

Anlagestiftung Swiss Life BVG-Mix 75

(Aktien- und Fremdwährungsquote gemäss BVV2 überschritten)

Nettovermögen (NAV) in Mio. CHF: 382.82
Nettovermögen pro Anspruch in CHF: 142.46

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.

Wertentwicklung in Referenzwährung (Basis 100)



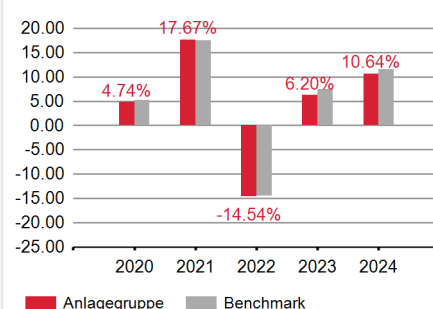
Performance in Referenzwährung

	Kumulierte Performance				Annualisierte Performance			
	YTD	1 Monat	3 Monate	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Aufl.
Anlagegruppe	1.65%	0.68%	0.57%	2.31%	5.65%	5.56%	-	5.45%
Benchmark	2.12%	0.69%	1.06%	3.23%	6.67%	6.19%	-	6.06%

Statistische Angaben (annualisiert)

	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Aufl.
Volatilität Anlagegruppe (in %)	8.14	9.00	9.57	-	10.29
Volatilität Benchmark (in %)	7.84	9.30	9.79	-	10.66
Tracking Error ex post (in %)	0.44	0.60	0.60	-	0.77
Information Ratio	-2.07	-1.71	-1.04	-	-0.78
Sharpe Ratio	0.20	0.50	0.53	-	0.51
Korrelation	1.00	1.00	1.00	-	1.00
Beta	1.04	0.97	0.98	-	0.96
Jensen-Alpha	-1.02	-0.82	-0.49	-	-0.38
Maximum Drawdown (in %)	-13.10	-13.10	-17.76	-	-23.54
Recovery Period (Jahre)	-	-	1.76	-	0.74

Performance



Produktinformationen

Valorennummer: 43583002

ISIN: CH0435830028

LEI: 2549007MI5RG5X8NMB06

Bloomberg-Code: SWABM75 SW

Benchmark: Customized

Währung: CHF

Domizil: Schweiz

Aufledgedatum: 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: 30/09/2024 0.61%

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.

(Aktien- und Fremdwährungsquote gemäss BVV2 überschritten)

Portfoliostruktur nach Anlagekategorien

	Anlagegruppe	Benchmark	max. BVV2
Liquidität	3.69%	2.00%	-
Hypotheken Schweiz	1.23%	1.50%	-
Obligationen CHF Inland	3.39%	4.50%	-
Obligationen Fremdwährungen (CHF hedged)	5.88%	4.00%	-
Aktien Schweiz	27.65%	29.00%	-
Aktien Ausland	17.86%	17.00%	-
Aktien Ausland (CHF hedged)	29.43%	29.00%	-
Immobilien Schweiz	7.10%	6.50%	30.00%
Immobilien Ausland (CHF hedged)	1.80%	1.50%	10.00%
Alternative Anlagen (CHF hedged)	1.97%	3.00%	15.00%
Infrastruktur	-	2.00%	-
Total Aktien (In- und Ausland)	74.94%	75.00%	50.00%
Total Fremdwährungen	17.86%	37.00%	30.00%

Grösste Aktienpositionen

NESTLE SA-REG	3.54%
NOVARTIS AG-REG	3.29%
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	3.17%
NVIDIA CORP	2.03%
MICROSOFT CORP	1.85%
APPLE INC	1.62%
ZURICH INSURANCE GROUP AG	1.42%
UBS GROUP AG-REG	1.41%
CIE FINANCIERE RICHEMO-A REG	1.40%
ABB LTD-REG	1.30%

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	82.14%
USD	6.93%
JPY	3.50%
EUR	2.03%
Übrige	5.40%

Eigenschaften der festverzinslichen Anlagen

Modified Duration	5.39
Durchschnittliches Rating	A+