

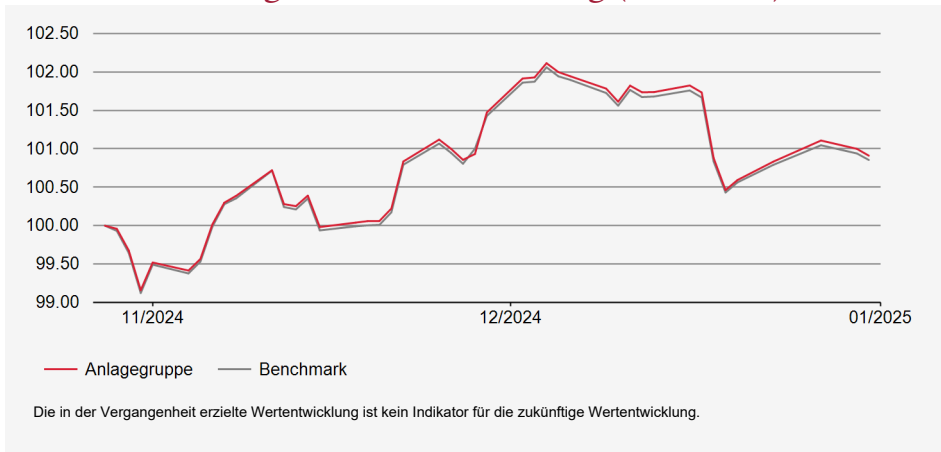
# Anlagestiftung Swiss Life BVG-Mix Index 35

**Nettovermögen (NAV) in Mio. CHF: 10.32**  
**Nettovermögen pro Anspruch in CHF: 1'009.11**

## 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	-	-0.55%	-	-	-	-	-	-
Benchmark	-	-0.56%	-	-	-	-	-	-

## Statistische Angaben (annualisiert)

	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Aufl.
Volatilität Anlagegruppe (in %)	-	-	-	-	6.03
Volatilität Benchmark (in %)	-	-	-	-	6.07
Tracking Error ex post (in %)	-	-	-	-	0.06
Information Ratio	-	-	-	-	3.79
Sharpe Ratio	-	-	-	-	0.46
Korrelation	-	-	-	-	1.00
Beta	-	-	-	-	0.99
Jensen-Alpha	-	-	-	-	0.35
Maximum Drawdown (in %)	-	-	-	-	-1.62
Recovery Period (Jahre)	-	-	-	-	-

## Performance

Datenhistorie unzureichend

## Produktinformationen

**Valorennummer:** 137660522  
**ISIN:** CH1376605221  
**LEI:** 254900GF0BJD6RE4WJ66  
**Bloomberg-Code:** SLAI35S 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](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	0.07%	-	-
Obligationen CHF	22.56%	23.00%	-
Obligationen Fremdwährungen (CHF hedged)	34.31%	35.00%	-
Aktien Schweiz	13.01%	12.50%	-
Aktien Ausland	22.88%	22.50%	-
Aktien Ausland (CHF hedged)	-	-	-
Immobilien Schweiz	7.17%	7.00%	30.00%
Total Aktien (In- und Ausland)	35.89%	-	50.00%
Total Fremdwährungen	22.88%	-	30.00%

## Grösste Positionen

NESTLE SA-REG	1.67%
NOVARTIS AG-REG	1.54%
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	1.53%
APPLE INC	1.13%
NVIDIA CORP	0.98%
MICROSOFT CORP	0.89%
UBS GROUP AG-REG	0.72%
ZURICH INSURANCE GROUP AG	0.67%
ABB LTD-REG	0.67%
CIE FINANCIERE RICHEMO-A REG	0.63%

## 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	77.12%
USD	17.08%
EUR	1.71%
JPY	1.44%
Übrige	2.65%

## Eigenschaften der festverzinslichen Anlagen

Modified Duration	6.81
Durchschnittliches Rating	A+