

31. Juli 2026

Anlagestiftung Swiss Life BVG-Mix 35

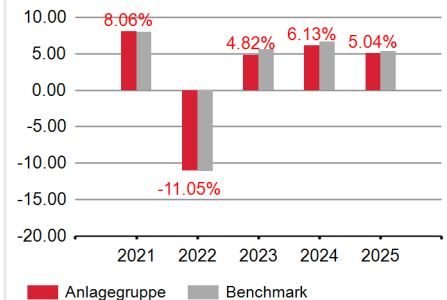


Nettovermögen (NAV) in Mio. CHF: 413.68
Nettovermögen pro Anspruch in CHF: 232.68

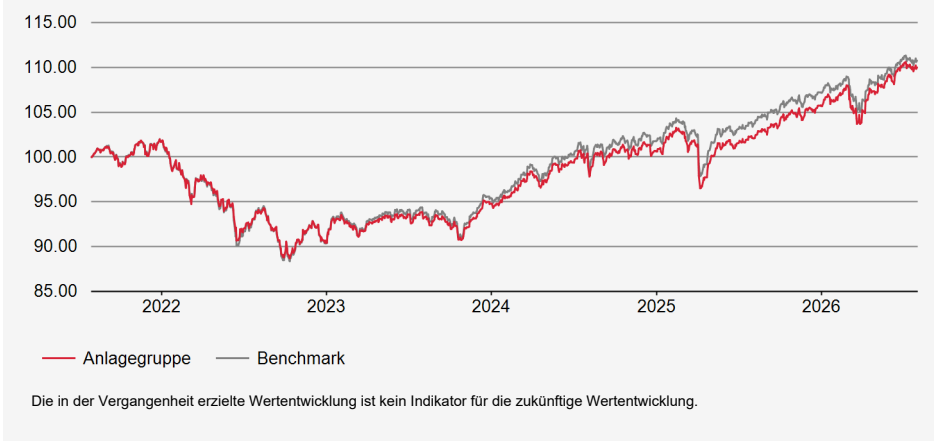
Anlagestrategie

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
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: 0.50%
ex post per: 30/09/2025 0.53%

Performance in Referenzwährung

	Kumulierte Performance				Annualisierte Performance			
	YTD	1 Monat	3 Monate	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Aufl.
Anlagegruppe	4.08%	-0.33%	2.54%	7.73%	5.43%	1.92%	3.44%	3.46%
Benchmark	3.35%	-0.30%	2.24%	6.82%	5.48%	2.06%	3.68%	3.94%

Statistische Angaben (annualisiert)

	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Aufl.
Volatilität Anlagegruppe (in %)	4.91	4.44	5.34	5.14	5.16
Volatilität Benchmark (in %)	4.26	4.24	5.44	5.28	5.12
Tracking Error ex post (in %)	0.73	0.55	0.60	0.58	0.64
Information Ratio	1.23	-0.09	-0.24	-0.42	-0.76
Sharpe Ratio	1.52	1.03	0.27	0.69	0.62
Korrelation	1.00	0.99	0.99	0.99	0.99
Beta	1.15	1.04	0.98	0.97	1.00
Jensen-Alpha	-0.13	-0.24	-0.10	-0.12	-0.49
Maximum Drawdown (in %)	-4.00	-6.55	-13.03	-13.41	-21.36
Recovery Period (Jahre)	0.13	0.42	2.28	0.65	3.00

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	5.12%	4.00%	-
Hypotheken Schweiz	4.50%	5.00%	-
Obligationen CHF Inland	16.51%	19.00%	-
Obligationen Fremdwährungen (CHF hedged)	20.86%	20.00%	-
Aktien Schweiz	15.10%	15.00%	-
Aktien Ausland	7.68%	8.00%	-
Aktien Ausland (CHF hedged)	12.28%	12.00%	-
Immobilien Schweiz	14.14%	12.00%	30.00%
Immobilien Ausland (CHF hedged)	1.81%	2.00%	10.00%
Alternative Anlagen (CHF hedged)	2.00%	3.00%	15.00%
Infrastruktur	-	-	-
Total Aktien (In- und Ausland)	35.06%	35.00%	50.00%
Total Fremdwährungen	7.68%	17.00%	30.00%

Grösste Aktienpositionen

ROCHE HOLDING AG	2.04%
NOVARTIS AG-REG	1.99%
NESTLE SA-REG	1.71%
UBS GROUP AG-REG	1.07%
ABB LTD-REG	1.02%
NVIDIA CORP	0.96%
APPLE INC	0.94%
CIE FINANCIERE RICHEMO-A REG	0.84%
ZURICH INSURANCE GROUP AG	0.78%
MICROSOFT CORP	0.68%

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	92.32%
USD	4.75%
EUR	1.20%
JPY	0.34%
Übrige	1.40%

Eigenschaften der festverzinslichen Anlagen

Modified Duration	5.61
Durchschnittliches Rating	A+