

Anlagestiftung Swiss Life BVG-Mix 75

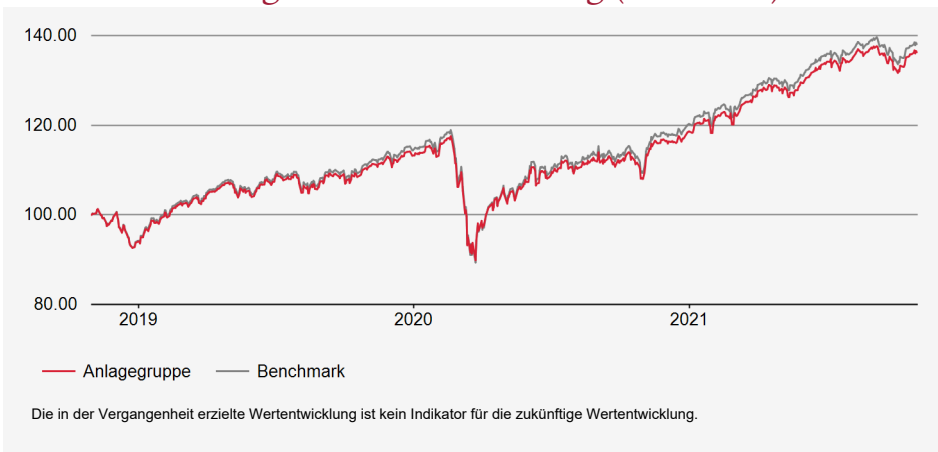
(Aktien- und Fremdwährungsquote gemäss BVV2 überschritten)

Nettovermögen (NAV) in Mio. CHF: 75.11
Nettovermögen pro Anspruch in CHF: 136.26

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	14.87%	2.66%	1.61%	26.13%	10.87%	-	-	10.87%
BENCHMARK	14.79%	2.53%	1.69%	26.26%	11.37%	-	-	11.37%

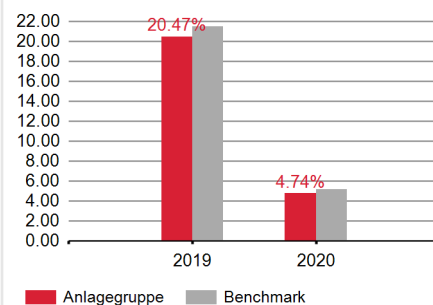
Statistische Angaben (annualisiert)

	1 JAHR	3 JAHRE	5 JAHRE	10 JAHRE	AUFL.
Volatilität Anlagegruppe (in %)	9.26	11.17	-	-	11.02
Volatilität Benchmark (in %)	9.15	11.61	-	-	11.45
Tracking Error ex post (in %)	0.33	0.90	-	-	0.89
Information Ratio	-0.38	-0.55	-	-	-0.54
Sharpe Ratio	2.57	0.99	-	-	0.98
Korrelation	1.00	1.00	-	-	1.00
Beta	1.01	0.96	-	-	0.96
Jensen-Alpha	-0.42	-0.01	-	-	-0.02
Maximum Drawdown (in %)	-4.33	-23.54	-	-	-23.54
Recovery Period (Jahre)	-	0.74	-	-	0.74

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.

Performance



Produktinformationen

Valorennummer: 43583002

ISIN: CH0435830028

LEI: 2549007MI5RG5X8NMB06

Bloomberg-Code: SWABM75 SW

Benchmark: Customized

Währung: CHF

Domizil: Schweiz

Aufledgedatum: 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%

(Aktien- und Fremdwährungsquote gemäss BVV2 überschritten)

Portfoliostruktur nach Anlagekategorien

	Anlagegruppe	Benchmark	max. BVV2
Liquidität	2.47%	2.00%	-
Obligationen Fremdwährungen (CHF hedged)	11.61%	13.00%	-
Aktien Schweiz	38.88%	38.00%	-
Aktien Ausland	38.86%	37.00%	-
Aktien Ausland (CHF hedged)	1.00%	-	-
Immobilien Schweiz	4.62%	5.00%	30.00%
Immobilien Ausland (CHF hedged)	0.39%	-	10.00%
Alternative Anlagen (CHF hedged)	2.16%	5.00%	15.00%
Total Aktien (In- und Ausland)	78.75%	75.00%	50.00%
Total Fremdwährungen	38.86%	37.00%	30.00%

Portfoliostruktur nach Währungen

CHF	61.14%
USD	27.07%
EUR	4.57%
JPY	2.61%
ÜBRIGE	4.61%

Benchmarkzusammensetzung

CITIGROUP CHF 1 M EURO DEPO	2.00%
BB* GL. AGG. TREAS. EX CH TR (CHF HEDGED)	2.00%
BB* GL. AGG. CORP. TR (CHF HEDGED)	4.00%
BB* 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, 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%

* Bloomberg Barclays

Eigenschaften der festverzinslichen Anlagen

Modified Duration	4.72
Durchschnittliches Rating	A-