

## Anlagestrategie

- Anlagen in alle vom BVG zugelassenen Anlagekategorien (strategischer Aktienanteil: 35%)
- Aktive Asset Allocation
- Begrenzung für Beteiligungspapiere: 45%, Begrenzung für Fremdwährungen: 30%
- Durchschnittliche Ratingqualität der Obligationen: mindestens BBB+
- Umsetzung mittels Einsatz artreiner Kollektivanlagen
- Empfohlene Schwankungsreserven: über 15%

## Produkteinformationen

Valorennummer	1245606
ISIN	CH0012456064
LEI	254900SR5GM6HP44F130
Bloomberg Ticker	SWABM35 SW
Benchmark	customized
Währung	CHF
Lancierungsdatum	30.09.2001
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

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

- ex ante	0.57%
- ex post per 30.09.2018	0.56%

Ausgabe-/Rücknahmekommission \*\*\* keine

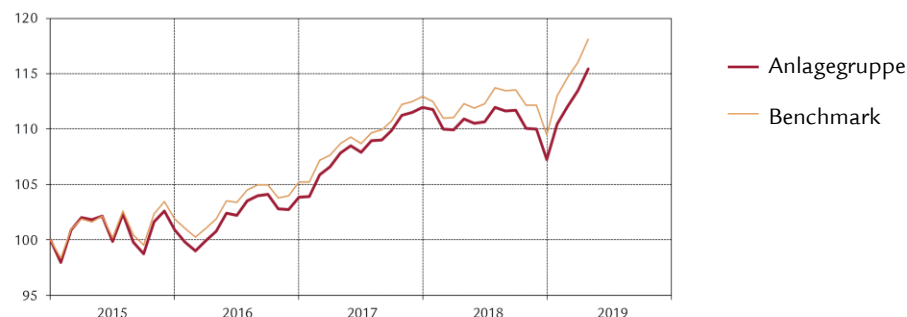
Ausschüttungspraxis Thesaurierung

\* 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

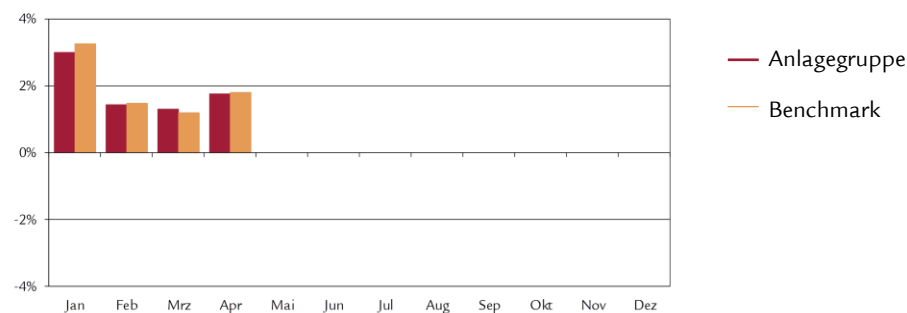
\*\*\* Vorbehalten bleiben abweichende Bestimmungen in den Gebührenordnungen von Freizügigkeitsstiftungen sowie Vorsorgestiftungen 3a

## Indexierte Wertentwicklung und Performances



Performance	1M	3M	1J	3J	5J	10J	p.a. seit p.a. 30.09.01
Anlagegruppe (in %)	1.75	4.53	4.09	4.62	4.14	5.40	3.56
Benchmark (in %)	1.80	4.52	5.19	5.06	4.66	5.72	4.19
	YTD	2018	2017	2016	2015	2014	2013
Anlagegruppe (in %)	7.65	-4.20	7.79	2.89	0.92	9.01	7.87
Benchmark (in %)	7.92	-3.07	7.29	3.32	1.86	9.36	7.99

## Monatliche Performance



## Statistische Angaben (annualisiert)

	1J	3J	5J	10J	seit 30.09.01
Volatilität Anlagegruppe (in %)	5.15	3.71	4.36	4.22	4.96
Volatilität Benchmark (in %)	5.14	3.64	4.12	3.97	4.83
Tracking Error ex post (in %)	0.42	0.49	0.55	0.52	0.63
Tracking Error ex ante (in %)	0.50				
Information Ratio	-2.63	-0.89	-0.95	-0.61	-0.99
Sharpe Ratio	0.92	1.42	1.07	1.31	0.62
Korrelation	1.00	0.99	0.99	0.99	0.99
Beta	1.00	1.01	1.05	1.06	1.02
Jensen-Alpha	-1.04	-0.46	-0.77	-0.64	-0.68
Maximum Drawdown (in %)	-4.98	-5.72	-6.84	-9.99	-21.36
Recovery Period (Jahre)	0.16	0.23	0.44	0.44	3.00

## Kennzahlen

	31.12.2018	30.04.2019
Vermögen in Mio. CHF	182.0	199.1
Nettoinventarwert pro Anspruch in CHF	171.86	185.01

30. April 2019

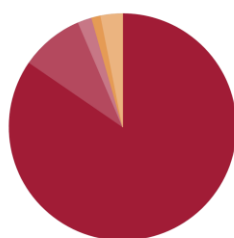
# Anlagestiftung Swiss Life BVG-Mix 35



## Portefeuillestruktur nach Anlagekategorien

	Anlagegruppe	Benchmark	BVW2-Max.
Liquide Mittel	0.8%	2%	
Obligationen CHF Inland	9.4%	14%	
Obligationen CHF Ausland	4.6%	7%	
Obligationen Fremdwährungen (CHF hedged)	29.1%	24%	
Aktien Schweiz	16.7%	18%	
Aktien Ausland	15.4%	17%	
Aktien Ausland (CHF hedged)	7.5%	0%	
Immobilien Schweiz	12.1%	11%	30%
Immobilien Ausland (CHF hedged)	2.1%	2%	10%
Alternative Anlagen	2.3%	5%	15%
<b>Total</b>	<b>100.0%</b>	<b>100%</b>	
<hr/>			
Total Aktien (In- und Ausland)	39.6%	35%	50%
Total Fremdwährungen	15.4%	17%	30%

## Portefeuillestruktur nach Währungen



CHF	84.6%
USD	9.0%
EUR	2.0%
JPY	1.3%
Übrige	3.1%

## Benchmarkzusammensetzung

Citigroup CHF 1 M Euro Depo	2%
SBI Domestic AAA-BBB	14%
SBI Foreign AAA-BBB	7%
BB* Gl. Agg. Treas. ex CH TR (CHF hedged)	3.5%
BB* Gl. Agg. Corp. TR (CHF hedged)	7.5%
BB* Gl. Agg. Corp. Short Term TR (CHF hedged)	8%
JP Morgan CEMBI Broad Div IG Index (CHF hedged)	5%
Swiss Performance Index	18%
MSCI World ex CH, in CHF	13.6%
MSCI AC World Small Cap, in CHF	2.55%
MSCI Emerging Markets, in CHF	0.85%
KGAST Immo-Index	11%
SL REF (LUX) German Core Real Estate (CHF hedged)	2%
HFRX Global Hedge Funds (CHF hedged)	5%
<b>Total</b>	<b>100.0%</b>

\* Bloomberg Barclays

## Eigenschaften der festverzinslichen Anlagen

Modified Duration	5.67
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 Einrichtungen der 2. Säule und der Säule 3a sowie sonstige steuerbefreite Einrichtungen mit Sitz in der Schweiz, die ihrem Zweck nach der beruflichen Vorsorge dienen und Personen, die kollektive Anlagen für diese Einrichtungen verwalten, von der Eidgenössischen Finanzmarktaufsicht beaufsichtigt werden und bei der Stiftung ausschliesslich Gelder für diese Einrichtungen anlegen. 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.