

31. Juli 2025

Anlagestiftung Swiss Life BVG-Mix 15

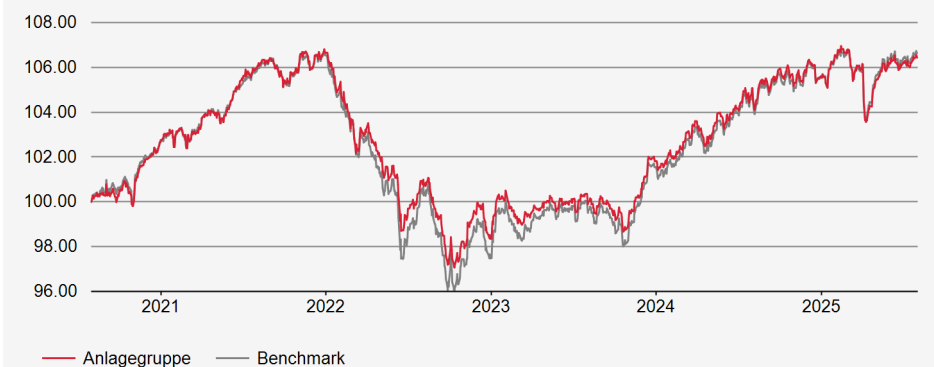


Nettovermögen (NAV) in Mio. CHF: 213.52
Nettovermögen pro Anspruch in CHF: 176.95

Anlagestrategie

Anlagen in alle vom BVG zugelassenen Anlagekategorien (strategischer Aktienanteil: 15%). Aktive Asset Allocation. Begrenzung für Beteiligungspapiere: 20%. Begrenzung für Fremdwährungen: 30%. Durchschnittliche Ratingqualität der Obligationen: mindestens BBB+. Umsetzung mittels Einsatz artreiner Kollektivanlagen. Empfohlene Schwankungsreserven: über 6.5%.

Wertentwicklung in Referenzwährung (Basis 100)



Die in der Vergangenheit erzielte Wertentwicklung ist kein Indikator für die zukünftige Wertentwicklung.

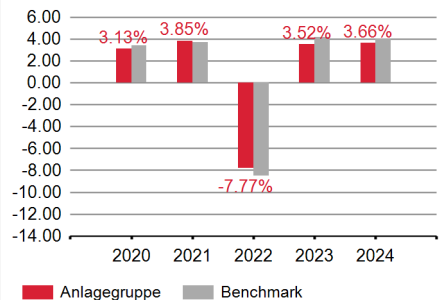
Performance in Referenzwährung

	Kumulierte Performance				Annualisierte Performance			
	YTD	1 Monat	3 Monate	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Aufl.
Anlagegruppe	0.84%	0.24%	1.01%	1.29%	1.78%	1.25%	1.81%	2.62%
Benchmark	1.08%	0.24%	1.00%	1.75%	1.98%	1.29%	1.96%	2.92%

Statistische Angaben (annualisiert)

	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Aufl.
Volatilität Anlagegruppe (in %)	2.15	3.07	3.18	3.05	2.80
Volatilität Benchmark (in %)	2.04	3.40	3.50	3.20	2.85
Tracking Error ex post (in %)	0.46	0.53	0.56	0.52	0.57
Information Ratio	-1.01	-0.39	-0.07	-0.28	-0.52
Sharpe Ratio	0.33	0.25	0.28	0.67	0.87
Korrelation	0.98	0.99	0.99	0.99	0.98
Beta	1.03	0.89	0.90	0.94	0.97
Jensen-Alpha	-0.49	-0.10	0.06	-0.02	-0.22
Maximum Drawdown (in %)	-3.17	-3.96	-9.12	-9.12	-9.12
Recovery Period (Jahre)	-	1.15	2.34	2.34	2.34

Performance



Produktinformationen

Valorennummer: 1564965

ISIN: CH0015649657

LEI: 254900RW4KJYAQTH6Y97

Bloomberg-Code: SWABM15 SW

Benchmark: Customized

Währung: CHF

Domizil: Schweiz

Auflagedatum: 30/06/2003

Erstausgabepreis: 100.00

Jahresabschluss: 30.09

Ausgabe/Rücknahme: Täglich

Annahmeschluss: 12.00 Uhr

Verwässerungsschutz:

Ausgabe- / Rücknahmekommission zugunsten der Anlagegruppe gemäss Konditionenübersicht.

Asset Management:

Strategische und taktische Asset Allocation

durch Swiss Life Asset Management AG

Eingesetzte artreine Anlagegruppen:

Diverse gemäss Swiss Life Best Select

Invest Plus © Ansatz

Externe Beratung:

Überwachung der Anlageresultate der

eingesetzten Anlagegruppen sowie

Beratung zu geeigneter Mandatsstruktur

und bei der Selektion geeigneter Asset

Managers durch PPCmetrics

Kurspublikationen: Bloomberg: ASSL

www.swisslife.ch/anlagestiftung

Betriebsaufwandquote TER KGAST

ex ante: 0.50%

ex post per: 30/09/2024 0.60%

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.

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	2.73%	4.00%	-
Hypotheken Schweiz	6.71%	7.00%	-
Obligationen CHF Inland	27.28%	28.00%	-
Obligationen Fremdwährungen (CHF hedged)	25.50%	27.00%	-
Aktien Schweiz	7.80%	7.00%	-
Aktien Ausland	4.61%	4.00%	-
Aktien Ausland (CHF hedged)	5.62%	4.00%	-
Immobilien Schweiz	16.75%	15.00%	30.00%
Immobilien Ausland (CHF hedged)	1.06%	1.00%	10.00%
Alternative Anlagen (CHF hedged)	1.95%	3.00%	15.00%
Infrastruktur	-	-	-
Total Aktien (In- und Ausland)	18.02%	15.00%	50.00%
Total Fremdwährungen	4.61%	7.00%	30.00%

Grösste Aktienpositionen

NOVARTIS AG-REG	0.91%
NESTLE SA-REG	0.91%
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	0.89%
NVIDIA CORP	0.49%
UBS GROUP AG-REG	0.45%
MICROSOFT CORP	0.42%
ABB LTD-REG	0.42%
ZURICH INSURANCE GROUP AG	0.40%
CIE FINANCIERE RICHEMO-A REG	0.35%
APPLE INC	0.35%

Benchmarkzusammensetzung

1M Saron	4.00%
SBI Domestic AAA-A 1-3Y Total Return	7.00%
SBI AAA-BBB Total Return	28.00%
Bloomberg Gl. Agg. Treas. ex CH (CHF hedged)	17.00%
Bloomberg Gl. Agg. Corp. (CHF hedged)	4.00%
Bloomberg Gl. Agg. Corp. Short Term (CHF hedged)	4.00%
JP Morgan CEMBI Broad Diversified IG Index (CHF hedged)	2.00%
SP1® Total Return	7.00%
MSCI World ex Switzerland Net Return	4.00%
MSCI World ex Switzerland Net Return (CHF hedged)	4.00%
KGAST Immo-Index	15.00%
SL REF (LUX) ESG German Core Real Estate (CHF hedged)	0.75%
Anlagestiftung Swiss Life Immobilien Europa Industrie und Logistik ESG (EUR), CHF hedged	0.25%
HFRX Global Hedge Funds (CHF hedged)	3.00%
Anlagestiftung Swiss Life Infrastruktur Global ESG (EUR)	-

Portfoliostruktur nach Währungen

CHF	95.39%
USD	2.69%
EUR	0.67%
JPY	0.15%
Übrige	1.10%

Eigenschaften der festverzinslichen Anlagen

Modified Duration	5.94
Durchschnittliches Rating	AA-