

29. Februar 2024

# Anlagestiftung Swiss Life BVG-Mix 75

(Aktien- und Fremdwährungsquote gemäss BVV2 überschritten)

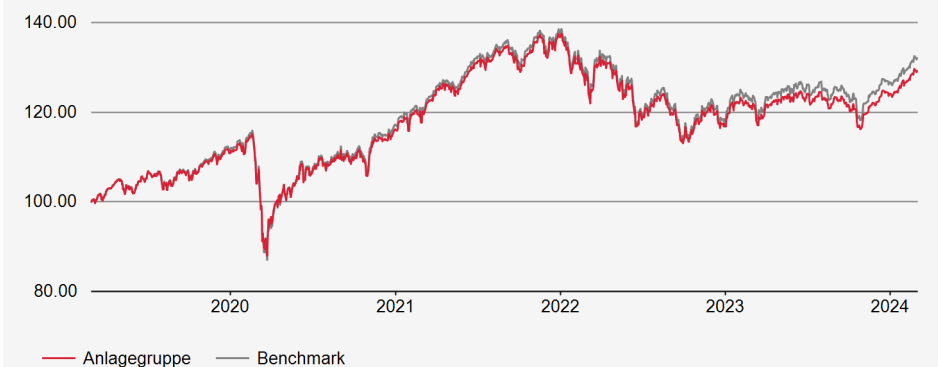
Nettovermögen (NAV) in Mio. CHF: 204.99

Nettovermögen pro Anspruch in CHF: 131.95

## 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

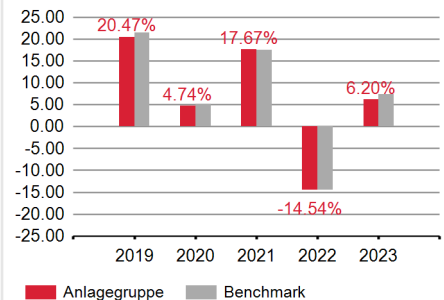
|              | Kumulierte Performance |         |          |        | Annualisierte Performance |         |          |       |
|--------------|------------------------|---------|----------|--------|---------------------------|---------|----------|-------|
|              | YTD                    | 1 Monat | 3 Monate | 1 Jahr | 3 Jahre                   | 5 Jahre | 10 Jahre | Aufl. |
| Anlagegruppe | 4.17%                  | 2.63%   | 6.21%    | 7.00%  | 3.16%                     | 5.26%   | -        | 5.34% |
| Benchmark    | 4.32%                  | 2.75%   | 6.37%    | 7.89%  | 3.63%                     | 5.72%   | -        | 5.87% |

## Statistische Angaben (annualisiert)

|                                 | 1 Jahr | 3 Jahre | 5 Jahre | 10 Jahre | Aufl.  |
|---------------------------------|--------|---------|---------|----------|--------|
| Volatilität Anlagegruppe (in %) | 6.74   | 10.02   | 10.48   | -        | 10.80  |
| Volatilität Benchmark (in %)    | 6.93   | 10.41   | 10.99   | -        | 11.28  |
| Tracking Error ex post (in %)   | 0.30   | 0.71    | 0.86    | -        | 0.85   |
| Information Ratio               | -2.93  | -0.67   | -0.53   | -        | -0.63  |
| Sharpe Ratio                    | 0.77   | 0.28    | 0.50    | -        | 0.50   |
| Korrelation                     | 1.00   | 1.00    | 1.00    | -        | 1.00   |
| Beta                            | 0.97   | 0.96    | 0.95    | -        | 0.96   |
| Jensen-Alpha                    | -0.71  | -0.34   | -0.18   | -        | -0.27  |
| Maximum Drawdown (in %)         | -6.81  | -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

Aufgagedatum: 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

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.

# Anlagestiftung Swiss Life BVG-Mix 75



(Aktien- und Fremdwährungsquote gemäss BVV2 überschritten)

## Portfoliostruktur nach Anlagekategorien

|                                          | Anlagegruppe | Benchmark | max. BVV2 |
|------------------------------------------|--------------|-----------|-----------|
| Liquidität                               | 3.46%        | 2.00%     | -         |
| Hypotheken Schweiz                       | 0.34%        | -         | -         |
| Obligationen Fremdwährungen (CHF hedged) | 11.63%       | 13.00%    | -         |
| Aktien Schweiz                           | 37.46%       | 38.00%    | -         |
| Aktien Ausland                           | 36.01%       | 37.00%    | -         |
| Aktien Ausland (CHF hedged)              | 2.05%        | -         | -         |
| Immobilien Schweiz                       | 6.43%        | 5.00%     | 30.00%    |
| Immobilien Ausland (CHF hedged)          | 0.37%        | -         | 10.00%    |
| Alternative Anlagen (CHF hedged)         | 2.25%        | 5.00%     | 15.00%    |
| Total Aktien (In- und Ausland)           | 75.53%       | 75.00%    | 50.00%    |
| Total Fremdwährungen                     | 36.01%       | 37.00%    | 30.00%    |

## Grösste Aktienpositionen

|                              |       |
|------------------------------|-------|
| NESTLE SA-REG                | 5.95% |
| NOVARTIS AG-REG              | 4.60% |
| ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN | 3.96% |
| MICROSOFT CORP.              | 2.65% |
| UBS GROUP AG-REG             | 1.87% |
| CIE FINANCIERE RICHEMONT-REG | 1.84% |
| NVIDIA CORP                  | 1.77% |
| ZURICH INSURANCE GROUP AG    | 1.67% |
| ABB LTD-REG                  | 1.60% |
| ALPHABET INC                 | 1.39% |

## 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    | 62.69% |
| USD    | 24.48% |
| EUR    | 2.85%  |
| JPY    | 2.43%  |
| Übrige | 7.55%  |

## Eigenschaften der festverzinslichen Anlagen

|                           |      |
|---------------------------|------|
| Modified Duration         | 4.62 |
| Durchschnittliches Rating | A-   |