

30. September 2025

Anlagestiftung Swiss Life BVG-Mix 75

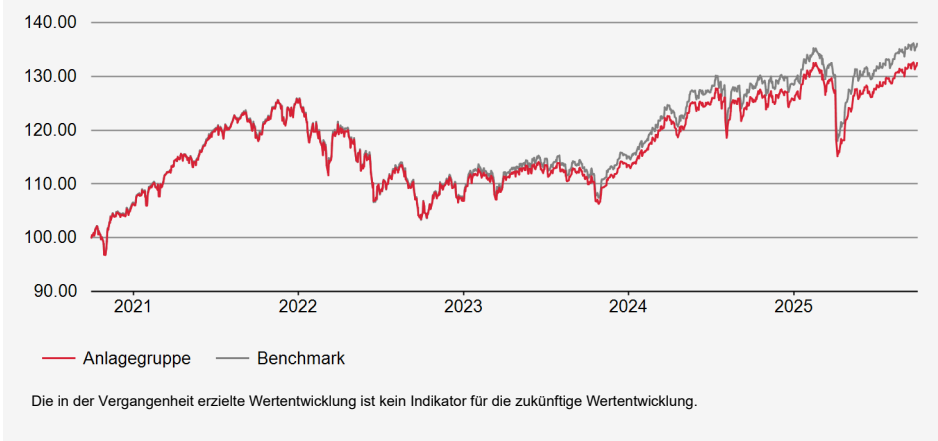
(Aktien- und Fremdwährungsquote gemäss BVV2 überschritten)

Nettovermögen (NAV) in Mio. CHF: 418.67
Nettovermögen pro Anspruch in CHF: 147.88

Anlagestrategie

Anlagen in alle vom BVG zugelassenen Anlagekategorien (strategischer Aktienanteil: 75%). Aktive Asset Allocation. Begrenzung für Beteiligungspapiere: 85%. Begrenzung für Fremdwährungen: 50%. Durchschnittliche Ratingqualität der Obligationen: mindestens BBB. Umsetzung mittels Einsatz artreiner Kollektivanlagen. Aufgrund des erhöhten Aktien- und Fremdwährungsanteils beinhaltet diese Anlagegruppe ein höheres Risiko im Vergleich zu einem BVG-Mix mit maximal 50% Aktien- bzw. maximal 30% Fremdwährungsanteil.

Wertentwicklung in Referenzwährung (Basis 100)



Performance in Referenzwährung

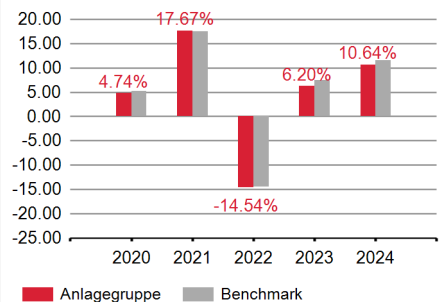
	Kumulierte Performance				Annualisierte Performance			
	YTD	1 Monat	3 Monate	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Aufl.
Anlagegruppe	5.52%	1.39%	3.80%	5.27%	8.47%	5.79%	-	5.82%
Benchmark	5.96%	1.20%	3.76%	5.98%	9.45%	6.35%	-	6.40%

Statistische Angaben (annualisiert)

	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Aufl.
Volatilität Anlagegruppe (in %)	8.26	7.84	9.54	-	10.11
Volatilität Benchmark (in %)	7.94	7.97	9.74	-	10.48
Tracking Error ex post (in %)	0.52	0.48	0.60	-	0.77
Information Ratio	-1.36	-2.05	-0.94	-	-0.76
Sharpe Ratio	0.58	0.91	0.55	-	0.55
Korrelation	1.00	1.00	1.00	-	1.00
Beta	1.04	0.98	0.98	-	0.96
Jensen-Alpha	-0.93	-0.83	-0.43	-	-0.35
Maximum Drawdown (in %)	-13.10	-13.10	-17.76	-	-23.54
Recovery Period (Jahre)	0.46	0.46	1.76	-	0.74



Performance



Produktinformationen

Valorennummer: 43583002

ISIN: CH0435830028

LEI: 2549007MI5RG5X8NMB06

Bloomberg-Code: SWABM75 SW

Benchmark: Customized

Währung: CHF

Domizil: Schweiz

Auflagedatum: 31/10/2018

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 0.61%

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.

Anlagestiftung Swiss Life BVG-Mix 75



(Aktien- und Fremdwährungsquote gemäss BVV2 überschritten)

Portfoliostruktur nach Anlagekategorien

	Anlagegruppe	Benchmark	max. BVV2
Liquidität	2.58%	4.00%	-
Hypotheken Schweiz	1.12%	1.50%	-
Obligationen CHF Inland	3.16%	4.50%	-
Obligationen Fremdwährungen (CHF hedged)	5.54%	4.00%	-
Aktien Schweiz	28.08%	29.00%	-
Aktien Ausland	17.49%	17.00%	-
Aktien Ausland (CHF hedged)	31.49%	29.00%	-
Immobilien Schweiz	7.07%	6.50%	30.00%
Immobilien Ausland (CHF hedged)	1.61%	1.50%	10.00%
Alternative Anlagen (CHF hedged)	1.86%	3.00%	15.00%
Infrastruktur	-	-	-
Total Aktien (In- und Ausland)	77.06%	75.00%	50.00%
Total Fremdwährungen	17.49%	37.00%	30.00%

Grösste Aktienpositionen

NOVARTIS AG-REG	3.51%
NESTLE SA-REG	3.36%
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	3.26%
NVIDIA CORP	2.39%
APPLE INC	2.00%
MICROSOFT CORP	1.92%
UBS GROUP AG-REG	1.73%
ABB LTD-REG	1.61%
ZURICH INSURANCE GROUP AG	1.48%
CIE FINANCIERE RICHEMO-A REG	1.45%

Benchmarkzusammensetzung

1M Saron	4.00%
SBI Domestic AAA-A 1-3Y Total Return	1.50%
SBI AAA-BBB Total Return	4.50%
Bloomberg Gl. Agg. Treas. ex CH (CHF hedged)	1.00%
Bloomberg Gl. Agg. Corp. (CHF hedged)	1.00%
Bloomberg Gl. Agg. Corp. Short Term (CHF hedged)	-
JP Morgan CEMBI Broad Diversified IG Index (CHF hedged)	2.00%
SPI® Total Return	29.00%
MSCI World ex Switzerland Net Return	17.00%
MSCI World ex Switzerland Net Return (CHF hedged)	29.00%
KGAST Immo-Index	6.50%
SL REF (LUX) ESG German Core Real Estate (CHF hedged)	1.30%
Anlagestiftung Swiss Life Immobilien Europa Industrie und Logistik ESG (EUR), CHF hedged	0.20%
HFRX Global Hedge Funds (CHF hedged)	3.00%
Anlagestiftung Swiss Life Infrastruktur Global ESG (EUR)	-

Portfoliostruktur nach Währungen

CHF	82.81%
USD	10.31%
EUR	0.86%
JPY	0.55%
Übrige	5.47%

Eigenschaften der festverzinslichen Anlagen

Modified Duration	5.50
Durchschnittliches Rating	A+