

31. Juli 2026

Anlagestiftung Swiss Life BVG-Mix 45

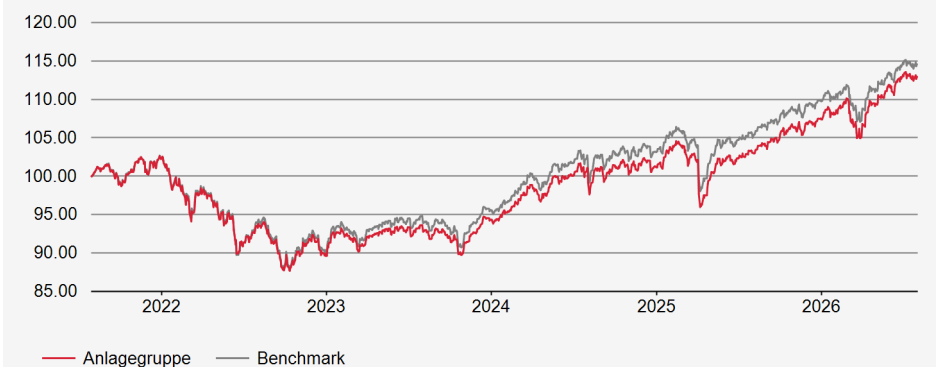


Nettovermögen (NAV) in Mio. CHF: 917.00
Nettovermögen pro Anspruch in CHF: 248.68

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)



Die in der Vergangenheit erzielte Wertentwicklung ist kein Indikator für die zukünftige Wertentwicklung.

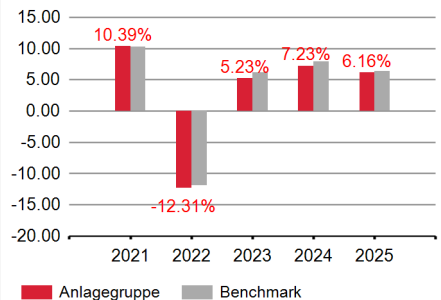
Performance in Referenzwährung

	Kumulierte Performance				Annualisierte Performance			
	YTD	1 Monat	3 Monate	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Aufl.
Anlagegruppe	5.17%	-0.23%	3.20%	9.59%	6.44%	2.46%	4.22%	3.73%
Benchmark	4.39%	-0.19%	2.88%	8.65%	6.52%	2.76%	4.57%	4.33%

Statistische Angaben (annualisiert)

	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Aufl.
Volatilität Anlagegruppe (in %)	5.89	5.39	6.34	6.19	6.38
Volatilität Benchmark (in %)	5.08	5.09	6.37	6.27	6.33
Tracking Error ex post (in %)	0.91	0.63	0.63	0.59	0.68
Information Ratio	1.03	-0.11	-0.46	-0.60	-0.87
Sharpe Ratio	1.56	1.03	0.31	0.69	0.54
Korrelation	1.00	0.99	0.99	1.00	0.99
Beta	1.16	1.05	0.99	0.98	1.00
Jensen-Alpha	-0.41	-0.38	-0.27	-0.27	-0.60
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	5.02%	4.00%	-
Hypotheken Schweiz	3.30%	4.00%	-
Obligationen CHF Inland	14.04%	16.00%	-
Obligationen Fremdwährungen (CHF hedged)	16.52%	16.00%	-
Aktien Schweiz	17.98%	18.00%	-
Aktien Ausland	10.03%	10.00%	-
Aktien Ausland (CHF hedged)	17.06%	17.00%	-
Immobilien Schweiz	12.39%	10.00%	30.00%
Immobilien Ausland (CHF hedged)	1.73%	2.00%	10.00%
Alternative Anlagen (CHF hedged)	1.94%	3.00%	15.00%
Infrastruktur	-	-	-
Total Aktien (In- und Ausland)	45.07%	45.00%	50.00%
Total Fremdwährungen	10.03%	22.00%	30.00%

Grösste Aktienpositionen

ROCHE HOLDING AG	2.45%
NOVARTIS AG-REG	2.39%
NESTLE SA-REG	2.06%
NVIDIA CORP	1.32%
APPLE INC	1.29%
UBS GROUP AG-REG	1.29%
ABB LTD-REG	1.22%
CIE FINANCIERE RICHEMO-A REG	1.01%
MICROSOFT CORP	0.93%
ZURICH INSURANCE GROUP AG	0.93%

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	89.97%
USD	6.33%
EUR	1.29%
JPY	0.46%
Übrige	1.94%

Eigenschaften der festverzinslichen Anlagen

Modified Duration	5.57
Durchschnittliches Rating	A+