

30. November 2025

Anlagestiftung Swiss Life BVG-Mix Index 25

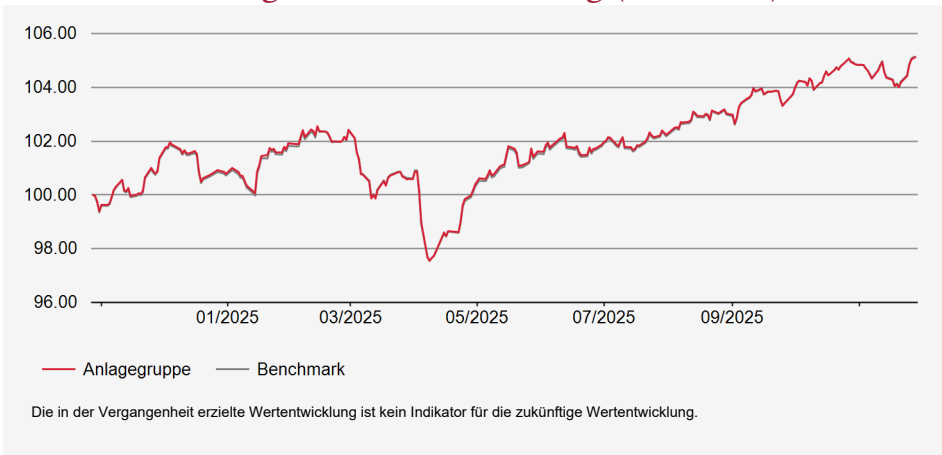


Nettovermögen (NAV) in Mio. CHF: 31.10
Nettovermögen pro Anspruch in CHF: 1'051.18

Anlagestrategie

Die Anlagegruppe wird mit einem indexierten Ansatz verwaltet, wobei die strategische Aktienquote 25% beträgt. Die Anlagegruppe investiert indirekt über indexierte kollektive Anlagen global in Aktien, in Unternehmens- wie auch Staatsobligationen sowie in Schweizer Immobilien und zeichnet sich so durch eine breite Diversifikation aus.

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 | 4.30% | 0.27% | 2.03% | 3.68% | - | - | - | 4.71% |
| Benchmark | 4.38% | 0.28% | 2.08% | 3.73% | - | - | - | 4.72% |

Statistische Angaben (annualisiert)

| | 1 Jahr | 3 Jahre | 5 Jahre | 10 Jahre | Aufl. |
|---------------------------------|--------|---------|---------|----------|-------|
| Volatilität Anlagegruppe (in %) | 2.94 | - | - | - | 3.27 |
| Volatilität Benchmark (in %) | 2.95 | - | - | - | 3.28 |
| Tracking Error ex post (in %) | 0.15 | - | - | - | 0.14 |
| Information Ratio | -0.36 | - | - | - | -0.07 |
| Sharpe Ratio | 1.17 | - | - | - | 1.23 |
| Korrelation | 1.00 | - | - | - | 1.00 |
| Beta | 0.99 | - | - | - | 0.99 |
| Jensen-Alpha | -0.04 | - | - | - | 0.02 |
| Maximum Drawdown (in %) | -4.87 | - | - | - | -4.87 |
| Recovery Period (Jahre) | 0.33 | - | - | - | 0.33 |

Performance

Datenhistorie unzureichend

Produktinformationen

Valorennummer: 137660520

ISIN: CH1376605205

LEI: 254900BN8UJF3508WG67

Bloomberg-Code: SLAI25S SW

Benchmark: Customized

Währung: CHF

Domizil: Schweiz

Auflagedatum: 28/10/2024

Erstausgabepreis: 1000.00

Jahresabschluss: 30.09

Ausgabe/Rücknahme: Täglich

Annahmeschluss: 12.00 Uhr

Verwässerungsschutz:

Ausgabe- / Rücknahmekommission zugunsten der Anlagegruppe gemäss Konditionenübersicht.

Asset Management:

Strategische Asset Allocation und regelbasiertes Rebalancing durch Swiss Life Asset Management AG

Eingesetzte artreine Anlagegruppen: Index Anlagegruppen der Anlagestiftung Swiss Life

Externe Beratung:

Überwachung der Anlageresultate der eingesetzten Anlagegruppen durch PPCmetrics

Kurspublikationen: Bloomberg: ASSL
www.swisslife.ch/anlagestiftung

Betriebsaufwandquote TER KGAST

ex ante: 0.38%

ex post per: 30/09/2025 0.37%

Asset Manager: Die Auswahl der Manager, deren permanente Überwachung und die gesamte Prozessbegleitung erfolgen nach objektiven Kriterien und bester institutioneller Praxis durch Swiss Life Asset Management AG.

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 | -0.02% | - | - |
| Obligationen CHF | 26.71% | 27.00% | - |
| Obligationen Fremdwährungen (CHF hedged) | 40.74% | 41.00% | - |
| Aktien Schweiz | 9.20% | 9.00% | - |
| Aktien Ausland | 7.62% | 7.50% | - |
| Aktien Ausland (CHF hedged) | 8.57% | 8.50% | - |
| Immobilien Schweiz | 7.18% | 7.00% | 30.00% |
| Total Aktien (In- und Ausland) | 25.39% | - | 50.00% |
| Total Fremdwährungen | 7.62% | - | 30.00% |

Grösste Positionen

| | |
|-------------------------------|-------|
| ROCHE HOLDING AG-GENUSSSCHEIN | 1.18% |
| NESTLE SA-REG | 1.12% |
| NOVARTIS AG-REG | 1.12% |
| NVIDIA CORP | 0.65% |
| APPLE INC | 0.63% |
| MICROSOFT CORP | 0.53% |
| UBS GROUP AG-REG | 0.50% |
| CIE FINANCIERE RICHEMO-A REG | 0.50% |
| ABB LTD-REG | 0.50% |
| ZURICH INSURANCE GROUP AG | 0.46% |

Benchmarkzusammensetzung

| | |
|---|--------|
| SBI® AAA-BBB Total Return | 27.00% |
| FTSE Non-CHF World Government Bond Index TR (CHF hedged) | 20.50% |
| Bloomberg Global Aggregate Corporate ex CHF TR (CHF hedged) | 20.50% |
| SPI® Total Return | 9.00% |
| MSCI World ex Switzerland Net Return | 3.50% |
| MSCI World ex Switzerland Net Return (CHF hedged) | 8.50% |
| MSCI World ex Switzerland Small Cap Net Return | 2.00% |
| MSCI Emerging Markets Net Return | 2.00% |
| SXI Real Estate® Funds Broad Total Return | 7.00% |

Portfoliostruktur nach Währungen

| | |
|--------|--------|
| CHF | 92.38% |
| USD | 4.02% |
| JPY | 0.47% |
| EUR | 0.44% |
| Übrige | 2.69% |

Eigenschaften der festverzinslichen Anlagen

| | |
|---------------------------|------|
| Modified Duration | 6.73 |
| Durchschnittliches Rating | A+ |