

30. April 2025

Anlagestiftung Swiss Life BVG-Mix Index 35



Nettvermögen (NAV) in Mio. CHF: 12.04
Nettvermögen pro Anspruch in CHF: 1'001.18

Anlagestrategie

Die Anlagegruppe wird mit einem indexierten Ansatz verwaltet, wobei die strategische Aktienquote 35% beträgt. Die Anlagegruppe investiert indirekt über indexierte kollektive Anlagen global in Aktien, in Unternehmens- wie auch Staatsobligationen sowie in Schweizer Immobilien und zeichnet sich so durch eine breite Diversifikation aus.

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	-0.79%	-0.65%	-2.41%	-	-	-	-	-
Benchmark	-0.70%	-0.61%	-2.30%	-	-	-	-	-

Statistische Angaben (annualisiert)

	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Aufl.
Volatilität Anlagegruppe (in %)	-	-	-	-	5.40
Volatilität Benchmark (in %)	-	-	-	-	5.38
Tracking Error ex post (in %)	-	-	-	-	0.12
Information Ratio	-	-	-	-	-0.38
Sharpe Ratio	-	-	-	-	-0.06
Korrelation	-	-	-	-	1.00
Beta	-	-	-	-	1.00
Jensen-Alpha	-	-	-	-	-0.05
Maximum Drawdown (in %)	-	-	-	-	-6.49
Recovery Period (Jahre)	-	-	-	-	-

Performance

Datenhistorie unzureichend

Produktinformationen

Valorennummer: 137660522

ISIN: CH1376605221

LEI: 254900GF0BJD6RE4WJ66

Bloomberg-Code: SLAI35S SW

Benchmark: Customized

Währung: CHF

Domizil: Schweiz

Aufgagedatum: 28/10/2024

Erstausgabepreis: 1000.00

Jahresabschluss: 30.09

Ausgabe/Rücknahme: Täglich

Annahmeschluss: 12.00 Uhr

Verwässerungsschutz:

Ausgabe- / Rücknahmekommission zugunsten der Anlagegruppe gemäss Konditionenübersicht.

Ausschüttungspraxis: Thesaurierung

Asset Management:

Strategische Asset Allocation und regelbasiertes Rebalancing durch Swiss Life Asset Management AG

Eingesetzte artreine Anlagegruppen: Index Anlagegruppen der Anlagestiftung Swiss Life

Externe Beratung:

Überwachung der Anlageresultate der eingesetzten Anlagegruppen durch PPCmetrics

Kurspublikationen: Bloomberg: ASSL
www.swisslife.ch/anlagestiftung

Betriebsaufwandquote TER KGAST

ex ante: 0.35%

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: 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	0.02%	-	-
Obligationen CHF	23.12%	23.00%	-
Obligationen Fremdwährungen (CHF hedged)	36.00%	35.00%	-
Aktien Schweiz	12.49%	12.50%	-
Aktien Ausland	9.11%	10.00%	-
Aktien Ausland (CHF hedged)	12.33%	12.50%	-
Immobilien Schweiz	6.94%	7.00%	30.00%
Total Aktien (In- und Ausland)	33.92%	-	50.00%
Total Fremdwährungen	9.11%	-	30.00%

Grösste Positionen

NESTLE SA-REG	1.81%
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	1.49%
NOVARTIS AG-REG	1.45%
APPLE INC	0.81%
MICROSOFT CORP	0.71%
NVIDIA CORP	0.68%
ZURICH INSURANCE GROUP AG	0.67%
UBS GROUP AG-REG	0.62%
CIE FINANCIERE RICHEMO-A REG	0.61%
ABB LTD-REG	0.54%

Benchmarkzusammensetzung

SBI® AAA-BBB Total Return	23.00%
FTSE Non-CHF World Government Bond Index TR (CHF hedged)	17.50%
Bloomberg Global Aggregate Corporate ex CHF TR (CHF hedged)	17.50%
SPI® Total Return	12.50%
MSCI World ex Switzerland Net Return	5.00%
MSCI World ex Switzerland Net Return (CHF hedged)	12.50%
MSCI World ex Switzerland Small Cap Net Return	2.50%
MSCI Emerging Markets Net Return	2.50%
SXI Real Estate® Funds Broad Total Return	7.00%

Portfoliostruktur nach Währungen

CHF	90.89%
USD	4.75%
EUR	0.58%
JPY	0.58%
Übrige	3.21%

Eigenschaften der festverzinslichen Anlagen

Modified Duration	6.68
Durchschnittliches Rating	A+