

30. April 2026

Anlagestiftung Swiss Life BVG-Mix 45

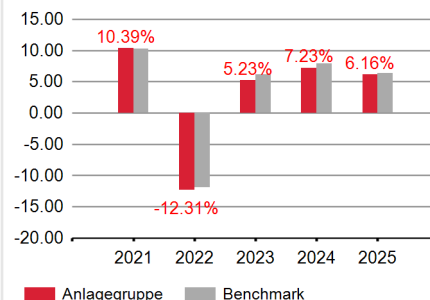


Nettovermögen (NAV) in Mio. CHF: 892.89
Nettovermögen pro Anspruch in CHF: 240.97

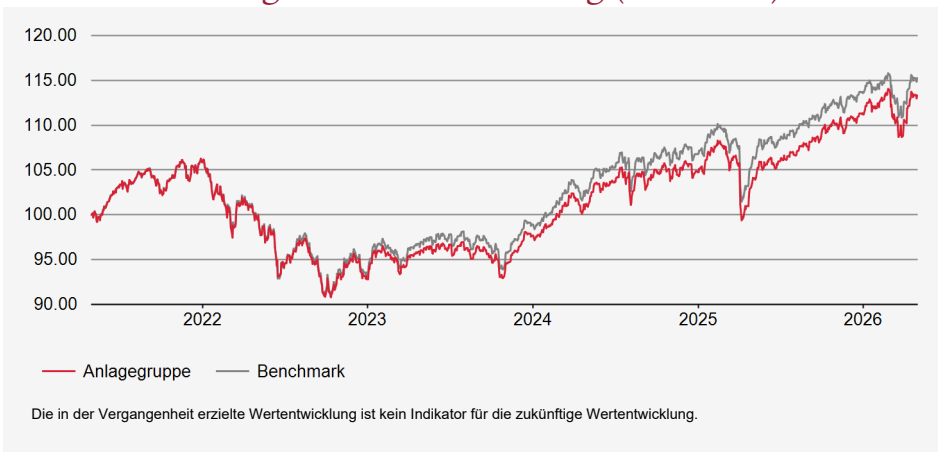
Anlagestrategie

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%.

Performance



Wertentwicklung in Referenzwährung (Basis 100)



Produktinformationen

Valorennummer: 1245607
ISIN: CH0012456072
LEI: 2549001XL79VZWJO5Q69
Bloomberg-Code: SWABM45 SW
Benchmark: Customized
Währung: CHF
Domizil: Schweiz
Aufgatedatum: 30/09/2001
Erstausgabepreis: 100.00
Jahresabschluss: 30.09
Ausgabe/Rücknahme: Täglich
Annahmeschluss: 12:00 Uhr
Verwässerungsschutz: Ausgabe- / Rücknahmekommission zugunsten der Anlagegruppe gemäss Konditionenübersicht.

Performance in Referenzwährung

	Kumulierte Performance				Annualisierte Performance			
	YTD	1 Monat	3 Monate	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Aufl.
Anlagegruppe	1.91%	3.30%	1.27%	9.52%	5.65%	2.53%	4.19%	3.64%
Benchmark	1.47%	2.93%	1.08%	9.00%	5.91%	2.88%	4.56%	4.25%

Statistische Angaben (annualisiert)

	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Aufl.
Volatilität Anlagegruppe (in %)	5.76	5.28	6.34	6.19	6.40
Volatilität Benchmark (in %)	5.04	5.02	6.37	6.28	6.35
Tracking Error ex post (in %)	0.88	0.60	0.62	0.58	0.68
Information Ratio	0.59	-0.43	-0.56	-0.63	-0.90
Sharpe Ratio	1.58	0.89	0.33	0.69	0.53
Korrelation	1.00	0.99	1.00	1.00	0.99
Beta	1.14	1.05	0.99	0.98	1.00
Jensen-Alpha	-0.72	-0.50	-0.32	-0.29	-0.62
Maximum Drawdown (in %)	-4.71	-8.21	-14.55	-16.22	-28.27
Recovery Period (Jahre)	-	0.43	2.28	0.67	3.76

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: 30/09/2025 0.53%

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	3.72%	4.00%	-
Hypotheken Schweiz	3.38%	4.00%	-
Obligationen CHF Inland	12.42%	16.00%	-
Obligationen Fremdwährungen (CHF hedged)	15.49%	16.00%	-
Aktien Schweiz	18.98%	18.00%	-
Aktien Ausland	11.41%	10.00%	-
Aktien Ausland (CHF hedged)	17.98%	17.00%	-
Immobilien Schweiz	12.32%	10.00%	30.00%
Immobilien Ausland (CHF hedged)	1.80%	2.00%	10.00%
Alternative Anlagen (CHF hedged)	2.50%	3.00%	15.00%
Infrastruktur	-	-	-
Total Aktien (In- und Ausland)	48.37%	45.00%	50.00%
Total Fremdwährungen	11.41%	22.00%	30.00%

Grösste Aktienpositionen

NOVARTIS AG-REG	2.55%
ROCHE HOLDING AG	2.51%
NESTLE SA-REG	2.28%
ABB LTD-REG	1.39%
NVIDIA CORP	1.28%
UBS GROUP AG-REG	1.19%
APPLE INC	1.05%
ZURICH INSURANCE GROUP AG	0.94%
CIE FINANCIERE RICHEMO-A REG	0.89%
MICROSOFT CORP	0.76%

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	88.59%
USD	6.04%
JPY	1.01%
EUR	0.89%
Übrige	3.47%

Eigenschaften der festverzinslichen Anlagen

Modified Duration	5.46
Durchschnittliches Rating	A+