

Anlagestiftung Swiss Life BVG-Mix 75

(Aktien- und Fremdwährungsquote gemäss BVV2 überschritten)

Nettovermögen (NAV) in Mio. CHF: 204.99
Nettovermögen pro Anspruch in CHF: 131.95

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)



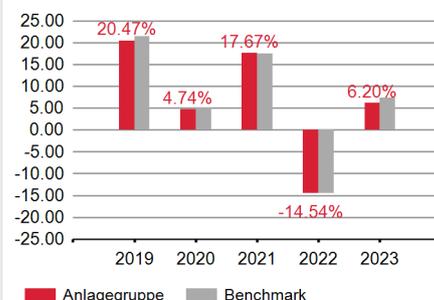
Performance in Referenzwährung

	Kumulierte Performance				Annualisierte Performance			
	YTD	1 Monat	3 Monate	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Aufl.
Anlagegruppe	4.17%	2.63%	6.21%	7.00%	3.16%	5.26%	-	5.34%
Benchmark	4.32%	2.75%	6.37%	7.89%	3.63%	5.72%	-	5.87%

Statistische Angaben (annualisiert)

	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Aufl.
Volatilität Anlagegruppe (in %)	6.74	10.02	10.48	-	10.80
Volatilität Benchmark (in %)	6.93	10.41	10.99	-	11.28
Tracking Error ex post (in %)	0.30	0.71	0.86	-	0.85
Information Ratio	-2.93	-0.67	-0.53	-	-0.63
Sharpe Ratio	0.77	0.28	0.50	-	0.50
Korrelation	1.00	1.00	1.00	-	1.00
Beta	0.97	0.96	0.95	-	0.96
Jensen-Alpha	-0.71	-0.34	-0.18	-	-0.27
Maximum Drawdown (in %)	-6.81	-17.76	-23.54	-	-23.54
Recovery Period (Jahre)	0.13	-	0.74	-	0.74

Performance



Produktinformationen

Valorennummer: 43583002

ISIN: CH0435830028

LEI: 2549007MI5RG5X8NMB06

Bloomberg-Code: SWABM75 SW

Benchmark: Customized

Währung: CHF

Domizil: Schweiz

Aufgatedatum: 31/10/2018

Erstausgabepreis: 100.00

Jahresabschluss: 30.09

Ausgabe/Rücknahme: Täglich

Annahmeschluss: 14.00 Uhr

Ausgabe-/Rücknahmekommission: Keine

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

Betriebsaufwandquote TER KGAST

ex ante: 0.64%

ex post per: 30/09/2023 0.64%

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.

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.

Anlagestiftung Swiss Life BVG-Mix 75



(Aktien- und Fremdwährungsquote gemäss BVV2 überschritten)

Portfoliostruktur nach Anlagekategorien

	Anlagegruppe	Benchmark	max. BVV2
Liquidität	3.46%	2.00%	-
Hypotheken Schweiz	0.34%	-	-
Obligationen Fremdwährungen (CHF hedged)	11.63%	13.00%	-
Aktien Schweiz	37.46%	38.00%	-
Aktien Ausland	36.01%	37.00%	-
Aktien Ausland (CHF hedged)	2.05%	-	-
Immobilien Schweiz	6.43%	5.00%	30.00%
Immobilien Ausland (CHF hedged)	0.37%	-	10.00%
Alternative Anlagen (CHF hedged)	2.25%	5.00%	15.00%
Total Aktien (In- und Ausland)	75.53%	75.00%	50.00%
Total Fremdwährungen	36.01%	37.00%	30.00%

Grösste Aktienpositionen

NESTLE SA-REG	5.95%
NOVARTIS AG-REG	4.60%
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	3.96%
MICROSOFT CORP.	2.65%
UBS GROUP AG-REG	1.87%
CIE FINANCIERE RICHEMONT-REG	1.84%
NVIDIA CORP	1.77%
ZURICH INSURANCE GROUP AG	1.67%
ABB LTD-REG	1.60%
ALPHABET INC	1.39%

Benchmarkzusammensetzung

1M Saron	2.00%
Bloomberg Gl. Agg. Treas. ex CH TR (CHF hedged)	2.00%
Bloomberg Gl. Agg. Corp. TR (CHF hedged)	4.00%
Bloomberg Gl. Agg. Corp. Short Term TR (CHF hedged)	4.00%
JP Morgan CEMBI Broad Div IG Index (CHF hedged)	3.00%
Swiss Performance Index	38.00%
MSCI World ex CH ESG Leaders, in CHF	29.60%
MSCI AC World Small Cap, in CHF	5.55%
MSCI Emerging Markets, in CHF	1.85%
KGAST Immo-Index	5.00%
HFRX Global Hedge Funds (CHF hedged)	5.00%

Portfoliostruktur nach Währungen

CHF	62.69%
USD	24.48%
EUR	2.85%
JPY	2.43%
Übrige	7.55%

Eigenschaften der festverzinslichen Anlagen

Modified Duration	4.62
Durchschnittliches Rating	A-