

31. Juli 2025

Anlagestiftung Swiss Life BVG-Mix 75

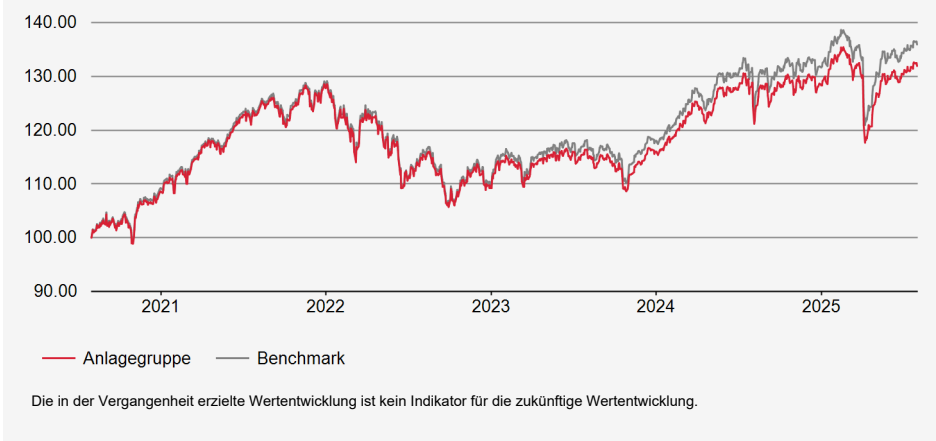
(Aktien- und Fremdwährungsquote gemäss BVV2 überschritten)

Nettovermögen (NAV) in Mio. CHF: 398.13
Nettovermögen pro Anspruch in CHF: 144.08

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

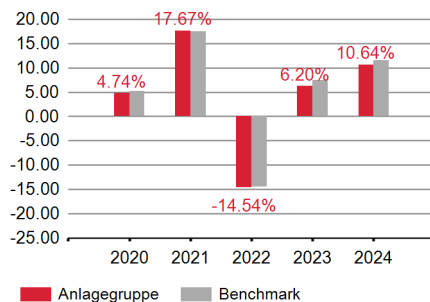
	Kumulierte Performance				Annualisierte Performance			
	YTD	1 Monat	3 Monate	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Aufl.
Anlagegruppe	2.80%	1.14%	5.24%	2.40%	4.71%	5.69%	-	5.56%
Benchmark	3.26%	1.12%	5.31%	3.30%	5.53%	6.33%	-	6.15%

Statistische Angaben (annualisiert)

	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Aufl.
Volatilität Anlagegruppe (in %)	8.15	8.79	9.57	-	10.23
Volatilität Benchmark (in %)	7.85	9.04	9.79	-	10.60
Tracking Error ex post (in %)	0.45	0.54	0.60	-	0.77
Information Ratio	-1.99	-1.53	-1.06	-	-0.78
Sharpe Ratio	0.22	0.41	0.54	-	0.52
Korrelation	1.00	1.00	1.00	-	1.00
Beta	1.04	0.97	0.98	-	0.96
Jensen-Alpha	-1.00	-0.69	-0.49	-	-0.37
Maximum Drawdown (in %)	-13.10	-13.10	-17.76	-	-23.54
Recovery Period (Jahre)	-	-	1.76	-	0.74



Performance



Produktinformationen

Valorennummer: 43583002
ISIN: CH0435830028
LEI: 2549007MI5RG5X8NMB06
Bloomberg-Code: SWABM75 SW
Benchmark: Customized
Währung: CHF
Domizil: Schweiz
Auflagedatum: 31/10/2018
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 0.61%

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.
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.

Anlagestiftung Swiss Life BVG-Mix 75



(Aktien- und Fremdwährungsquote gemäss BVV2 überschritten)

Portfoliostruktur nach Anlagekategorien

	Anlagegruppe	Benchmark	max. BVV2
Liquidität	2.50%	4.00%	-
Hypotheken Schweiz	1.18%	1.50%	-
Obligationen CHF Inland	2.66%	4.50%	-
Obligationen Fremdwährungen (CHF hedged)	4.86%	4.00%	-
Aktien Schweiz	29.34%	29.00%	-
Aktien Ausland	18.40%	17.00%	-
Aktien Ausland (CHF hedged)	30.11%	29.00%	-
Immobilien Schweiz	7.33%	6.50%	30.00%
Immobilien Ausland (CHF hedged)	1.73%	1.50%	10.00%
Alternative Anlagen (CHF hedged)	1.89%	3.00%	15.00%
Infrastruktur	-	-	-
Total Aktien (In- und Ausland)	77.86%	75.00%	50.00%
Total Fremdwährungen	18.40%	37.00%	30.00%

Grösste Aktienpositionen

NOVARTIS AG-REG	3.44%
NESTLE SA-REG	3.41%
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	3.36%
NVIDIA CORP	2.33%
MICROSOFT CORP	2.02%
UBS GROUP AG-REG	1.70%
APPLE INC	1.67%
ABB LTD-REG	1.57%
ZURICH INSURANCE GROUP AG	1.51%
CIE FINANCIERE RICHEMO-A REG	1.33%

Benchmarkzusammensetzung

1M Saron	4.00%
SBI Domestic AAA-A 1-3Y Total Return	1.50%
SBI AAA-BBB Total Return	4.50%
Bloomberg Gl. Agg. Treas. ex CH (CHF hedged)	1.00%
Bloomberg Gl. Agg. Corp. (CHF hedged)	1.00%
Bloomberg Gl. Agg. Corp. Short Term (CHF hedged)	-
JP Morgan CEMBI Broad Diversified IG Index (CHF hedged)	2.00%
SPI® Total Return	29.00%
MSCI World ex Switzerland Net Return	17.00%
MSCI World ex Switzerland Net Return (CHF hedged)	29.00%
KGAST Immo-Index	6.50%
SL REF (LUX) ESG German Core Real Estate (CHF hedged)	1.30%
Anlagestiftung Swiss Life Immobilien Europa Industrie und Logistik ESG (EUR), CHF hedged	0.20%
HFRX Global Hedge Funds (CHF hedged)	3.00%
Anlagestiftung Swiss Life Infrastruktur Global ESG (EUR)	-

Portfoliostruktur nach Währungen

CHF	81.60%
USD	10.42%
EUR	2.02%
JPY	0.53%
Übrige	5.43%

Eigenschaften der festverzinslichen Anlagen

Modified Duration	5.09
Durchschnittliches Rating	A+