

31. Oktober 2025

Anlagestiftung Swiss Life BVG-Mix 15

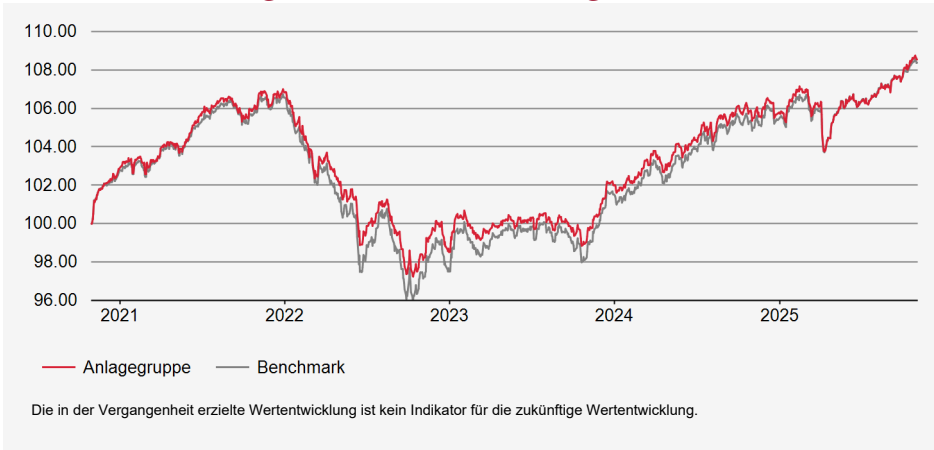


Nettovermögen (NAV) in Mio. CHF: 206.68
Nettovermögen pro Anspruch in CHF: 180.14

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)



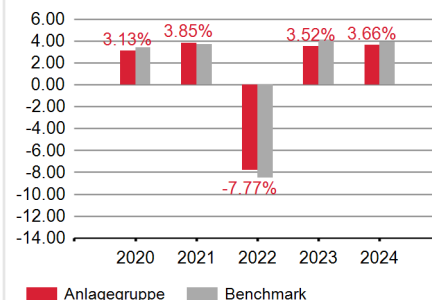
Performance in Referenzwährung

	Kumulierte Performance				Annualisierte Performance			
	YTD	1 Monat	3 Monate	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Aufl.
Anlagegruppe	2.66%	0.66%	1.80%	3.03%	3.32%	1.65%	2.00%	2.67%
Benchmark	2.72%	0.62%	1.62%	3.38%	3.60%	1.62%	2.09%	2.96%

Statistische Angaben (annualisiert)

	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Aufl.
Volatilität Anlagegruppe (in %)	2.07	2.59	3.19	3.00	2.79
Volatilität Benchmark (in %)	1.89	2.80	0.00	0.00	0.00
Tracking Error ex post (in %)	0.49	0.47	0.00	0.00	0.00
Information Ratio	-0.73	-0.61	0.00	0.00	0.00
Sharpe Ratio	1.31	0.88	0.40	0.73	0.89
Korrelation	0.97	0.99	0.00	0.00	0.00
Beta	1.07	0.91	0.00	0.00	0.00
Jensen-Alpha	-0.56	-0.06	1.28	2.22	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

Performance



Produktinformationen

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

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	2.50%	4.00%	-
Hypotheken Schweiz	6.95%	7.00%	-
Obligationen CHF Inland	26.99%	28.00%	-
Obligationen Fremdwährungen (CHF hedged)	25.95%	27.00%	-
Aktien Schweiz	7.02%	7.00%	-
Aktien Ausland	3.99%	4.00%	-
Aktien Ausland (CHF hedged)	5.77%	4.00%	-
Immobilien Schweiz	17.62%	15.00%	30.00%
Immobilien Ausland (CHF hedged)	1.11%	1.00%	10.00%
Alternative Anlagen (CHF hedged)	2.10%	3.00%	15.00%
Infrastruktur	-	-	-
Total Aktien (In- und Ausland)	16.78%	15.00%	50.00%
Total Fremdwährungen	3.99%	7.00%	30.00%

Grösste Aktienpositionen

NESTLE SA-REG	0.86%
NOVARTIS AG-REG	0.84%
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	0.79%
NVIDIA CORP	0.49%
ABB LTD-REG	0.41%
APPLE INC	0.40%
UBS GROUP AG-REG	0.40%
CIE FINANCIERE RICHEMO-A REG	0.37%
MICROSOFT CORP	0.36%
ZURICH INSURANCE GROUP AG	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%
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	96.01%
USD	2.32%
EUR	0.39%
JPY	0.12%
Übrige	1.16%

Eigenschaften der festverzinslichen Anlagen

Modified Duration	5.93
Durchschnittliches Rating	AA-