

31. Mai 2025

# Anlagestiftung Swiss Life BVG-Mix 35

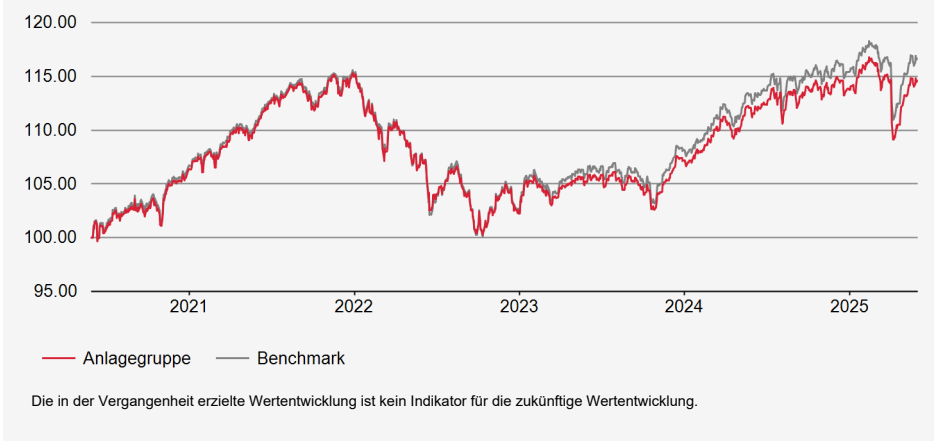


Nettovermögen (NAV) in Mio. CHF: 400.56  
Nettovermögen pro Anspruch in CHF: 214.44

## Anlagestrategie

Anlagen in alle vom BVG zugelassenen Anlagekategorien (strategischer Aktienanteil: 35%). Aktive Asset Allocation. Begrenzung für Beteiligungspapiere: 45%. Begrenzung für Fremdwährungen: 30%. Durchschnittliche Ratingqualität der Obligationen: mindestens BBB+. Umsetzung mittels Einsatz artreiner Kollektivanlagen. Empfohlene Schwankungsreserven: über 15%.

## Wertentwicklung in Referenzwährung (Basis 100)



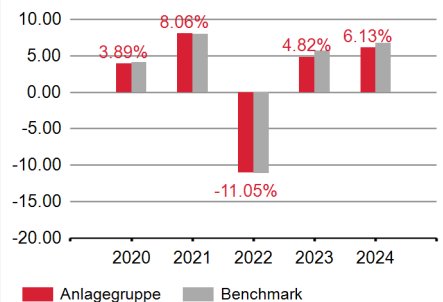
## Performance in Referenzwährung

|              | Kumulierte Performance |         |          |        | Annualisierte Performance |         |          |       |
|--------------|------------------------|---------|----------|--------|---------------------------|---------|----------|-------|
|              | YTD                    | 1 Monat | 3 Monate | 1 Jahr | 3 Jahre                   | 5 Jahre | 10 Jahre | Aufl. |
| Anlagegruppe | 0.76%                  | 1.67%   | -1.39%   | 2.77%  | 2.24%                     | 2.76%   | 2.74%    | 3.27% |
| Benchmark    | 1.07%                  | 1.67%   | -1.06%   | 3.42%  | 2.81%                     | 3.12%   | 3.16%    | 3.82% |

## Statistische Angaben (annualisiert)

|                                 | 1 Jahr | 3 Jahre | 5 Jahre | 10 Jahre | Aufl.  |
|---------------------------------|--------|---------|---------|----------|--------|
| Volatilität Anlagegruppe (in %) | 4.18   | 5.63    | 5.38    | 5.27     | 5.19   |
| Volatilität Benchmark (in %)    | 3.98   | 6.00    | 5.60    | 5.42     | 5.18   |
| Tracking Error ex post (in %)   | 0.43   | 0.58    | 0.51    | 0.56     | 0.63   |
| Information Ratio               | -1.52  | -0.98   | -0.71   | -0.76    | -0.86  |
| Sharpe Ratio                    | 0.47   | 0.22    | 0.45    | 0.56     | 0.58   |
| Korrelation                     | 1.00   | 1.00    | 1.00    | 0.99     | 0.99   |
| Beta                            | 1.04   | 0.93    | 0.96    | 0.97     | 1.00   |
| Jensen-Alpha                    | -0.77  | -0.45   | -0.25   | -0.32    | -0.53  |
| Maximum Drawdown (in %)         | -6.55  | -6.55   | -13.03  | -13.41   | -21.36 |
| Recovery Period (Jahre)         | -      | -       | 2.28    | 0.65     | 3.00   |

## Performance



## Produktinformationen

Valorennummer: 1245606

ISIN: CH0012456064

LEI: 254900SR5GM6HP44F130

Bloomberg-Code: SWABM35 SW

Benchmark: Customized

Währung: CHF

Domizil: Schweiz

Aufgagedatum: 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: 0.55%

ex post per: 30/09/2024 0.57%

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](http://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                               | 3.83%        | 2.00%     | -         |
| Hypotheken Schweiz                       | 0.62%        | -         | -         |
| Obligationen CHF Inland                  | 13.24%       | 14.00%    | -         |
| Obligationen CHF Ausland                 | 6.95%        | 7.00%     | -         |
| Obligationen Fremdwährungen (CHF hedged) | 23.03%       | 24.00%    | -         |
| Aktien Schweiz                           | 15.03%       | 18.00%    | -         |
| Aktien Ausland                           | 8.66%        | 17.00%    | -         |
| Aktien Ausland (CHF hedged)              | 11.20%       | -         | -         |
| Immobilien Schweiz                       | 12.88%       | 11.00%    | 30.00%    |
| Immobilien Ausland (CHF hedged)          | 1.99%        | 2.00%     | 10.00%    |
| Alternative Anlagen (CHF hedged)         | 2.56%        | 5.00%     | 15.00%    |
| Total Aktien (In- und Ausland)           | 34.90%       | 35.00%    | 50.00%    |
| Total Fremdwährungen                     | 8.66%        | 17.00%    | 30.00%    |

## Grösste Aktienpositionen

|                              |       |
|------------------------------|-------|
| NESTLE SA-REG                | 2.12% |
| ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN | 1.72% |
| NOVARTIS AG-REG              | 1.71% |
| ZURICH INSURANCE GROUP AG    | 0.78% |
| CIE FINANCIERE RICHEMO-A REG | 0.77% |
| UBS GROUP AG-REG             | 0.77% |
| NVIDIA CORP                  | 0.73% |
| MICROSOFT CORP               | 0.72% |
| ABB LTD-REG                  | 0.69% |
| APPLE INC                    | 0.67% |

## Benchmarkzusammensetzung

|                                                     |        |
|-----------------------------------------------------|--------|
| 1M Saron                                            | 2.00%  |
| SBI Domestic AAA-BBB                                | 14.00% |
| SBI Foreign AAA-BBB                                 | 7.00%  |
| Bloomberg Gl. Agg. Treas. ex CH TR (CHF hedged)     | 3.50%  |
| Bloomberg Gl. Agg. Corp. TR (CHF hedged)            | 7.50%  |
| Bloomberg Gl. Agg. Corp. Short Term TR (CHF hedged) | 8.00%  |
| JP Morgan CEMBI Broad Div IG Index (CHF hedged)     | 5.00%  |
| SPI® Total Return                                   | 18.00% |
| MSCI World ex CH ESG Leaders, in CHF                | 13.60% |
| MSCI AC World Small Cap, in CHF                     | 2.55%  |
| MSCI Emerging Markets, in CHF                       | 0.85%  |
| KGAST Immo-Index                                    | 11.00% |
| SL REF (LUX) German Core Real Estate (CHF hedged)   | 2.00%  |
| HFRX Global Hedge Funds (CHF hedged)                | 5.00%  |

## Portfoliostruktur nach Währungen

|        |        |
|--------|--------|
| CHF    | 91.34% |
| USD    | 3.33%  |
| JPY    | 1.78%  |
| EUR    | 1.15%  |
| Übrige | 2.40%  |

## Eigenschaften der festverzinslichen Anlagen

|                           |      |
|---------------------------|------|
| Modified Duration         | 5.63 |
| Durchschnittliches Rating | A    |