

Anlagestiftung Swiss Life BVG-Mix 75

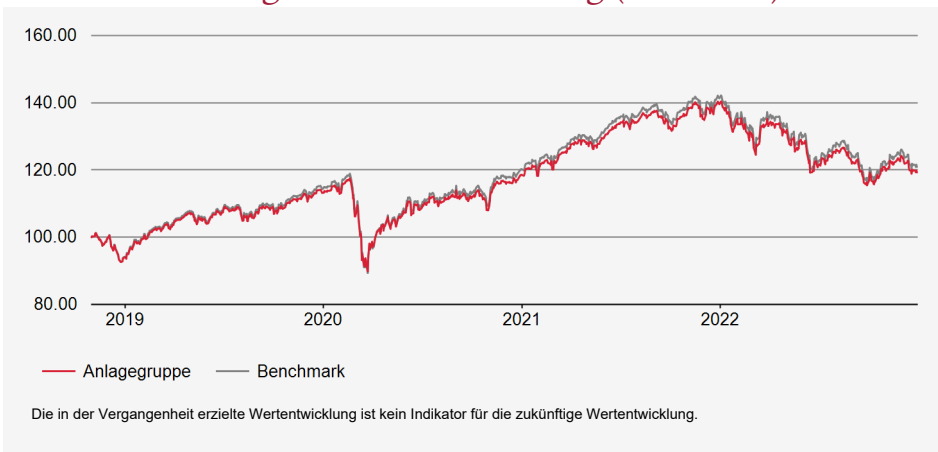
(Aktien- und Fremdwährungsquote gemäss BVV2 überschritten)

Nettovermögen (NAV) in Mio. CHF: 116.09
Nettovermögen pro Anspruch in CHF: 119.28

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)



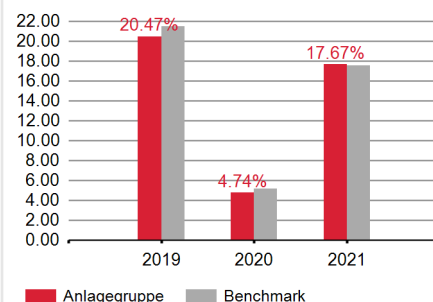
Performance in Referenzwährung

| | KUMULIERTE PERFORMANCE | | | | ANNUALISIERTE PERFORMANCE | | | |
|--------------|------------------------|---------|----------|---------|---------------------------|---------|----------|-------|
| | YTD | 1 MONAT | 3 MONATE | 1 JAHR | 3 JAHRE | 5 JAHRE | 10 JAHRE | AUFL. |
| ANLAGEGRUPPE | -14.54% | -3.65% | 2.95% | -14.54% | 1.74% | - | - | 4.32% |
| BENCHMARK | -14.45% | -3.83% | 3.26% | -14.45% | 1.86% | - | - | 4.67% |

Statistische Angaben (annualisiert)

| | 1 JAHR | 3 JAHRE | 5 JAHRE | 10 JAHRE | AUFL. |
|---------------------------------|--------|---------|---------|----------|--------|
| Volatilität Anlagegruppe (in %) | 12.26 | 12.31 | - | - | 11.64 |
| Volatilität Benchmark (in %) | - | 12.94 | - | - | 12.14 |
| Tracking Error ex post (in %) | 1.07 | 1.06 | - | - | 0.92 |
| Information Ratio | -0.09 | -0.11 | - | - | -0.38 |
| Sharpe Ratio | -1.26 | 0.18 | - | - | 0.42 |
| Korrelation | 1.00 | 1.00 | - | - | 1.00 |
| Beta | 0.93 | 0.95 | - | - | 0.96 |
| Jensen-Alpha | -1.02 | 0.00 | - | - | -0.11 |
| 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

Aufledgedatum: 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

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 | 5.39% | 2.00% | - |
| Hypotheken Schweiz | 0.56% | - | - |
| Obligationen Fremdwährungen (CHF hedged) | 13.39% | 13.00% | - |
| Aktien Schweiz | 37.17% | 38.00% | - |
| Aktien Ausland | 31.23% | 37.00% | - |
| Aktien Ausland (CHF hedged) | 3.86% | - | - |
| Immobilien Schweiz | 5.36% | 5.00% | 30.00% |
| Immobilien Ausland (CHF hedged) | 0.70% | - | 10.00% |
| Alternative Anlagen (CHF hedged) | 2.34% | 5.00% | 15.00% |
| Total Aktien (In- und Ausland) | 72.26% | 75.00% | 50.00% |
| Total Fremdwährungen | 31.23% | 37.00% | 30.00% |

Portfoliostruktur nach Währungen

| | |
|--------|--------|
| CHF | 68.77% |
| USD | 21.29% |
| EUR | 3.96% |
| JPY | 2.04% |
| 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 | 4.04 |
| Durchschnittliches Rating | A- |