

30. April 2025

Anlagestiftung Swiss Life BVG-Mix Index 45



Nettvermögen (NAV) in Mio. CHF: 24.65
Nettvermögen pro Anspruch in CHF: 1'001.02

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	-0.94%	-0.83%	-3.06%	-	-	-	-	-
Benchmark	-1.05%	-0.97%	-3.15%	-	-	-	-	-

Statistische Angaben (annualisiert)

	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Aufl.
Volatilität Anlagegruppe (in %)	-	-	-	-	6.44
Volatilität Benchmark (in %)	-	-	-	-	6.49
Tracking Error ex post (in %)	-	-	-	-	0.20
Information Ratio	-	-	-	-	1.53
Sharpe Ratio	-	-	-	-	-0.06
Korrelation	-	-	-	-	1.00
Beta	-	-	-	-	0.99
Jensen-Alpha	-	-	-	-	0.35
Maximum Drawdown (in %)	-	-	-	-	-8.15
Recovery Period (Jahre)	-	-	-	-	-

Performance

Datenhistorie unzureichend

Produktinformationen

Valorennummer: 137661035

ISIN: CH1376610353

LEI: 2549004PTRK412MK4644

Bloomberg-Code: SLAI45S SW

Benchmark: Customized

Währung: CHF

Domizil: Schweiz

Aufgagedatum: 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 Management:

Strategische Asset Allocation und regelbasiertes Rebalancing durch Swiss Life Asset Management AG

Eingesetzte artreine Anlagegruppen: Index Anlagegruppen der Anlagestiftung Swiss Life

Externe Beratung:

Überwachung der Anlageresultate der eingesetzten Anlagegruppen durch PPCmetrics

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	0.03%	-	-
Obligationen CHF	18.25%	19.00%	-
Obligationen Fremdwährungen (CHF hedged)	27.82%	29.00%	-
Aktien Schweiz	16.55%	16.00%	-
Aktien Ausland	13.67%	13.00%	-
Aktien Ausland (CHF hedged)	17.04%	16.00%	-
Immobilien Schweiz	6.63%	7.00%	30.00%
Total Aktien (In- und Ausland)	47.26%	-	50.00%
Total Fremdwährungen	13.67%	-	30.00%

Grösste Positionen

NESTLE SA-REG	2.40%
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	1.97%
NOVARTIS AG-REG	1.93%
APPLE INC	1.17%
MICROSOFT CORP	1.02%
NVIDIA CORP	0.98%
ZURICH INSURANCE GROUP AG	0.89%
UBS GROUP AG-REG	0.82%
CIE FINANCIERE RICHEMO-A REG	0.81%
ABB LTD-REG	0.72%

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%
SPI® Total Return	16.00%
MSCI World ex Switzerland Net Return	7.00%
MSCI World ex Switzerland Net Return (CHF hedged)	16.00%
MSCI World ex Switzerland Small Cap Net Return	3.00%
MSCI Emerging Markets Net Return	3.00%
SXI Real Estate® Funds Broad Total Return	7.00%

Portfoliostruktur nach Währungen

CHF	86.33%
USD	7.44%
EUR	0.91%
JPY	0.89%
Übrige	4.43%

Eigenschaften der festverzinslichen Anlagen

Modified Duration	6.68
Durchschnittliches Rating	A+