

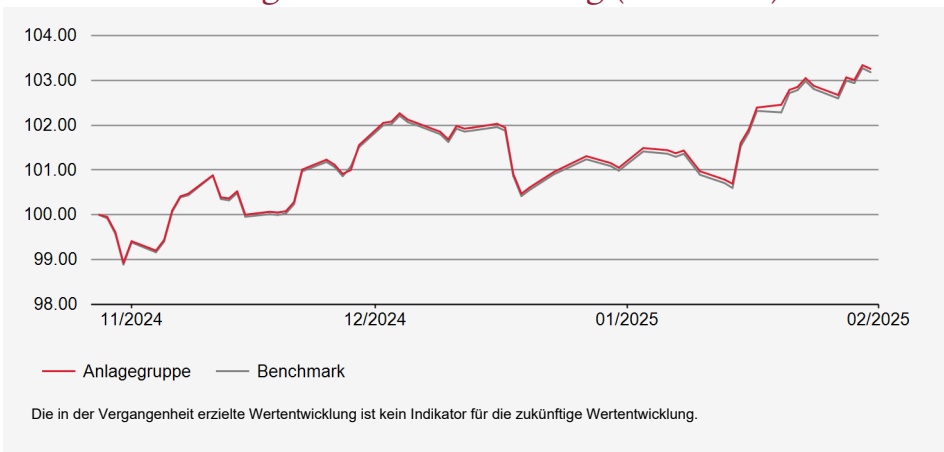
# Anlagestiftung Swiss Life BVG-Mix Index 45

**Nettovermögen (NAV) in Mio. CHF: 12.49**  
**Nettovermögen pro Anspruch in CHF: 1'032.57**

## 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	2.18%	2.18%	4.37%	-	-	-	-	-
Benchmark	2.17%	2.17%	4.34%	-	-	-	-	-

## Statistische Angaben (annualisiert)

	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Aufl.
Volatilität Anlagegruppe (in %)	-	-	-	-	6.43
Volatilität Benchmark (in %)	-	-	-	-	6.48
Tracking Error ex post (in %)	-	-	-	-	0.05
Information Ratio	-	-	-	-	4.39
Sharpe Ratio	-	-	-	-	1.38
Korrelation	-	-	-	-	1.00
Beta	-	-	-	-	0.99
Jensen-Alpha	-	-	-	-	0.39
Maximum Drawdown (in %)	-	-	-	-	-1.75
Recovery Period (Jahre)	-	-	-	-	0.08

## Performance

Datenhistorie unzureichend

## Produktinformationen

**Valorennummer:** 137661035  
**ISIN:** CH1376610353  
**LEI:** 2549004PTRK412MK4644  
**Bloomberg-Code:** SLAI45S 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	19.03%	19.00%	-
Obligationen Fremdwährungen (CHF hedged)	28.92%	29.00%	-
Aktien Schweiz	16.14%	16.00%	-
Aktien Ausland	29.03%	29.00%	-
Aktien Ausland (CHF hedged)	-	-	-
Immobilien Schweiz	6.79%	7.00%	30.00%
Total Aktien (In- und Ausland)	45.17%	-	50.00%
Total Fremdwährungen	29.03%	-	30.00%

## Grösste Positionen

NESTLE SA-REG	1.98%
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	1.96%
NOVARTIS AG-REG	1.91%
APPLE INC	1.32%
NVIDIA CORP	1.09%
MICROSOFT CORP	1.08%
UBS GROUP AG-REG	0.97%
CIE FINANCIERE RICHEMO-A REG	0.93%
AMAZON.COM INC	0.83%
ZURICH INSURANCE GROUP AG	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	70.97%
USD	21.64%
EUR	2.27%
JPY	1.77%
Übrige	3.35%

## Eigenschaften der festverzinslichen Anlagen

Modified Duration	6.75
Durchschnittliches Rating	A+