

Nettvermögen (NAV) in Mio. CHF: 773.90
Nettvermögen pro Anspruch in CHF: 182.65

Anlagestrategie

Anlagen in alle vom BVG zugelassenen Anlagekategorien (strategischer Aktienanteil: 25%). Aktive Asset Allocation. Begrenzung für Beteiligungspapiere: 35%. Begrenzung für Fremdwährungen: 30%. Durchschnittliche Ratingqualität der Obligationen: mindestens BBB+. Umsetzung mittels Einsatz artreiner Kollektivanlagen. Empfohlene Schwankungsreserven: über 10%.

Wertentwicklung in Referenzwährung (Basis 100)



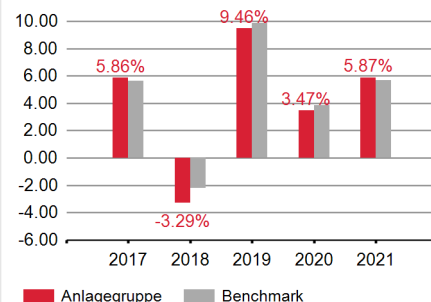
Performance in Referenzwährung

	KUMULIERTE PERFORMANCE				ANNUALISIERTE PERFORMANCE			
	YTD	1 MONAT	3 MONATE	1 JAHR	3 JAHRE	5 JAHRE	10 JAHRE	AUFL.
ANLAGEGRUPPE	-9.86%	1.41%	-3.19%	-8.81%	-0.08%	0.99%	2.87%	2.90%
BENCHMARK	-10.28%	1.56%	-3.52%	-9.33%	-0.16%	1.22%	3.12%	3.37%

Statistische Angaben (annualisiert)

	1 JAHR	3 JAHRE	5 JAHRE	10 JAHRE	AUFL.
Volatilität Anlagegruppe (in %)	5.80	5.85	4.92	4.17	4.13
Volatilität Benchmark (in %)	-	6.26	5.20	4.23	4.10
Tracking Error ex post (in %)	0.84	0.63	0.56	0.53	0.59
Information Ratio	0.62	0.13	-0.41	-0.47	-0.79
Sharpe Ratio	-1.51	0.09	0.34	0.81	0.67
Korrelation	1.00	1.00	1.00	0.99	0.99
Beta	0.90	0.93	0.94	0.98	1.00
Jensen-Alpha	-0.35	0.11	-0.12	-0.17	-0.46
Maximum Drawdown (in %)	-11.75	-11.75	-11.75	-11.75	-14.16
Recovery Period (Jahre)	-	-	-	-	0.98

Performance



Produktinformationen

Valorennummer: 1245601
ISIN: CH0012456015
LEI: 254900JNOBNDNHDGRO53
Bloomberg-Code: SWABM25 SW
Benchmark: Customized
Währung: CHF
Domizil: Schweiz
Aufgagedatum: 30/09/2001
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: 0.56%
ex post per: 30/09/2022 0.60%

Portfoliostruktur nach Anlagekategorien

	Anlagegruppe	Benchmark	max. BVV2
Liquidität	5.28%	2.00%	-
Hypotheken Schweiz	0.73%	-	-
Obligationen CHF Inland	13.33%	16.00%	-
Obligationen CHF Ausland	6.75%	9.00%	-
Obligationen Fremdwährungen (CHF hedged)	28.34%	28.00%	-
Aktien Schweiz	12.34%	13.00%	-
Aktien Ausland	10.27%	12.00%	-
Aktien Ausland (CHF hedged)	1.81%	-	-
Immobilien Schweiz	15.65%	13.00%	30.00%
Immobilien Ausland (CHF hedged)	3.24%	2.00%	10.00%
Alternative Anlagen (CHF hedged)	2.28%	5.00%	15.00%
Total Aktien (In- und Ausland)	24.41%	25.00%	50.00%
Total Fremdwährungen	10.27%	12.00%	30.00%

Portfoliostruktur nach Währungen

CHF	89.73%
USD	7.32%
EUR	1.11%
JPY	0.62%
ÜBRIGE	1.22%

Benchmarkzusammensetzung

1M SARON	2.00%
SBI DOMESTIC AAA-BBB	16.00%
SBI FOREIGN AAA-BBB	9.00%
BLOOMBERG GL. AGG. TREAS. EX CH TR (CHF HEDGED)	4.00%
BLOOMBERG GL. AGG. CORP. TR (CHF HEDGED)	9.00%
BLOOMBERG GL. AGG. CORP. SHORT TERM TR (CHF HEDGED)	9.00%
JP MORGAN CEMBI BROAD DIV IG INDEX (CHF HEDGED)	6.00%
SWISS PERFORMANCE INDEX	13.00%
MSCI WORLD EX CH ESG LEADERS, IN CHF	9.60%
MSCI AC WORLD SMALL CAP, IN CHF	1.80%
MSCI EMERGING MARKETS, IN CHF	0.60%
KGAST IMMO-INDEX	13.00%
SL REF (LUX) GERMAN CORE REAL ESTATE (CHF HEDGED)	2.00%
HFRX GLOBAL HEDGE FUNDS (CHF HEDGED)	5.00%

Eigenschaften der festverzinslichen Anlagen

Modified Duration	5.22
Durchschnittliches Rating	A