

# Anlagestiftung Swiss Life BVG-Mix 75

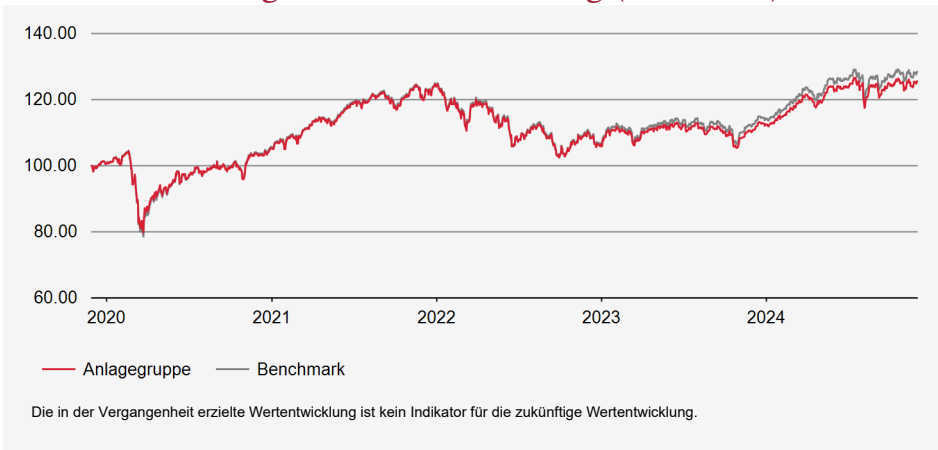
(Aktien- und Fremdwährungsquote gemäss BVV2 überschritten)

**Nettovermögen (NAV) in Mio. CHF: 308.74**  
**Nettovermögen pro Anspruch in CHF: 141.47**

## 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)



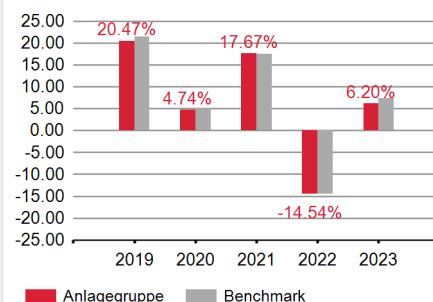
## Performance in Referenzwährung

	Kumulierte Performance				Annualisierte Performance			
	YTD	1 Monat	3 Monate	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Aufl.
Anlagegruppe	11.68%	2.35%	0.72%	13.87%	1.51%	4.66%	-	5.87%
Benchmark	12.46%	2.36%	0.99%	14.66%	2.16%	5.13%	-	6.43%

## Statistische Angaben (annualisiert)

	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Aufl.
Volatilität Anlagegruppe (in %)	6.19	9.60	10.44	-	10.36
Volatilität Benchmark (in %)	6.19	10.07	10.95	-	10.80
Tracking Error ex post (in %)	0.17	0.69	0.86	-	0.79
Information Ratio	-4.70	-0.95	-0.55	-	-0.71
Sharpe Ratio	1.88	0.07	0.42	-	0.55
Korrelation	1.00	1.00	1.00	-	1.00
Beta	1.00	0.95	0.95	-	0.96
Jensen-Alpha	-0.78	-0.59	-0.23	-	-0.29
Maximum Drawdown (in %)	-7.18	-17.76	-23.54	-	-23.54
Recovery Period (Jahre)	-	1.76	0.74	-	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.

**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:** 0.62%

**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](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.

(Aktien- und Fremdwährungsquote gemäss BVV2 überschritten)

## Portfoliostruktur nach Anlagekategorien

	Anlagegruppe	Benchmark	max. BVV2
Liquidität	2.06%	2.00%	-
Hypotheken Schweiz	0.23%	-	-
Obligationen Fremdwährungen (CHF hedged)	13.39%	13.00%	-
Aktien Schweiz	38.10%	38.00%	-
Aktien Ausland	39.03%	37.00%	-
Aktien Ausland (CHF hedged)	-	-	-
Immobilien Schweiz	4.44%	5.00%	30.00%
Immobilien Ausland (CHF hedged)	0.23%	-	10.00%
Alternative Anlagen (CHF hedged)	2.53%	5.00%	15.00%
<b>Total Aktien (In- und Ausland)</b>	<b>77.13%</b>	<b>75.00%</b>	<b>50.00%</b>
<b>Total Fremdwährungen</b>	<b>39.03%</b>	<b>37.00%</b>	<b>30.00%</b>

## Grösste Aktienpositionen

NESTLE SA-REG	4.88%
NOVARTIS AG-REG	4.64%
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	4.37%
NVIDIA CORP	2.43%
UBS GROUP AG-REG	2.24%
MICROSOFT CORP	2.15%
ZURICH INSURANCE GROUP AG	1.99%
ABB LTD-REG	1.95%
CIE FINANCIERE RICHEMO-A REG	1.61%
ALPHABET INC	1.22%

## 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	60.97%
USD	24.29%
EUR	2.31%
JPY	2.29%
Übrige	10.15%

## Eigenschaften der festverzinslichen Anlagen

Modified Duration	4.55
Durchschnittliches Rating	A-