

30. November 2025

Anlagestiftung Swiss Life BVG-Mix Index 45

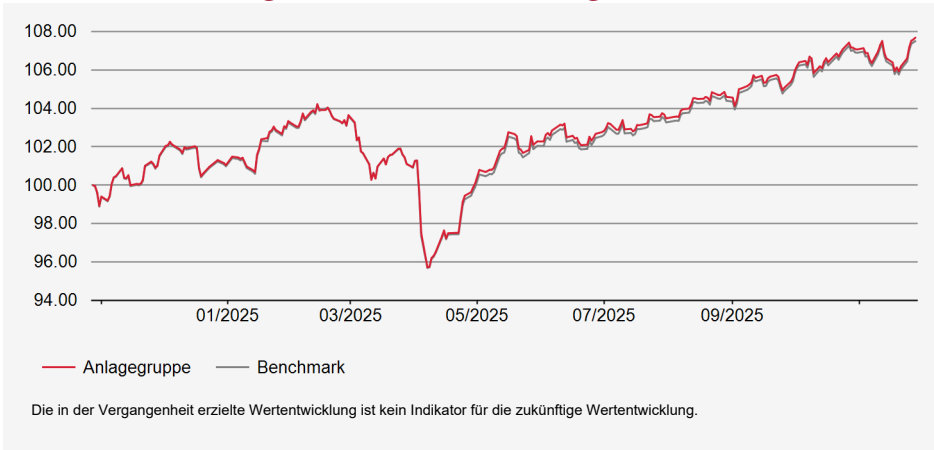


Nettovermögen (NAV) in Mio. CHF: 47.42
Nettovermögen pro Anspruch in CHF: 1'076.84

Anlagestrategie

Die Anlagegruppe wird mit einem indexierten Ansatz verwaltet, wobei die strategische Aktienquote 45% 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	6.56%	0.58%	2.95%	6.04%	-	-	-	7.06%
Benchmark	6.45%	0.57%	2.97%	5.90%	-	-	-	6.89%

Statistische Angaben (annualisiert)

	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Aufl.
Volatilität Anlagegruppe (in %)	4.62	-	-	-	4.95
Volatilität Benchmark (in %)	4.66	-	-	-	4.99
Tracking Error ex post (in %)	0.18	-	-	-	0.17
Information Ratio	0.72	-	-	-	0.91
Sharpe Ratio	1.23	-	-	-	1.23
Korrelation	1.00	-	-	-	1.00
Beta	0.99	-	-	-	0.99
Jensen-Alpha	0.19	-	-	-	0.23
Maximum Drawdown (in %)	-8.15	-	-	-	-8.15
Recovery Period (Jahre)	0.35	-	-	-	0.35

Performance

Datenhistorie unzureichend

Produktinformationen

Valorennummer: 137661035

ISIN: CH1376610353

LEI: 2549004PTRK412MK4644

Bloomberg-Code: SLAI45S SW

Benchmark: Customized

Währung: CHF

Domizil: Schweiz

Auflagedatum: 28/10/2024

Erstausgabepreis: 1000.00

Jahresabschluss: 30.09

Ausgabe/Rücknahme: Täglich

Annahmeschluss: 12.00 Uhr

Verwässerungsschutz:

Ausgabe- / Rücknahmekommission zugunsten der Anlagegruppe gemäss Konditionenübersicht.

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: 0.37%

ex post per: 30/09/2025 0.37%

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	18.76%	19.00%	-
Obligationen Fremdwährungen (CHF hedged)	28.71%	29.00%	-
Aktien Schweiz	16.22%	16.00%	-
Aktien Ausland	12.96%	13.00%	-
Aktien Ausland (CHF hedged)	16.26%	16.00%	-
Immobilien Schweiz	7.11%	7.00%	30.00%
Total Aktien (In- und Ausland)	45.43%	-	50.00%
Total Fremdwährungen	12.96%	-	30.00%

Grösste Positionen

ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	2.08%
NESTLE SA-REG	1.98%
NOVARTIS AG-REG	1.98%
NVIDIA CORP	1.25%
APPLE INC	1.20%
MICROSOFT CORP	1.01%
UBS GROUP AG-REG	0.89%
CIE FINANCIERE RICHEMO-A REG	0.88%
ABB LTD-REG	0.88%
ZURICH INSURANCE GROUP AG	0.81%

Benchmarkzusammensetzung

SBI® AAA-BBB Total Return	19.00%
FTSE Non-CHF World Government Bond Index TR (CHF hedged)	14.50%
Bloomberg Global Aggregate Corporate ex CHF TR (CHF hedged)	14.50%
SPI® Total Return	16.00%
MSCI World ex Switzerland Net Return	7.00%
MSCI World ex Switzerland Net Return (CHF hedged)	16.00%
MSCI World ex Switzerland Small Cap Net Return	3.00%
MSCI Emerging Markets Net Return	3.00%
SXI Real Estate® Funds Broad Total Return	7.00%

Portfoliostruktur nach Währungen

CHF	87.04%
USD	7.19%
EUR	0.80%
JPY	0.78%
Übrige	4.18%

Eigenschaften der festverzinslichen Anlagen

Modified Duration	6.73
Durchschnittliches Rating	A+