

31. Juli 2026

Anlagestiftung Swiss Life BVG-Mix 75

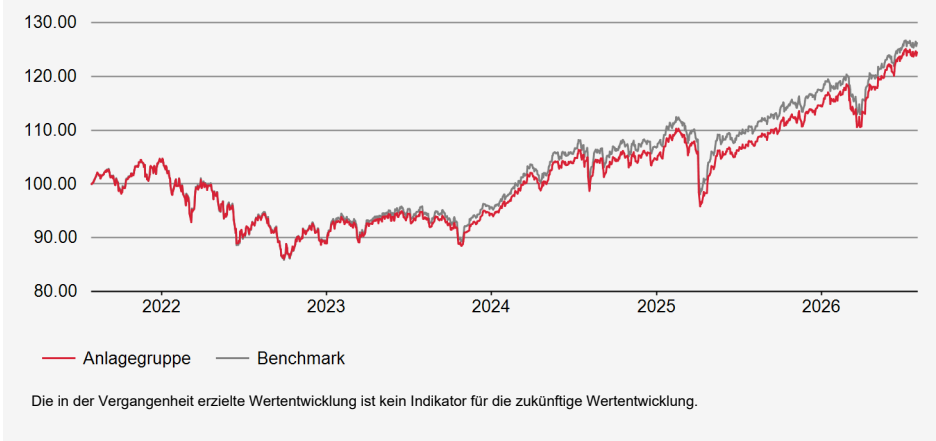
(Aktien- und Fremdwährungsquote gemäss BVV2 überschritten)

Nettovermögen (NAV) in Mio. CHF: 578.86
Nettovermögen pro Anspruch in CHF: 166.90

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

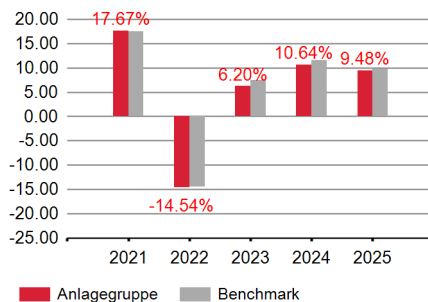
	Kumulierte Performance				Annualisierte Performance			
	YTD	1 Monat	3 Monate	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Aufl.
Anlagegruppe	8.78%	0.11%	5.45%	15.84%	9.50%	4.47%	-	6.83%
Benchmark	7.65%	0.19%	4.98%	14.50%	9.65%	4.76%	-	7.19%

Statistische Angaben (annualisiert)

	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Aufl.
Volatilität Anlagegruppe (in %)	8.60	8.22	9.28	-	10.03
Volatilität Benchmark (in %)	7.54	7.81	9.31	-	10.25
Tracking Error ex post (in %)	1.26	0.81	0.82	-	0.86
Information Ratio	1.06	-0.19	-0.36	-	-0.43
Sharpe Ratio	1.71	1.02	0.42	-	0.65
Korrelation	1.00	1.00	1.00	-	1.00
Beta	1.14	1.05	0.99	-	0.98
Jensen-Alpha	-0.65	-0.59	-0.26	-	-0.19
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	5.82%	4.00%	-
Hypotheken Schweiz	0.81%	1.50%	-
Obligationen CHF Inland	2.44%	4.50%	-
Obligationen Fremdwährungen (CHF hedged)	4.98%	4.00%	-
Aktien Schweiz	28.92%	29.00%	-
Aktien Ausland	17.02%	17.00%	-
Aktien Ausland (CHF hedged)	29.28%	29.00%	-
Immobilien Schweiz	7.30%	6.50%	30.00%
Immobilien Ausland (CHF hedged)	1.10%	1.50%	10.00%
Alternative Anlagen (CHF hedged)	2.32%	3.00%	15.00%
Infrastruktur	-	-	-
Total Aktien (In- und Ausland)	75.22%	75.00%	50.00%
Total Fremdwährungen	17.02%	37.00%	30.00%

Grösste Aktienpositionen

ROCHE HOLDING AG	4.08%
NOVARTIS AG-REG	3.97%
NESTLE SA-REG	3.43%
NVIDIA CORP	2.26%
APPLE INC	2.22%
UBS GROUP AG-REG	2.14%
ABB LTD-REG	2.04%
CIE FINANCIERE RICHEMO-A REG	1.69%
MICROSOFT CORP	1.60%
ZURICH INSURANCE GROUP AG	1.55%

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	82.98%
USD	10.84%
EUR	2.21%
JPY	0.79%
Übrige	3.18%

Eigenschaften der festverzinslichen Anlagen

Modified Duration	5.12
Durchschnittliches Rating	A