

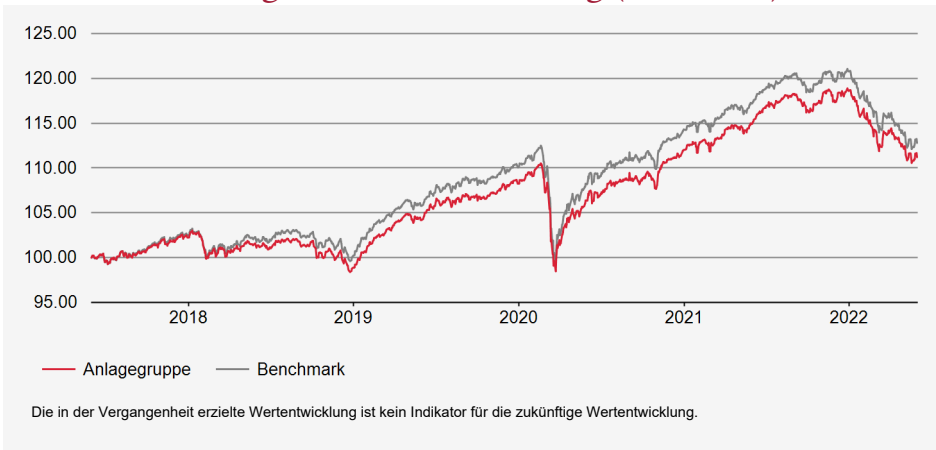
# Anlagestiftung Swiss Life BVG-Mix 25

**Nettovermögen (NAV) in Mio. CHF: 800.44**  
**Nettovermögen pro Anspruch in CHF: 189.99**

## 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)



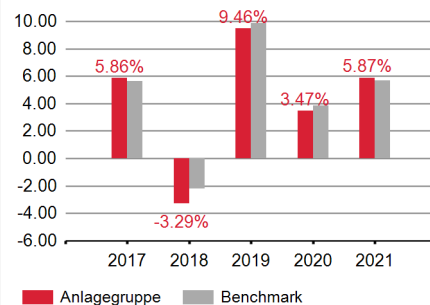
## Performance in Referenzwährung

	KUMULIERTE PERFORMANCE				ANNUALISIERTE PERFORMANCE			
	YTD	1 MONAT	3 MONATE	1 JAHR	3 JAHRE	5 JAHRE	10 JAHRE	AUFL.
ANLAGEGRUPPE	-6.23%	-1.07%	-2.61%	-3.23%	2.19%	2.15%	3.68%	3.15%
BENCHMARK	-6.60%	-0.95%	-2.93%	-3.76%	2.16%	2.44%	3.91%	3.64%

## Statistische Angaben (annualisiert)

	1 JAHR	3 JAHRE	5 JAHRE	10 JAHRE	AUFL.
Volatilität Anlagegruppe (in %)	4.21	5.08	4.35	3.86	3.99
Volatilität Benchmark (in %)	4.14	5.32	4.51	3.81	3.92
Tracking Error ex post (in %)	0.43	0.50	0.46	0.49	0.57
Information Ratio	1.22	0.06	-0.63	-0.46	-0.85
Sharpe Ratio	-0.63	0.56	0.66	1.08	0.75
Korrelation	0.99	1.00	1.00	0.99	0.99
Beta	1.01	0.95	0.96	1.00	1.01
Jensen-Alpha	0.56	0.17	-0.16	-0.24	-0.52
Maximum Drawdown (in %)	-6.99	-10.89	-10.89	-10.89	-14.16
Recovery Period (Jahre)	-	0.65	0.65	0.65	0.98

## Performance



## Produktinformationen

**Valorennummer:** 1245601

**ISIN:** CH0012456015

**LEI:** 254900JNOBNDNHDGRO53

**Bloomberg-Code:** SWABM25 SW

**Benchmark:** Customized

**Währung:** CHF

**Domizil:** Schweiz

**Aufgagedatum:** 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](http://www.swisslife.ch/anlagestiftung)

**Betriebsaufwandquote TER KGAST**

**ex ante:** 0.57%

**ex post per:** 30/09/2021 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.

**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	5.89%	2.00%	-
Hypotheken Schweiz	0.74%	-	-
Obligationen CHF Inland	11.28%	16.00%	-
Obligationen CHF Ausland	6.65%	9.00%	-
Obligationen Fremdwährungen (CHF hedged)	28.86%	28.00%	-
Aktien Schweiz	12.84%	13.00%	-
Aktien Ausland	10.80%	12.00%	-
Aktien Ausland (CHF hedged)	1.66%	-	-
Immobilien Schweiz	15.97%	13.00%	30.00%
Immobilien Ausland (CHF hedged)	3.15%	2.00%	10.00%
Alternative Anlagen (CHF hedged)	2.16%	5.00%	15.00%
Total Aktien (In- und Ausland)	25.30%	25.00%	50.00%
Total Fremdwährungen	10.80%	12.00%	30.00%

## Portfoliostruktur nach Währungen

CHF	89.20%
USD	7.53%
EUR	1.19%
JPY	0.69%
ÜBRIGE	1.39%

## Benchmarkzusammensetzung

1M SARON	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	5.40
Durchschnittliches Rating	A