

30. April 2025

# Anlagestiftung Swiss Life BVG-Mix Index 75



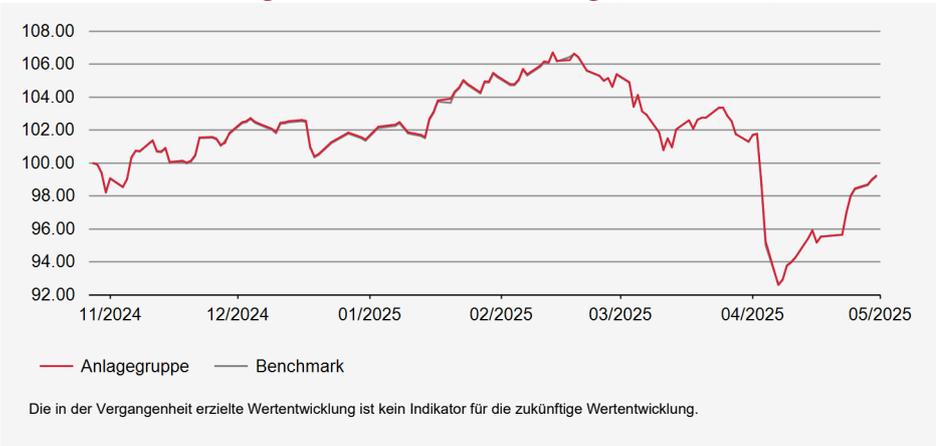
(Aktien- und Fremdwährungsquote gemäss BVV2 überschritten)

**Nettovermögen (NAV) in Mio. CHF: 19.63**  
**Nettovermögen pro Anspruch in CHF: 992.40**

## Anlagestrategie

Die Anlagegruppe wird mit einem indexierten Ansatz verwaltet, wobei die strategische Aktienquote 75% 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. Aufgrund des erhöhten Aktienanteils beinhaltet dieses Produkt ein höheres Risiko als Vorsorgelösungen mit einem max. Aktienanteil von 50%.

## 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	-2.16%	-2.05%	-5.74%	-	-	-	-	-
Benchmark	-2.14%	-2.07%	-5.73%	-	-	-	-	-

## Statistische Angaben (annualisiert)

	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Aufl.
Volatilität Anlagegruppe (in %)	-	-	-	-	9.99
Volatilität Benchmark (in %)	-	-	-	-	10.00
Tracking Error ex post (in %)	-	-	-	-	0.07
Information Ratio	-	-	-	-	1.23
Sharpe Ratio	-	-	-	-	-0.18
Korrelation	-	-	-	-	1.00
Beta	-	-	-	-	1.00
Jensen-Alpha	-	-	-	-	0.10
Maximum Drawdown (in %)	-	-	-	-	-13.23
Recovery Period (Jahre)	-	-	-	-	-

## Performance

Datenhistorie unzureichend

## Produktinformationen

**Valorennummer:** 137661037

**ISIN:** CH1376610379

**LEI:** 25490045MD808NK0DS90

**Bloomberg-Code:** SLAI75S SW

**Benchmark:** Customized

**Währung:** CHF

**Domizil:** Schweiz

**Aufledgedatum:** 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](http://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](http://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.

30. April 2025

# Anlagestiftung Swiss Life BVG-Mix Index 75



(Aktien- und Fremdwährungsquote gemäss BVV2 überschritten)

## Portfoliostruktur nach Anlagekategorien

	Anlagegruppe	Benchmark	max. BVV2
Liquidität	0.03%	-	-
Obligationen CHF	6.83%	7.00%	-
Obligationen Fremdwährungen (CHF hedged)	10.45%	11.00%	-
Aktien Schweiz	26.71%	26.50%	-
Aktien Ausland	22.35%	22.00%	-
Aktien Ausland (CHF hedged)	26.80%	26.50%	-
Immobilien Schweiz	6.83%	7.00%	30.00%
Total Aktien (In- und Ausland)	75.86%	-	50.00%
Total Fremdwährungen	22.35%	-	30.00%

## Grösste Positionen

NESTLE SA-REG	3.87%
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	3.18%
NOVARTIS AG-REG	3.11%
APPLE INC	1.82%
MICROSOFT CORP	1.59%
NVIDIA CORP	1.52%
ZURICH INSURANCE GROUP AG	1.43%
UBS GROUP AG-REG	1.33%
CIE FINANCIERE RICHEMO-A REG	1.31%
ABB LTD-REG	1.16%

## Benchmarkzusammensetzung

SBI® AAA-BBB Total Return	7.00%
FTSE Non-CHF World Government Bond Index TR (CHF hedged)	5.50%
Bloomberg Global Aggregate Corporate ex CHF TR (CHF hedged)	5.50%
SPI® Total Return	26.50%
MSCI World ex Switzerland Net Return	11.00%
MSCI World ex Switzerland Net Return (CHF hedged)	26.50%
MSCI World ex Switzerland Small Cap Net Return	5.50%
MSCI Emerging Markets Net Return	5.50%
SXI Real Estate® Funds Broad Total Return	7.00%

## Portfoliostruktur nach Währungen

CHF	77.65%
USD	11.68%
JPY	1.44%
EUR	1.43%
Übrige	7.81%

## Eigenschaften der festverzinslichen Anlagen

Modified Duration	6.68
Durchschnittliches Rating	A+

**Haftungsausschluss:** Die vorliegende Publikation begründet weder eine Aufforderung noch eine Empfehlung zum Erwerb oder Verkauf von Anlageinstrumenten, sondern dient lediglich zu Informationszwecken. Sämtliche Dokumente, welche die rechtliche Grundlage für eine allfällige Investition bilden, können kostenlos bei der Anlagestiftung Swiss Life, c/o Swiss Life AG, Postfach, 8022 Zürich, Tel. 043 547 71 11 und unter [www.swisslife.ch/anlagestiftung](http://www.swisslife.ch/anlagestiftung) bezogen werden. Der Kreis der Anleger ist beschränkt auf Einrichtungen der 2. Säule und der Säule 3a sowie sonstige steuerbefreite Einrichtungen mit Sitz in der Schweiz, die ihrem Zweck nach der beruflichen Vorsorge dienen und Personen, die kollektive Anlagen für diese Einrichtungen verwalten, von der Eidgenössischen Finanzmarktaufsicht FINMA beaufsichtigt werden und bei der Stiftung ausschliesslich Gelder für diese Einrichtungen anlegen. Die vergangene Performance stellt keinen Indikator für die laufende und zukünftige Entwicklung dar. Sämtliche Produkt- und Firmennamen sind Marken™ oder eingetragene® Warenzeichen ihrer jeweiligen Inhaber. Ihre Verwendung stellt keine Zugehörigkeit zu ihnen und keine Zustimmung durch sie dar. Dieses Dokument wurde möglicherweise mithilfe künstlicher Intelligenz erstellt. **Quelle:** Swiss Life Asset Managers. Alle Rechte vorbehalten.