

30. September 2025

Anlagestiftung Swiss Life BVG-Mix 45

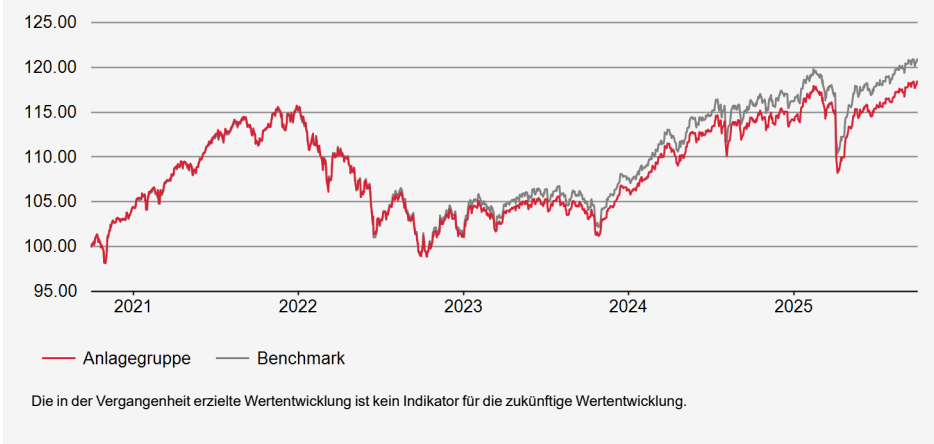


Nettovermögen (NAV) in Mio. CHF: 846.90
Nettovermögen pro Anspruch in CHF: 231.27

Anlagestrategie

Anlagen in alle vom BVG zugelassenen Anlagekategorien (strategischer Aktienanteil: 45%). Aktive Asset Allocation. Begrenzung für Beteiligungspapiere: 50%. Begrenzung für Fremdwährungen: 30%. Durchschnittliche Ratingqualität der Obligationen: mindestens BBB+. Umsetzung mittels Einsatz artreiner Kollektivanlagen. Empfohlene Schwankungsreserven: über 20%.

Wertentwicklung in Referenzwährung (Basis 100)



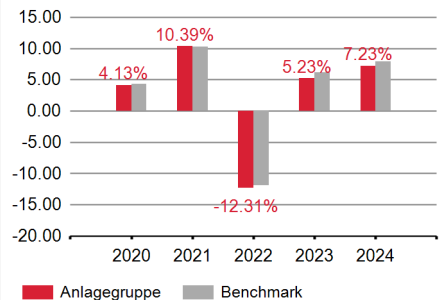
Performance in Referenzwährung

	Kumulierte Performance				Annualisierte Performance			
	YTD	1 Monat	3 Monate	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Aufl.
Anlagegruppe	3.83%	1.06%	2.63%	3.57%	6.07%	3.44%	3.96%	3.55%
Benchmark	4.13%	0.87%	2.56%	4.18%	6.77%	3.87%	4.42%	4.20%

Statistische Angaben (annualisiert)

	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Aufl.
Volatilität Anlagegruppe (in %)	5.18	5.20	6.43	6.15	6.38
Volatilität Benchmark (in %)	4.92	5.31	6.58	6.28	6.36
Tracking Error ex post (in %)	0.49	0.43	0.49	0.53	0.66
Information Ratio	-1.24	-1.61	-0.87	-0.85	-0.97
Sharpe Ratio	0.61	0.94	0.47	0.67	0.51
Korrelation	1.00	1.00	1.00	1.00	0.99
Beta	1.05	0.97	0.98	0.98	1.00
Jensen-Alpha	-0.80	-0.56	-0.34	-0.35	-0.64
Maximum Drawdown (in %)	-8.21	-8.21	-14.55	-16.22	-28.27
Recovery Period (Jahre)	0.43	0.43	2.28	0.67	3.76

Performance



Produktinformationen

Valorennummer: 1245607

ISIN: CH0012456072

LEI: 2549001XL79VZWJO5Q69

Bloomberg-Code: SWABM45 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%

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	3.00%	4.00%	-
Hypotheken Schweiz	3.56%	4.00%	-
Obligationen CHF Inland	15.02%	16.00%	-
Obligationen Fremdwährungen (CHF hedged)	16.37%	16.00%	-
Aktien Schweiz	17.69%	18.00%	-
Aktien Ausland	10.22%	10.00%	-
Aktien Ausland (CHF hedged)	19.45%	17.00%	-
Immobilien Schweiz	10.63%	10.00%	30.00%
Immobilien Ausland (CHF hedged)	1.96%	2.00%	10.00%
Alternative Anlagen (CHF hedged)	2.10%	3.00%	15.00%
Infrastruktur	-	-	-
Total Aktien (In- und Ausland)	47.36%	45.00%	50.00%
Total Fremdwährungen	10.22%	22.00%	30.00%

Grösste Aktienpositionen

NOVARTIS AG-REG	2.21%
NESTLE SA-REG	2.12%
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	2.05%
NVIDIA CORP	1.43%
APPLE INC	1.19%
MICROSOFT CORP	1.15%
UBS GROUP AG-REG	1.09%
ABB LTD-REG	1.02%
ZURICH INSURANCE GROUP AG	0.93%
CIE FINANCIERE RICHEMO-A REG	0.92%

Benchmarkzusammensetzung

1M Saron	4.00%
SBI Domestic AAA-A 1-3Y Total Return	4.00%
SBI AAA-BBB Total Return	16.00%
Bloomberg Gl. Agg. Treas. ex CH (CHF hedged)	6.00%
Bloomberg Gl. Agg. Corp. (CHF hedged)	2.00%
Bloomberg Gl. Agg. Corp. Short Term (CHF hedged)	2.00%
JP Morgan CEMBI Broad Diversified IG Index (CHF hedged)	6.00%
SPI® Total Return	18.00%
MSCI World ex Switzerland Net Return	10.00%
MSCI World ex Switzerland Net Return (CHF hedged)	17.00%
KGAST Immo-Index	10.00%
SL REF (LUX) ESG German Core Real Estate (CHF hedged)	1.20%
Anlagestiftung Swiss Life Immobilien Europa Industrie und Logistik ESG (EUR), CHF hedged	0.80%
HFRX Global Hedge Funds (CHF hedged)	3.00%
Anlagestiftung Swiss Life Infrastruktur Global ESG (EUR)	-

Portfoliostruktur nach Währungen

CHF	89.98%
USD	5.84%
EUR	0.46%
JPY	0.29%
Übrige	3.44%

Eigenschaften der festverzinslichen Anlagen

Modified Duration	5.68
Durchschnittliches Rating	A+