

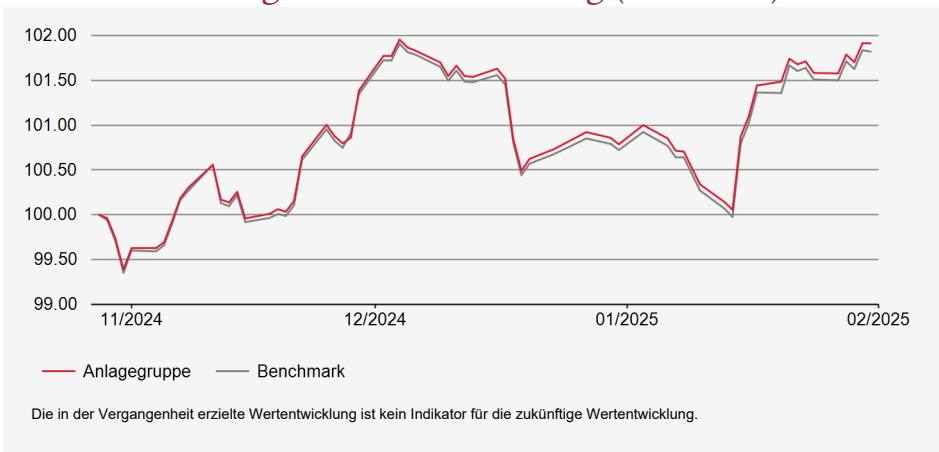
# Anlagestiftung Swiss Life BVG-Mix Index 25

**Nettovermögen (NAV) in Mio. CHF: 11.20**  
**Nettovermögen pro Anspruch in CHF: 1'019.13**

## Anlagestrategie

Die Anlagegruppe wird mit einem indexierten Ansatz verwaltet, wobei die strategische Aktienquote 25% 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	1.12%	1.12%	2.54%	-	-	-	-	-
Benchmark	1.09%	1.09%	2.48%	-	-	-	-	-

## Statistische Angaben (annualisiert)

	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Aufl.
Volatilität Anlagegruppe (in %)	-	-	-	-	4.48
Volatilität Benchmark (in %)	-	-	-	-	4.52
Tracking Error ex post (in %)	-	-	-	-	0.05
Information Ratio	-	-	-	-	5.76
Sharpe Ratio	-	-	-	-	1.11
Korrelation	-	-	-	-	1.00
Beta	-	-	-	-	0.99
Jensen-Alpha	-	-	-	-	0.42
Maximum Drawdown (in %)	-	-	-	-	-1.86
Recovery Period (Jahre)	-	-	-	-	-

## Performance

Datenhistorie unzureichend

## Produktinformationen

**Valorennummer:** 137660520  
**ISIN:** CH1376605205  
**LEI:** 254900BN8UJF3508WG67  
**Bloomberg-Code:** SLAI25S 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	2.80%	-	-
Obligationen CHF	25.97%	27.00%	-
Obligationen Fremdwährungen (CHF hedged)	39.70%	41.00%	-
Aktien Schweiz	9.25%	9.00%	-
Aktien Ausland	15.76%	16.00%	-
Aktien Ausland (CHF hedged)	-	-	-
Immobilien Schweiz	6.51%	7.00%	30.00%
Total Aktien (In- und Ausland)	25.01%	-	50.00%
Total Fremdwährungen	15.76%	-	30.00%

## Grösste Positionen

NESTLE SA-REG	1.13%
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	1.12%
NOVARTIS AG-REG	1.09%
APPLE INC	0.70%
NVIDIA CORP	0.58%
MICROSOFT CORP	0.57%
UBS GROUP AG-REG	0.55%
CIE FINANCIERE RICHEMO-A REG	0.53%
ZURICH INSURANCE GROUP AG	0.45%
ABB LTD-REG	0.45%

## Benchmarkzusammensetzung

SBI® AAA-BBB Total Return	27.00%
FTSE Non-CHF World Government Bond Index TR (CHF hedged))	20.50%
Bloomberg Global Aggregate Corporate ex CHF TR (CHF hedged)	20.50%
Swiss Performance Index	9.00%
MSCI World ex Switzerland Total Return	14.00%
MSCI World ex Switzerland Small Cap Total Return	2.00%
SXI Real Estate® Funds Broad Total Return	7.00%

## Portfoliostruktur nach Währungen

CHF	84.24%
USD	11.71%
EUR	1.22%
JPY	0.98%
Übrige	1.84%

## Eigenschaften der festverzinslichen Anlagen

Modified Duration	6.75
Durchschnittliches Rating	A+