

31. Oktober 2025

Anlagestiftung Swiss Life BVG-Mix 25



Nettovermögen (NAV) in Mio. CHF: 712.22
Nettovermögen pro Anspruch in CHF: 206.74

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)



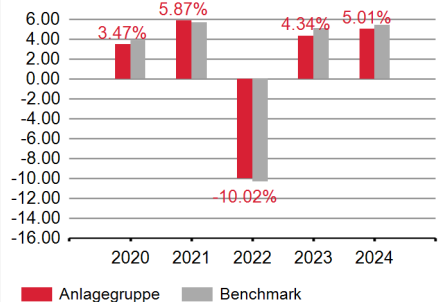
Performance in Referenzwährung

	Kumulierte Performance				Annualisierte Performance			
	YTD	1 Monat	3 Monate	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Aufl.
Anlagegruppe	3.48%	0.86%	2.24%	4.12%	4.21%	2.36%	2.49%	3.06%
Benchmark	3.62%	0.77%	2.07%	4.47%	4.65%	2.49%	2.77%	3.53%

Statistische Angaben (annualisiert)

	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Aufl.
Volatilität Anlagegruppe (in %)	2.96	3.48	4.38	4.12	4.05
Volatilität Benchmark (in %)	2.81	3.65	4.62	4.31	4.04
Tracking Error ex post (in %)	0.43	0.41	0.50	0.50	0.57
Information Ratio	-0.81	-1.07	-0.26	-0.56	-0.82
Sharpe Ratio	1.27	0.90	0.45	0.65	0.69
Korrelation	0.99	0.99	1.00	0.99	0.99
Beta	1.05	0.95	0.94	0.95	0.99
Jensen-Alpha	-0.54	-0.25	-0.01	-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%

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	2.99%	4.00%	-
Hypotheken Schweiz	6.10%	6.00%	-
Obligationen CHF Inland	22.22%	23.00%	-
Obligationen Fremdwährungen (CHF hedged)	21.50%	23.00%	-
Aktien Schweiz	10.97%	11.00%	-
Aktien Ausland	5.95%	6.00%	-
Aktien Ausland (CHF hedged)	9.98%	8.00%	-
Immobilien Schweiz	16.51%	14.00%	30.00%
Immobilien Ausland (CHF hedged)	2.15%	2.00%	10.00%
Alternative Anlagen (CHF hedged)	1.64%	3.00%	15.00%
Infrastruktur	-	-	-
Total Aktien (In- und Ausland)	26.90%	25.00%	50.00%
Total Fremdwährungen	5.95%	12.00%	30.00%

Grösste Aktienpositionen

NESTLE SA-REG	1.34%
NOVARTIS AG-REG	1.32%
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	1.23%
NVIDIA CORP	0.79%
APPLE INC	0.65%
ABB LTD-REG	0.64%
UBS GROUP AG-REG	0.62%
MICROSOFT CORP	0.59%
CIE FINANCIERE RICHEMO-A REG	0.58%
ZURICH INSURANCE GROUP AG	0.55%

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	3.38%
EUR	0.45%
JPY	0.16%
Übrige	1.95%

Eigenschaften der festverzinslichen Anlagen

Modified Duration	5.84
Durchschnittliches Rating	AA-