

Anlagestiftung Swiss Life

BVG-Mix 45



SwissLife

Nettovermögen (NAV) in Mio. CHF: 876.27
Nettovermögen pro Anspruch in CHF: 235.50

Anlagestrategie

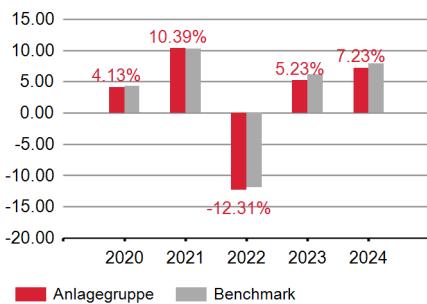
Anlagen in alle vom BVG zugelassenen Anlagekategorien (strategischer Aktienanteil: 45%). Aktive Asset Allocation. Begrenzung für Beteiligungspapiere: 50%. Begrenzung für Fremdwährungen: 30%. Durchschnittliche Ratingqualität der Obligationen: mindestens BBB+. Umsetzung mittels Einsatz artreiner Kollektivanlagen.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

Wertentwicklung in Referenzwährung (Basis 100)



Die in der Vergangenheit erzielte Wertentwicklung ist kein Indikator für die zukünftige Wertentwicklung.

Performance



Performance in Referenzwährung

	Kumulierte Performance				Annualisierte Performance			
	YTD	1 Monat	3 Monate	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Aufl.
Anlagegruppe	5.73%	0.61%	2.91%	4.97%	5.13%	3.20%	3.67%	3.61%
Benchmark	6.01%	0.68%	2.69%	5.37%	5.70%	3.63%	4.12%	4.25%

Statistische Angaben (annualisiert)

	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Aufl.
Volatilität Anlagegruppe (in %)	4.82	5.00	6.03	6.06	6.36
Volatilität Benchmark (in %)	4.54	5.07	6.20	6.20	6.34
Tracking Error ex post (in %)	0.51	0.41	0.49	0.53	0.66
Information Ratio	-0.80	-1.37	-0.87	-0.84	-0.96
Sharpe Ratio	0.97	0.81	0.46	0.63	0.52
Korrelation	1.00	1.00	1.00	1.00	0.99
Beta	1.06	0.98	0.97	0.97	1.00
Jensen-Alpha	-0.71	-0.48	-0.34	-0.34	-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

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: Gesamttrag 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.

Produktinformationen

Valorennummer: 1245607

ISIN: CH0012456072

LEI: 2549001XL79VZWJO5Q69

Bloomberg-Code: SWABM45 SW

Benchmark: Customized

Währung: CHF

Domizil: Schweiz

Auflagedatum: 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 0.53%

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

Anlagestiftung Swiss Life

BVG-Mix 45

Portfoliostruktur nach Anlagekategorien

	Anlagegruppe	Benchmark	max. BVV2
Liquidität	2.46%	4.00%	-
Hypotheken Schweiz	3.45%	4.00%	-
Obligationen CHF Inland	15.04%	16.00%	-
Obligationen Fremdwährungen (CHF hedged)	17.29%	16.00%	-
Aktien Schweiz	18.43%	18.00%	-
Aktien Ausland	9.81%	10.00%	-
Aktien Ausland (CHF hedged)	18.82%	17.00%	-
Immobilien Schweiz	10.77%	10.00%	30.00%
Immobilien Ausland (CHF hedged)	1.86%	2.00%	10.00%
Alternative Anlagen (CHF hedged)	2.07%	3.00%	15.00%
Infrastruktur	-	-	-
Total Aktien (In- und Ausland)	47.07%	45.00%	50.00%
Total Fremdwährungen	9.81%	22.00%	30.00%

Grösste Aktienpositionen

ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	2.36%
NESTLE SA-REG	2.25%
NOVARTIS AG-REG	2.25%
NVIDIA CORP	1.28%
APPLE INC	1.23%
MICROSOFT CORP	1.03%
UBS GROUP AG-REG	1.01%
CIE FINANCIERE RICHEMO-A REG	1.00%
ABB LTD-REG	1.00%
ZURICH INSURANCE GROUP AG	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	90.19%
USD	5.76%
EUR	0.64%
JPY	0.29%
Übrige	3.12%

Eigenschaften der festverzinslichen Anlagen

Modified Duration	0.31
Durchschnittliches Rating	AAA