

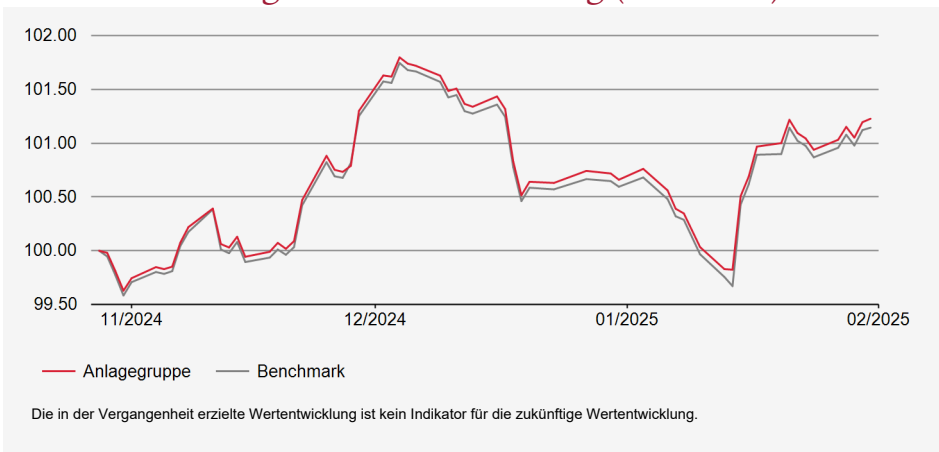
# Anlagestiftung Swiss Life BVG-Mix Index 15

**Nettovermögen (NAV) in Mio. CHF: 12.97**  
**Nettovermögen pro Anspruch in CHF: 1'012.27**

## 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	0.56%	0.56%	1.60%	-	-	-	-	-
Benchmark	0.55%	0.55%	1.57%	-	-	-	-	-

## Statistische Angaben (annualisiert)

	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Aufl.
Volatilität Anlagegruppe (in %)	-	-	-	-	3.61
Volatilität Benchmark (in %)	-	-	-	-	3.65
Tracking Error ex post (in %)	-	-	-	-	0.06
Information Ratio	-	-	-	-	4.04
Sharpe Ratio	-	-	-	-	0.82
Korrelation	-	-	-	-	1.00
Beta	-	-	-	-	0.99
Jensen-Alpha	-	-	-	-	0.37
Maximum Drawdown (in %)	-	-	-	-	-1.94
Recovery Period (Jahre)	-	-	-	-	-

## Performance

Datenhistorie unzureichend

## Produktinformationen

**Valorennummer:** 137660518

**ISIN:** CH1376605189

**LEI:** 254900B4UANU1ZR4GC06

**Bloomberg-Code:** SLA115S SW

**Benchmark:** Customized

**Währung:** CHF

**Domizil:** Schweiz

**Aufgatedatum:** 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	0.09%	-	-
Obligationen CHF	30.77%	31.00%	-
Obligationen Fremdwährungen (CHF hedged)	46.93%	47.00%	-
Aktien Schweiz	5.84%	5.50%	-
Aktien Ausland	9.58%	9.50%	-
Aktien Ausland (CHF hedged)	-	-	-
Immobilien Schweiz	6.79%	7.00%	30.00%
Total Aktien (In- und Ausland)	15.42%	-	50.00%
Total Fremdwährungen	9.58%	-	30.00%

## Grösste Positionen

NESTLE SA-REG	0.72%
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	0.71%
NOVARTIS AG-REG	0.69%
APPLE INC	0.44%
NVIDIA CORP	0.36%
MICROSOFT CORP	0.36%
UBS GROUP AG-REG	0.35%
CIE FINANCIERE RICHEMO-A REG	0.34%
ZURICH INSURANCE GROUP AG	0.29%
ABB LTD-REG	0.28%

## 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	90.42%
USD	7.14%
EUR	0.75%
JPY	0.58%
Übrige	1.10%

## Eigenschaften der festverzinslichen Anlagen

Modified Duration	6.75
Durchschnittliches Rating	A+