

Anlagestiftung Swiss Life BVG-Mix 75

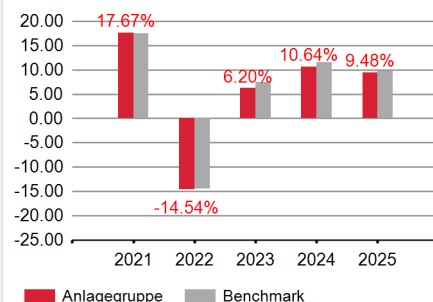
(Aktien- und Fremdwährungsquote gemäss BVV2 überschritten)

Nettovermögen (NAV) in Mio. CHF: 498.41
Nettovermögen pro Anspruch in CHF: 150.32

Anlagestrategie

Anlagen in alle vom BVG zugelassenen Anlagekategorien (strategischer Aktienanteil: 75%). Aktive Asset Allocation. Begrenzung für Beteiligungspapiere: 85%. Begrenzung für Fremdwährungen: 50%. Durchschnittliche Ratingqualität der Obligationen: mindestens BBB. Umsetzung mittels Einsatz artreiner Kollektivanlagen. Aufgrund des erhöhten Aktien- und Fremdwährungsanteils beinhaltet diese Anlagegruppe ein höheres Risiko im Vergleich zu einem BVG-Mix mit maximal 50% Aktien- bzw. maximal 30% Fremdwährungsanteil.

Performance



Wertentwicklung in Referenzwährung (Basis 100)



Produktinformationen

Valorennummer: 43583002
ISIN: CH0435830028
LEI: 2549007MI5RG5X8NMB06
Bloomberg-Code: SWABM75 SW
Benchmark: Customized
Währung: CHF
Domizil: Schweiz
Aufgedatum: 31/10/2018
Erstausgabepreis: 100.00
Jahresabschluss: 30.09
Ausgabe/Rücknahme: Täglich
Annahmeschluss: 12:00 Uhr
Verwässerungsschutz: Ausgabe- / Rücknahmekommission zugunsten der Anlagegruppe gemäss Konditionenübersicht.

Asset Management: Strategische und taktische Asset Allocation durch Swiss Life Asset Management AG
Eingesetzte artreine Anlagegruppen: Diverse gemäss Swiss Life Best Select Invest Plus © Ansatz

Externe Beratung: Überwachung der Anlageresultate der eingesetzten Anlagegruppen sowie Beratung zu geeigneter Mandatsstruktur und bei der Selektion geeigneter Asset Managers durch PPCmetrics

Kurspublikationen: Bloomberg: ASSL
www.swisslife.ch/anlagestiftung

Betriebsaufwandquote TER KGAST ex ante: 0.50%
ex post per: 30/09/2025 0.55%

Performance in Referenzwährung

	Kumulierte Performance				Annualisierte Performance			
	YTD	1 Monat	3 Monate	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Aufl.
Anlagegruppe	-2.03%	-5.23%	-2.03%	6.12%	6.54%	3.52%	-	5.65%
Benchmark	-2.21%	-4.50%	-2.21%	6.30%	7.13%	4.00%	-	6.15%

Statistische Angaben (annualisiert)

	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Aufl.
Volatilität Anlagegruppe (in %)	8.46	7.61	9.00	-	10.04
Volatilität Benchmark (in %)	7.54	7.32	9.12	-	10.31
Tracking Error ex post (in %)	1.21	0.72	0.76	-	0.84
Information Ratio	-0.15	-0.83	-0.64	-	-0.60
Sharpe Ratio	0.70	0.72	0.34	-	0.54
Korrelation	1.00	1.00	1.00	-	1.00
Beta	1.12	1.04	0.98	-	0.97
Jensen-Alpha	-0.91	-0.81	-0.43	-	-0.32
Maximum Drawdown (in %)	-9.63	-13.10	-17.76	-	-23.54
Recovery Period (Jahre)	0.11	0.46	1.76	-	0.74

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.

(Aktien- und Fremdwährungsquote gemäss BVV2 überschritten)

Portfoliostruktur nach Anlagekategorien

	Anlagegruppe	Benchmark	max. BVV2
Liquidität	3.12%	4.00%	-
Hypotheken Schweiz	0.94%	1.50%	-
Obligationen CHF Inland	2.17%	4.50%	-
Obligationen Fremdwährungen (CHF hedged)	4.23%	4.00%	-
Aktien Schweiz	30.64%	29.00%	-
Aktien Ausland	19.06%	17.00%	-
Aktien Ausland (CHF hedged)	28.40%	29.00%	-
Immobilien Schweiz	7.56%	6.50%	30.00%
Immobilien Ausland (CHF hedged)	1.36%	1.50%	10.00%
Alternative Anlagen (CHF hedged)	2.56%	3.00%	15.00%
Infrastruktur	-	-	-
Total Aktien (In- und Ausland)	78.10%	75.00%	50.00%
Total Fremdwährungen	19.06%	37.00%	30.00%

Grösste Aktienpositionen

NVIDIA CORP	2.00%
APPLE INC	1.76%
MICROSOFT CORP	1.23%
AMAZON.COM INC	0.95%
ALPHABET INC-CL A	0.79%
ALPHABET INC-CL C	0.66%
BROADCOM INC	0.66%
META PLATFORMS INC-CLASS A	0.59%
NOVARTIS AG-REG	0.57%
TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	0.55%

Benchmarkzusammensetzung

1M Saron	4.00%
SBI Domestic AAA-A 1-3Y Total Return	1.50%
SBI AAA-BBB Total Return	4.50%
Bloomberg Gl. Agg. Treas. ex CH (CHF hedged)	1.00%
Bloomberg Gl. Agg. Corp. (CHF hedged)	1.00%
Bloomberg Gl. Agg. Corp. Short Term (CHF hedged)	-
JP Morgan CEMBI Broad Diversified IG Index (CHF hedged)	2.00%
SPI® Total Return	29.00%
MSCI World ex Switzerland Net Return	17.00%
MSCI World ex Switzerland Net Return (CHF hedged)	29.00%
KGAST Immo-Index	6.50%
SL REF (LUX) ESG German Core Real Estate (CHF hedged)	1.30%
Anlagestiftung Swiss Life Immobilien Europa Industrie und Logistik ESG (EUR), CHF hedged	0.20%
HFRX Global Hedge Funds (CHF hedged)	3.00%
Anlagestiftung Swiss Life Infrastruktur Global ESG (EUR)	-

Portfoliostruktur nach Währungen

CHF	80.94%
USD	9.47%
JPY	3.23%
EUR	1.25%
Übrige	5.11%

Eigenschaften der festverzinslichen Anlagen

Modified Duration	5.05
Durchschnittliches Rating	A