

Anlagestiftung Swiss Life BVG-Mix 25



Nettovermögen (NAV) in Mio. CHF: 803.41
Nettovermögen pro Anspruch in CHF: 200.29

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)



Performance in Referenzwährung

| | KUMULIERTE PERFORMANCE | | | | ANNUALISIERTE PERFORMANCE | | | |
|---------------------|------------------------|---------|----------|--------|---------------------------|---------|----------|-------|
| | YTD | 1 MONAT | 3 MONATE | 1 JAHR | 3 JAHRE | 5 JAHRE | 10 JAHRE | AUFL. |
| ANLAGEGRUPPE | 4.66% | 0.66% | -0.11% | 8.88% | 5.23% | 4.02% | 4.68% | 3.52% |
| BENCHMARK | 4.49% | 0.66% | -0.04% | 8.68% | 5.46% | 4.39% | 4.95% | 4.04% |

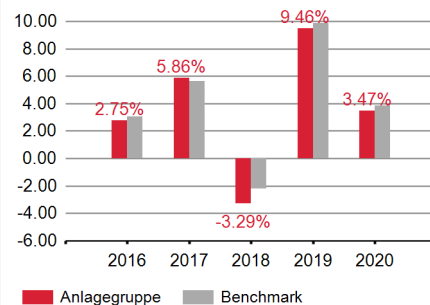
Statistische Angaben (annualisiert)

| | 1 JAHR | 3 JAHRE | 5 JAHRE | 10 JAHRE | AUFL. |
|---------------------------------|--------|---------|---------|----------|--------|
| Volatilität Anlagegruppe (in %) | 3.79 | 4.94 | 4.07 | 3.71 | 3.96 |
| Volatilität Benchmark (in %) | 3.72 | 5.18 | 4.21 | 3.64 | 3.88 |
| Tracking Error ex post (in %) | 0.23 | 0.45 | 0.46 | 0.50 | 0.57 |
| Information Ratio | 0.88 | -0.51 | -0.81 | -0.55 | -0.92 |
| Sharpe Ratio | 2.41 | 1.18 | 1.15 | 1.37 | 0.84 |
| Korrelation | 1.00 | 1.00 | 0.99 | 0.99 | 0.99 |
| Beta | 1.02 | 0.95 | 0.96 | 1.01 | 1.01 |
| Jensen-Alpha | 0.05 | 0.07 | -0.18 | -0.34 | -0.57 |
| Maximum Drawdown (in %) | -1.77 | -10.89 | -10.89 | -10.89 | -14.16 |
| Recovery Period (Jahre) | - | 0.65 | 0.65 | 0.65 | 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.

Performance



Produktinformationen

Valorennummer: 1245601
ISIN: CH0012456015
LEI: 254900JNOBNDNHDGRO53
Bloomberg-Code: SWABM25 SW
Benchmark: Customized
Währung: CHF
Domizil: Schweiz
Aufgatedatum: 30/09/2001
Ausgabepreis: 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: 0.57%
ex post per: 30/09/2021 0.59%

Portfoliostruktur nach Anlagekategorien

| | Anlagegruppe | Benchmark | max. BVV2 |
|--|--------------|-----------|-----------|
| Liquidität | 1.68% | 2.00% | - |
| Obligationen CHF Inland | 11.81% | 16.00% | - |
| Obligationen CHF Ausland | 6.81% | 9.00% | - |
| Obligationen Fremdwährungen (CHF hedged) | 29.80% | 28.00% | - |
| Aktien Schweiz | 13.95% | 13.00% | - |
| Aktien Ausland | 11.71% | 12.00% | - |
| Aktien Ausland (CHF hedged) | 4.27% | - | - |
| Immobilien Schweiz | 15.56% | 13.00% | 30.00% |
| Immobilien Ausland (CHF hedged) | 2.30% | 2.00% | 10.00% |
| Alternative Anlagen (CHF hedged) | 2.11% | 5.00% | 15.00% |
| Total Aktien (In- und Ausland) | 29.93% | 25.00% | 50.00% |
| Total Fremdwährungen | 11.71% | 12.00% | 30.00% |

Portfoliostruktur nach Währungen

| | |
|--------|--------|
| CHF | 88.29% |
| USD | 8.28% |
| EUR | 1.33% |
| JPY | 0.76% |
| ÜBRIGE | 1.34% |

Benchmarkzusammensetzung

| | |
|---|--------|
| CITIGROUP CHF 1 M EURO DEPO | 2.00% |
| SBI DOMESTIC AAA-BBB | 16.00% |
| SBI FOREIGN AAA-BBB | 9.00% |
| BB* GL. AGG. TREAS. EX CH TR (CHF HEDGED) | 4.00% |
| BB* GL. AGG. CORP. TR (CHF HEDGED) | 9.00% |
| BB* 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, 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% |

* Bloomberg Barclays

Eigenschaften der festverzinslichen Anlagen

| | |
|---------------------------|------|
| Modified Duration | 5.75 |
| Durchschnittliches Rating | A |