

Anlagestiftung Swiss Life BVG-Mix 75

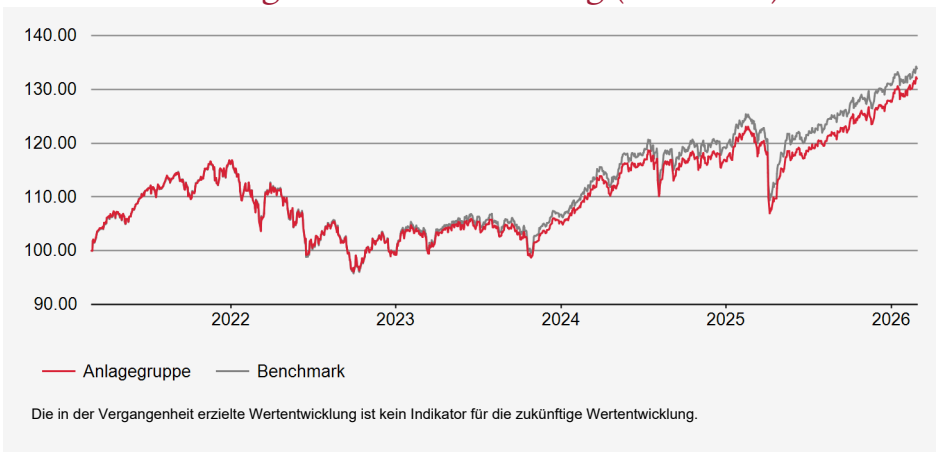
(Aktien- und Fremdwährungsquote gemäss BVV2 überschritten)

Nettovermögen (NAV) in Mio. CHF: 516.06
Nettovermögen pro Anspruch in CHF: 158.61

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)



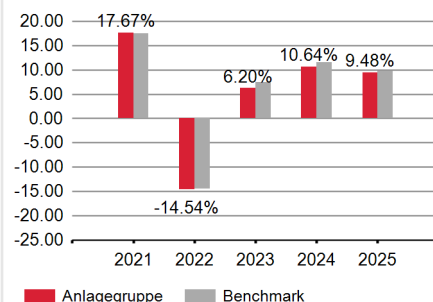
Performance in Referenzwährung

| | Kumulierte Performance | | | | Annualisierte Performance | | | |
|--------------|------------------------|---------|----------|--------|---------------------------|---------|----------|-------|
| | YTD | 1 Monat | 3 Monate | 1 Jahr | 3 Jahre | 5 Jahre | 10 Jahre | Aufl. |
| Anlagegruppe | 3.38% | 2.57% | 4.31% | 8.39% | 8.75% | 5.70% | - | 6.49% |
| Benchmark | 2.40% | 1.98% | 3.26% | 7.78% | 9.07% | 6.00% | - | 6.89% |

Statistische Angaben (annualisiert)

| | 1 Jahr | 3 Jahre | 5 Jahre | 10 Jahre | Aufl. |
|---------------------------------|--------|---------|---------|----------|--------|
| Volatilität Anlagegruppe (in %) | 6.99 | 6.75 | 8.88 | - | 9.86 |
| Volatilität Benchmark (in %) | 6.58 | 6.65 | 9.07 | - | 10.20 |
| Tracking Error ex post (in %) | 0.88 | 0.57 | 0.69 | - | 0.80 |
| Information Ratio | 0.69 | -0.56 | -0.44 | - | -0.50 |
| Sharpe Ratio | 1.15 | 1.11 | 0.58 | - | 0.63 |
| Korrelation | 0.99 | 1.00 | 1.00 | - | 1.00 |
| Beta | 1.06 | 1.01 | 0.98 | - | 0.96 |
| Jensen-Alpha | 0.18 | -0.43 | -0.17 | - | -0.16 |
| Maximum Drawdown (in %) | -12.18 | -13.10 | -17.76 | - | -23.54 |
| Recovery Period (Jahre) | 0.38 | 0.46 | 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: 0.47%

ex post per: 30/09/2025 0.55%

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 | 4.07% | 4.00% | - |
| Hypotheken Schweiz | 0.91% | 1.50% | - |
| Obligationen CHF Inland | 2.58% | 4.50% | - |
| Obligationen Fremdwährungen (CHF hedged) | 4.17% | 4.00% | - |
| Aktien Schweiz | 28.24% | 29.00% | - |
| Aktien Ausland | 19.08% | 17.00% | - |
| Aktien Ausland (CHF hedged) | 28.97% | 29.00% | - |
| Immobilien Schweiz | 6.30% | 6.50% | 30.00% |
| Immobilien Ausland (CHF hedged) | 1.28% | 1.50% | 10.00% |
| Alternative Anlagen (CHF hedged) | 1.62% | 3.00% | 15.00% |
| Infrastruktur | - | - | - |
| Total Aktien (In- und Ausland) | 76.28% | 75.00% | 50.00% |
| Total Fremdwährungen | 19.08% | 37.00% | 30.00% |

Grösste Aktienpositionen

| | |
|------------------------------|-------|
| ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN | 4.48% |
| NOVARTIS AG-REG | 4.45% |
| NESTLE SA-REG | 3.76% |
| ABB LTD-REG | 1.97% |
| NVIDIA CORP | 1.91% |
| APPLE INC | 1.72% |
| UBS GROUP AG-REG | 1.63% |
| ZURICH INSURANCE GROUP AG | 1.48% |
| CIE FINANCIERE RICHEMO-A REG | 1.47% |
| MICROSOFT CORP | 1.23% |

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 | 80.92% |
| USD | 9.05% |
| JPY | 3.36% |
| EUR | 1.29% |
| Übrige | 5.38% |

Eigenschaften der festverzinslichen Anlagen

| | |
|---------------------------|------|
| Modified Duration | 5.26 |
| Durchschnittliches Rating | A+ |