

30. September 2025

Anlagestiftung Swiss Life BVG-Mix 15

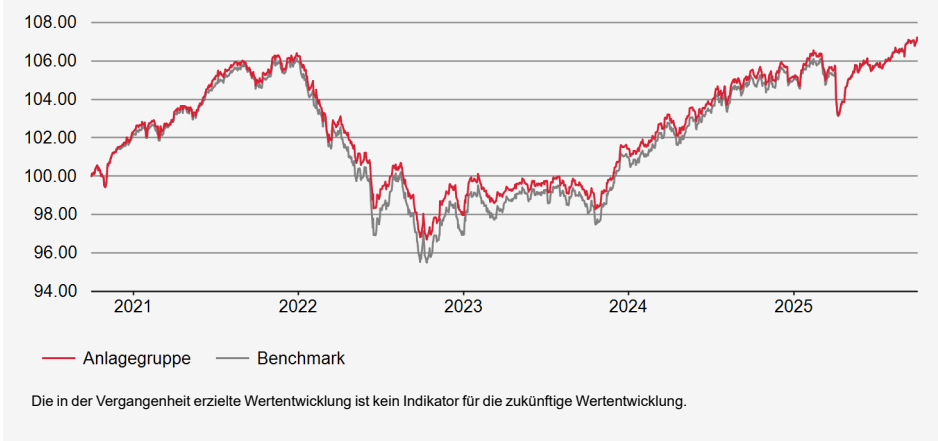


Nettovermögen (NAV) in Mio. CHF: 208.09
Nettovermögen pro Anspruch in CHF: 178.95

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)



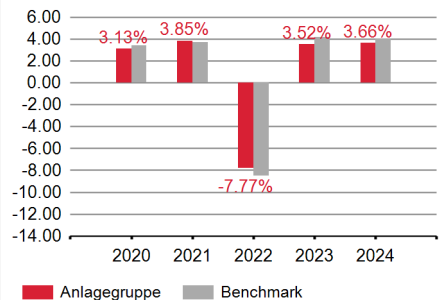
Performance in Referenzwährung

	Kumulierte Performance				Annualisierte Performance			
	YTD	1 Monat	3 Monate	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Aufl.
Anlagegruppe	1.98%	0.69%	1.37%	1.61%	3.37%	1.40%	2.08%	2.65%
Benchmark	2.09%	0.52%	1.24%	2.03%	3.72%	1.38%	2.17%	2.94%

Statistische Angaben (annualisiert)

	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Aufl.
Volatilität Anlagegruppe (in %)	2.22	2.60	3.20	3.02	2.80
Volatilität Benchmark (in %)	2.08	2.82	3.51	3.18	2.84
Tracking Error ex post (in %)	0.48	0.48	0.56	0.52	0.57
Information Ratio	-0.87	-0.75	0.04	-0.18	-0.50
Sharpe Ratio	0.56	0.89	0.32	0.75	0.88
Korrelation	0.98	0.99	0.99	0.99	0.98
Beta	1.04	0.91	0.90	0.94	0.97
Jensen-Alpha	-0.49	-0.11	0.12	0.05	-0.21
Maximum Drawdown (in %)	-3.17	-3.17	-9.12	-9.12	-9.12
Recovery Period (Jahre)	0.34	0.34	2.34	2.34	2.34

Performance



Produktinformationen

Valorennummer: 1564965

ISIN: CH0015649657

LEI: 254900RW4KJYAQTH6Y97

Bloomberg-Code: SWABM15 SW

Benchmark: Customized

Währung: CHF

Domizil: Schweiz

Aufliedatum: 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	2.60%	4.00%	-
Hypotheken Schweiz	6.90%	7.00%	-
Obligationen CHF Inland	26.98%	28.00%	-
Obligationen Fremdwährungen (CHF hedged)	25.94%	27.00%	-
Aktien Schweiz	6.87%	7.00%	-
Aktien Ausland	4.25%	4.00%	-
Aktien Ausland (CHF hedged)	5.85%	4.00%	-
Immobilien Schweiz	17.44%	15.00%	30.00%
Immobilien Ausland (CHF hedged)	1.11%	1.00%	10.00%
Alternative Anlagen (CHF hedged)	2.07%	3.00%	15.00%
Infrastruktur	-	-	-
Total Aktien (In- und Ausland)	16.97%	15.00%	50.00%
Total Fremdwährungen	4.25%	7.00%	30.00%

Grösste Aktienpositionen

NOVARTIS AG-REG	0.86%
NESTLE SA-REG	0.82%
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	0.80%
NVIDIA CORP	0.48%
UBS GROUP AG-REG	0.42%
APPLE INC	0.40%
ABB LTD-REG	0.40%
MICROSOFT CORP	0.39%
ZURICH INSURANCE GROUP AG	0.36%
CIE FINANCIERE RICHEMO-A REG	0.36%

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%
SPI® 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	95.95%
USD	2.54%
EUR	0.22%
JPY	0.14%
Übrige	1.15%

Eigenschaften der festverzinslichen Anlagen

Modified Duration	5.93
Durchschnittliches Rating	AA-