

Anlagestiftung Swiss Life BVG-Mix 75

(Aktien- und Fremdwährungsquote gemäss BVV2 überschritten)



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

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

Betriebsaufwandquote TER_{KGAST} **

- ex ante	0.65%
- ex post per 30.09.2019	0.65%

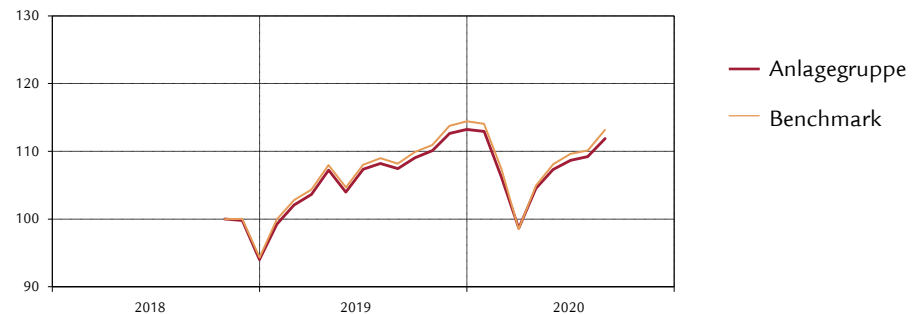
Ausgabe-/Rücknahmekommission *** keine
Ausschüttungspraxis Thesaurierung

* 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_{KGAST} deckt sämtliche Kosten mit Ausnahme der Transaktionskosten und der transaktionsbezogenen steuerlichen Abgaben ab

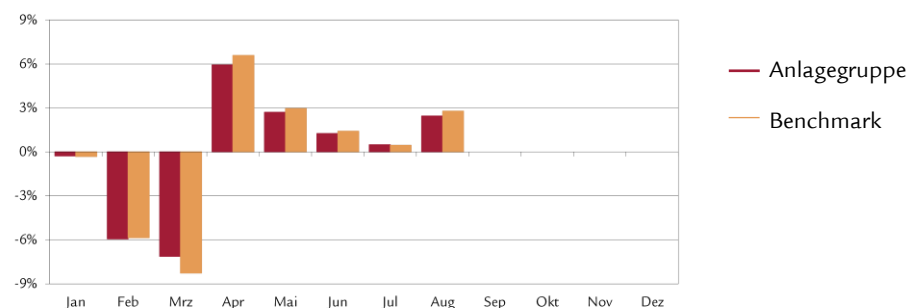
*** Vorbehalten bleiben abweichende Bestimmungen in den Gebührenordnungen von Freizügigkeitsstiftungen sowie Vorsorgestiftungen 3a

Indizierte Wertentwicklung und Performances



Performance	1M	3M	1J	3J p.a.	5J p.a.	p.a. seit 31.10.18
Anlagegruppe (in %)	2.44	4.24	4.12			6.32
Benchmark (in %)	2.78	4.69	4.63			6.99
	YTD	2019	2018	2017	2016	2015
Anlagegruppe (in %)	-1.20	20.47				
Benchmark (in %)	-1.09	21.29				

Monatliche Performance



Statistische Angaben (annualisiert)

	1J	3J	5J	seit 31.10.18
Volatilität Anlagegruppe (in %)	12.49			11.86
Volatilität Benchmark (in %)	13.72			12.59
Tracking Error ex post (in %)	1.47			1.11
Tracking Error ex ante (in %)	0.60			
Information Ratio	-0.34			-0.60
Sharpe Ratio	0.38			0.58
Korrelation	1.00			1.00
Beta	0.91			0.94
Jensen-Alpha	-0.01			-0.18
Maximum Drawdown (in %)	-23.54			-23.54
Recovery Period (Jahre)	-			-

Kennzahlen

	31.12.2019	31.08.2020
Vermögen in Mio. CHF	11.9	27.2
Nettoinventarwert pro Anspruch in CHF	113.25	111.89

31. August 2020

Anlagestiftung Swiss Life BVG-Mix 75

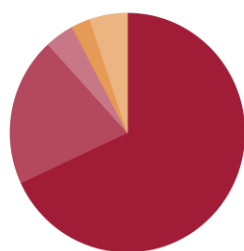
(Aktien- und Fremdwährungsquote gemäss BW2 überschritten)



Portefeuillestruktur nach Anlagekategorien

	Anlagegruppe	Benchmark	BW2-Max.
Liquide Mittel	1.7%	2%	
Obligationen Fremdwährungen (CHF hedged)	13.5%	13%	
Aktien Schweiz	41.8%	38%	
Aktien Ausland	31.9%	37%	
Aktien Ausland (CHF hedged)	3.0%	0%	
Immobilien Schweiz	6.0%	5%	30%
Alternative Anlagen (CHF hedged)	2.1%	5%	15%
Total	100.0%	100%	
<hr/>			
Total Aktien (In- und Ausland)	76.7%	75%	50%
Total Fremdwährungen	31.9%	37%	30%

Portefeuillestruktur nach Währungen



CHF	68.1%
USD	20.1%
EUR	4.0%
JPY	2.6%
Übrige	5.2%

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	29.6%
MSCI AC World Small Cap, in CHF	5.55%
MSCI Emerging Markets, in CHF	1.85%
KGAST Immo-Index	5%
HFRX Global Hedge Funds (CHF hedged)	5%
Total	100%

* Bloomberg Barclays

Eigenschaften der festverzinslichen Anlagen

Modified Duration	5.19
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 Vorsorgedienern 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.