

Anlagestiftung Swiss Life BVG-Mix 75

(Aktien- und Fremdwährungsquote gemäss BVV2 überschritten)

Nettovermögen (NAV) in Mio. CHF: 101.15
Nettovermögen pro Anspruch in CHF: 122.74

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)



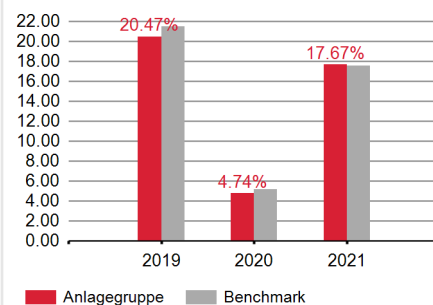
Performance in Referenzwährung

	KUMULIERTE PERFORMANCE				ANNUALISIERTE PERFORMANCE			
	YTD	1 MONAT	3 MONATE	1 JAHR	3 JAHRE	5 JAHRE	10 JAHRE	AUFL.
ANLAGEGRUPPE	-12.06%	-2.17%	-4.36%	-10.45%	4.52%	-	-	5.49%
BENCHMARK	-11.85%	-2.12%	-4.35%	-10.28%	4.81%	-	-	5.90%

Statistische Angaben (annualisiert)

	1 JAHR	3 JAHRE	5 JAHRE	10 JAHRE	AUFL.
Volatilität Anlagegruppe (in %)	10.69	11.34	-	-	11.18
Volatilität Benchmark (in %)	11.06	11.89	-	-	11.62
Tracking Error ex post (in %)	0.90	1.01	-	-	0.90
Information Ratio	-0.19	-0.29	-	-	-0.45
Sharpe Ratio	-0.98	0.45	-	-	0.53
Korrelation	1.00	1.00	-	-	1.00
Beta	0.96	0.95	-	-	0.96
Jensen-Alpha	-0.53	-0.03	-	-	-0.15
Maximum Drawdown (in %)	-15.04	-23.54	-	-	-23.54
Recovery Period (Jahre)	-	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

Ausgabepreis: 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: 30/09/2021 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.

(Aktien- und Fremdwährungsquote gemäss BVV2 überschritten)

Portfoliostruktur nach Anlagekategorien

	Anlagegruppe	Benchmark	max. BVV2
Liquidität	7.13%	2.00%	-
Hypotheken Schweiz	0.66%	-	-
Obligationen Fremdwährungen (CHF hedged)	11.08%	13.00%	-
Aktien Schweiz	37.11%	38.00%	-
Aktien Ausland	32.95%	37.00%	-
Aktien Ausland (CHF hedged)	3.37%	-	-
Immobilien Schweiz	4.72%	5.00%	30.00%
Immobilien Ausland (CHF hedged)	0.73%	-	10.00%
Alternative Anlagen (CHF hedged)	2.24%	5.00%	15.00%
Total Aktien (In- und Ausland)	73.43%	75.00%	50.00%
Total Fremdwährungen	32.95%	37.00%	30.00%

Portfoliostruktur nach Währungen

CHF	67.05%
USD	23.15%
EUR	3.53%
JPY	2.18%
ÜBRIGE	4.09%

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%

Eigenschaften der festverzinslichen Anlagen

Modified Duration	4.16
Durchschnittliches Rating	A-