

31. Mai 2026

Anlagestiftung Swiss Life BVG-Mix 45

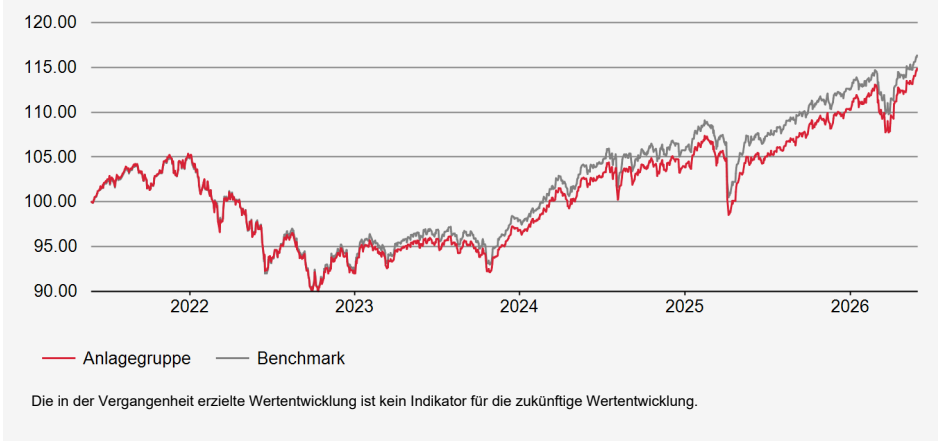


Nettovermögen (NAV) in Mio. CHF: 912.42
Nettovermögen pro Anspruch in CHF: 246.31

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)



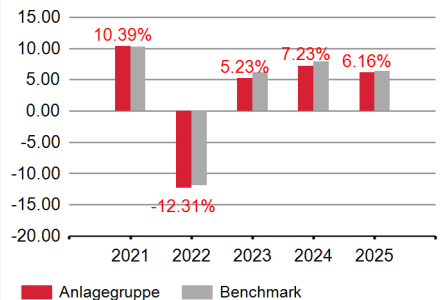
Performance in Referenzwährung

	Kumulierte Performance				Annualisierte Performance			
	YTD	1 Monat	3 Monate	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Aufl.
Anlagegruppe	4.17%	2.22%	1.65%	9.66%	6.50%	2.83%	4.22%	3.72%
Benchmark	3.40%	1.90%	1.56%	8.77%	6.61%	3.10%	4.56%	4.32%

Statistische Angaben (annualisiert)

	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Aufl.
Volatilität Anlagegruppe (in %)	5.79	5.36	6.39	6.19	6.40
Volatilität Benchmark (in %)	4.98	5.07	6.41	6.27	6.35
Tracking Error ex post (in %)	0.92	0.63	0.64	0.59	0.68
Information Ratio	0.97	-0.17	-0.43	-0.57	-0.87
Sharpe Ratio	1.60	1.03	0.37	0.70	0.54
Korrelation	1.00	0.99	1.00	1.00	0.99
Beta	1.16	1.05	0.99	0.98	1.00
Jensen-Alpha	-0.51	-0.41	-0.25	-0.26	-0.61
Maximum Drawdown (in %)	-4.71	-8.21	-14.55	-16.22	-28.27
Recovery Period (Jahre)	0.11	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

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: 0.50%

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	3.14%	4.00%	-
Hypotheken Schweiz	3.31%	4.00%	-
Obligationen CHF Inland	12.15%	16.00%	-
Obligationen Fremdwährungen (CHF hedged)	15.67%	16.00%	-
Aktien Schweiz	19.19%	18.00%	-
Aktien Ausland	11.78%	10.00%	-
Aktien Ausland (CHF hedged)	18.39%	17.00%	-
Immobilien Schweiz	12.08%	10.00%	30.00%
Immobilien Ausland (CHF hedged)	1.77%	2.00%	10.00%
Alternative Anlagen (CHF hedged)	2.51%	3.00%	15.00%
Infrastruktur	-	-	-
Total Aktien (In- und Ausland)	49.36%	45.00%	50.00%
Total Fremdwährungen	11.78%	22.00%	30.00%

Grösste Aktienpositionen

NVIDIA CORP	1.27%
APPLE INC	1.20%
MICROSOFT CORP	0.83%
AMAZON.COM INC	0.68%
ALPHABET INC-CL A	0.58%
BROADCOM INC	0.52%
ALPHABET INC-CL C	0.45%
META PLATFORMS INC-CLASS A	0.36%
TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	0.34%
TESLA INC	0.32%

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	88.22%
USD	7.83%
EUR	0.90%
JPY	0.26%
Übrige	2.78%

Eigenschaften der festverzinslichen Anlagen

Modified Duration	5.47
Durchschnittliches Rating	A+