

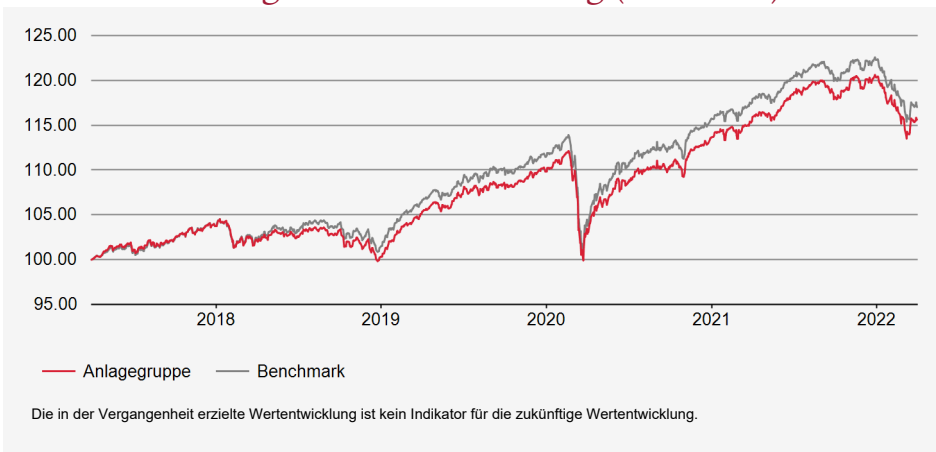
# Anlagestiftung Swiss Life BVG-Mix 25

**Nettovermögen (NAV) in Mio. CHF: 808.99**  
**Nettovermögen pro Anspruch in CHF: 194.73**

## 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)



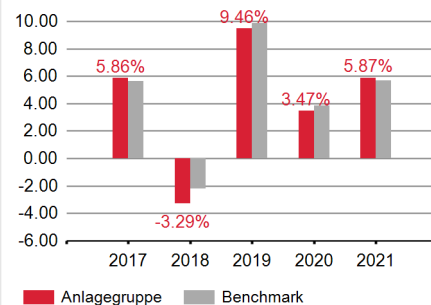
## Performance in Referenzwährung

	KUMULIERTE PERFORMANCE				ANNUALISIERTE PERFORMANCE			
	YTD	1 MONAT	3 MONATE	1 JAHR	3 JAHRE	5 JAHRE	10 JAHRE	AUFL.
ANLAGEGRUPPE	-3.89%	-0.18%	-3.89%	0.15%	3.22%	2.95%	3.93%	3.30%
BENCHMARK	-4.31%	-0.54%	-4.31%	-0.42%	3.21%	3.19%	4.16%	3.79%

## Statistische Angaben (annualisiert)

	1 JAHR	3 JAHRE	5 JAHRE	10 JAHRE	AUFL.
Volatilität Anlagegruppe (in %)	3.98	4.99	4.26	3.80	3.98
Volatilität Benchmark (in %)	3.94	5.24	4.41	3.75	3.91
Tracking Error ex post (in %)	0.43	0.50	0.47	0.49	0.58
Information Ratio	1.31	0.03	-0.52	-0.48	-0.85
Sharpe Ratio	0.20	0.78	0.86	1.16	0.79
Korrelation	0.99	1.00	0.99	0.99	0.99
Beta	1.00	0.95	0.96	1.00	1.01
Jensen-Alpha	0.57	0.21	-0.09	-0.26	-0.53
Maximum Drawdown (in %)	-5.89	-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	3.60%	2.00%	-
Hypotheken Schweiz	0.40%	-	-
Obligationen CHF Inland	11.31%	16.00%	-
Obligationen CHF Ausland	6.59%	9.00%	-
Obligationen Fremdwährungen (CHF hedged)	28.85%	28.00%	-
Aktien Schweiz	14.12%	13.00%	-
Aktien Ausland	11.40%	12.00%	-
Aktien Ausland (CHF hedged)	3.18%	-	-
Immobilien Schweiz	15.55%	13.00%	30.00%
Immobilien Ausland (CHF hedged)	2.89%	2.00%	10.00%
Alternative Anlagen (CHF hedged)	2.12%	5.00%	15.00%
Total Aktien (In- und Ausland)	28.70%	25.00%	50.00%
Total Fremdwährungen	11.40%	12.00%	30.00%

## Portfoliostruktur nach Währungen

CHF	88.60%
USD	8.03%
EUR	1.27%
JPY	0.75%
ÜBRIGE	1.35%

## 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	5.54
Durchschnittliches Rating	A