

30. April 2026

Anlagestiftung Swiss Life BVG-Mix 35

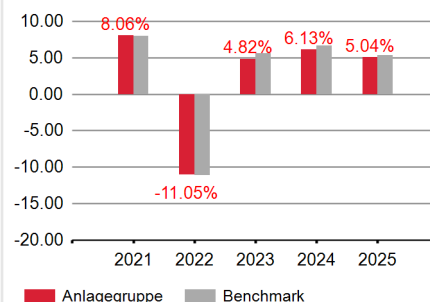


Nettvermögen (NAV) in Mio. CHF: 408.19
Nettvermögen pro Anspruch in CHF: 226.91

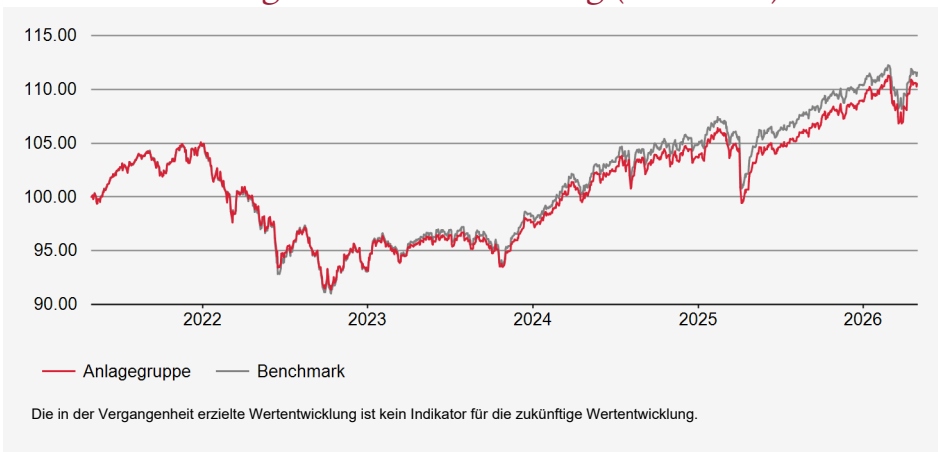
Anlagestrategie

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)



Produktinformationen

Valorennummer: 1245606
ISIN: CH0012456064
LEI: 254900SR5GM6HP44F130
Bloomberg-Code: SWABM35 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.

Performance in Referenzwährung

	Kumulierte Performance				Annualisierte Performance			
	YTD	1 Monat	3 Monate	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Aufl.
Anlagegruppe	1.50%	2.60%	0.97%	7.59%	4.81%	2.02%	3.45%	3.39%
Benchmark	1.09%	2.26%	0.73%	7.07%	5.02%	2.21%	3.72%	3.89%

Statistische Angaben (annualisiert)

	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Aufl.
Volatilität Anlagegruppe (in %)	4.78	4.35	5.33	5.13	5.17
Volatilität Benchmark (in %)	4.20	4.17	5.45	5.29	5.14
Tracking Error ex post (in %)	0.71	0.53	0.58	0.57	0.64
Information Ratio	0.74	-0.39	-0.33	-0.46	-0.78
Sharpe Ratio	1.53	0.89	0.29	0.70	0.60
Korrelation	1.00	0.99	0.99	0.99	0.99
Beta	1.14	1.04	0.97	0.97	1.00
Jensen-Alpha	-0.44	-0.35	-0.15	-0.13	-0.50
Maximum Drawdown (in %)	-4.00	-6.55	-13.03	-13.41	-21.36
Recovery Period (Jahre)	-	0.42	2.28	0.65	3.00

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	3.02%	4.00%	-
Hypotheken Schweiz	4.55%	5.00%	-
Obligationen CHF Inland	16.20%	19.00%	-
Obligationen Fremdwährungen (CHF hedged)	18.44%	20.00%	-
Aktien Schweiz	15.99%	15.00%	-
Aktien Ausland	10.70%	8.00%	-
Aktien Ausland (CHF hedged)	12.80%	12.00%	-
Immobilien Schweiz	14.40%	12.00%	30.00%
Immobilien Ausland (CHF hedged)	1.87%	2.00%	10.00%
Alternative Anlagen (CHF hedged)	2.02%	3.00%	15.00%
Infrastruktur	-	-	-
Total Aktien (In- und Ausland)	39.48%	35.00%	50.00%
Total Fremdwährungen	10.70%	17.00%	30.00%

Grösste Aktienpositionen

NOVARTIS AG-REG	2.15%
ROCHE HOLDING AG	2.11%
NESTLE SA-REG	1.92%
ABB LTD-REG	1.17%
UBS GROUP AG-REG	1.00%
NVIDIA CORP	0.93%
ZURICH INSURANCE GROUP AG	0.79%
APPLE INC	0.76%
CIE FINANCIERE RICHEMO-A REG	0.75%
MICROSOFT CORP	0.55%

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	89.30%
USD	5.78%
JPY	1.42%
EUR	0.72%
Übrige	2.78%

Eigenschaften der festverzinslichen Anlagen

Modified Duration	5.66
Durchschnittliches Rating	A+