

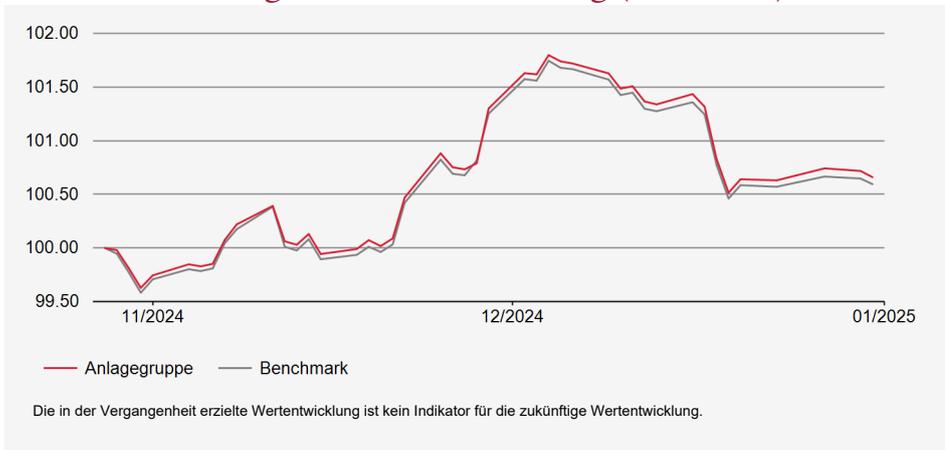
Anlagestiftung Swiss Life BVG-Mix Index 15

Nettovermögen (NAV) in Mio. CHF: 10.07
Nettovermögen pro Anspruch in CHF: 1'006.60

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	-	-0.63%	-	-	-	-	-	-
Benchmark	-	-0.65%	-	-	-	-	-	-

Statistische Angaben (annualisiert)

	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Aufl.
Volatilität Anlagegruppe (in %)	-	-	-	-	4.36
Volatilität Benchmark (in %)	-	-	-	-	4.41
Tracking Error ex post (in %)	-	-	-	-	0.08
Information Ratio	-	-	-	-	3.46
Sharpe Ratio	-	-	-	-	0.41
Korrelation	-	-	-	-	1.00
Beta	-	-	-	-	0.99
Jensen-Alpha	-	-	-	-	0.40
Maximum Drawdown (in %)	-	-	-	-	-1.26
Recovery Period (Jahre)	-	-	-	-	-

Performance

Datenhistorie unzureichend

Produktinformationen

Valorennummer: 137660518
ISIN: CH1376605189
LEI: 254900B4UANU1ZR4GC06
Bloomberg-Code: SLA115S 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 Manager:
Taktische Asset Allocation
Swiss Life Asset Management AG
Eingesetzte artreine Anlagegruppen
Diverse gemäss
Swiss Life Best Select Invest Plus®

Externe Beratung:
PPCmetrics erbringt innerhalb der artreinen Anlagegruppen folgende Dienstleistungen: Beratung betreffend geeigneter Mandatsstruktur, Unterstützung bei der Selektion geeigneter Asset Manager sowie Unterstützung bei der laufenden Überwachung des Asset Managers und Beurteilung der Anlageresultate.
Kurspublikationen: Bloomberg: ASSL
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, «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	0.03%	-	-
Obligationen CHF	31.19%	31.00%	-
Obligationen Fremdwährungen (CHF hedged)	46.35%	47.00%	-
Aktien Schweiz	5.19%	5.50%	-
Aktien Ausland	9.90%	9.50%	-
Aktien Ausland (CHF hedged)	-	-	-
Immobilien Schweiz	7.35%	7.00%	30.00%
Total Aktien (In- und Ausland)	15.09%	-	50.00%
Total Fremdwährungen	9.90%	-	30.00%

Grösste Positionen

NESTLE SA-REG	0.67%
NOVARTIS AG-REG	0.62%
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	0.61%
APPLE INC	0.49%
NVIDIA CORP	0.43%
MICROSOFT CORP	0.39%
UBS GROUP AG-REG	0.29%
AMAZON.COM INC	0.27%
ZURICH INSURANCE GROUP AG	0.27%
ABB LTD-REG	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%
Swiss Performance Index	5.50%
MSCI World ex Switzerland Total Return	8.50%
MSCI World ex Switzerland Small Cap Total Return	1.00%
SXI Real Estate® Funds Broad Total Return	7.00%

Portfoliostruktur nach Währungen

CHF	90.10%
USD	7.39%
EUR	0.74%
JPY	0.62%
Übrige	1.14%

Eigenschaften der festverzinslichen Anlagen

Modified Duration	6.82
Durchschnittliches Rating	A+