

Anlagestiftung Swiss Life BVG-Mix 15

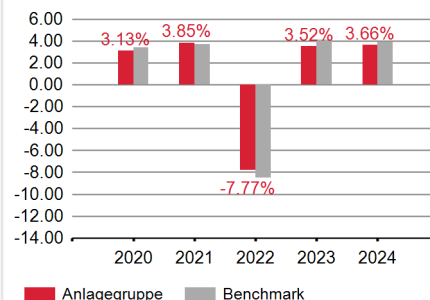


Nettovermögen (NAV) in Mio. CHF: 201.93
Nettovermögen pro Anspruch in CHF: 180.53

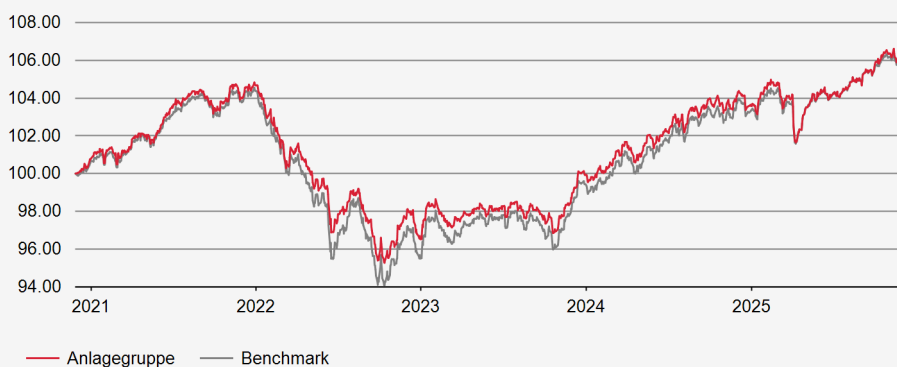
Anlagestrategie

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%.

Performance



Wertentwicklung in Referenzwährung (Basis 100)



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

Produktinformationen

Valorennummer: 1564965
ISIN: CH0015649657
LEI: 254900RW4KJYAQTH6Y97
Bloomberg-Code: SWABM15 SW
Benchmark: Customized
Währung: CHF
Domizil: Schweiz
Aufledgedatum: 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: 0.47%

ex post per: 30/09/2025 0.53%
Vorbehalten bleiben abweichende Bestimmungen in den Gebührenordnungen von Freizügigkeitsstiftungen sowie Vorsorgestiftungen 3a.

Performance in Referenzwährung

	Kumulierte Performance				Annualisierte Performance			
	YTD	1 Monat	3 Monate	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Aufl.
Anlagegruppe	2.88%	0.22%	1.58%	2.37%	2.91%	1.28%	1.97%	2.67%
Benchmark	2.95%	0.22%	1.36%	2.56%	3.19%	1.26%	2.05%	2.96%

Statistische Angaben (annualisiert)

	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Aufl.
Volatilität Anlagegruppe (in %)	1.96	2.49	3.07	3.00	2.79
Volatilität Benchmark (in %)	1.71	2.71	0.00	0.00	0.00
Tracking Error ex post (in %)	0.47	0.47	0.00	0.00	0.00
Information Ratio	-0.41	-0.59	0.00	0.00	0.00
Sharpe Ratio	1.10	0.76	0.29	0.72	0.89
Korrelation	0.98	0.99	0.00	0.00	0.00
Beta	1.11	0.91	0.00	0.00	0.00
Jensen-Alpha	-0.46	-0.08	0.89	2.18	2.52
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

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	2.94%	4.00%	-
Hypotheken Schweiz	7.12%	7.00%	-
Obligationen CHF Inland	25.63%	28.00%	-
Obligationen Fremdwährungen (CHF hedged)	25.83%	27.00%	-
Aktien Schweiz	7.37%	7.00%	-
Aktien Ausland	4.08%	4.00%	-
Aktien Ausland (CHF hedged)	5.67%	4.00%	-
Immobilien Schweiz	18.08%	15.00%	30.00%
Immobilien Ausland (CHF hedged)	1.12%	1.00%	10.00%
Alternative Anlagen (CHF hedged)	2.17%	3.00%	15.00%
Infrastruktur	-	-	-
Total Aktien (In- und Ausland)	17.11%	15.00%	50.00%
Total Fremdwährungen	4.08%	7.00%	30.00%

Grösste Aktienpositionen

ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	0.95%
NESTLE SA-REG	0.90%
NOVARTIS AG-REG	0.90%
NVIDIA CORP	0.42%
APPLE INC	0.41%
UBS GROUP AG-REG	0.40%
CIE FINANCIERE RICHEMO-A REG	0.40%
ABB LTD-REG	0.40%
ZURICH INSURANCE GROUP AG	0.37%
MICROSOFT CORP	0.34%

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	95.92%
USD	2.38%
EUR	0.41%
JPY	0.12%
Übrige	1.17%

Eigenschaften der festverzinslichen Anlagen

Modified Duration	0.18
Durchschnittliches Rating	AAA