

30. September 2025

Anlagestiftung Swiss Life BVG-Mix 35

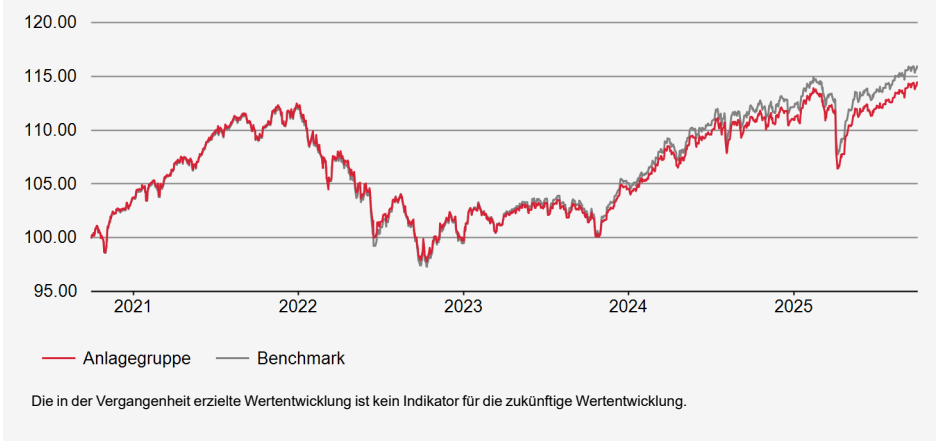


Nettovermögen (NAV) in Mio. CHF: 404.75
Nettovermögen pro Anspruch in CHF: 219.54

Anlagestrategie

Anlagen in alle vom BVG zugelassenen Anlagekategorien (strategischer Aktienanteil: 35%). Aktive Asset Allocation. Begrenzung für Beteiligungspapiere: 45%. Begrenzung für Fremdwährungen: 30%. Durchschnittliche Ratingqualität der Obligationen: mindestens BBB+. Umsetzung mittels Einsatz artreiner Kollektivanlagen. Empfohlene Schwankungsreserven: über 15%.

Wertentwicklung in Referenzwährung (Basis 100)



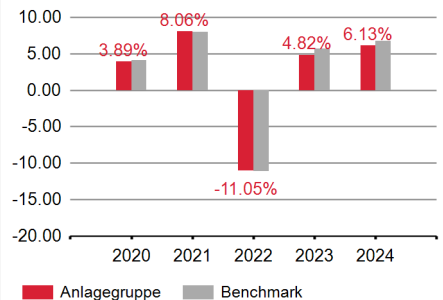
Performance in Referenzwährung

	Kumulierte Performance				Annualisierte Performance			
	YTD	1 Monat	3 Monate	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Aufl.
Anlagegruppe	3.15%	0.91%	2.20%	2.91%	5.23%	2.73%	3.32%	3.33%
Benchmark	3.47%	0.74%	2.13%	3.47%	5.84%	3.00%	3.67%	3.86%

Statistische Angaben (annualisiert)

	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Aufl.
Volatilität Anlagegruppe (in %)	4.17	4.34	5.37	5.08	5.15
Volatilität Benchmark (in %)	3.95	4.48	5.58	5.27	5.14
Tracking Error ex post (in %)	0.47	0.42	0.50	0.55	0.63
Information Ratio	-1.20	-1.45	-0.53	-0.63	-0.85
Sharpe Ratio	0.60	0.95	0.43	0.69	0.59
Korrelation	0.99	1.00	1.00	1.00	0.99
Beta	1.05	0.96	0.96	0.96	1.00
Jensen-Alpha	-0.72	-0.43	-0.16	-0.19	-0.52
Maximum Drawdown (in %)	-6.55	-6.55	-13.03	-13.41	-21.36
Recovery Period (Jahre)	0.42	0.42	2.28	0.65	3.00

Performance



Produktinformationen

Valorennummer: 1245606

ISIN: CH0012456064

LEI: 254900SR5GM6HP44F130

Bloomberg-Code: SWABM35 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 0.57%

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	3.35%	4.00%	-
Hypotheken Schweiz	4.59%	5.00%	-
Obligationen CHF Inland	18.73%	19.00%	-
Obligationen Fremdwährungen (CHF hedged)	18.78%	20.00%	-
Aktien Schweiz	14.67%	15.00%	-
Aktien Ausland	8.21%	8.00%	-
Aktien Ausland (CHF hedged)	14.53%	12.00%	-
Immobilien Schweiz	13.41%	12.00%	30.00%
Immobilien Ausland (CHF hedged)	1.94%	2.00%	10.00%
Alternative Anlagen (CHF hedged)	1.79%	3.00%	15.00%
Infrastruktur	-	-	-
Total Aktien (In- und Ausland)	37.41%	35.00%	50.00%
Total Fremdwährungen	8.21%	17.00%	30.00%

Grösste Aktienpositionen

NOVARTIS AG-REG	1.83%
NESTLE SA-REG	1.76%
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	1.70%
NVIDIA CORP	1.09%
APPLE INC	0.91%
UBS GROUP AG-REG	0.90%
MICROSOFT CORP	0.87%
ABB LTD-REG	0.84%
ZURICH INSURANCE GROUP AG	0.77%
CIE FINANCIERE RICHEMO-A REG	0.76%

Benchmarkzusammensetzung

1M Saron	4.00%
SBI Domestic AAA-A 1-3Y Total Return	5.00%
SBI AAA-BBB Total Return	19.00%
Bloomberg Gl. Agg. Treas. ex CH (CHF hedged)	8.00%
Bloomberg Gl. Agg. Corp. (CHF hedged)	3.00%
Bloomberg Gl. Agg. Corp. Short Term (CHF hedged)	2.00%
JP Morgan CEMBI Broad Diversified IG Index (CHF hedged)	7.00%
SPi® Total Return	15.00%
MSCI World ex Switzerland Net Return	8.00%
MSCI World ex Switzerland Net Return (CHF hedged)	12.00%
KGAST Immo-Index	12.00%
SL REF (LUX) ESG German Core Real Estate (CHF hedged)	1.50%
Anlagestiftung Swiss Life Immobilien Europa Industrie und Logistik ESG (EUR), CHF hedged	0.50%
HFRX Global Hedge Funds (CHF hedged)	3.00%
Anlagestiftung Swiss Life Infrastruktur Global ESG (EUR)	-

Portfoliostruktur nach Währungen

CHF	91.99%
USD	4.81%
EUR	0.37%
JPY	0.24%
Übrige	2.59%

Eigenschaften der festverzinslichen Anlagen

Modified Duration	5.77
Durchschnittliches Rating	A+