

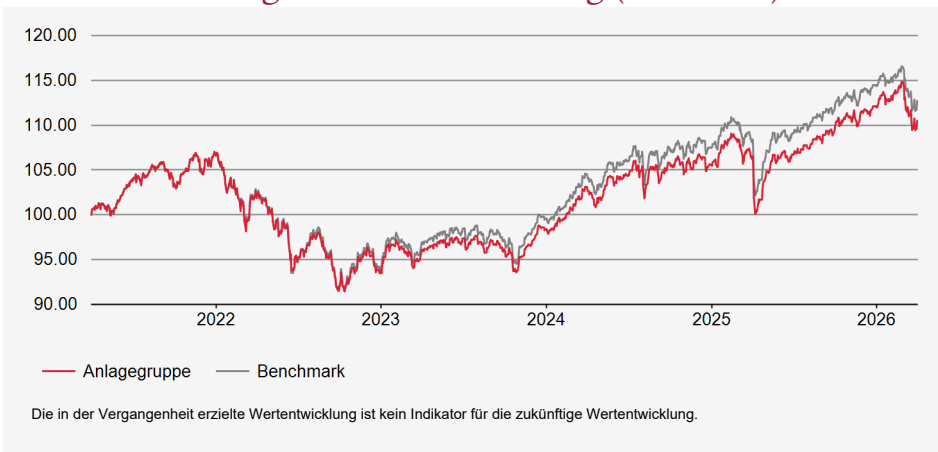
Anlagestiftung Swiss Life BVG-Mix 45

Nettovermögen (NAV) in Mio. CHF: 857.29
Nettovermögen pro Anspruch in CHF: 233.27

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)



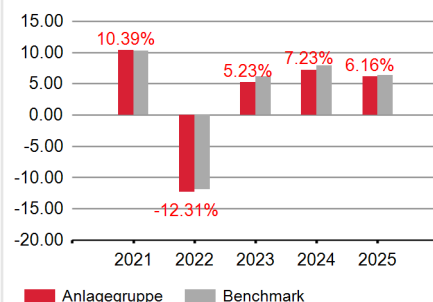
Performance in Referenzwährung

	Kumulierte Performance				Annualisierte Performance			
	YTD	1 Monat	3 Monate	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Aufl.
Anlagegruppe	-1.34%	-3.73%	-1.34%	4.02%	4.77%	2.02%	3.97%	3.52%
Benchmark	-1.43%	-3.19%	-1.43%	4.29%	5.17%	2.42%	4.37%	4.14%

Statistische Angaben (annualisiert)

	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Aufl.
Volatilität Anlagegruppe (in %)	5.64	5.02	6.19	6.12	6.38
Volatilität Benchmark (in %)	4.90	4.81	6.26	6.23	6.34
Tracking Error ex post (in %)	0.89	0.55	0.59	0.57	0.67
Information Ratio	-0.30	-0.72	-0.69	-0.71	-0.92
Sharpe Ratio	0.70	0.76	0.25	0.67	0.51
Korrelation	1.00	0.99	1.00	1.00	0.99
Beta	1.14	1.04	0.98	0.98	1.00
Jensen-Alpha	-0.88	-0.56	-0.38	-0.31	-0.63
Maximum Drawdown (in %)	-6.03	-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
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.

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	2.71%	4.00%	-
Hypotheken Schweiz	3.52%	4.00%	-
Obligationen CHF Inland	12.96%	16.00%	-
Obligationen Fremdwährungen (CHF hedged)	16.07%	16.00%	-
Aktien Schweiz	19.59%	18.00%	-
Aktien Ausland	11.58%	10.00%	-
Aktien Ausland (CHF hedged)	16.66%	17.00%	-
Immobilien Schweiz	12.02%	10.00%	30.00%
Immobilien Ausland (CHF hedged)	1.93%	2.00%	10.00%
Alternative Anlagen (CHF hedged)	2.99%	3.00%	15.00%
Infrastruktur	-	-	-
Total Aktien (In- und Ausland)	47.83%	45.00%	50.00%
Total Fremdwährungen	11.58%	22.00%	30.00%

Grösste Aktienpositionen

NVIDIA CORP	1.11%
APPLE INC	0.98%
MICROSOFT CORP	0.68%
AMAZON.COM INC	0.53%
ALPHABET INC-CL A	0.44%
TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	0.37%
ALPHABET INC-CL C	0.37%
BROADCOM INC	0.37%
META PLATFORMS INC-CLASS A	0.33%
TESLA INC	0.28%

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	88.42%
USD	5.39%
JPY	2.16%
EUR	0.82%
Übrige	3.21%

Eigenschaften der festverzinslichen Anlagen

Modified Duration	5.51
Durchschnittliches Rating	A+