31. Juli 2025

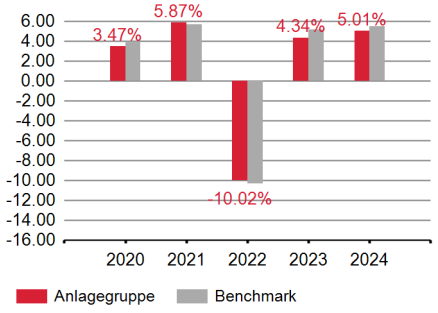
Anlagestiftung Swiss Life BVG-Mix 25

Nettovermögen (NAV) in Mio. CHF: 706.59
Nettovermögen pro Anspruch in CHF: 202.20

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%.

Performance



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	1.22%	0.40%	1.74%	1.62%	2.33%	1.85%	2.23%	3.00%
Benchmark	1.51%	0.41%	1.76%	2.15%	2.72%	2.05%	2.57%	3.48%

Statistische Angaben (annualisiert)

	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Aufl.
Volatilität Anlagegruppe (in %)	3.05	4.15	4.39	4.22	4.06
Volatilität Benchmark (in %)	2.95	4.43	4.64	4.39	4.06
Tracking Error ex post (in %)	0.36	0.44	0.50	0.51	0.57
Information Ratio	-1.47	-0.88	-0.41	-0.67	-0.84
Sharpe Ratio	0.34	0.32	0.34	0.58	0.67
Korrelation	0.99	1.00	1.00	0.99	0.99
Beta	1.02	0.93	0.94	0.96	0.99
Jensen-Alpha	-0.57	-0.28	-0.11	-0.22	-0.46
Maximum Drawdown (in %)	-4.81	-5.28	-11.75	-11.75	-14.16
Recovery Period (Jahre)	-	1.17	2.34	2.34	0.98

Produktinformationen

Valorennummer: 1245601
ISIN: CH0012456015
LEI: 5493000KUC3Z24U77V93
Bloomberg-Code: SWABM25 SW
Benchmark: Customized
Währung: CHF
Domizil: Schweiz
Auflagedatum: 30/09/2001
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 0.59%

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.
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.

31. Juli 2025

Anlagestiftung Swiss Life BVG-Mix 25

Portfoliostruktur nach Anlagekategorien

	Anlagegruppe	Benchmark	max. BVV2
Liquidität	2.72%	4.00%	-
Hypotheken Schweiz	6.13%	6.00%	-
Obligationen CHF Inland	22.58%	23.00%	-
Obligationen Fremdwährungen (CHF hedged)	20.77%	23.00%	-
Aktien Schweiz	12.02%	11.00%	-
Aktien Ausland	6.65%	6.00%	-
Aktien Ausland (CHF hedged)	9.02%	8.00%	-
Immobilien Schweiz	16.35%	14.00%	30.00%
Immobilien Ausland (CHF hedged)	2.18%	2.00%	10.00%
Alternative Anlagen (CHF hedged)	1.58%	3.00%	15.00%
Infrastruktur	-	-	-
Total Aktien (In- und Ausland)	27.69%	25.00%	50.00%
Total Fremdwährungen	6.65%	12.00%	30.00%

Grösste Aktienpositionen

NOVARTIS AG-REG	1.41%
NESTLE SA-REG	1.40%
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	1.38%
NVIDIA CORP	0.72%
UBS GROUP AG-REG	0.70%
ABB LTD-REG	0.64%
MICROSOFT CORP	0.63%
ZURICH INSURANCE GROUP AG	0.62%
CIE FINANCIERE RICHEMO-A REG	0.55%
APPLE INC	0.52%

Benchmarkzusammensetzung

1M Saron	4.00%
SBI Domestic AAA-A 1-3Y Total Return	6.00%
SBI AAA-BBB Total Return	23.00%
Bloomberg Gl. Agg. Treas. ex CH (CHF hedged)	11.00%
Bloomberg Gl. Agg. Corp. (CHF hedged)	4.00%
Bloomberg Gl. Agg. Corp. Short Term (CHF hedged)	3.00%
JP Morgan CEMBI Broad Diversified IG Index (CHF hedged)	5.00%
SPI® Total Return	11.00%
MSCI World ex Switzerland Net Return	6.00%
MSCI World ex Switzerland Net Return (CHF hedged)	8.00%
KGAST Immo-Index	14.00%
SL REF (LUX) ESG German Core Real Estate (CHF hedged)	1.40%
Anlagestiftung Swiss Life Immobilien Europa Industrie und Logistik ESG (EUR), CHF hedged	0.60%
HFRX Global Hedge Funds (CHF hedged)	3.00%
Anlagestiftung Swiss Life Infrastruktur Global ESG (EUR)	-

Portfoliostruktur nach Währungen

CHF	93.35%
USD	3.67%
EUR	0.95%
JPY	0.18%
Übrige	1.85%

Eigenschaften der festverzinslichen Anlagen

Modified Duration	5.80
Durchschnittliches Rating	AA-

Haftungsausschluss: Die vorliegende Publikation begründet weder eine Aufforderung noch eine Empfehlung zum Erwerb oder Verkauf von Anlageinstrumenten, sondern dient lediglich zu Informationszwecken. Sämtliche Dokumente, welche die rechtliche Grundlage für eine allfällige Investition bilden, können kostenlos bei der Anlagestiftung Swiss Life, c/o Swiss Life AG, Postfach, 8022 Zürich, Tel. 043 547 71 11 und unter www.swisslife.ch/anlagestiftung bezogen werden. Der Kreis der Anleger ist beschränkt auf Einrichtungen der 2. Säule und der Säule 3a sowie sonstige steuerbefreite Einrichtungen mit Sitz in der Schweiz, die ihrem Zweck nach der beruflichen Vorsorge dienen und Personen, die kollektive Anlagen für diese Einrichtungen verwalten, von der Eidgenössischen Finanzmarktaufsicht FINMA beaufsichtigt werden und bei der Stiftung ausschliesslich Gelder für diese Einrichtungen anlegen. Die vergangene Performance stellt keinen Indikator für die laufende und zukünftige Entwicklung dar. Sämtliche Produkt- und Firmennamen sind Marken™ oder eingetragene® Warenzeichen ihrer jeweiligen Inhaber. Ihre Verwendung stellt keine Zugehörigkeit zu ihnen und keine Zustimmung durch sie dar. Dieses Dokument wurde möglicherweise mithilfe künstlicher Intelligenz erstellt. **Quelle:** Swiss Life Asset Managers. Alle Rechte vorbehalten.