

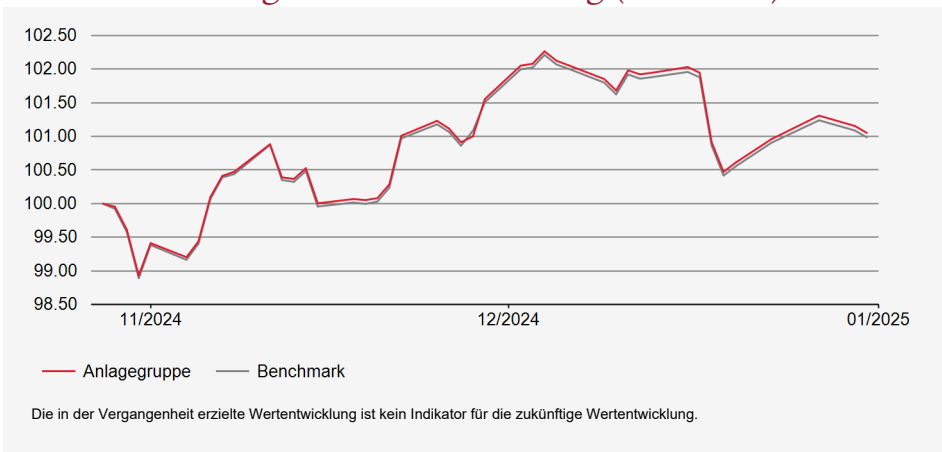
# Anlagestiftung Swiss Life BVG-Mix Index 45

**Nettovermögen (NAV) in Mio. CHF: 10.11**  
**Nettovermögen pro Anspruch in CHF: 1'010.52**

## 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 | -                      | -0.50%  | -        | -      | -                         | -       | -        | -     |
| Benchmark    | -                      | -0.51%  | -        | -      | -                         | -       | -        | -     |

## Statistische Angaben (annualisiert)

|                                 | 1 Jahr | 3 Jahre | 5 Jahre | 10 Jahre | Aufl. |
|---------------------------------|--------|---------|---------|----------|-------|
| Volatilität Anlagegruppe (in %) | -      | -       | -       | -        | 6.88  |
| Volatilität Benchmark (in %)    | -      | -       | -       | -        | 6.93  |
| Tracking Error ex post (in %)   | -      | -       | -       | -        | 0.06  |
| Information Ratio               | -      | -       | -       | -        | 4.56  |
| Sharpe Ratio                    | -      | -       | -       | -        | 0.49  |
| Korrelation                     | -      | -       | -       | -        | 1.00  |
| Beta                            | -      | -       | -       | -        | 0.99  |
| Jensen-Alpha                    | -      | -       | -       | -        | 0.42  |
| Maximum Drawdown (in %)         | -      | -       | -       | -        | -1.75 |
| Recovery Period (Jahre)         | -      | -       | -       | -        | -     |

## Performance

Datenhistorie unzureichend

## Produktinformationen

**Valorennummer:** 137661035

**ISIN:** CH1376610353

**LEI:** 2549004PTRK412MK4644

**Bloomberg-Code:** SLAI45S 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](http://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](http://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                               | 0.04%        | -         | -         |
| Obligationen CHF                         | 19.02%       | 19.00%    | -         |
| Obligationen Fremdwährungen (CHF hedged) | 28.44%       | 29.00%    | -         |
| Aktien Schweiz                           | 16.24%       | 16.00%    | -         |
| Aktien Ausland                           | 28.95%       | 29.00%    | -         |
| Aktien Ausland (CHF hedged)              | -            | -         | -         |
| Immobilien Schweiz                       | 7.31%        | 7.00%     | 30.00%    |
| Total Aktien (In- und Ausland)           | 45.19%       | -         | 50.00%    |
| Total Fremdwährungen                     | 28.95%       | -         | 30.00%    |

## Grösste Positionen

|                              |       |
|------------------------------|-------|
| NESTLE SA-REG                | 2.08% |
| NOVARTIS AG-REG              | 1.92% |
| ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN | 1.90% |
| APPLE INC                    | 1.44% |
| NVIDIA CORP                  | 1.25% |
| MICROSOFT CORP               | 1.13% |
| UBS GROUP AG-REG             | 0.90% |
| ZURICH INSURANCE GROUP AG    | 0.84% |
| ABB LTD-REG                  | 0.83% |
| CIE FINANCIERE RICHEMO-A REG | 0.79% |

## 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% |
| Swiss Performance Index                                     | 16.00% |
| MSCI World ex Switzerland Total Return                      | 26.00% |
| MSCI World ex Switzerland Small Cap Total Return            | 3.00%  |
| SXI Real Estate® Funds Broad Total Return                   | 7.00%  |

## Portfoliostruktur nach Währungen

|        |        |
|--------|--------|
| CHF    | 71.05% |
| USD    | 21.62% |
| EUR    | 2.17%  |
| JPY    | 1.81%  |
| Übrige | 3.35%  |

## Eigenschaften der festverzinslichen Anlagen

|                           |      |
|---------------------------|------|
| Modified Duration         | 6.82 |
| Durchschnittliches Rating | A+   |