

30. September 2024

# Anlagestiftung Swiss Life BVG-Mix 75



(Aktien- und Fremdwährungsquote gemäss BVV2 überschritten)

**Nettovermögen (NAV) in Mio. CHF: 286.50**  
**Nettovermögen pro Anspruch in CHF: 140.48**

## 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)



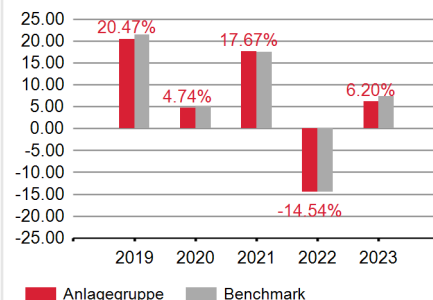
## Performance in Referenzwährung

	Kumulierte Performance True				Annualisierte Performance			
	YTD	1 Monat	3 Monate	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Aufl.
Anlagegruppe	10.90%	0.01%	0.88%	13.09%	1.91%	5.19%	-	5.91%
Benchmark	11.54%	0.16%	1.07%	14.00%	2.47%	5.68%	-	6.47%

## Statistische Angaben (annualisiert)

	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Aufl.
Volatilität Anlagegruppe (in %)	7.75	9.59	10.40	-	10.44
Volatilität Benchmark (in %)	7.92	10.05	10.92	-	10.89
Tracking Error ex post (in %)	0.29	0.70	0.86	-	0.80
Information Ratio	-3.17	-0.81	-0.57	-	-0.69
Sharpe Ratio	1.40	0.12	0.47	-	0.55
Korrelation	1.00	1.00	1.00	-	1.00
Beta	0.98	0.95	0.95	-	0.96
Jensen-Alpha	-0.63	-0.48	-0.22	-	-0.28
Maximum Drawdown (in %)	-7.18	-17.76	-23.54	-	-23.54
Recovery Period (Jahre)	-	1.76	0.74	-	0.74

## Performance



## Produktinformationen

**Valorennummer:** 43583002  
**ISIN:** CH0435830028  
**LEI:** 2549007MI5RG5X8NMB06  
**Bloomberg-Code:** SWABM75 SW  
**Benchmark:** Customized  
**Währung:** CHF  
**Domizil:** Schweiz  
**Aufledgedatum:** 31/10/2018  
**Erstausgabepreis:** 100.00  
**Jahresabschluss:** 30.09  
**Ausgabe/Rücknahme:** Täglich  
**Annahmeschluss:** 12.00 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:** 0.62%  
**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.  
**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.

(Aktien- und Fremdwährungsquote gemäss BVV2 überschritten)

## Portfoliostruktur nach Anlagekategorien

	Anlagegruppe	Benchmark	max. BVV2
Liquidität	3.80%	2.00%	-
Hypotheken Schweiz	0.24%	-	-
Obligationen Fremdwährungen (CHF hedged)	15.11%	13.00%	-
Aktien Schweiz	36.89%	38.00%	-
Aktien Ausland	36.95%	37.00%	-
Aktien Ausland (CHF hedged)	-	-	-
Immobilien Schweiz	4.74%	5.00%	30.00%
Immobilien Ausland (CHF hedged)	0.25%	-	10.00%
Alternative Anlagen (CHF hedged)	2.01%	5.00%	15.00%
<b>Total Aktien (In- und Ausland)</b>	<b>73.84%</b>	<b>75.00%</b>	<b>50.00%</b>
<b>Total Fremdwährungen</b>	<b>36.95%</b>	<b>37.00%</b>	<b>30.00%</b>

## Grösste Aktienpositionen

NESTLE SA-REG	5.08%
NOVARTIS AG-REG	4.54%
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	4.34%
MICROSOFT CORP	2.17%
NVIDIA CORP	2.14%
UBS GROUP AG-REG	1.92%
ABB LTD-REG	1.79%
ZURICH INSURANCE GROUP AG	1.70%
CIE FINANCIERE RICHEMO-A REG	1.64%
ALPHABET INC	1.30%

## 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%
Swiss Performance Index	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	63.05%
USD	25.08%
EUR	2.74%
JPY	2.34%
Übrige	6.80%

## Eigenschaften der festverzinslichen Anlagen

Modified Duration	4.57
Durchschnittliches Rating	A-