

30. April 2024

Anlagestiftung Swiss Life BVG-Mix 25

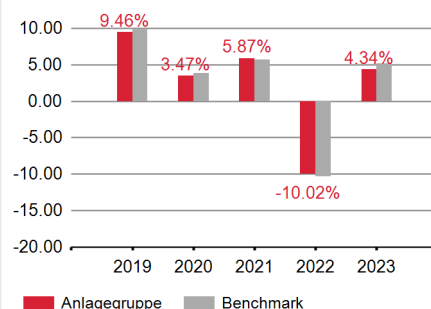


Nettovermögen (NAV) in Mio. CHF: 727.76
Nettovermögen pro Anspruch in CHF: 193.63

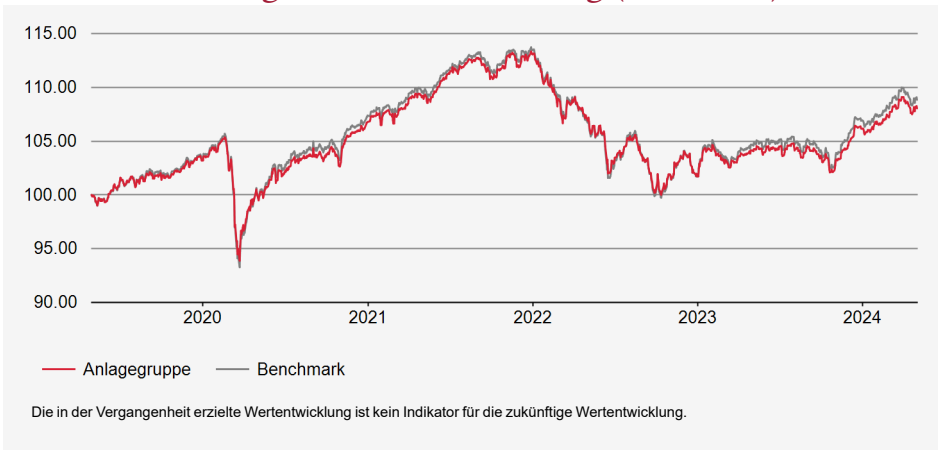
Anlagestrategie

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	1.78%	-0.97%	1.36%	3.75%	-0.31%	1.56%	2.54%	2.97%
Benchmark	1.78%	-1.01%	1.41%	3.98%	-0.21%	1.71%	2.85%	3.45%

Statistische Angaben (annualisiert)

	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Aufl.
Volatilität Anlagegruppe (in %)	3.61	4.91	5.12	4.30	4.12
Volatilität Benchmark (in %)	3.92	5.30	5.48	4.43	4.12
Tracking Error ex post (in %)	0.40	0.59	0.56	0.52	0.58
Information Ratio	-0.59	-0.18	-0.27	-0.58	-0.82
Sharpe Ratio	0.57	-0.15	0.31	0.67	0.66
Korrelation	1.00	1.00	1.00	0.99	0.99
Beta	0.92	0.92	0.93	0.96	0.99
Jensen-Alpha	-0.05	-0.15	-0.03	-0.19	-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	3.94%	2.00%	-
Hypotheken Schweiz	0.86%	-	-
Obligationen CHF Inland	14.96%	16.00%	-
Obligationen CHF Ausland	8.95%	9.00%	-
Obligationen Fremdwährungen (CHF hedged)	24.43%	28.00%	-
Aktien Schweiz	12.50%	13.00%	-
Aktien Ausland	12.33%	12.00%	-
Aktien Ausland (CHF hedged)	0.66%	-	-
Immobilien Schweiz	15.86%	13.00%	30.00%
Immobilien Ausland (CHF hedged)	3.20%	2.00%	10.00%
Alternative Anlagen (CHF hedged)	2.31%	5.00%	15.00%
Total Aktien (In- und Ausland)	25.49%	25.00%	50.00%
Total Fremdwährungen	12.33%	12.00%	30.00%

Grösste Aktienpositionen

NESTLE SA-REG	2.02%
NOVARTIS AG-REG	1.50%
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	1.27%
MICROSOFT CORP.	0.86%
NVIDIA CORP	0.67%
UBS GROUP AG-REG	0.64%
ABB LTD-REG	0.60%
ALPHABET INC	0.57%
CIE FINANCIERE RICHEMONT-REG	0.56%
ZURICH INSURANCE GROUP AG	0.53%

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	85.51%
USD	8.32%
EUR	1.00%
JPY	0.81%
Übrige	4.36%

Eigenschaften der festverzinslichen Anlagen

Modified Duration	5.56
Durchschnittliches Rating	A