

# Anlagestiftung Swiss Life

## BVG-Mix 75 (Aktienquote gemäss BVV2 überschritten)

### Anlagestrategie

- Anlagen in alle vom BVG zugelassenen Anlagekategorien (strategischer Aktienanteil: 75%)
- Aktive Asset Allocation
- Begrenzung für Beteiligungspapiere: 85%, Begrenzung für Fremdwährungen: 30%
- Durchschnittliche Ratingqualität der Obligationen: mindestens BBB
- Umsetzung mittels Einsatz artreiner Kollektivanlagen
- Der Anlegerkreis beschränkt sich auf Vorsorgestiftungen 3a sowie Vorsorgeeinrichtungen mit Bezug auf deren Vorsorgepläne 1e
- Aufgrund des erhöhten Aktienanteils beinhaltet diese Anlagegruppe ein höheres Risiko im Vergleich zu einem BVG-Mix mit einem max. Aktienanteil von 50%

### Produkteinformationen

Valorennummer	43583002
ISIN	CH0435830028
LEI	2549007M15RG5X8NMB06
Bloomberg Ticker	SWABM75 SW
Benchmark	customized
Währung	CHF
Lancierungsdatum	31.10.2018
Lancierungspreis	100.00
Jahresabschluss	30.09.
Ausgabe/Rücknahme	täglich
Annahmeschluss	14.00 Uhr

#### 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<sub>KGAST</sub> \*\*

- ex ante 0.69%

- ex post per n.a.

Ausgabe-/Rücknahmekommission \*\*\* keine

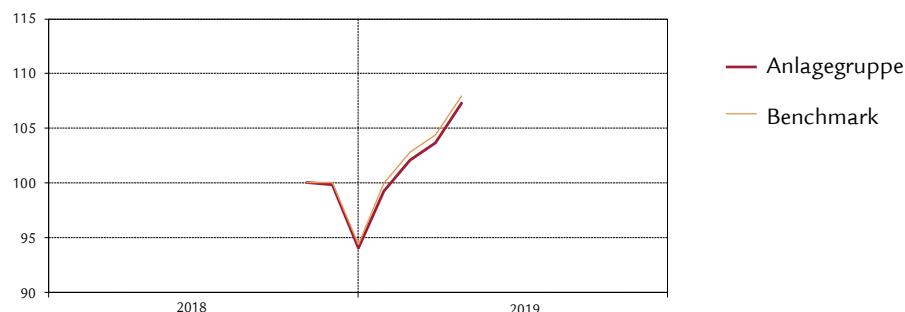
Ausschüttungspraxis Thesaurierung

\* 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

\*\* Die Betriebsaufwandquote TER<sub>KGAST</sub> deckt sämtliche Kosten mit Ausnahme der Transaktionskosten und der transaktionsbezogenen steuerlichen Abgaben ab

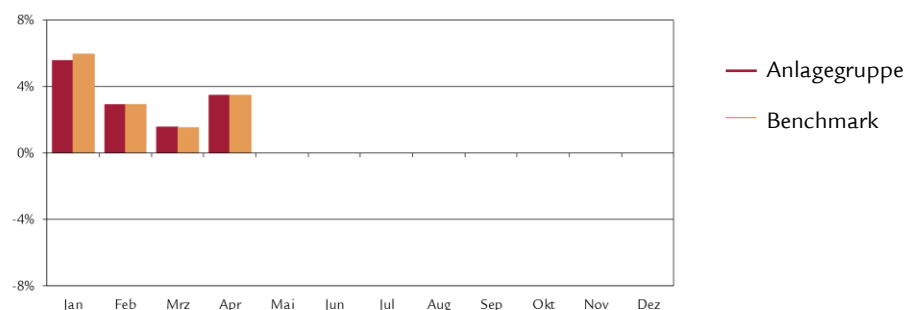
\*\*\* Vorbehalten bleiben abweichende Bestimmungen in den Gebührenordnungen von Freizügigkeitsstiftungen sowie Vorsorgestiftungen 3a

### Indexierte Wertentwicklung und Performances



Performance	1M	3M	1J	3J	5J	p.a. seit
				p.a.	p.a.	31.10.18
Anlagegruppe (in %)	3.46	8.07				7.25
Benchmark (in %)	3.46	8.04				7.97
	YTD	2018	2017	2016	2015	2014
Anlagegruppe (in %)	14.08					
Benchmark (in %)	14.45					

### Monatliche Performance



### Statistische Angaben (annualisiert)

	1J	3J	5J	seit
				31.10.18
Volatilität Anlagegruppe (in %)				13.70
Volatilität Benchmark (in %)				13.76
Tracking Error ex post (in %)				0.54
Tracking Error ex ante (in %)	0.60			
Information Ratio				-1.34
Sharpe Ratio				0.56
Korrelation				
Beta				0.99
Jensen-Alpha				-0.62
Maximum Drawdown (in %)				-8.35
Recovery Period (Jahre)				0.13

### Kennzahlen

	31.12.2018	30.04.2019
Vermögen in Mio. CHF	4.7	6.3
Nettoinventarwert pro Anspruch in CHF	94.01	107.25

30. April 2019

# Anlagestiftung Swiss Life

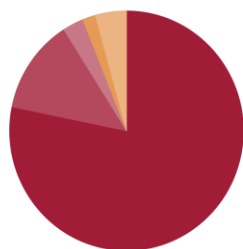
## BVG-Mix 75 (Aktienquote gemäss BWV2 überschritten)



### Portefeuillestruktur nach Anlagekategorien

	Anlagegruppe	Benchmark	BWV2-Max.
Liquide Mittel	0.1%	2%	
Obligationen Fremdwährungen (CHF hedged)	12.3%	13%	
Aktien Schweiz	39.2%	38%	
Aktien Ausland	21.8%	20%	
Aktien Ausland (CHF hedged)	18.2%	17%	
Immobilien Schweiz	6.1%	5%	30%
Alternative Anlagen	2.3%	5%	15%
<b>Total</b>	<b>100.0%</b>	<b>100%</b>	
<hr/>			
Total Aktien (In- und Ausland)	79.2%	75%	50%
Total Fremdwährungen	21.8%	20%	30%

### Portefeuillestruktur nach Währungen



CHF	78.2%
USD	12.8%
EUR	2.9%
JPY	1.8%
Übrige	4.3%

### Benchmarkzusammensetzung

Citigroup CHF 1 M Euro Depo	2%
BB* Gl. Agg. Treas. ex CH TR (CHF hedged)	2%
BB* Gl. Agg. Corp. TR (CHF hedged)	4%
BB* Gl. Agg. Corp. Short Term TR (CHF hedged)	4%
JP Morgan CEMBI Broad Diversified IG (CHF hedged)	3%
Swiss Performance Index	38%
MSCI World ex CH, in CHF	16%
MSCI World ex CH, (CHF hedged)	17%
MSCI AC World Small Cap, in CHF	3%
MSCI Emerging Markets, in CHF	1%
KGAST Immo-Index	5%
HFRX Global Hedge Funds (CHF hedged)	5%
<b>Total</b>	<b>100%</b>

\* Bloomberg Barclays

### Eigenschaften der festverzinslichen Anlagen

Modified Duration	4.43
Durchschnittliches Rating	A-

### Disclaimer

Die vorliegende Publikation begründet weder eine Aufforderung noch eine Empfehlung zum Erwerb oder Verkauf von Anlageinstrumenten, sondern dient lediglich zu Informationszwecken. Sämtliche Dokumente, welche die rechtliche Grundlage für eine allfällige Investition bilden, können kostenlos bei der Anlagestiftung Swiss Life, Postfach, 8022 Zürich, Tel. 043 284 79 79 bezogen werden. Der Kreis der Anleger ist beschränkt auf in der Schweiz domizilierte Vorsorgeeinrichtungen der gebundenen Selbstvorsorge sowie in der Schweiz domizilierte Vorsorgeeinrichtungen mit Bezug auf deren Vorsorgepläne 1e.

Die vergangene Performance stellt keinen Indikator für die laufende und zukünftige Entwicklung dar. Die Performancedaten lassen die bei der Ausgabe und Rücknahme von Ansprüchen allenfalls erhobenen Kommissionen und Kosten unberücksichtigt.