

30. November 2025

Anlagestiftung Swiss Life BVG-Mix 25

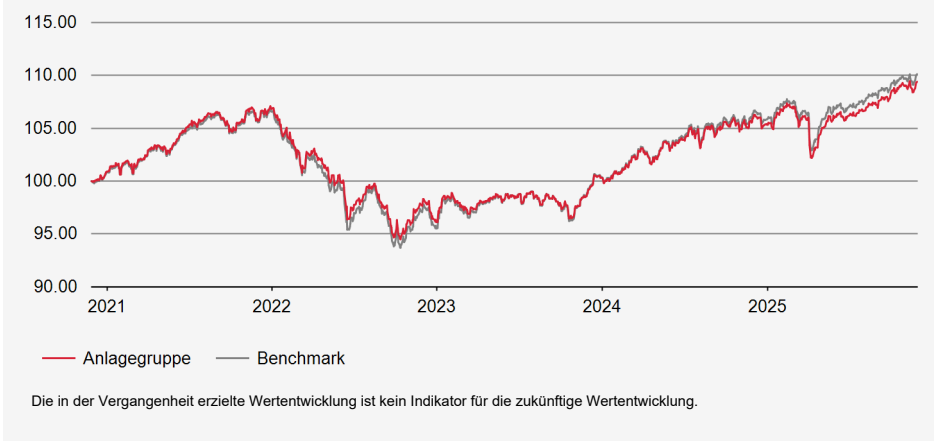


Nettovermögen (NAV) in Mio. CHF: 710.23
Nettovermögen pro Anspruch in CHF: 207.50

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%.

Wertentwicklung in Referenzwährung (Basis 100)



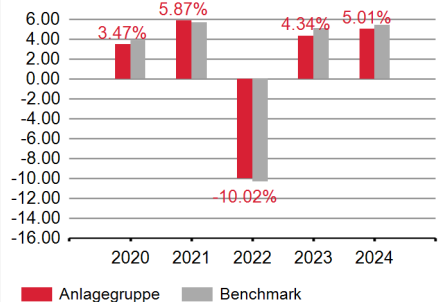
Performance in Referenzwährung

	Kumulierte Performance				Annualisierte Performance			
	YTD	1 Monat	3 Monate	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Aufl.
Anlagegruppe	3.86%	0.37%	2.04%	3.27%	3.75%	1.83%	2.45%	3.07%
Benchmark	4.04%	0.39%	1.81%	3.53%	4.18%	1.97%	2.72%	3.54%

Statistische Angaben (annualisiert)

	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Aufl.
Volatilität Anlagegruppe (in %)	2.82	3.38	4.19	4.12	4.04
Volatilität Benchmark (in %)	2.62	3.56	4.45	4.31	4.03
Tracking Error ex post (in %)	0.41	0.41	0.50	0.49	0.57
Information Ratio	-0.63	-1.05	-0.29	-0.55	-0.82
Sharpe Ratio	1.08	0.80	0.34	0.64	0.70
Korrelation	0.99	0.99	0.99	0.99	0.99
Beta	1.06	0.94	0.94	0.95	0.99
Jensen-Alpha	-0.48	-0.25	-0.05	-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

Performance



Produktinformationen

Valorennummer: 1245601

ISIN: CH0012456015

LEI: 5493000KUC3Z24U77V93

Bloomberg-Code: SWABM25 SW

Benchmark: Customized

Währung: CHF

Domizil: Schweiz

Aufgatedatum: 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: 0.47%

ex post per: 30/09/2025 0.54%

Vorbehalten bleiben abweichende Bestimmungen in den Gebührenordnungen von Freizügigkeitsstiftungen sowie Vorsorgestiftungen 3a.

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	2.42%	4.00%	-
Hypotheken Schweiz	6.12%	6.00%	-
Obligationen CHF Inland	22.23%	23.00%	-
Obligationen Fremdwährungen (CHF hedged)	21.54%	23.00%	-
Aktien Schweiz	11.42%	11.00%	-
Aktien Ausland	5.95%	6.00%	-
Aktien Ausland (CHF hedged)	9.95%	8.00%	-
Immobilien Schweiz	16.59%	14.00%	30.00%
Immobilien Ausland (CHF hedged)	2.12%	2.00%	10.00%
Alternative Anlagen (CHF hedged)	1.66%	3.00%	15.00%
Infrastruktur	-	-	-
Total Aktien (In- und Ausland)	27.32%	25.00%	50.00%
Total Fremdwährungen	5.95%	12.00%	30.00%

Grösste Aktienpositionen

ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	1.47%
NESTLE SA-REG	1.40%
NOVARTIS AG-REG	1.39%
NVIDIA CORP	0.69%
APPLE INC	0.66%
UBS GROUP AG-REG	0.63%
CIE FINANCIERE RICHEMO-A REG	0.62%
ABB LTD-REG	0.62%
ZURICH INSURANCE GROUP AG	0.57%
MICROSOFT CORP	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	94.05%
USD	3.39%
EUR	0.46%
JPY	0.16%
Übrige	1.93%

Eigenschaften der festverzinslichen Anlagen

Modified Duration	0.11
Durchschnittliches Rating	AAA