

# Anlagestiftung Swiss Life BVG-Mix 75

(Aktien- und Fremdwährungsquote gemäss BVV2 überschritten)

**Nettovermögen (NAV) in Mio. CHF: 249.00**  
**Nettovermögen pro Anspruch in CHF: 139.25**

## 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)



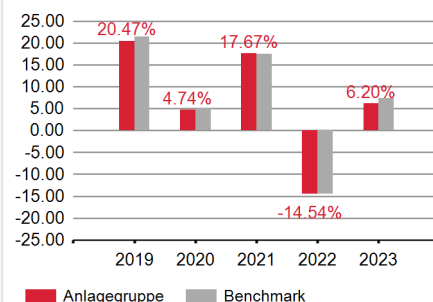
## Performance in Referenzwährung

	Kumulierte Performance				Annualisierte Performance			
	YTD	1 Monat	3 Monate	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Aufl.
Anlagegruppe	9.93%	0.43%	1.79%	9.93%	1.38%	5.33%	-	6.02%
Benchmark	10.36%	0.48%	1.96%	10.76%	1.93%	5.84%	-	6.57%

## Statistische Angaben (annualisiert)

	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Aufl.
Volatilität Anlagegruppe (in %)	8.22	9.84	10.42	-	10.67
Volatilität Benchmark (in %)	8.41	10.29	10.94	-	11.13
Tracking Error ex post (in %)	0.27	0.70	0.86	-	0.82
Information Ratio	-3.07	-0.78	-0.59	-	-0.67
Sharpe Ratio	0.96	0.08	0.49	-	0.55
Korrelation	1.00	1.00	1.00	-	1.00
Beta	0.98	0.96	0.95	-	0.96
Jensen-Alpha	-0.63	-0.48	-0.22	-	-0.26
Maximum Drawdown (in %)	-6.64	-17.76	-23.54	-	-23.54
Recovery Period (Jahre)	0.13	-	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:** 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:** 30/09/2023 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	4.08%	2.00%	-
Hypotheken Schweiz	0.27%	-	-
Obligationen Fremdwährungen (CHF hedged)	12.76%	13.00%	-
Aktien Schweiz	37.66%	38.00%	-
Aktien Ausland	37.33%	37.00%	-
Aktien Ausland (CHF hedged)	-	-	-
Immobilien Schweiz	5.34%	5.00%	30.00%
Immobilien Ausland (CHF hedged)	0.30%	-	10.00%
Alternative Anlagen (CHF hedged)	2.27%	5.00%	15.00%
<b>Total Aktien (In- und Ausland)</b>	<b>74.99%</b>	<b>75.00%</b>	<b>50.00%</b>
<b>Total Fremdwährungen</b>	<b>37.33%</b>	<b>37.00%</b>	<b>30.00%</b>

## Grösste Aktienpositionen

NESTLE SA-REG	5.69%
NOVARTIS AG-REG	4.66%
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	4.15%
MICROSOFT CORP	2.73%
NVIDIA CORP	2.67%
UBS GROUP AG-REG	2.02%
ABB LTD-REG	1.88%
CIE FINANCIERE RICHEMO-A REG	1.78%
ALPHABET INC	1.74%
ZURICH INSURANCE GROUP AG	1.66%

## 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	60.83%
USD	25.75%
EUR	2.75%
JPY	2.25%
Übrige	8.40%

## Eigenschaften der festverzinslichen Anlagen

Modified Duration	5.22
Durchschnittliches Rating	A-