

Anlagestiftung Swiss Life

BVG-Mix Index 25

Nettovermögen (NAV) in Mio. CHF: 31.10
Nettovermögen pro Anspruch in CHF: 1'051.18

Anlagestrategie

Die Anlagegruppe wird mit einem indexierten Ansatz verwaltet, wobei die strategische Aktienquote 25% beträgt. Die Anlagegruppe investiert indirekt über indexierte kollektive Anlagen global in Aktien, in Unternehmens- wie auch Staatsoptionen 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	4.30%	0.27%	2.03%	3.68%	-	-	-	4.71%	
Benchmark	4.38%	0.28%	2.08%	3.73%	-	-	-	4.72%	

Statistische Angaben (annualisiert)

	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Aufl.
Volatilität Anlagegruppe (in %)	2.94	-	-	-	3.27
Volatilität Benchmark (in %)	2.95	-	-	-	3.28
Tracking Error ex post (in %)	0.15	-	-	-	0.14
Information Ratio	-0.36	-	-	-	-0.07
Sharpe Ratio	1.17	-	-	-	1.23
Korrelation	1.00	-	-	-	1.00
Beta	0.99	-	-	-	0.99
Jensen-Alpha	-0.04	-	-	-	0.02
Maximum Drawdown (in %)	-4.87	-	-	-	-4.87
Recovery Period (Jahre)	0.33	-	-	-	0.33

Performance

Datenhistorie unzureichend

Produktinformationen

Valorennummer: 137660520

ISIN: CH1376605205

LEI: 254900BN8UJF3508WG67

Bloomberg-Code: SLAI25S 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: 0.38%

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: Gesamttertag 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.

Anlagestiftung Swiss Life

BVG-Mix Index 25

Portfoliostruktur nach Anlagekategorien

	Anlagegruppe	Benchmark	max. BVV2
Liquidität	-0.02%	-	-
Obligationen CHF	26.71%	27.00%	-
Obligationen Fremdwährungen (CHF hedged)	40.74%	41.00%	-
Aktien Schweiz	9.20%	9.00%	-
Aktien Ausland	7.62%	7.50%	-
Aktien Ausland (CHF hedged)	8.57%	8.50%	-
Immobilien Schweiz	7.18%	7.00%	30.00%
Total Aktien (In- und Ausland)	25.39%	-	50.00%
Total Fremdwährungen	7.62%	-	30.00%

Grösste Positionen

ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	1.18%
NESTLE SA-REG	1.12%
NOVARTIS AG-REG	1.12%
NVIDIA CORP	0.65%
APPLE INC	0.63%
MICROSOFT CORP	0.53%
UBS GROUP AG-REG	0.50%
CIE FINANCIERE RICHEMO-A REG	0.50%
ABB LTD-REG	0.50%
ZURICH INSURANCE GROUP AG	0.46%

Benchmarkzusammensetzung

SBI® AAA-BBB Total Return	27.00%
FTSE Non-CHF World Government Bond Index TR (CHF hedged)	20.50%
Bloomberg Global Aggregate Corporate ex CHF TR (CHF hedged)	20.50%
SPI® Total Return	9.00%
MSCI World ex Switzerland Net Return	3.50%
MSCI World ex Switzerland Net Return (CHF hedged)	8.50%
MSCI World ex Switzerland Small Cap Net Return	2.00%
MSCI Emerging Markets Net Return	2.00%
SXI Real Estate® Funds Broad Total Return	7.00%

Portfoliostruktur nach Währungen

CHF	92.38%
USD	4.02%
JPY	0.47%
EUR	0.44%
Übrige	2.69%

Eigenschaften der festverzinslichen Anlagen

Modified Duration	6.73
Durchschnittliches Rating	A+