

31. Oktober 2025

Anlagestiftung Swiss Life BVG-Mix 75

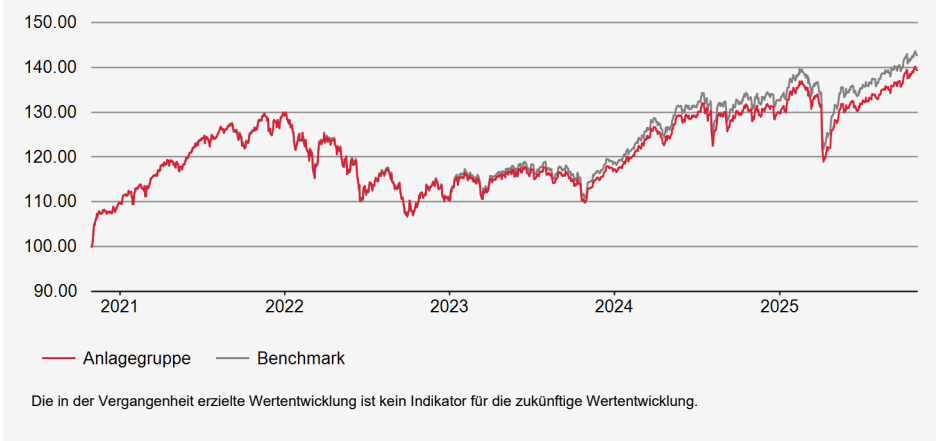
(Aktien- und Fremdwährungsquote gemäss BVV2 überschritten)

Nettovermögen (NAV) in Mio. CHF: 438.03
Nettovermögen pro Anspruch in CHF: 150.51

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

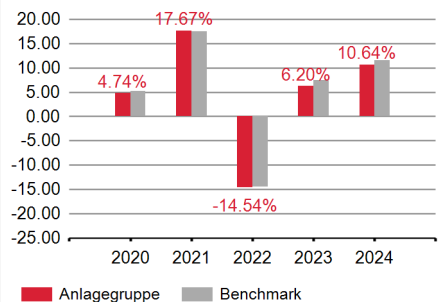
	Kumulierte Performance				Annualisierte Performance			
	YTD	1 Monat	3 Monate	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Aufl.
Anlagegruppe	7.39%	1.78%	4.46%	8.89%	7.54%	6.85%	-	6.01%
Benchmark	7.69%	1.63%	4.29%	9.35%	8.36%	7.36%	-	6.56%

Statistische Angaben (annualisiert)

	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Aufl.
Volatilität Anlagegruppe (in %)	8.03	7.56	9.41	-	10.06
Volatilität Benchmark (in %)	7.70	7.65	9.61	-	10.42
Tracking Error ex post (in %)	0.56	0.48	0.60	-	0.77
Information Ratio	-0.82	-1.71	-0.85	-	-0.72
Sharpe Ratio	1.03	0.83	0.67	-	0.58
Korrelation	1.00	1.00	1.00	-	1.00
Beta	1.04	0.99	0.98	-	0.96
Jensen-Alpha	-0.84	-0.72	-0.36	-	-0.31
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: 0.47%

ex post per: 30/09/2025 0.55%

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	3.05%	4.00%	-
Hypotheken Schweiz	1.07%	1.50%	-
Obligationen CHF Inland	3.03%	4.50%	-
Obligationen Fremdwährungen (CHF hedged)	5.74%	4.00%	-
Aktien Schweiz	28.52%	29.00%	-
Aktien Ausland	17.19%	17.00%	-
Aktien Ausland (CHF hedged)	31.27%	29.00%	-
Immobilien Schweiz	6.79%	6.50%	30.00%
Immobilien Ausland (CHF hedged)	1.54%	1.50%	10.00%
Alternative Anlagen (CHF hedged)	1.80%	3.00%	15.00%
Infrastruktur	-	-	-
Total Aktien (In- und Ausland)	76.97%	75.00%	50.00%
Total Fremdwährungen	17.19%	37.00%	30.00%

Grösste Aktienpositionen

NESTLE SA-REG	3.49%
NOVARTIS AG-REG	3.43%
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	3.20%
NVIDIA CORP	2.53%
APPLE INC	2.07%
MICROSOFT CORP	1.87%
ABB LTD-REG	1.66%
UBS GROUP AG-REG	1.61%
CIE FINANCIERE RICHEMO-A REG	1.50%
ZURICH INSURANCE GROUP AG	1.44%

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	82.82%
USD	10.32%
EUR	1.14%
JPY	0.55%
Übrige	5.18%

Eigenschaften der festverzinslichen Anlagen

Modified Duration	5.59
Durchschnittliches Rating	A+