

31. Oktober 2025

Anlagestiftung Swiss Life BVG-Mix 45

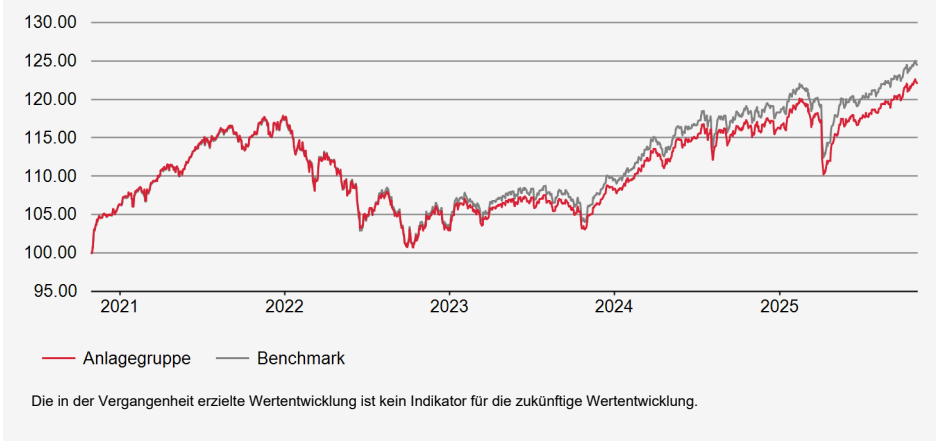


Nettovermögen (NAV) in Mio. CHF: 871.53
Nettovermögen pro Anspruch in CHF: 234.08

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)



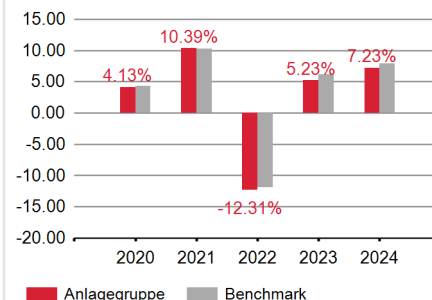
Performance in Referenzwährung

	Kumulierte Performance				Annualisierte Performance			
	YTD	1 Monat	3 Monate	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Aufl.
Anlagegruppe	5.09%	1.22%	3.16%	6.09%	5.61%	4.07%	3.73%	3.59%
Benchmark	5.28%	1.11%	2.97%	6.48%	6.16%	4.48%	4.18%	4.23%

Statistische Angaben (annualisiert)

	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Aufl.
Volatilität Anlagegruppe (in %)	4.99	5.08	6.37	6.07	6.38
Volatilität Benchmark (in %)	4.71	5.15	6.51	6.21	6.35
Tracking Error ex post (in %)	0.51	0.41	0.50	0.53	0.66
Information Ratio	-0.77	-1.32	-0.83	-0.85	-0.96
Sharpe Ratio	1.13	0.88	0.57	0.64	0.52
Korrelation	1.00	1.00	1.00	1.00	0.99
Beta	1.05	0.98	0.98	0.97	1.00
Jensen-Alpha	-0.73	-0.46	-0.31	-0.34	-0.63
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: 0.47%
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	2.76%	4.00%	-
Hypotheken Schweiz	3.46%	4.00%	-
Obligationen CHF Inland	15.50%	16.00%	-
Obligationen Fremdwährungen (CHF hedged)	17.22%	16.00%	-
Aktien Schweiz	17.71%	18.00%	-
Aktien Ausland	10.04%	10.00%	-
Aktien Ausland (CHF hedged)	18.98%	17.00%	-
Immobilien Schweiz	10.35%	10.00%	30.00%
Immobilien Ausland (CHF hedged)	1.90%	2.00%	10.00%
Alternative Anlagen (CHF hedged)	2.06%	3.00%	15.00%
Infrastruktur	-	-	-
Total Aktien (In- und Ausland)	46.74%	45.00%	50.00%
Total Fremdwährungen	10.04%	22.00%	30.00%

Grösste Aktienpositionen

NESTLE SA-REG	2.17%
NOVARTIS AG-REG	2.13%
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	1.99%
NVIDIA CORP	1.47%
APPLE INC	1.20%
MICROSOFT CORP	1.09%
ABB LTD-REG	1.03%
UBS GROUP AG-REG	1.00%
CIE FINANCIERE RICHEMO-A REG	0.93%
ZURICH INSURANCE GROUP AG	0.89%

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	89.96%
USD	5.68%
EUR	0.62%
JPY	0.28%
Übrige	3.47%

Eigenschaften der festverzinslichen Anlagen

Modified Duration	5.65
Durchschnittliches Rating	A+