

31. Mai 2026

Anlagestiftung Swiss Life BVG-Mix 75

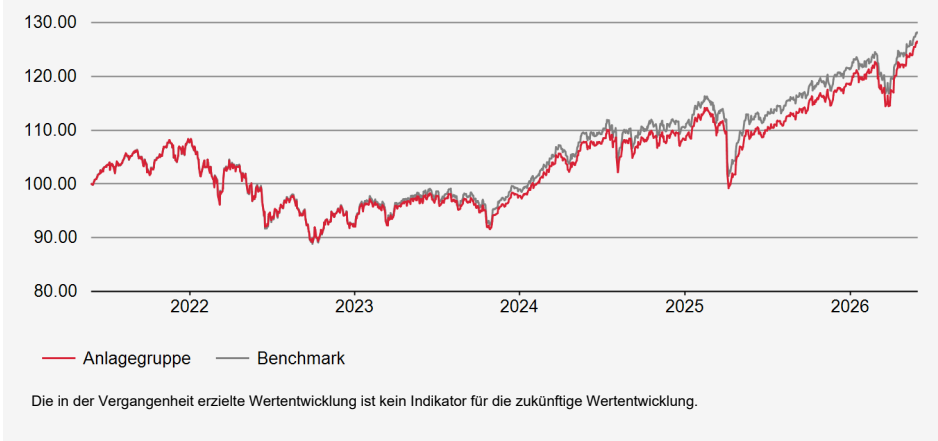
(Aktien- und Fremdwährungsquote gemäss BVV2 überschritten)

Nettovermögen (NAV) in Mio. CHF: 545.97
Nettovermögen pro Anspruch in CHF: 163.88

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

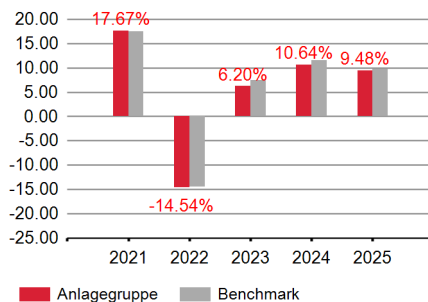
	Kumulierte Performance				Annualisierte Performance			
	YTD	1 Monat	3 Monate	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Aufl.
Anlagegruppe	6.81%	3.54%	3.32%	15.82%	9.47%	4.85%	-	6.73%
Benchmark	5.70%	3.08%	3.23%	14.48%	9.70%	5.14%	-	7.11%

Statistische Angaben (annualisiert)

	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Aufl.
Volatilität Anlagegruppe (in %)	8.53	8.20	9.35	-	10.13
Volatilität Benchmark (in %)	7.48	7.80	9.39	-	10.35
Tracking Error ex post (in %)	1.25	0.81	0.81	-	0.86
Information Ratio	1.07	-0.28	-0.36	-	-0.43
Sharpe Ratio	1.73	1.01	0.46	-	0.64
Korrelation	1.00	1.00	1.00	-	1.00
Beta	1.14	1.05	0.99	-	0.98
Jensen-Alpha	-0.65	-0.65	-0.26	-	-0.20
Maximum Drawdown (in %)	-6.73	-13.10	-17.76	-	-23.54
Recovery Period (Jahre)	0.13	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: 30/09/2025 0.55%

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	2.62%	4.00%	-
Hypotheken Schweiz	0.86%	1.50%	-
Obligationen CHF Inland	1.97%	4.50%	-
Obligationen Fremdwährungen (CHF hedged)	4.05%	4.00%	-
Aktien Schweiz	30.06%	29.00%	-
Aktien Ausland	20.19%	17.00%	-
Aktien Ausland (CHF hedged)	29.61%	29.00%	-
Immobilien Schweiz	7.48%	6.50%	30.00%
Immobilien Ausland (CHF hedged)	1.20%	1.50%	10.00%
Alternative Anlagen (CHF hedged)	1.94%	3.00%	15.00%
Infrastruktur	-	-	-
Total Aktien (In- und Ausland)	79.86%	75.00%	50.00%
Total Fremdwährungen	20.19%	37.00%	30.00%

Grösste Aktienpositionen

NVIDIA CORP	2.15%
APPLE INC	2.02%
MICROSOFT CORP	1.40%
AMAZON.COM INC	1.16%
ALPHABET INC-CL A	0.98%
BROADCOM INC	0.89%
ALPHABET INC-CL C	0.77%
NOVARTIS AG-REG	0.67%
ROCHE HOLDING AG	0.67%
META PLATFORMS INC-CLASS A	0.61%

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	79.81%
USD	13.56%
EUR	1.53%
JPY	0.53%
Übrige	4.58%

Eigenschaften der festverzinslichen Anlagen

Modified Duration	5.05
Durchschnittliches Rating	A