

# Anlagestiftung Swiss Life

## BVG-Mix 35



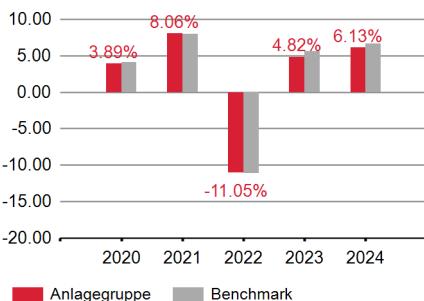
SwissLife

**Nettovermögen (NAV) in Mio. CHF: 399.96**  
**Nettovermögen pro Anspruch in CHF: 222.91**

### 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%.

### Performance



### Wertentwicklung in Referenzwährung (Basis 100)



Die in der Vergangenheit erzielte Wertentwicklung ist kein Indikator für die zukünftige Wertentwicklung.

### Performance in Referenzwährung

	Kumulierte Performance				Annualisierte Performance			
	YTD	1 Monat	3 Monate	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Aufl.
Anlagegruppe	4.74%	0.50%	2.46%	4.07%	4.44%	2.53%	3.09%	3.37%
Benchmark	5.02%	0.56%	2.25%	4.46%	4.94%	2.81%	3.42%	3.90%

### Statistische Angaben (annualisiert)

	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Aufl.
Volatilität Anlagegruppe (in %)	3.83	4.17	5.07	5.02	5.14
Volatilität Benchmark (in %)	3.57	4.29	5.29	5.21	5.13
Tracking Error ex post (in %)	0.49	0.41	0.50	0.55	0.63
Information Ratio	-0.80	-1.22	-0.55	-0.61	-0.84
Sharpe Ratio	0.99	0.81	0.42	0.65	0.60
Korrelation	0.99	1.00	1.00	0.99	0.99
Beta	1.07	0.97	0.95	0.96	1.00
Jensen-Alpha	-0.67	-0.37	-0.17	-0.18	-0.52
Maximum Drawdown (in %)	-6.55	-6.55	-13.03	-13.41	-21.36
Recovery Period (Jahre)	0.42	0.42	2.28	0.65	3.00

**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:** Gesamttrag 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.

### Produktinformationen

**Valorennummer:** 1245606

**ISIN:** CH0012456064

**LEI:** 254900SR5GM6HP44F130

**Bloomberg-Code:** SWABM35 SW

**Benchmark:** Customized

**Währung:** CHF

**Domizil:** Schweiz

**Auflagedatum:** 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:** 0.48%

**ex post per:** 30/09/2025 0.53%

Vorbehalten bleiben abweichende Bestimmungen in den Gebührenordnungen von Freizügigkeitsstiftungen sowie Vorsorgestiftungen 3a.

# Anlagestiftung Swiss Life

## BVG-Mix 35

### Portfoliostruktur nach Anlagekategorien

	Anlagegruppe	Benchmark	max. BVV2
Liquidität	2.81%	4.00%	-
Hypotheken Schweiz	4.65%	5.00%	-
Obligationen CHF Inland	17.50%	19.00%	-
Obligationen Fremdwährungen (CHF hedged)	19.99%	20.00%	-
Aktien Schweiz	15.55%	15.00%	-
Aktien Ausland	7.66%	8.00%	-
Aktien Ausland (CHF hedged)	14.02%	12.00%	-
Immobilien Schweiz	14.06%	12.00%	30.00%
Immobilien Ausland (CHF hedged)	1.93%	2.00%	10.00%
Alternative Anlagen (CHF hedged)	1.84%	3.00%	15.00%
Infrastruktur	-	-	-
Total Aktien (In- und Ausland)	37.23%	35.00%	50.00%
Total Fremdwährungen	7.66%	17.00%	30.00%

### Grösste Aktienpositionen

ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	1.99%
NESTLE SA-REG	1.90%
NOVARTIS AG-REG	1.89%
NVIDIA CORP	0.95%
APPLE INC	0.92%
UBS GROUP AG-REG	0.85%
CIE FINANCIERE RICHEMO-A REG	0.85%
ABB LTD-REG	0.84%
ZURICH INSURANCE GROUP AG	0.78%
MICROSOFT CORP	0.77%

### Benchmarkzusammensetzung

1M Saron	4.00%
SBI Domestic AAA-A 1-3Y Total Return	5.00%
SBI AAA-BBB Total Return	19.00%
Bloomberg Gl. Agg. Treas. ex CH (CHF hedged)	8.00%
Bloomberg Gl. Agg. Corp. (CHF hedged)	3.00%
Bloomberg Gl. Agg. Corp. Short Term (CHF hedged)	2.00%
JP Morgan CEMBI Broad Diversified IG Index (CHF hedged)	7.00%
SPI® Total Return	15.00%
MSCI World ex Switzerland Net Return	8.00%
MSCI World ex Switzerland Net Return (CHF hedged)	12.00%
KGAST Immo-Index	12.00%
SL REF (LUX) ESG German Core Real Estate (CHF hedged)	1.50%
Anlagestiftung Swiss Life Immobilien Europa Industrie und Logistik ESG (EUR), CHF hedged	0.50%
HFRX Global Hedge Funds (CHF hedged)	3.00%
Anlagestiftung Swiss Life Infrastruktur Global ESG (EUR)	-

### Portfoliostruktur nach Währungen

CHF	92.34%
USD	4.51%
EUR	0.54%
JPY	0.21%
Übrige	2.40%

### Eigenschaften der festverzinslichen Anlagen

Modified Duration	0.17
Durchschnittliches Rating	AAA