen: mindestens BBB. Umsetzung mittels Einsatz artreiner Kollektivanlagen. Aufgrund des erhöhten Aktien- und Fremdwährungsanteils beinhaltet diese Anlagegruppe ein höheres Risiko im Vergleich zu einem BVG-Mix mit maximal 50% Aktien- bzw. maximal 30% Fremdwährungsanteil.

Wertentwicklung in Referenzwährung (Basis 100)



Performance in Referenzwährung

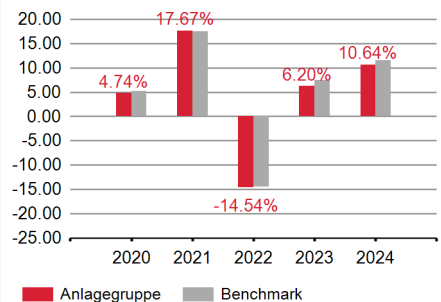
	Kumulierte Performance				Annualisierte Performance			
	YTD	1 Monat	3 Monate	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Aufl.
Anlagegruppe	0.96%	3.36%	-3.30%	2.06%	3.31%	5.68%	-	5.41%
Benchmark	1.41%	3.42%	-2.81%	3.01%	4.11%	6.33%	-	6.03%

Statistische Angaben (annualisiert)

	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Aufl.
Volatilität Anlagegruppe (in %)	8.12	9.75	9.57	-	10.35
Volatilität Benchmark (in %)	7.83	10.17	9.79	-	10.73
Tracking Error ex post (in %)	0.44	0.70	0.60	-	0.78
Information Ratio	-2.16	-1.15	-1.09	-	-0.79
Sharpe Ratio	0.15	0.23	0.54	-	0.50
Korrelation	1.00	1.00	1.00	-	1.00
Beta	1.04	0.96	0.98	-	0.96
Jensen-Alpha	-1.03	-0.67	-0.51	-	-0.39
Maximum Drawdown (in %)	-13.10	-13.10	-17.76	-	-23.54
Recovery Period (Jahre)	-	-	1.76	-	0.74



Performance



Produktinformationen

Valorennummer: 43583002
ISIN: CH0435830028
LEI: 2549007MI5RG5X8NMB06
Bloomberg-Code: SWABM75 SW
Benchmark: Customized
Währung: CHF
Domizil: Schweiz
Auflagedatum: 31/10/2018
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: 0.59%
ex post per: 30/09/2024 0.61%

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.

Anlagestiftung Swiss Life BVG-Mix 75

(Aktien- und Fremdwährungsquote gemäss BVV2 überschritten)

Portfoliostruktur nach Anlagekategorien

	Anlagegruppe	Benchmark	max. BVV2
Liquidität	3.73%	2.00%	-
Hypotheken Schweiz	0.19%	-	-
Obligationen Fremdwährungen (CHF hedged)	11.31%	13.00%	-
Aktien Schweiz	28.99%	38.00%	-
Aktien Ausland	17.98%	37.00%	-
Aktien Ausland (CHF hedged)	27.82%	-	-
Immobilien Schweiz	7.28%	5.00%	30.00%
Immobilien Ausland (CHF hedged)	0.19%	-	10.00%
Alternative Anlagen (CHF hedged)	2.51%	5.00%	15.00%
Total Aktien (In- und Ausland)	74.79%	75.00%	50.00%
Total Fremdwährungen	17.98%	37.00%	30.00%

Grösste Aktienpositionen

NESTLE SA-REG	4.09%
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	3.32%
NOVARTIS AG-REG	3.30%
NVIDIA CORP	1.73%
MICROSOFT CORP	1.71%
APPLE INC	1.59%
ZURICH INSURANCE GROUP AG	1.50%
CIE FINANCIERE RICHEMO-A REG	1.48%
UBS GROUP AG-REG	1.48%
ABB LTD-REG	1.32%

Benchmarkzusammensetzung

1M Saron	2.00%
Bloomberg Gl. Agg. Treas. ex CH TR (CHF hedged)	2.00%
Bloomberg Gl. Agg. Corp. TR (CHF hedged)	4.00%
Bloomberg Gl. Agg. Corp. Short Term TR (CHF hedged)	4.00%
JP Morgan CEMBI Broad Div IG Index (CHF hedged)	3.00%
SPI® Total Return	38.00%
MSCI World ex CH ESG Leaders, in CHF	29.60%
MSCI AC World Small Cap, in CHF	5.55%
MSCI Emerging Markets, in CHF	1.85%
KGAST Immo-Index	5.00%
HFRX Global Hedge Funds (CHF hedged)	5.00%

Portfoliostruktur nach Währungen

CHF	82.02%
USD	6.86%
JPY	3.67%
EUR	2.06%
Übrige	5.40%

Eigenschaften der festverzinslichen Anlagen

Modified Duration	4.82
Durchschnittliches Rating	A-