

Anlagestiftung Swiss Life BVG-Mix 25 P

Nettovermögen (NAV) in Mio. CHF: 675.31
Nettovermögen pro Anspruch in CHF: 168.39

Anlagestrategie

Die Anlagegruppe BVG-Mix 25 P investiert im Durchschnitt ca. 25% in Aktien. Etwas über die Hälfte des Aktienanteils wird in schweizerische Dividendenpapiere angelegt, der Rest entfällt auf ausländische Gesellschaften. Durchschnittlich sind rund 53% des Vermögens in Obligationen investiert. Es gelten folgende Höchstgrenzen: 35% Aktien, 30% Fremdwährungen. BVG-Mix 25 P eignet sich für Anleger, die bereit sind, Kursschwankungen in Kauf zu nehmen. Wir empfehlen einen Anlagehorizont von über fünf Jahren.

Wertentwicklung in Referenzwährung (Basis 100)



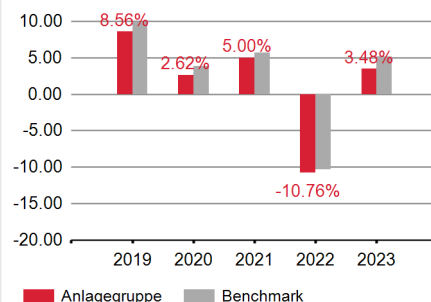
Performance in Referenzwährung

	Kumulierte Performance				Annualisierte Performance			
	YTD	1 Monat	3 Monate	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Aufl.
Anlagegruppe	3.65%	-0.94%	-0.43%	7.25%	-1.11%	0.80%	1.56%	2.39%
Benchmark	4.69%	-0.85%	-0.12%	8.86%	-0.10%	1.82%	2.75%	3.70%

Statistische Angaben (annualisiert)

	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Aufl.
Volatilität Anlagegruppe (in %)	3.16	4.83	5.12	4.30	4.09
Volatilität Benchmark (in %)	3.36	5.25	5.48	4.44	4.10
Tracking Error ex post (in %)	0.37	0.59	0.55	0.52	0.59
Information Ratio	-4.29	-1.73	-1.86	-2.29	-2.26
Sharpe Ratio	1.77	-0.39	0.12	0.43	0.53
Korrelation	1.00	1.00	1.00	0.99	0.99
Beta	0.93	0.91	0.93	0.96	0.99
Jensen-Alpha	-1.10	-1.08	-0.91	-1.08	-1.28
Maximum Drawdown (in %)	-1.93	-12.33	-12.33	-12.33	-15.36
Recovery Period (Jahre)	0.07	-	-	-	1.67

Performance



Produktinformationen

Valorennummer: 1436904

ISIN: CH0014369042

LEI: 5493000KUC3Z24U77V93

Bloomberg-Code: SLVOR25 SW

Benchmark: Customized

Währung: CHF

Domizil: Schweiz

Aufledgedatum: 30/09/2002

Erstausgabepreis: 100.00

Jahresabschluss: 30.09

Ausgabe/Rücknahme: Täglich

Annahmeschluss: 12.00 Uhr

Verwässerungsschutz:

Ausgabe- / Rücknahmekommission zugunsten der Anlagegruppe gemäss Konditionenübersicht.

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: 1.39%

ex post per: 30/09/2024 1.42%

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.

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	2.19%	2.00%	-
Hypotheken Schweiz	0.93%	-	-
Obligationen CHF Inland	15.16%	16.00%	-
Obligationen CHF Ausland	9.17%	9.00%	-
Obligationen Fremdwährungen (CHF hedged)	26.05%	28.00%	-
Aktien Schweiz	12.85%	13.00%	-
Aktien Ausland	11.88%	12.00%	-
Aktien Ausland (CHF hedged)	-	-	-
Immobilien Schweiz	15.91%	13.00%	30.00%
Immobilien Ausland (CHF hedged)	3.35%	2.00%	10.00%
Alternative Anlagen (CHF hedged)	2.52%	5.00%	15.00%
Total Aktien (In- und Ausland)	24.73%	25.00%	50.00%
Total Fremdwährungen	11.88%	12.00%	30.00%

Grösste Aktienpositionen

NESTLE SA-REG	1.75%
NOVARTIS AG-REG	1.57%
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	1.54%
NVIDIA CORP	0.77%
UBS GROUP AG-REG	0.70%
MICROSOFT CORP	0.68%
ABB LTD-REG	0.63%
ZURICH INSURANCE GROUP AG	0.61%
CIE FINANCIERE RICHEMO-A REG	0.55%
ALPHABET INC	0.44%

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	88.12%
USD	8.17%
EUR	0.84%
JPY	0.72%
Übrige	2.15%

Eigenschaften der festverzinslichen Anlagen

Modified Duration	5.90
Durchschnittliches Rating	A