

Anlagestiftung Swiss Life BVG-Mix Index 35

Nettovermögen (NAV) in Mio. CHF: 11.90
Nettovermögen pro Anspruch in CHF: 1'025.86

Anlagestrategie

Die Anlagegruppe wird mit einem indexierten Ansatz verwaltet, wobei die strategische Aktienquote 35% 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	1.66%	1.66%	3.45%	-	-	-	-	-
Benchmark	1.63%	1.63%	3.41%	-	-	-	-	-

Statistische Angaben (annualisiert)

	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Aufl.
Volatilität Anlagegruppe (in %)	-	-	-	-	5.44
Volatilität Benchmark (in %)	-	-	-	-	5.47
Tracking Error ex post (in %)	-	-	-	-	0.05
Information Ratio	-	-	-	-	5.17
Sharpe Ratio	-	-	-	-	1.28
Korrelation	-	-	-	-	1.00
Beta	-	-	-	-	1.00
Jensen-Alpha	-	-	-	-	0.38
Maximum Drawdown (in %)	-	-	-	-	-1.67
Recovery Period (Jahre)	-	-	-	-	0.02

Performance

Datenhistorie unzureichend

Produktinformationen

Valorennummer: 137660522
ISIN: CH1376605221
LEI: 254900GF0BJD6RE4WJ66
Bloomberg-Code: SLAI35S 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
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	0.18%	-	-
Obligationen CHF	22.44%	23.00%	-
Obligationen Fremdwährungen (CHF hedged)	34.34%	35.00%	-
Aktien Schweiz	13.25%	12.50%	-
Aktien Ausland	22.98%	22.50%	-
Aktien Ausland (CHF hedged)	-	-	-
Immobilien Schweiz	6.80%	7.00%	30.00%
Total Aktien (In- und Ausland)	36.23%	-	50.00%
Total Fremdwährungen	22.98%	-	30.00%

Grösste Positionen

NESTLE SA-REG	1.63%
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	1.61%
NOVARTIS AG-REG	1.56%
APPLE INC	1.03%
NVIDIA CORP	0.85%
MICROSOFT CORP	0.85%
UBS GROUP AG-REG	0.79%
CIE FINANCIERE RICHEMO-A REG	0.76%
ZURICH INSURANCE GROUP AG	0.65%
AMAZON.COM INC	0.65%

Benchmarkzusammensetzung

SBI® AAA-BBB Total Return	23.00%
FTSE Non-CHF World Government Bond Index TR (CHF hedged))	17.50%
Bloomberg Global Aggregate Corporate ex CHF TR (CHF hedged)	17.50%
Swiss Performance Index	12.50%
MSCI World ex Switzerland Total Return	20.00%
MSCI World ex Switzerland Small Cap Total Return	2.50%
SXI Real Estate® Funds Broad Total Return	7.00%

Portfoliostruktur nach Währungen

CHF	77.02%
USD	17.10%
EUR	1.79%
JPY	1.42%
Übrige	2.67%

Eigenschaften der festverzinslichen Anlagen

Modified Duration	6.75
Durchschnittliches Rating	A+