

31. Mai 2026

Anlagestiftung Swiss Life BVG-Mix 35

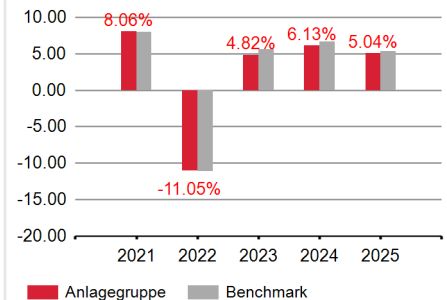


Nettovermögen (NAV) in Mio. CHF: 412.02
Nettovermögen pro Anspruch in CHF: 230.94

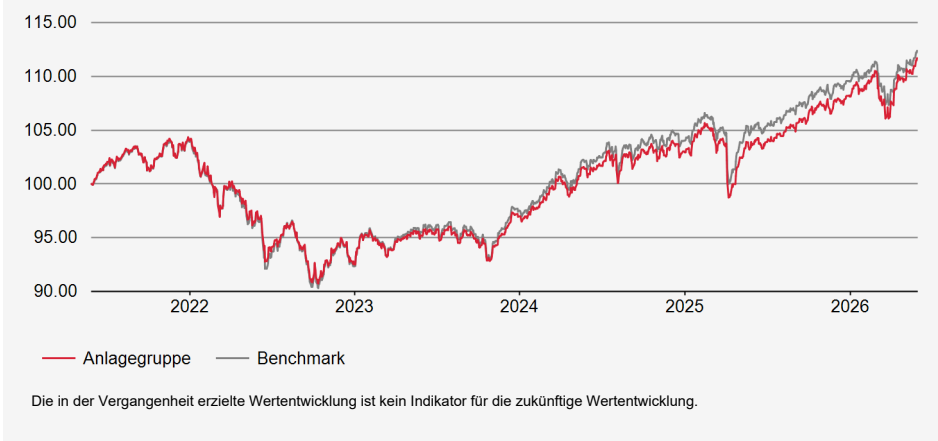
Anlagestrategie

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.

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	3.31%	1.78%	1.13%	7.69%	5.48%	2.25%	3.48%	3.45%
Benchmark	2.62%	1.51%	0.96%	6.89%	5.56%	2.38%	3.71%	3.94%

Statistische Angaben (annualisiert)

	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Aufl.
Volatilität Anlagegruppe (in %)	4.81	4.41	5.37	5.14	5.17
Volatilität Benchmark (in %)	4.15	4.21	5.47	5.28	5.14
Tracking Error ex post (in %)	0.74	0.55	0.60	0.58	0.64
Information Ratio	1.08	-0.16	-0.22	-0.41	-0.76
Sharpe Ratio	1.55	1.03	0.33	0.70	0.62
Korrelation	1.00	0.99	0.99	0.99	0.99
Beta	1.16	1.04	0.98	0.97	1.00
Jensen-Alpha	-0.28	-0.28	-0.08	-0.11	-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	2.51%	4.00%	-
Hypotheken Schweiz	4.51%	5.00%	-
Obligationen CHF Inland	16.05%	19.00%	-
Obligationen Fremdwährungen (CHF hedged)	19.34%	20.00%	-
Aktien Schweiz	16.36%	15.00%	-
Aktien Ausland	10.36%	8.00%	-
Aktien Ausland (CHF hedged)	12.73%	12.00%	-
Immobilien Schweiz	14.23%	12.00%	30.00%
Immobilien Ausland (CHF hedged)	1.86%	2.00%	10.00%
Alternative Anlagen (CHF hedged)	2.05%	3.00%	15.00%
Infrastruktur	-	-	-
Total Aktien (In- und Ausland)	39.45%	35.00%	50.00%
Total Fremdwährungen	10.36%	17.00%	30.00%

Grösste Aktienpositionen

NVIDIA CORP	0.98%
APPLE INC	0.92%
MICROSOFT CORP	0.64%
AMAZON.COM INC	0.52%
ALPHABET INC-CL A	0.44%
BROADCOM INC	0.40%
ALPHABET INC-CL C	0.35%
META PLATFORMS INC-CLASS A	0.28%
TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	0.26%
TESLA INC	0.25%

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	89.64%
USD	6.96%
EUR	0.83%
JPY	0.28%
Übrige	2.29%

Eigenschaften der festverzinslichen Anlagen

Modified Duration	5.67
Durchschnittliches Rating	A+