

31. Oktober 2025

Anlagestiftung Swiss Life BVG-Mix 35

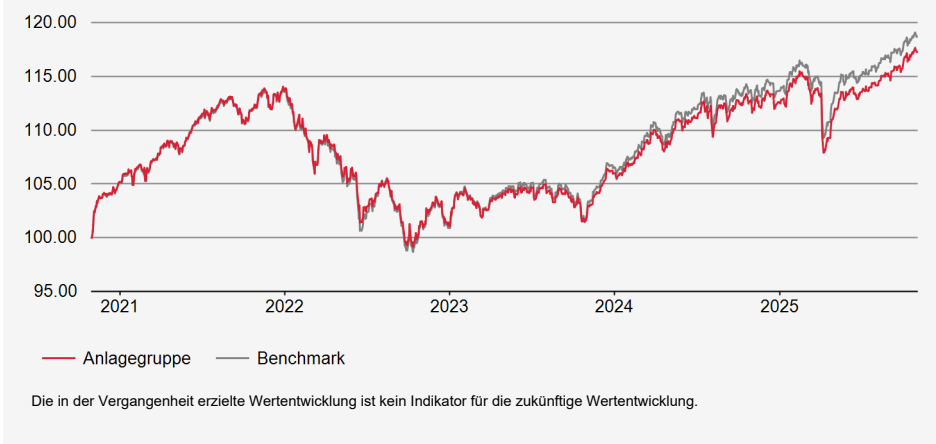


Nettovermögen (NAV) in Mio. CHF: 405.66
Nettovermögen pro Anspruch in CHF: 221.80

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)



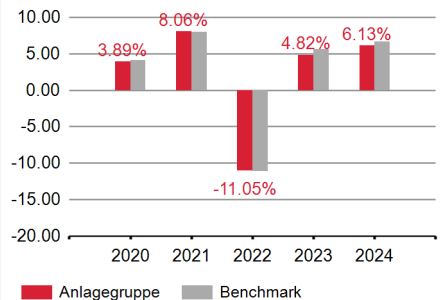
Performance in Referenzwährung

	Kumulierte Performance				Annualisierte Performance			
	YTD	1 Monat	3 Monate	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Aufl.
Anlagegruppe	4.21%	1.03%	2.69%	5.05%	4.91%	3.23%	3.14%	3.36%
Benchmark	4.43%	0.93%	2.52%	5.45%	5.39%	3.48%	3.48%	3.89%

Statistische Angaben (annualisiert)

	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Aufl.
Volatilität Anlagegruppe (in %)	3.99	4.26	5.34	5.02	5.15
Volatilität Benchmark (in %)	3.75	4.37	5.54	5.22	5.14
Tracking Error ex post (in %)	0.49	0.41	0.51	0.55	0.63
Information Ratio	-0.81	-1.19	-0.50	-0.62	-0.84
Sharpe Ratio	1.17	0.89	0.53	0.66	0.60
Korrelation	0.99	1.00	1.00	0.99	0.99
Beta	1.06	0.97	0.96	0.96	1.00
Jensen-Alpha	-0.70	-0.35	-0.13	-0.19	-0.51
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

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: 0.48%

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	3.02%	4.00%	-
Hypotheken Schweiz	4.58%	5.00%	-
Obligationen CHF Inland	18.38%	19.00%	-
Obligationen Fremdwährungen (CHF hedged)	20.02%	20.00%	-
Aktien Schweiz	14.75%	15.00%	-
Aktien Ausland	8.08%	8.00%	-
Aktien Ausland (CHF hedged)	14.00%	12.00%	-
Immobilien Schweiz	13.44%	12.00%	30.00%
Immobilien Ausland (CHF hedged)	1.94%	2.00%	10.00%
Alternative Anlagen (CHF hedged)	1.80%	3.00%	15.00%
Infrastruktur	-	-	-
Total Aktien (In- und Ausland)	36.83%	35.00%	50.00%
Total Fremdwährungen	8.08%	17.00%	30.00%

Grösste Aktienpositionen

NESTLE SA-REG	1.80%
NOVARTIS AG-REG	1.77%
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	1.66%
NVIDIA CORP	1.11%
APPLE INC	0.90%
ABB LTD-REG	0.86%
UBS GROUP AG-REG	0.83%
MICROSOFT CORP	0.82%
CIE FINANCIERE RICHEMO-A REG	0.78%
ZURICH INSURANCE GROUP AG	0.74%

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	91.92%
USD	4.65%
EUR	0.54%
JPY	0.22%
Übrige	2.66%

Eigenschaften der festverzinslichen Anlagen

Modified Duration	5.77
Durchschnittliches Rating	A+