

Anlagestiftung Swiss Life

BVG-Mix Index 35



Nettovermögen (NAV) in Mio. CHF: 26.88
Nettovermögen pro Anspruch in CHF: 1'061.89

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 Staatsoptionen sowie in Schweizer Immobilien und zeichnet sich so durch eine breite Diversifikation aus.

Performance

Datenhistorie unzureichend

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	5.23%	0.40%	2.48%	4.65%	-	-	-	5.69%	
Benchmark	5.43%	0.42%	2.52%	4.83%	-	-	-	5.82%	

Statistische Angaben (annualisiert)

	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Aufl.
Volatilität Anlagegruppe (in %)	3.77	-	-	-	4.10
Volatilität Benchmark (in %)	3.78	-	-	-	4.11
Tracking Error ex post (in %)	0.09	-	-	-	0.10
Information Ratio	-2.11	-	-	-	-1.26
Sharpe Ratio	1.16	-	-	-	1.19
Korrelation	1.00	-	-	-	1.00
Beta	1.00	-	-	-	1.00
Jensen-Alpha	-0.18	-	-	-	-0.12
Maximum Drawdown (in %)	-6.49	-	-	-	-6.49
Recovery Period (Jahre)	0.35	-	-	-	0.35

Produktinformationen

Valorennummer: 137660522

ISIN: CH1376605221

LEI: 254900GF0BJD6RE4WJ66

Bloomberg-Code: SLAI35S 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: Gesamttrag 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 35

Portfoliostruktur nach Anlagekategorien

	Anlagegruppe	Benchmark	max. BVV2
Liquidität	0.01%	-	-
Obligationen CHF	22.89%	23.00%	-
Obligationen Fremdwährungen (CHF hedged)	34.93%	35.00%	-
Aktien Schweiz	12.57%	12.50%	-
Aktien Ausland	10.00%	10.00%	-
Aktien Ausland (CHF hedged)	12.44%	12.50%	-
Immobilien Schweiz	7.17%	7.00%	30.00%
Total Aktien (In- und Ausland)	35.00%	-	50.00%
Total Fremdwährungen	10.00%	-	30.00%

Grösste Positionen

ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	1.61%
NESTLE SA-REG	1.53%
NOVARTIS AG-REG	1.53%
NVIDIA CORP	0.93%
APPLE INC	0.90%
MICROSOFT CORP	0.75%
UBS GROUP AG-REG	0.69%
CIE FINANCIERE RICHEMO-A REG	0.68%
ABB LTD-REG	0.68%
ZURICH INSURANCE GROUP AG	0.63%

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	90.00%
USD	5.32%
JPY	0.60%
EUR	0.59%
Übrige	3.49%

Eigenschaften der festverzinslichen Anlagen

Modified Duration	6.73
Durchschnittliches Rating	A+