

31. Mai 2026

Anlagestiftung Swiss Life BVG-Mix Index 15

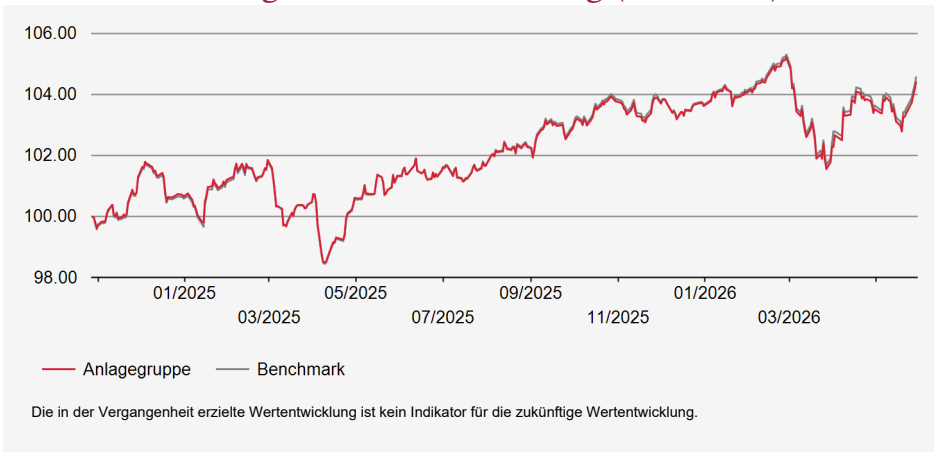


Nettovermögen (NAV) in Mio. CHF: 44.92
Nettovermögen pro Anspruch in CHF: 1'044.06

Anlagestrategie

Die Anlagegruppe wird mit einem indexierten Ansatz verwaltet, wobei die strategische Aktienquote 15% 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)



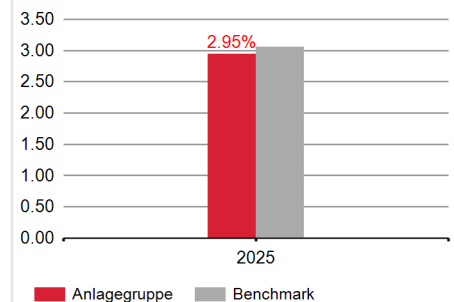
Performance in Referenzwährung

	Kumulierte Performance				Annualisierte Performance			
	YTD	1 Monat	3 Monate	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Aufl.
Anlagegruppe	0.75%	0.86%	-0.77%	3.03%	-	-	-	2.76%
Benchmark	0.87%	0.90%	-0.70%	3.20%	-	-	-	2.86%

Statistische Angaben (annualisiert)

	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Aufl.
Volatilität Anlagegruppe (in %)	3.67	-	-	-	3.42
Volatilität Benchmark (in %)	3.67	-	-	-	3.43
Tracking Error ex post (in %)	0.08	-	-	-	0.10
Information Ratio	-2.17	-	-	-	-0.92
Sharpe Ratio	0.82	-	-	-	0.71
Korrelation	1.00	-	-	-	1.00
Beta	1.00	-	-	-	1.00
Jensen-Alpha	-0.17	-	-	-	-0.09
Maximum Drawdown (in %)	-3.47	-	-	-	-3.47
Recovery Period (Jahre)	-	-	-	-	-

Performance



Produktinformationen

Valorennummer: 137660518

ISIN: CH1376605189

LEI: 254900B4UANU1ZR4GC06

Bloomberg-Code: SLA15S SW

Benchmark: Customized

Währung: CHF

Domizil: Schweiz

Aufgatedatum: 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: 0.38%

ex post per: 30/09/2025 0.38%

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	30.86%	31.00%	-
Obligationen Fremdwährungen (CHF hedged)	46.70%	47.00%	-
Aktien Schweiz	5.61%	5.50%	-
Aktien Ausland	4.10%	4.00%	-
Aktien Ausland (CHF hedged)	5.57%	5.50%	-
Immobilien Schweiz	7.18%	7.00%	30.00%
Total Aktien (In- und Ausland)	15.28%	-	50.00%
Total Fremdwährungen	4.10%	-	30.00%

Grösste Positionen

NOVARTIS AG-REG	0.72%
ROCHE HOLDING AG	0.72%
NESTLE SA-REG	0.64%
NVIDIA CORP	0.42%
ABB LTD-REG	0.41%
APPLE INC	0.40%
UBS GROUP AG-REG	0.35%
CIE FINANCIERE RICHEMO-A REG	0.28%
MICROSOFT CORP	0.28%
ZURICH INSURANCE GROUP AG	0.27%

Benchmarkzusammensetzung

SBI® AAA-BBB Total Return	31.00%
FTSE Non-CHF World Government Bond Index TR (CHF hedged)	23.50%
Bloomberg Global Aggregate Corporate ex CHF TR (CHF hedged)	23.50%
SPI® Total Return	5.50%
MSCI World ex Switzerland Net Return	2.00%
MSCI World ex Switzerland Net Return (CHF hedged)	5.50%
MSCI World ex Switzerland Small Cap Net Return	1.00%
MSCI Emerging Markets Net Return	1.00%
SXI Real Estate® Funds Broad Total Return	7.00%

Portfoliostruktur nach Währungen

CHF	95.90%
USD	2.17%
JPY	0.25%
EUR	0.24%
Übrige	1.44%

Eigenschaften der festverzinslichen Anlagen

Modified Duration	6.57
Durchschnittliches Rating	A+