

Anlagestiftung Swiss Life BVG-Mix 75

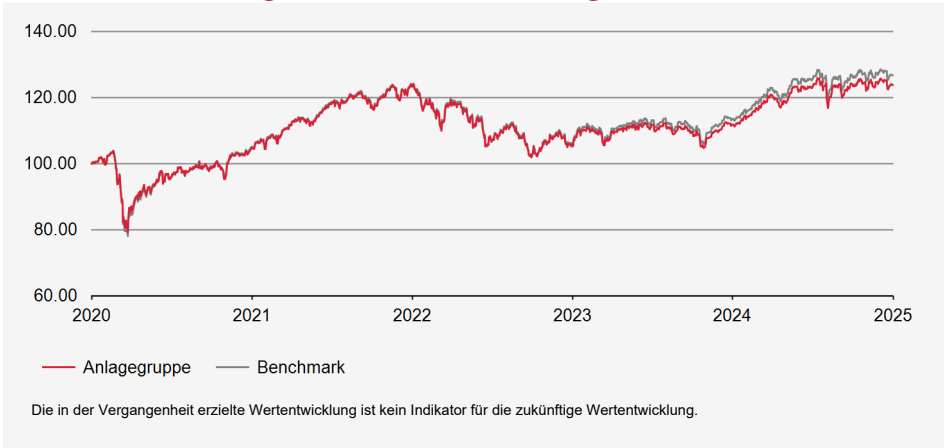
(Aktien- und Fremdwährungsquote gemäss BVV2 überschritten)

Nettovermögen (NAV) in Mio. CHF: 322.63
Nettovermögen pro Anspruch in CHF: 140.15

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)



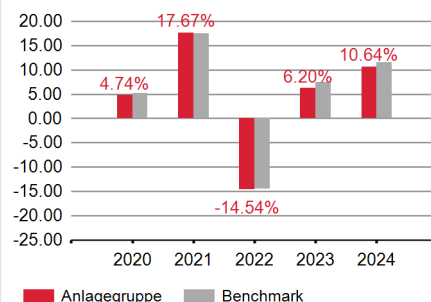
Performance in Referenzwährung

	Kumulierte Performance				Annualisierte Performance			
	YTD	1 Monat	3 Monate	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Aufl.
Anlagegruppe	10.64%	-0.93%	-0.23%	10.64%	0.14%	4.35%	-	5.62%
Benchmark	11.56%	-0.80%	0.02%	11.56%	0.84%	4.84%	-	6.20%

Statistische Angaben (annualisiert)

	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Aufl.
Volatilität Anlagegruppe (in %)	6.42	9.45	10.46	-	10.31
Volatilität Benchmark (in %)	6.41	9.94	10.96	-	10.74
Tracking Error ex post (in %)	0.17	0.69	0.86	-	0.79
Information Ratio	-5.32	-1.02	-0.57	-	-0.73
Sharpe Ratio	1.38	-0.07	0.39	-	0.53
Korrelation	1.00	1.00	1.00	-	1.00
Beta	1.00	0.95	0.95	-	0.96
Jensen-Alpha	-0.93	-0.70	-0.27	-	-0.32
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

Betriebsaufwandquote TER KGAST

ex ante: 0.59%

ex post per: 30/09/2024 0.59%

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, «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	2.79%	2.00%	-
Hypotheken Schweiz	0.22%	-	-
Obligationen Fremdwährungen (CHF hedged)	13.28%	13.00%	-
Aktien Schweiz	37.79%	38.00%	-
Aktien Ausland	39.05%	37.00%	-
Aktien Ausland (CHF hedged)	-	-	-
Immobilien Schweiz	4.28%	5.00%	30.00%
Immobilien Ausland (CHF hedged)	0.22%	-	10.00%
Alternative Anlagen (CHF hedged)	2.38%	5.00%	15.00%
Total Aktien (In- und Ausland)	76.84%	75.00%	50.00%
Total Fremdwährungen	39.05%	37.00%	30.00%

Grösste Aktienpositionen

NESTLE SA-REG	4.82%
NOVARTIS AG-REG	4.46%
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	4.41%
NVIDIA CORP	2.48%
MICROSOFT CORP	2.24%
UBS GROUP AG-REG	2.08%
ZURICH INSURANCE GROUP AG	1.94%
ABB LTD-REG	1.92%
CIE FINANCIERE RICHEMO-A REG	1.82%
HOLCIM LTD	1.16%

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	61.01%
USD	27.15%
JPY	2.35%
EUR	0.70%
Übrige	8.85%

Eigenschaften der festverzinslichen Anlagen

Modified Duration	4.41
Durchschnittliches Rating	A-