

Anlagestiftung Swiss Life BVG-Mix Index 75

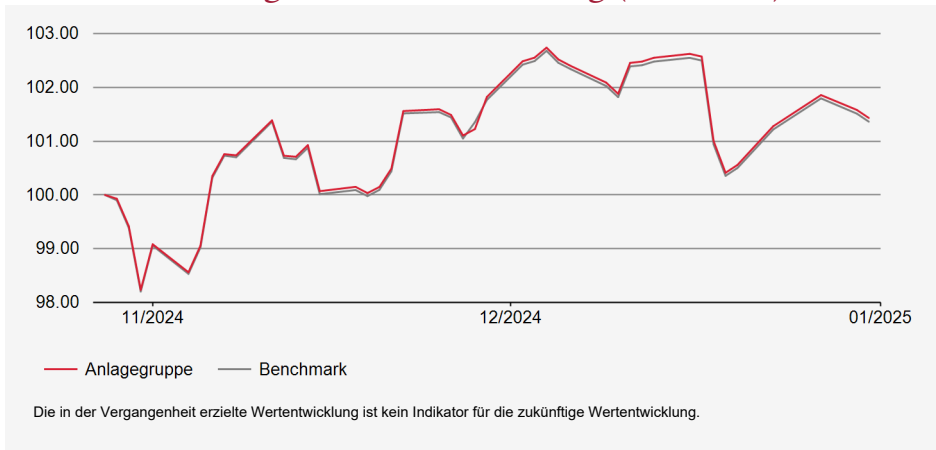
(Aktien- und Fremdwährungsquote gemäss BVV2 überschritten)

Nettovermögen (NAV) in Mio. CHF: 11.13
Nettovermögen pro Anspruch in CHF: 1'014.31

Anlagestrategie

Die Anlagegruppe wird mit einem indexierten Ansatz verwaltet, wobei die strategische Aktienquote 75% 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. Aufgrund des erhöhten Aktienanteils beinhaltet dieses Produkt ein höheres Risiko als Vorsorgelösungen mit einem max. Aktienanteil von 50%.

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	-	-0.38%	-	-	-	-	-	-
Benchmark	-	-0.40%	-	-	-	-	-	-

Statistische Angaben (annualisiert)

	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Aufl.
Volatilität Anlagegruppe (in %)	-	-	-	-	9.64
Volatilität Benchmark (in %)	-	-	-	-	9.65
Tracking Error ex post (in %)	-	-	-	-	0.03
Information Ratio	-	-	-	-	9.40
Sharpe Ratio	-	-	-	-	0.50
Korrelation	-	-	-	-	1.00
Beta	-	-	-	-	1.00
Jensen-Alpha	-	-	-	-	0.43
Maximum Drawdown (in %)	-	-	-	-	-2.26
Recovery Period (Jahre)	-	-	-	-	-

Performance

Datenhistorie unzureichend

Produktinformationen

Valorennummer: 137661037

ISIN: CH1376610379

LEI: 25490045MD808NK0DS90

Bloomberg-Code: SLAI75S 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.

Anlagestiftung Swiss Life BVG-Mix Index 75

(Aktien- und Fremdwährungsquote gemäss BVV2 überschritten)



Portfoliostruktur nach Anlagekategorien

	Anlagegruppe	Benchmark	max. BVV2
Liquidität	0.01%	-	-
Obligationen CHF	6.96%	7.00%	-
Obligationen Fremdwährungen (CHF hedged)	11.04%	11.00%	-
Aktien Schweiz	26.42%	26.50%	-
Aktien Ausland	48.65%	48.50%	-
Aktien Ausland (CHF hedged)	-	-	-
Immobilien Schweiz	6.92%	7.00%	30.00%
Total Aktien (In- und Ausland)	75.07%	-	50.00%
Total Fremdwährungen	48.65%	-	30.00%

Grösste Positionen

NESTLE SA-REG	3.39%
NOVARTIS AG-REG	3.13%
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	3.10%
APPLE INC	2.40%
NVIDIA CORP	2.08%
MICROSOFT CORP	1.88%
UBS GROUP AG-REG	1.46%
ZURICH INSURANCE GROUP AG	1.36%
ABB LTD-REG	1.35%
AMAZON.COM INC	1.31%

Benchmarkzusammensetzung

SBI® AAA-BBB Total Return	7.00%
FTSE Non-CHF World Government Bond Index TR (CHF hedged))	5.50%
Bloomberg Global Aggregate Corporate ex CHF TR (CHF hedged)	5.50%
Swiss Performance Index	26.50%
MSCI World ex Switzerland Total Return	43.00%
MSCI World ex Switzerland Small Cap Total Return	5.50%
SXI Real Estate® Funds Broad Total Return	7.00%

Portfoliostruktur nach Währungen

CHF	51.36%
USD	36.29%
EUR	3.64%
JPY	3.07%
Übrige	5.65%

Eigenschaften der festverzinslichen Anlagen

Modified Duration	6.84
Durchschnittliches Rating	A+