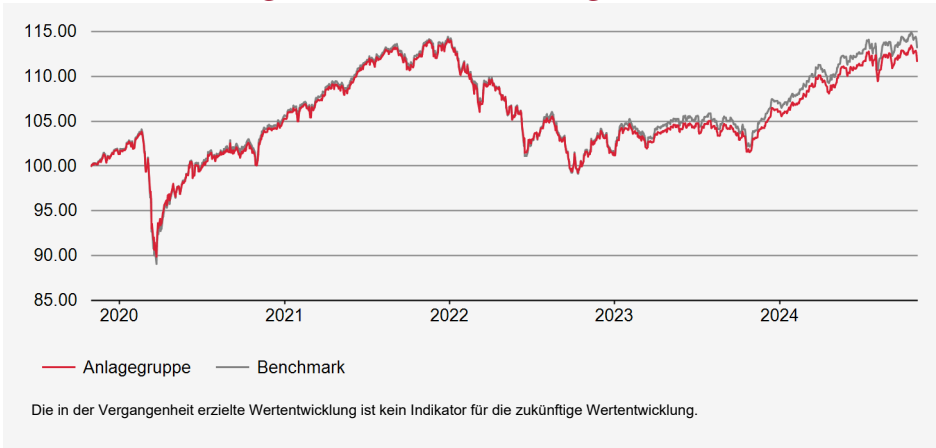


Nettovermögen (NAV) in Mio. CHF: 381.61
Nettovermögen pro Anspruch in CHF: 211.13

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%.

Wertentwicklung in Referenzwährung (Basis 100)



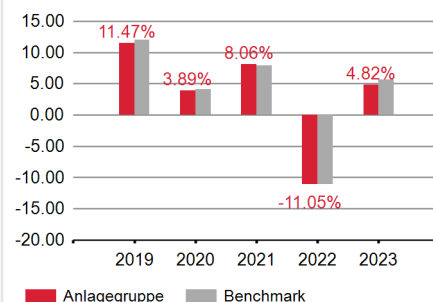
Performance in Referenzwährung

	Kumulierte Performance				Annualisierte Performance			
	YTD	1 Monat	3 Monate	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Aufl.
Anlagegruppe	5.28%	-1.04%	-0.57%	9.51%	-0.15%	2.23%	2.96%	3.29%
Benchmark	5.73%	-0.96%	-0.39%	10.35%	0.19%	2.51%	3.37%	3.83%

Statistische Angaben (annualisiert)

	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Aufl.
Volatilität Anlagegruppe (in %)	3.78	5.72	6.08	5.28	5.20
Volatilität Benchmark (in %)	3.91	6.11	6.48	5.42	5.19
Tracking Error ex post (in %)	0.33	0.59	0.60	0.58	0.63
Information Ratio	-2.54	-0.60	-0.46	-0.72	-0.85
Sharpe Ratio	2.03	-0.16	0.33	0.61	0.58
Korrelation	1.00	1.00	1.00	0.99	0.99
Beta	0.96	0.93	0.94	0.97	0.99
Jensen-Alpha	-0.49	-0.39	-0.13	-0.31	-0.52
Maximum Drawdown (in %)	-2.93	-13.03	-13.41	-13.41	-21.36
Recovery Period (Jahre)	0.14	-	0.65	0.65	3.00

Performance



Produktinformationen

Valorennummer: 1245606
ISIN: CH0012456064
LEI: 254900SR5GM6HP44F130
Bloomberg-Code: SWABM35 SW
Benchmark: Customized
Währung: CHF
Domizil: Schweiz
Aufledgedatum: 30/09/2001
Erstausgabepreis: 100.00
Jahresabschluss: 30.09

Ausgabe/Rücknahme: Täglich
Annahmeschluss: 12.00 Uhr
Verwässerungsschutz:
Ausgabe- / Rücknahmekommission zugunsten der Anlagegruppe gemäss Konditionenübersicht.
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: 0.57%
ex post per: 30/09/2024 0.57%

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.

Verwässerungsschutz: Konditionenübersicht abrufbar unter: www.swisslife.ch/anlagestiftung, «Rechtliche Dokumente» (Änderungen jederzeit ohne Vorankündigung möglich).

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.

Portfoliostruktur nach Anlagekategorien

	Anlagegruppe	Benchmark	max. BVV2
Liquidität	2.72%	2.00%	-
Hypotheken Schweiz	0.64%	-	-
Obligationen CHF Inland	13.15%	14.00%	-
Obligationen CHF Ausland	7.17%	7.00%	-
Obligationen Fremdwährungen (CHF hedged)	24.96%	24.00%	-
Aktien Schweiz	17.63%	18.00%	-
Aktien Ausland	17.15%	17.00%	-
Aktien Ausland (CHF hedged)	-	-	-
Immobilien Schweiz	12.04%	11.00%	30.00%
Immobilien Ausland (CHF hedged)	2.18%	2.00%	10.00%
Alternative Anlagen (CHF hedged)	2.36%	5.00%	15.00%
Total Aktien (In- und Ausland)	34.78%	35.00%	50.00%
Total Fremdwährungen	17.15%	17.00%	30.00%

Grösste Aktienpositionen

NESTLE SA-REG	2.40%
NOVARTIS AG-REG	2.16%
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	2.12%
NVIDIA CORP	1.11%
MICROSOFT CORP	0.98%
UBS GROUP AG-REG	0.96%
ABB LTD-REG	0.86%
ZURICH INSURANCE GROUP AG	0.84%
CIE FINANCIERE RICHEMO-A REG	0.76%
ALPHABET INC	0.64%

Benchmarkzusammensetzung

1M Saron	2.00%
SBI Domestic AAA-BBB	14.00%
SBI Foreign AAA-BBB	7.00%
Bloomberg Gl. Agg. Treas. ex CH TR (CHF hedged)	3.50%
Bloomberg Gl. Agg. Corp. TR (CHF hedged)	7.50%
Bloomberg Gl. Agg. Corp. Short Term TR (CHF hedged)	8.00%
JP Morgan CEMBI Broad Div IG Index (CHF hedged)	5.00%
Swiss Performance Index	18.00%
MSCI World ex CH ESG Leaders, in CHF	13.60%
MSCI AC World Small Cap, in CHF	2.55%
MSCI Emerging Markets, in CHF	0.85%
KGAST Immo-Index	11.00%
SL REF (LUX) German Core Real Estate (CHF hedged)	2.00%
HFRX Global Hedge Funds (CHF hedged)	5.00%

Portfoliostruktur nach Währungen

CHF	82.85%
USD	11.79%
EUR	1.21%
JPY	1.05%
Übrige	3.10%

Eigenschaften der festverzinslichen Anlagen

Modified Duration	5.75
Durchschnittliches Rating	A