

# Anlagestiftung Swiss Life BVG-Mix 75

(Aktien- und Fremdwährungsquote gemäss BVV2 überschritten)

**Nettovermögen (NAV) in Mio. CHF: 104.44**  
**Nettovermögen pro Anspruch in CHF: 121.00**

## 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)



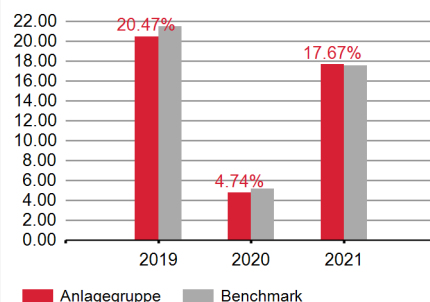
## Performance in Referenzwährung

	KUMULIERTE PERFORMANCE				ANNUALISIERTE PERFORMANCE			
	YTD	1 MONAT	3 MONATE	1 JAHR	3 JAHRE	5 JAHRE	10 JAHRE	AUFL.
ANLAGEGRUPPE	-13.31%	4.44%	-3.55%	-11.20%	3.19%	-	-	4.88%
BENCHMARK	-13.23%	4.74%	-3.65%	-11.17%	3.41%	-	-	5.23%

## Statistische Angaben (annualisiert)

	1 JAHR	3 JAHRE	5 JAHRE	10 JAHRE	AUFL.
Volatilität Anlagegruppe (in %)	12.27	12.10	-	-	11.66
Volatilität Benchmark (in %)	-	12.72	-	-	12.16
Tracking Error ex post (in %)	1.03	1.05	-	-	0.93
Information Ratio	-0.02	-0.20	-	-	-0.39
Sharpe Ratio	-0.93	0.31	-	-	0.46
Korrelation	1.00	1.00	-	-	1.00
Beta	0.94	0.95	-	-	0.96
Jensen-Alpha	-0.63	-0.01	-	-	-0.10
Maximum Drawdown (in %)	-17.76	-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

**Aufgagedatum:** 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](http://www.swisslife.ch/anlagestiftung)

**Betriebsaufwandquote TER KGAST**

**ex ante:** 0.64%

**ex post per:** 30/09/2022 0.63%

**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	5.43%	2.00%	-
Hypotheken Schweiz	0.60%	-	-
Obligationen Fremdwährungen (CHF hedged)	12.89%	13.00%	-
Aktien Schweiz	36.62%	38.00%	-
Aktien Ausland	32.32%	37.00%	-
Aktien Ausland (CHF hedged)	3.69%	-	-
Immobilien Schweiz	5.36%	5.00%	30.00%
Immobilien Ausland (CHF hedged)	0.77%	-	10.00%
Alternative Anlagen (CHF hedged)	2.33%	5.00%	15.00%
<b>Total Aktien (In- und Ausland)</b>	<b>72.62%</b>	<b>75.00%</b>	<b>50.00%</b>
<b>Total Fremdwährungen</b>	<b>32.32%</b>	<b>37.00%</b>	<b>30.00%</b>

## Portfoliostruktur nach Währungen

CHF	67.68%
USD	22.82%
EUR	3.57%
JPY	1.99%
ÜBRIGE	3.94%

## 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	3.90
Durchschnittliches Rating	A-