

30. September 2025

Anlagestiftung Swiss Life BVG-Mix 25

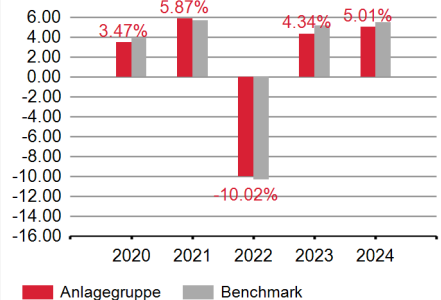


Nettovermögen (NAV) in Mio. CHF: 709.43
Nettovermögen pro Anspruch in CHF: 204.97

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)



Produktinformationen

Valorennummer: 1245601
ISIN: CH0012456015
LEI: 5493000KUC3Z24U77V93
Bloomberg-Code: SWABM25 SW
Benchmark: Customized
Währung: CHF
Domizil: Schweiz
Aufgagedatum: 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%

Performance in Referenzwährung

	Kumulierte Performance				Annualisierte Performance			
	YTD	1 Monat	3 Monate	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Aufl.
Anlagegruppe	2.60%	0.79%	1.77%	2.33%	4.40%	2.00%	2.63%	3.03%
Benchmark	2.83%	0.63%	1.70%	2.79%	4.93%	2.14%	2.91%	3.51%

Statistische Angaben (annualisiert)

	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Aufl.
Volatilität Anlagegruppe (in %)	3.13	3.52	4.40	4.17	4.05
Volatilität Benchmark (in %)	3.02	3.71	4.64	4.35	4.05
Tracking Error ex post (in %)	0.41	0.41	0.50	0.50	0.57
Information Ratio	-1.14	-1.29	-0.28	-0.56	-0.83
Sharpe Ratio	0.62	0.94	0.37	0.68	0.69
Korrelation	0.99	0.99	1.00	0.99	0.99
Beta	1.03	0.94	0.94	0.95	0.99
Jensen-Alpha	-0.54	-0.30	-0.04	-0.13	-0.45
Maximum Drawdown (in %)	-4.81	-4.81	-11.75	-11.75	-14.16
Recovery Period (Jahre)	0.37	0.37	2.34	2.34	0.98

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	2.49%	4.00%	-
Hypotheken Schweiz	6.11%	6.00%	-
Obligationen CHF Inland	22.31%	23.00%	-
Obligationen Fremdwährungen (CHF hedged)	21.23%	23.00%	-
Aktien Schweiz	10.85%	11.00%	-
Aktien Ausland	6.42%	6.00%	-
Aktien Ausland (CHF hedged)	10.28%	8.00%	-
Immobilien Schweiz	16.51%	14.00%	30.00%
Immobilien Ausland (CHF hedged)	2.16%	2.00%	10.00%
Alternative Anlagen (CHF hedged)	1.63%	3.00%	15.00%
Infrastruktur	-	-	-
Total Aktien (In- und Ausland)	27.56%	25.00%	50.00%
Total Fremdwährungen	6.42%	12.00%	30.00%

Grösste Aktienpositionen

NOVARTIS AG-REG	1.36%
NESTLE SA-REG	1.30%
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	1.26%
NVIDIA CORP	0.80%
UBS GROUP AG-REG	0.67%
APPLE INC	0.67%
MICROSOFT CORP	0.64%
ABB LTD-REG	0.62%
ZURICH INSURANCE GROUP AG	0.57%
CIE FINANCIERE RICHEMO-A REG	0.56%

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	93.78%
USD	3.78%
EUR	0.30%
JPY	0.19%
Übrige	1.95%

Eigenschaften der festverzinslichen Anlagen

Modified Duration	5.82
Durchschnittliches Rating	AA-