

31. Mai 2026

Anlagestiftung Swiss Life BVG-Mix 15

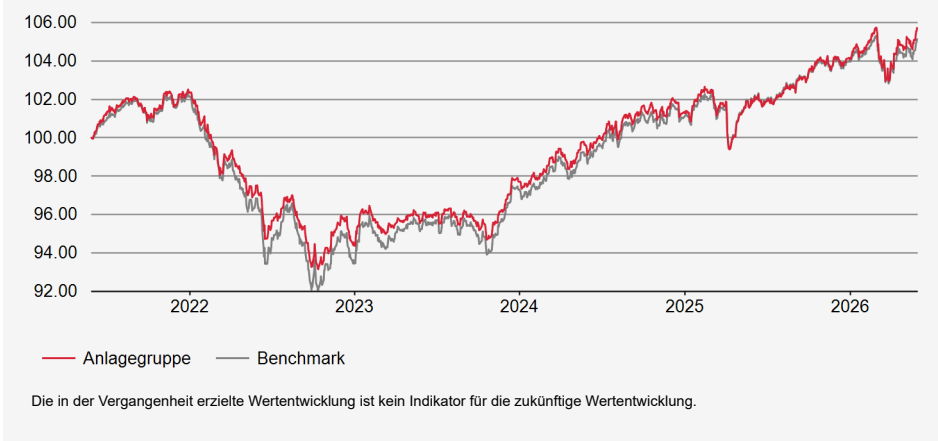


Nettovermögen (NAV) in Mio. CHF: 193.08
Nettovermögen pro Anspruch in CHF: 183.14

Anlagestrategie

Anlagen in alle vom BVG zugelassenen Anlagekategorien (strategischer Aktienanteil: 15%). Aktive Asset Allocation. Begrenzung für Beteiligungspapiere: 20%. Begrenzung für Fremdwährungen: 30%. Durchschnittliche Ratingqualität der Obligationen: mindestens BBB+. Umsetzung mittels Einsatz artreiner Kollektivanlagen. Empfohlene Schwankungsreserven: über 6.5%.

Wertentwicklung in Referenzwährung (Basis 100)



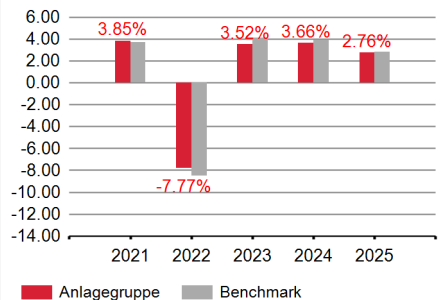
Performance in Referenzwährung

	Kumulierte Performance				Annualisierte Performance			
	YTD	1 Monat	3 Monate	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Aufl.
Anlagegruppe	1.56%	0.94%	-0.01%	3.73%	3.31%	1.13%	2.03%	2.67%
Benchmark	1.10%	0.74%	-0.15%	3.07%	3.26%	1.02%	2.07%	2.94%

Statistische Angaben (annualisiert)

	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Aufl.
Volatilität Anlagegruppe (in %)	2.95	2.59	3.27	3.09	2.82
Volatilität Benchmark (in %)	2.54	2.56	3.51	0.00	0.00
Tracking Error ex post (in %)	0.46	0.48	0.59	0.00	0.00
Information Ratio	1.44	0.10	0.19	0.00	0.00
Sharpe Ratio	1.25	0.95	0.21	0.70	0.88
Korrelation	1.00	0.98	0.99	0.00	0.00
Beta	1.16	0.99	0.92	0.00	0.00
Jensen-Alpha	0.17	0.06	0.16	2.20	2.53
Maximum Drawdown (in %)	-2.63	-3.17	-9.12	-9.12	-9.12
Recovery Period (Jahre)	-	0.34	2.34	2.34	2.34

Performance



Produktinformationen

Valorennummer: 1564965

ISIN: CH0015649657

LEI: 254900RW4KJYAQTH6Y97

Bloomberg-Code: SWABM15 SW

Benchmark: Customized

Währung: CHF

Domizil: Schweiz

Auflagedatum: 30/06/2003

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 0.54%

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	1.75%	4.00%	-
Hypotheken Schweiz	7.44%	7.00%	-
Obligationen CHF Inland	24.95%	28.00%	-
Obligationen Fremdwährungen (CHF hedged)	25.53%	27.00%	-
Aktien Schweiz	8.25%	7.00%	-
Aktien Ausland	6.30%	4.00%	-
Aktien Ausland (CHF hedged)	4.46%	4.00%	-
Immobilien Schweiz	17.82%	15.00%	30.00%
Immobilien Ausland (CHF hedged)	1.15%	1.00%	10.00%
Alternative Anlagen (CHF hedged)	2.35%	3.00%	15.00%
Infrastruktur	-	-	-
Total Aktien (In- und Ausland)	19.01%	15.00%	50.00%
Total Fremdwährungen	6.30%	7.00%	30.00%

Grösste Aktienpositionen

NVIDIA CORP	0.44%
APPLE INC	0.41%
MICROSOFT CORP	0.28%
AMAZON.COM INC	0.23%
ALPHABET INC-CL A	0.20%
BROADCOM INC	0.18%
ALPHABET INC-CL C	0.16%
TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	0.13%
META PLATFORMS INC-CLASS A	0.12%
TESLA INC	0.11%

Benchmarkzusammensetzung

1M Saron	4.00%
SBI Domestic AAA-A 1-3Y Total Return	7.00%
SBI AAA-BBB Total Return	28.00%
Bloomberg Gl. Agg. Treas. ex CH (CHF hedged)	17.00%
Bloomberg Gl. Agg. Corp. (CHF hedged)	4.00%
Bloomberg Gl. Agg. Corp. Short Term (CHF hedged)	4.00%
JP Morgan CEMBI Broad Diversified IG Index (CHF hedged)	2.00%
SPI® Total Return	7.00%
MSCI World ex Switzerland Net Return	4.00%
MSCI World ex Switzerland Net Return (CHF hedged)	4.00%
KGAST Immo-Index	15.00%
SL REF (LUX) ESG German Core Real Estate (CHF hedged)	0.75%
Anlagestiftung Swiss Life Immobilien Europa Industrie und Logistik ESG (EUR), CHF hedged	0.25%
HFRX Global Hedge Funds (CHF hedged)	3.00%
Anlagestiftung Swiss Life Infrastruktur Global ESG (EUR)	-

Portfoliostruktur nach Währungen

CHF	93.70%
USD	4.10%
EUR	0.75%
JPY	0.20%
Übrige	1.25%

Eigenschaften der festverzinslichen Anlagen

Modified Duration	5.77
Durchschnittliches Rating	AA-