

Anlagestiftung Swiss Life Obligationen CHF Inland

Nettovermögen (NAV) in Mio. CHF: 800.71
Nettovermögen pro Anspruch in CHF: 167.55

Anlagestrategie

Anlagen in auf CHF lautende Forderungspapiere von Schuldern mit Domizil hauptsächlich in der Schweiz. Aktive Titelselektion, Durationsteuerung und Zinskurvenpositionierung. Schuldnerbegrenzung: 10% (Ausnahmen: bis 25% in jedes Pfandbriefinstitut, Schweizerische Eidgenossenschaft ohne Begrenzung). Referenz-Indexfremde Schuldner: max. 10%. Durchschnittliche Ratingqualität: mindestens A+. Umsetzung mittels Einsatz des Swiss Life iFunds (CH) Bond Swiss Francs Domestic (CHF); Anlagefonds schweizerischen Rechts der Kategorie "Übrige Fonds für traditionelle Anlagen".

Wertentwicklung in Referenzwährung (Basis 100)



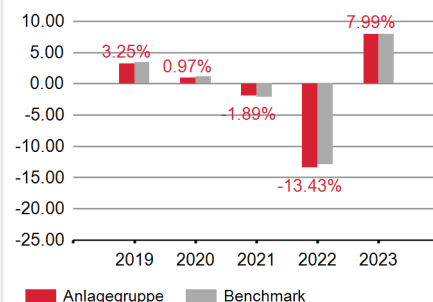
Performance in Referenzwährung

| | Kumulierte Performance | | | | Annualisierte Performance | | | |
|--------------|------------------------|---------|----------|--------|---------------------------|---------|----------|-------|
| | YTD | 1 Monat | 3 Monate | 1 Jahr | 3 Jahre | 5 Jahre | 10 Jahre | Aufl. |
| Anlagegruppe | 4.21% | 0.72% | 2.38% | 8.29% | -0.90% | -1.12% | 0.56% | 2.27% |
| Benchmark | 4.13% | 0.69% | 2.29% | 8.17% | -0.71% | -1.03% | 0.66% | 2.35% |

Statistische Angaben (annualisiert)

| | 1 Jahr | 3 Jahre | 5 Jahre | 10 Jahre | Aufl. |
|---------------------------------|--------|---------|---------|----------|--------|
| Volatilität Anlagegruppe (in %) | 3.63 | 6.04 | 5.75 | 4.73 | 3.81 |
| Volatilität Benchmark (in %) | 3.64 | 5.85 | 5.49 | 4.58 | 3.78 |
| Tracking Error ex post (in %) | 0.18 | 0.43 | 0.46 | 0.37 | 0.44 |
| Information Ratio | 0.71 | -0.44 | -0.19 | -0.28 | -0.17 |
| Sharpe Ratio | 1.78 | -0.27 | -0.22 | 0.18 | 0.53 |
| Korrelation | 1.00 | 1.00 | 1.00 | 1.00 | 0.99 |
| Beta | 1.00 | 1.03 | 1.04 | 1.03 | 1.00 |
| Jensen-Alpha | 0.14 | -0.15 | -0.04 | -0.13 | -0.08 |
| Maximum Drawdown (in %) | -2.16 | -16.18 | -18.41 | -19.71 | -19.71 |
| Recovery Period (Jahre) | 0.41 | - | - | - | - |

Performance



Produktinformationen

Valorennummer: 1239071
ISIN: CH0012390719
LEI: 254900M0YGKYAE29FA28
Bloomberg-Code: SWAOBIN SW
Benchmark: SBI Domestic AAA - BBB TR
Währung: CHF
Domizil: Schweiz
Aufledgedatum: 30/09/2001
Erstausgabepreis: 100.00
Jahresabschluss: 30.09
Ausgabe/Rücknahme: Täglich
Annahmeschluss: 13.00 Uhr
Ausgabe- / Rücknahmekommission: Keine
Ausschüttungspraxis: Thesaurierung
Asset Manager gemäss Swiss Life Best Select Invest Plus®: Swiss Life Asset Management AG
Überwachung Asset Manager: PPCmetrics unterstützt die laufende Überwachung des Asset Managers sowie die Beurteilung der Anlageresultate.
Kurspublikationen: Bloomberg: ASSL
www.swisslife.ch/anlagestiftung
Betriebsaufwandquote TER KGAST ex ante: 0.27%
ex post per: 30/09/2024 0.27%

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.

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 Branchen

| | Anlagegruppe | Benchmark |
|-------------------------|--------------|-----------|
| Pfandbriefinstitute | 30.54% | 39.43% |
| Finanzwesen | 27.73% | 15.82% |
| Staatlich und staatsnah | 23.04% | 29.83% |
| Basiskonsumgüter | 7.93% | 7.01% |
| Versorgungsbetriebe | 5.13% | 2.49% |
| Industrie | 2.79% | 2.75% |
| Nicht-Basiskonsumgüter | 1.38% | 0.38% |
| Kommunikation | 0.50% | 0.92% |
| Andere | 0.23% | 1.38% |
| Liquidität | 0.73% | - |

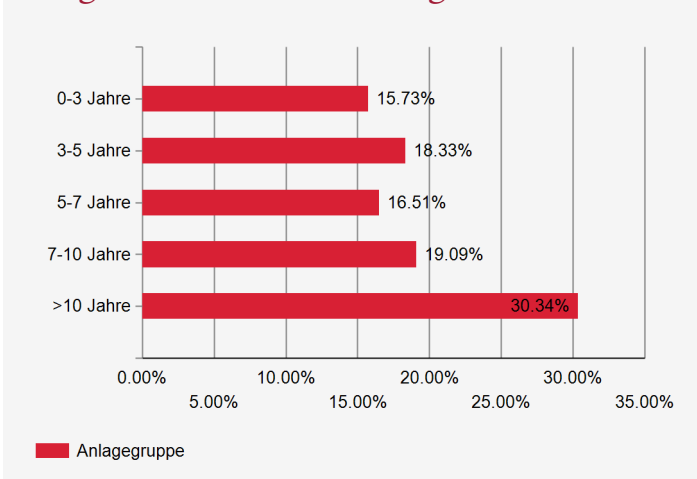
Grösste Schuldner und Rating

| | Rating | Anlagegruppe |
|--------------------|--------|--------------|
| Pfandbriefbank | AAA | 16.94% |
| Pfandbriefzentrale | AAA | 13.45% |
| Eidgenossenschaft | AAA | 13.37% |
| Stadt Zürich | AAA | 2.62% |
| UBS Group AG | AA- | 2.54% |

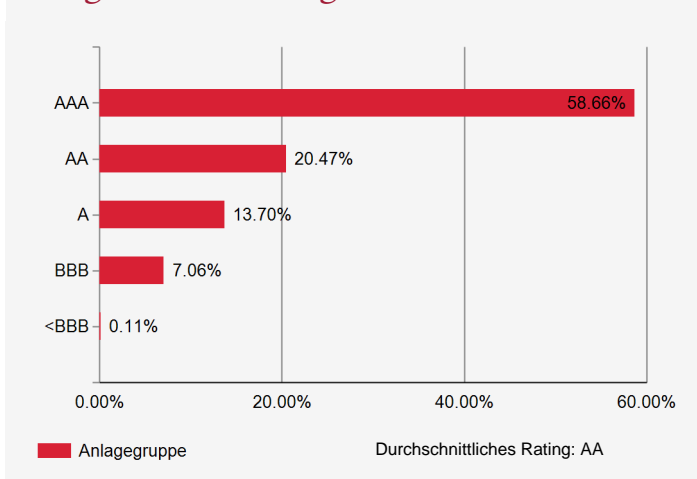
Weitere Angaben zu den Schuldnern

| | |
|----------------------------------|-------|
| Anzahl Schuldner | 113 |
| Anteil Benchmarkfremde Schuldner | 0.15% |

Fälligkeitstruktur der Anlagen



Anlagen nach Rating



Duration und Rendite auf Verfall

| | Anlagegruppe | Benchmark |
|-----------------------------------|--------------|-----------|
| Modified Duration* | 8.0 | 8.0 |
| Theoretische Rendite auf Verfall* | 0.89% | 0.79% |

* Vor Währungsabsicherung, unter Berücksichtigung der Derivate

Anlagestiftung Swiss Life

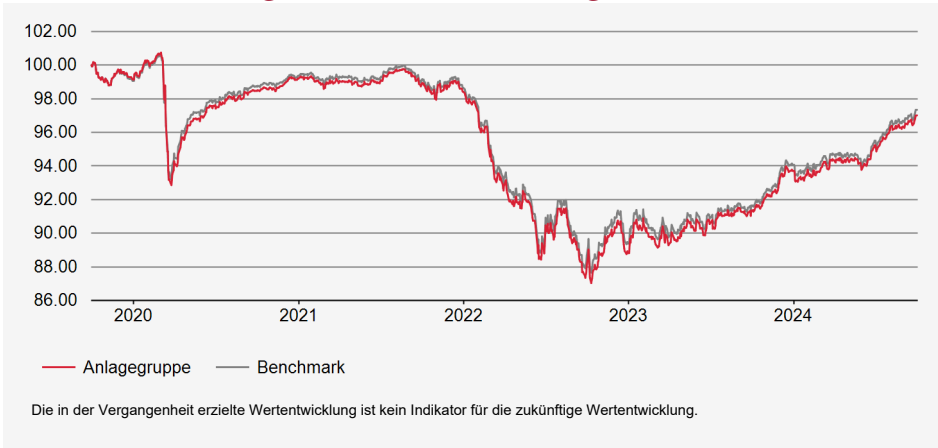
Obligationen CHF Ausland

Nettovermögen (NAV) in Mio. CHF: 305.94
Nettovermögen pro Anspruch in CHF: 150.40

Anlagestrategie

Anlagen in auf CHF lautende Forderungspapiere von Schuldern, die vorwiegend im Ausland domiziliert sind. Aktive Titelselektion, Durationsteuerung und Zinskurvenpositionierung. Schuldnerbegrenzung: 10%. Forderungspapiere benchmarkfremder Schuldner: max. 20%. Durchschnittliche Ratingqualität: mindestens A. Umsetzung mittels Einsatz des Swiss Life iFunds (CH) Bond Swiss Francs Foreign (CHF); Anlagefonds schweizerischen Rechts der Kategorie "Übrige Fonds für traditionelle Anlagen".

Wertentwicklung in Referenzwährung (Basis 100)



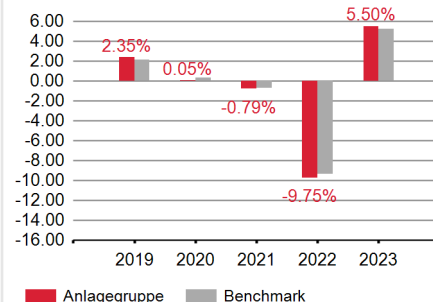
Performance in Referenzwährung

| | Kumulierte Performance | | | | Annualisierte Performance | | | |
|--------------|------------------------|---------|----------|--------|---------------------------|---------|----------|-------|
| | YTD | 1 Monat | 3 Monate | 1 Jahr | 3 Jahre | 5 Jahre | 10 Jahre | Aufl. |
| Anlagegruppe | 3.52% | 0.70% | 1.88% | 6.19% | -0.62% | -0.60% | 0.31% | 1.79% |
| Benchmark | 3.48% | 0.68% | 1.93% | 6.22% | -0.58% | -0.54% | 0.37% | 1.91% |

Statistische Angaben (annualisiert)

| | 1 Jahr | 3 Jahre | 5 Jahre | 10 Jahre | Aufl. |
|---------------------------------|--------|---------|---------|----------|--------|
| Volatilität Anlagegruppe (in %) | 1.97 | 3.92 | 4.47 | 3.40 | 3.21 |
| Volatilität Benchmark (in %) | 2.01 | 3.90 | 4.26 | 3.26 | 3.07 |
| Tracking Error ex post (in %) | 0.12 | 0.25 | 0.34 | 0.32 | 0.85 |
| Information Ratio | -0.22 | -0.15 | -0.20 | -0.20 | -0.13 |
| Sharpe Ratio | 2.30 | -0.34 | -0.17 | 0.18 | 0.49 |
| Korrelation | 1.00 | 1.00 | 1.00 | 1.00 | 0.96 |
| Beta | 0.98 | 1.00 | 1.05 | 1.04 | 1.01 |
| Jensen-Alpha | 0.09 | -0.03 | -0.04 | -0.09 | -0.15 |
| Maximum Drawdown (in %) | -0.98 | -12.15 | -13.61 | -14.23 | -14.23 |
| Recovery Period (Jahre) | 0.15 | - | - | - | - |

Performance



Produktinformationen

Valorennummer: 1245477
ISIN: CH0012454770
LEI: 2549002XPEQH1AZYBW05
Bloomberg-Code: SWAOBAU SW
Benchmark: SBI Foreign AAA - BBB TR
Währung: CHF
Domizil: Schweiz
Aufledgedatum: 30/09/2001
Erstausgabepreis: 100.00
Jahresabschluss: 30.09
Ausgabe/Rücknahme: Täglich
Annahmeschluss: 13.00 Uhr
Ausgabe- / Rücknahmekommission: Keine
Ausschüttungspraxis: Thesaurierung
Asset Manager gemäss Swiss Life Best Select Invest Plus®: Swiss Life Asset Management AG
Überwachung Asset Manager: PPCmetrics unterstützt die laufende Überwachung des Asset Managers sowie die Beurteilung der Anlageresultate.
Kurspublikationen: Bloomberg: ASSL
www.swisslife.ch/anlagestiftung
Betriebsaufwandquote TER KGAST ex ante: 0.27%
ex post per: 30/09/2024 0.27%

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.

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 Branchen

| | Anlagegruppe | Benchmark |
|-------------------------|--------------|-----------|
| Finanzwesen | 65.90% | 48.12% |
| Staatlich und staatsnah | 7.70% | 15.55% |
| Pfandbriefinstitute | 6.20% | 16.72% |
| Nicht-Basiskonsumgüter | 3.74% | 3.49% |
| Versorgungsbetriebe | 3.73% | 2.78% |
| Industrie | 3.01% | 5.30% |
| Basiskonsumgüter | 2.62% | 4.04% |
| Energie | 1.06% | 1.23% |
| Supranational | 4.73% | - |
| Andere | 1.43% | 2.78% |
| Liquidität | -0.13% | - |

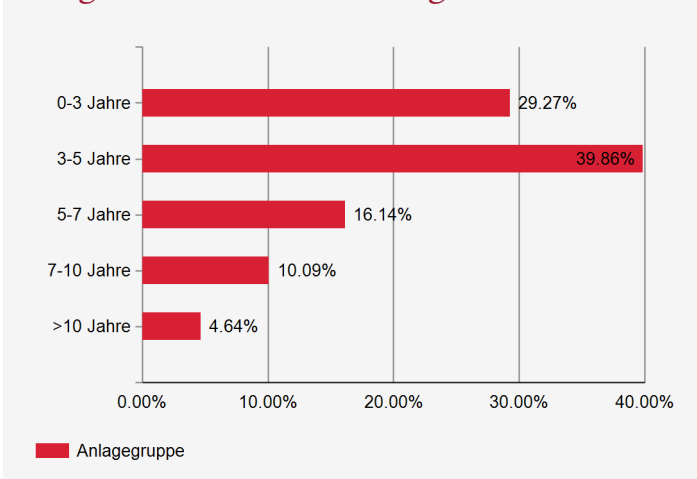
Grösste Schuldner und Rating

| | Rating | Anlagegruppe |
|----------------------------|--------|--------------|
| Banco Santander SA, Madrid | A+ | 4.35% |
| Bank of Nova Scotia/The | AA | 3.95% |
| Groupe BPCE | AA- | 3.83% |
| Müchener Hypothekenbank | AA | 3.71% |
| Credit Agricole Group | AA- | 3.28% |

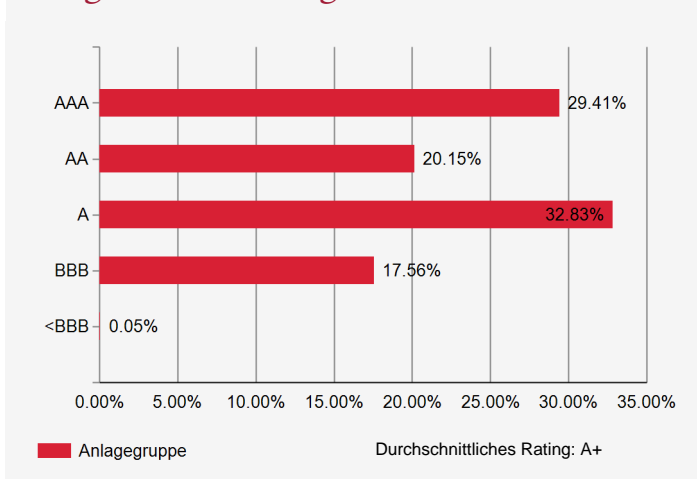
Weitere Angaben zu den Schuldnern

| | |
|----------------------------------|-------|
| Anzahl Schuldner | 113 |
| Anteil Benchmarkfremde Schuldner | 2.41% |

Fälligkeitstruktur der Anlagen



Anlagen nach Rating



Duration und Rendite auf Verfall

| | Anlagegruppe | Benchmark |
|-----------------------------------|--------------|-----------|
| Modified Duration* | 4.2 | 4.2 |
| Theoretische Rendite auf Verfall* | 1.17% | 1.05% |

* Vor Währungsabsicherung, unter Berücksichtigung der Derivate

Portfoliostruktur nach Ländern/Regionen

| | Anlagegruppe | Benchmark |
|-------------------------------|--------------|-----------|
| Frankreich | 16.28% | 16.23% |
| Deutschland | 14.97% | 13.38% |
| Kanada | 12.68% | 11.86% |
| Vereinigte Staaten | 9.95% | 12.19% |
| Australien | 6.08% | 6.67% |
| Spanien | 5.98% | 4.65% |
| Vereinigtes Königreich | 4.71% | 4.45% |
| Europäische Region (Ex EUR) | 8.54% | 6.59% |
| Europäische Region (EUR) | 5.45% | 9.60% |
| Schwellenländer Lateinamerika | 5.39% | 4.05% |
| Andere | 10.11% | 10.35% |
| Liquidität, Absicherung | -0.13% | - |

Anlagestiftung Swiss Life

Obligationen Global (CHF hedged)

Nettovermögen (NAV) in Mio. CHF: 149.41
Nettovermögen pro Anspruch in CHF: 120.24

Anlagestrategie

Anlagen in Forderungspapiere von Schuldern mit Domizil im In- oder Ausland (seit 1.1.2011 CHF hedged). Aktive Titelselektion, Durationsteuerung und Zinskurvenpositionierung. Schuldnerbegrenzung: 10% (Ausnahme: sofern in der Benchmark vertreten, max. 5%-Punkte mehr als Benchmarkgewichtung). Forderungspapiere benchmarkfremder Schuldner: max.10%. Durchschnittliche Ratingqualität: mindestens A-. Fremdwährungsrisiken werden zu mindestens 90% gegen Schweizerfranken abgesichert. Umsetzung mittels Einsatz Swiss Life iFunds (CH) Bond Global Aggregate (CHF hedged); Anlagefonds schweizerischen Rechts der Kategorie "Übrige Fonds für traditionelle Anlagen".

Wertentwicklung in Referenzwährung (Basis 100)



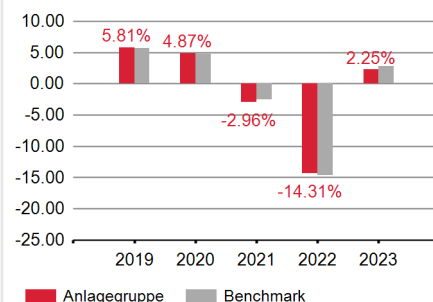
Performance in Referenzwährung

| | Kumulierte Performance | | | | Annualisierte Performance | | | |
|--------------|------------------------|---------|----------|--------|---------------------------|---------|----------|-------|
| | YTD | 1 Monat | 3 Monate | 1 Jahr | 3 Jahre | 5 Jahre | 10 Jahre | Aufl. |
| Anlagegruppe | 0.51% | 0.81% | 3.01% | 5.46% | -4.28% | -2.37% | -0.35% | 0.80% |
| Benchmark | 0.65% | 0.88% | 3.15% | 5.68% | -4.11% | -2.28% | -0.18% | 0.90% |

Statistische Angaben (annualisiert)

| | 1 Jahr | 3 Jahre | 5 Jahre | 10 Jahre | Aufl. |
|---------------------------------|--------|---------|---------|----------|--------|
| Volatilität Anlagegruppe (in %) | 5.47 | 5.87 | 5.24 | 4.26 | 5.40 |
| Volatilität Benchmark (in %) | 5.37 | 6.12 | 5.38 | 4.35 | 5.56 |
| Tracking Error ex post (in %) | 0.28 | 0.58 | 0.51 | 0.56 | 1.40 |
| Information Ratio | -0.78 | -0.30 | -0.18 | -0.31 | -0.06 |
| Sharpe Ratio | 0.70 | -0.87 | -0.49 | -0.01 | 0.11 |
| Korrelation | 1.00 | 1.00 | 1.00 | 0.99 | 0.97 |
| Beta | 1.02 | 0.95 | 0.97 | 0.97 | 0.94 |
| Jensen-Alpha | -0.28 | -0.40 | -0.16 | -0.17 | -0.05 |
| Maximum Drawdown (in %) | -4.13 | -18.55 | -20.24 | -20.24 | -20.24 |
| Recovery Period (Jahre) | 0.37 | - | - | - | - |

Performance



Produktinformationen

Valorennummer: 1245479
ISIN: CH0012454796
LEI: 254900F82G5L48XPDV74
Bloomberg-Code: SWAOBFG SW
Benchmark: BLOOMBERG GLO AGG EX SEC EX CNY HEDGED CHF
Währung: CHF
Domizil: Schweiz
Aufliedatum: 30/09/2001
Erstausgabepreis: 100.00
Jahresabschluss: 30.09
Ausgabe/Rücknahme: Täglich
Annahmeschluss: 13.00 Uhr
Ausgabe- / Rücknahmekommission: Keine
Ausschüttungspraxis: Thesaurierung
Asset Manager gemäss Swiss Life Best Select Invest Plus@: Swiss Life Asset Management AG
Überwachung Asset Manager: PPCmetrics unterstützt die laufende Überwachung des Asset Managers sowie die Beurteilung der Anlageregebnisse.
Kurspublikationen: Bloomberg: ASSL www.swisslife.ch/anlagestiftung
Betriebsaufwandquote TER KGAST ex ante: 0.46%
ex post per: 30/09/2024 0.46%

Benchmark: Die Benchmark wurde per 1. Juli 2012 gewechselt. Für Informationen betreffend die frühere Benchmark wenden Sie sich bitte an die Anlagestiftung Swiss Life.

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.

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 Obligationen Global (CHF hedged)

Portfoliostruktur nach Branchen

| | Anlagegruppe | Benchmark |
|-------------------------|--------------|-----------|
| Staatlich und staatsnah | 52.04% | 72.55% |
| Finanzwesen | 18.94% | 11.42% |
| Basiskonsumgüter | 6.85% | 4.01% |
| Kommunikation | 2.81% | 1.95% |
| Nicht-Basiskonsumgüter | 2.40% | 1.81% |
| Versorgungsbetriebe | 1.94% | 2.71% |
| Technologie | 1.48% | 1.10% |
| Energie | 1.38% | 1.67% |
| Supranational | 5.05% | - |
| Andere | 1.94% | 2.78% |
| Liquidität | 5.26% | - |
| Währungsabsicherung | -0.09% | - |

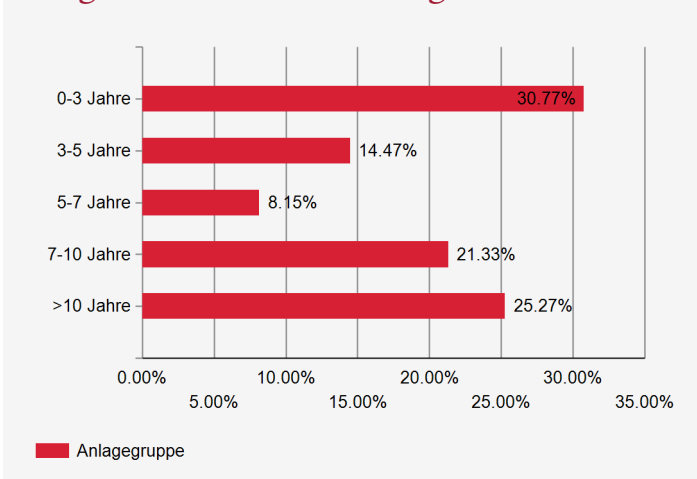
Grösste Schuldner und Rating

| | Rating | Anlagegruppe |
|-----------------|--------|--------------|
| Japan | A+ | 17.44% |
| US Treasury N/B | AAA | 8.85% |
| Italien | BBB | 5.45% |
| Spanien | A | 2.56% |
| BNG Bank NV | AAA | 1.97% |

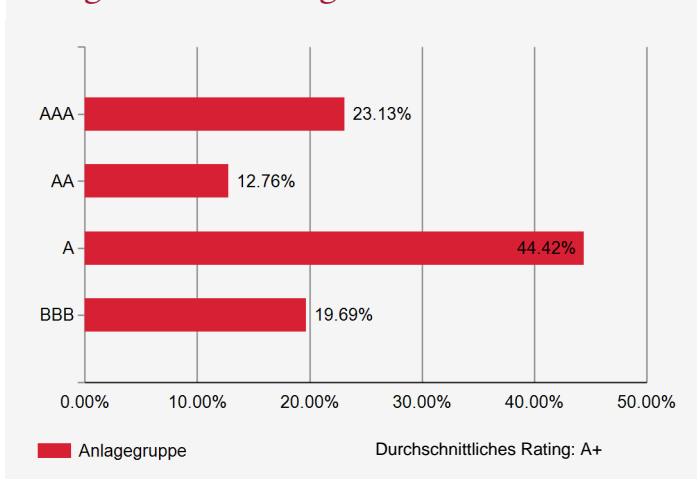
Weitere Angaben zu den Schuldnern

| | |
|----------------------------------|-------|
| Anzahl Schuldner | 149 |
| Anteil Benchmarkfremde Schuldner | 0.00% |

Fälligkeitstruktur der Anlagen



Anlagen nach Rating



Duration und Rendite auf Verfall

| | Anlagegruppe | Benchmark |
|-----------------------------------|--------------|-----------|
| Modified Duration* | 7.2 | 6.9 |
| Theoretische Rendite auf Verfall* | 3.47% | 3.42% |

* Vor Währungsabsicherung, unter Berücksichtigung der Derivate

Portfoliostruktur nach Ländern/Regionen

| | Anlagegruppe | Benchmark |
|-------------------------------|--------------|-----------|
| Vereinigte Staaten | 25.14% | 37.17% |
| Japan | 20.41% | 13.69% |
| Kanada | 8.10% | 4.37% |
| Italien | 6.81% | 4.00% |
| Deutschland | 5.41% | 5.87% |
| Frankreich | 5.24% | 6.18% |
| Vereinigtes Königreich | 3.78% | 5.48% |
| Europäische Region (EUR) | 11.10% | 8.90% |
| Europäische Region (Ex EUR) | 3.57% | 1.59% |
| Schwellenländer Lateinamerika | 1.66% | 0.04% |
| Andere | 3.61% | 12.72% |
| Liquidität, Absicherung | 5.17% | - |

Anlagestiftung Swiss Life

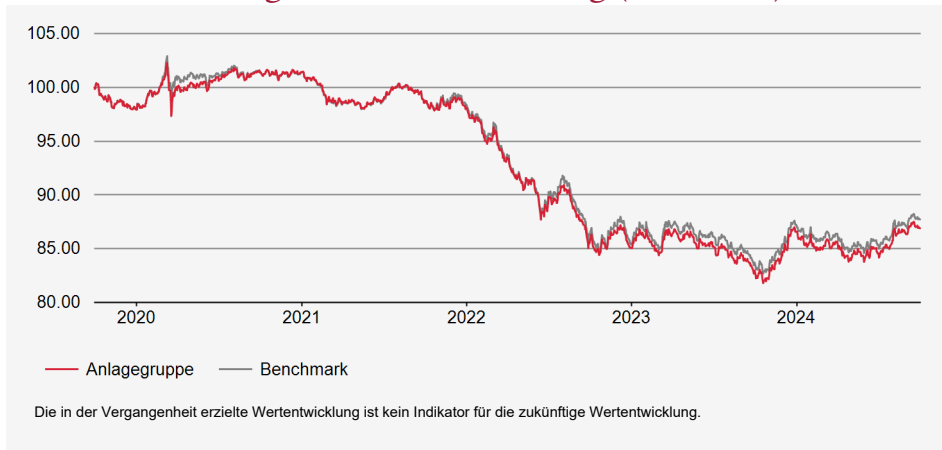
Obligationen Global Staaten+ (CHF hedged)

Nettovermögen (NAV) in Mio. CHF: 866.06
Nettovermögen pro Anspruch in CHF: 107.80

Anlagestrategie

Anlagen in Forderungspapiere von Staaten und staatsnahen Institutionen. Aktive Titelselektion, Durationsteuerung und Zinskurvenpositionierung. Schuldnerbegrenzung: 10% (Ausnahme: sofern in der Benchmark vertreten, max. 5%-Punkte mehr als Benchmarkgewichtung). Forderungspapiere benchmarkfremder Schuldner: max. 10%. Durchschnittliche Ratingqualität: mindestens A+. Fremdwährungsrisiken werden zu mindestens 90% gegen Schweizerfranken abgesichert. Umsetzung mittels Einsatz des Swiss Life iFunds (CH) Bond Global Government+ (CHF hedged); Anlagefonds schweizerischen Rechts der Kategorie "Übrige Fonds für traditionelle Anlagen".

Wertentwicklung in Referenzwährung (Basis 100)



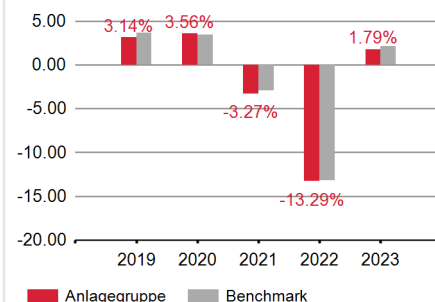
Performance in Referenzwährung

| | Kumulierte Performance | | | | Annualisierte Performance | | | |
|--------------|------------------------|---------|----------|--------|---------------------------|---------|----------|-------|
| | YTD | 1 Monat | 3 Monate | 1 Jahr | 3 Jahre | 5 Jahre | 10 Jahre | Aufl. |
| Anlagegruppe | 0.35% | 0.62% | 2.74% | 4.74% | -4.11% | -2.77% | -0.64% | 0.55% |
| Benchmark | 0.56% | 0.72% | 2.78% | 4.79% | -3.81% | -2.58% | -0.41% | 0.59% |

Statistische Angaben (annualisiert)

| | 1 Jahr | 3 Jahre | 5 Jahre | 10 Jahre | Aufl. |
|---------------------------------|--------|---------|---------|----------|--------|
| Volatilität Anlagegruppe (in %) | 4.88 | 5.04 | 4.32 | 3.71 | 3.57 |
| Volatilität Benchmark (in %) | 4.60 | 5.15 | 4.39 | 3.80 | 3.53 |
| Tracking Error ex post (in %) | 0.34 | 0.57 | 0.60 | 0.59 | 0.69 |
| Information Ratio | -0.15 | -0.52 | -0.31 | -0.39 | -0.06 |
| Sharpe Ratio | 0.64 | -0.97 | -0.68 | -0.09 | 0.21 |
| Korrelation | 1.00 | 0.99 | 0.99 | 0.99 | 0.98 |
| Beta | 1.06 | 0.97 | 0.98 | 0.96 | 0.99 |
| Jensen-Alpha | -0.25 | -0.43 | -0.25 | -0.23 | -0.03 |
| Maximum Drawdown (in %) | -3.70 | -17.43 | -20.00 | -20.00 | -20.00 |
| Recovery Period (Jahre) | 0.27 | - | - | - | - |

Performance



Produktinformationen

Valorennummer: 11955694

ISIN: CH0119556949

LEI: 254900H7WEVS3K9ANR90

Bloomberg-Code: SWLGSTP SW

Benchmark: BLOOMBERG GLOBAL AGG TREAS EX CHF TR HEDGED CHF

Währung: CHF

Domizil: Schweiz

Aufliedatum: 14/12/2010

Erstausgabepreis: 100.00

Jahresabschluss: 30.09

Ausgabe/Rücknahme: Täglich

Annahmeschluss: 13.00 Uhr

Ausgabe- / Rücknahmekommission: Keine

Ausschüttungspraxis: Thesaurierung

Asset Manager gemäss

Swiss Life Best Select Invest Plus@:
Swiss Life Asset Management AG

Überwachung Asset Manager:

PPCmetrics unterstützt die laufende Überwachung des Asset Managers sowie die Beurteilung der Anlageresultate.

Kurspublikationen: Bloomberg: ASSL
www.swisslife.ch/anlagestiftung

Betriebsaufwandquote TER KGAST

ex ante: 0.42%

ex post per: 30/09/2024 0.42%

Benchmark: Die Benchmark wurde per 1. Juli 2012 gewechselt. Für Informationen betreffend die frühere Benchmark wenden Sie sich bitte an die Anlagestiftung Swiss Life.

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.

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

Obligationen Global Staaten+ (CHF hedged)

Portfoliostruktur nach Branchen

| | Anlagegruppe | Benchmark |
|-------------------------|--------------|-----------|
| Staatlich und staatsnah | 76.59% | 100.00% |
| Finanzwesen | 6.78% | - |
| Pfandbriefinstitute | 3.56% | - |
| Industrie | 0.08% | - |
| Supranational | 4.27% | - |
| Liquidität | 8.59% | - |
| Währungsabsicherung | 0.11% | - |

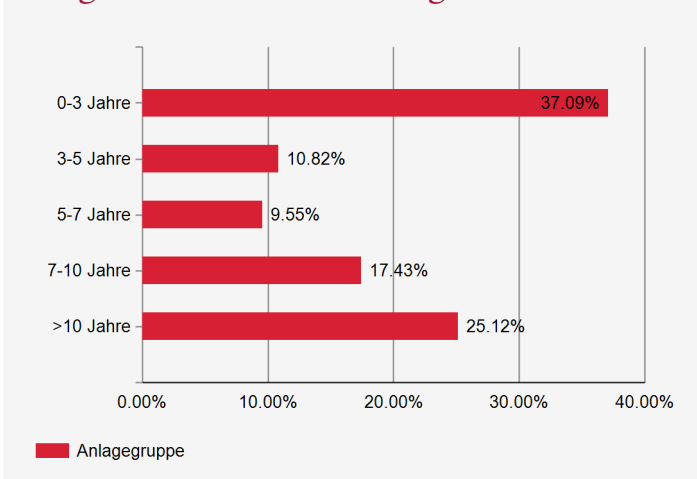
Grösste Schuldner und Rating

| | | Anlagegruppe |
|----------------------------|------|--------------|
| Japan | A+ | 21.87% |
| US Treasury N/B | AAA | 14.44% |
| Italien | BBB- | 5.73% |
| People's Republic of China | A+ | 5.38% |
| Spanien | A- | 4.64% |

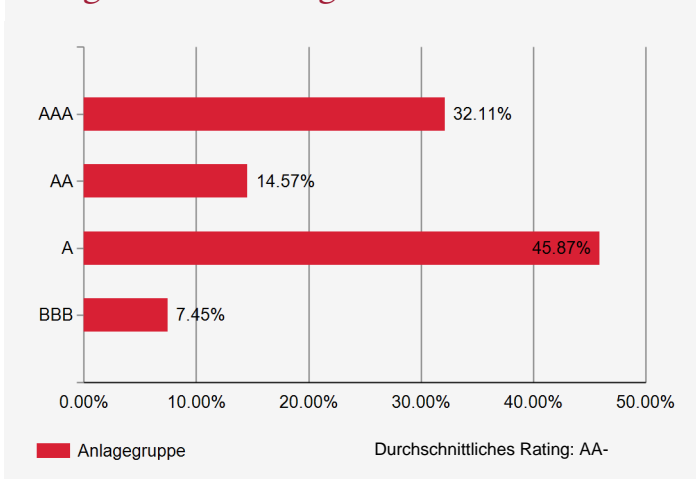
Weitere Angaben zu den Schuldnern

| | |
|----------------------------------|-------|
| Anzahl Schuldner | 65 |
| Anteil Benchmarkfremde Schuldner | 3.30% |

Fälligkeitstruktur der Anlagen



Anlagen nach Rating



Duration und Rendite auf Verfall

| | Anlagegruppe | Benchmark |
|-----------------------------------|--------------|-----------|
| Modified Duration* | 7.4 | 7.3 |
| Theoretische Rendite auf Verfall* | 3.03% | 2.92% |

* Vor Währungsabsicherung, unter Berücksichtigung der Derivate

Portfolio nach Währungen und Duration

| | Anlagegruppe | | Benchmark | |
|--------|--------------|----------|------------|----------|
| | Gewichtung | Duration | Gewichtung | Duration |
| JPY | 31.78% | 4.73 | 17.98% | 8.92 |
| EUR | 21.87% | 10.03 | 23.12% | 7.17 |
| USD | 18.19% | 12.31 | 33.43% | 6.01 |
| GBP | 9.08% | 8.72 | 5.54% | 8.99 |
| Andere | 19.07% | 7.28 | 19.94% | 7.11 |

Portfoliostruktur nach Ländern/Regionen

| | Anlagegruppe | Benchmark |
|-----------------------------|--------------|-----------|
| Japan | 24.39% | 17.98% |
| Vereinigte Staaten | 15.99% | 33.43% |
| Italien | 6.33% | 5.02% |
| China | 5.95% | 9.51% |
| Spanien | 5.28% | 3.28% |
| Vereinigtes Königreich | 4.97% | 5.54% |
| Deutschland | 3.73% | 4.37% |
| Europäische Region (EUR) | 10.92% | 9.68% |
| Europäische Region (Ex EUR) | 4.94% | 0.45% |
| Asien-Pazifik-Raum | 1.84% | 1.35% |
| Andere | 6.95% | 9.40% |
| Liquidität, Absicherung | 8.71% | - |

Anlagestiftung Swiss Life

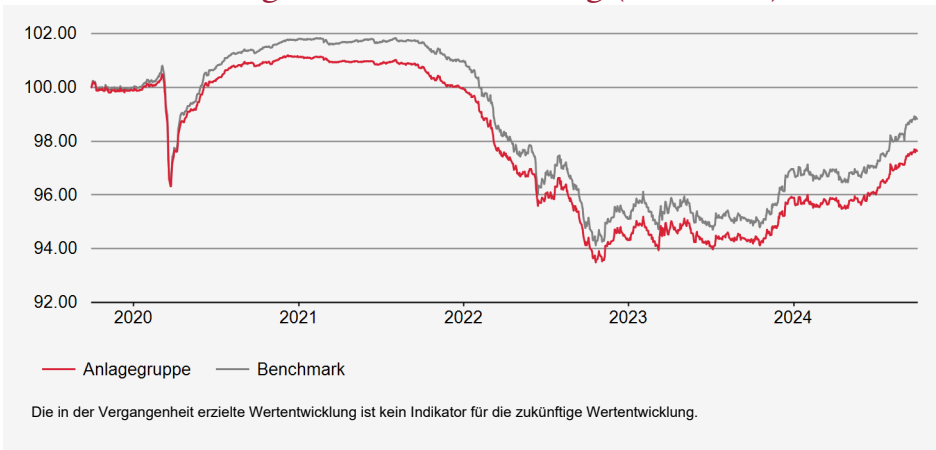
Obligationen Global Unternehmen Short Term (CHF hedged)

Nettovermögen (NAV) in Mio. CHF: 1'376.35
Nettovermögen pro Anspruch in CHF: 99.05

Anlagestrategie

Anlagen in Forderungspapiere von Unternehmen inklusive Agencies und Supranationals mit einer kurzen Restlaufzeit (mehrheitlich unter 3 Jahren). Aktive Titelselektion, Durationsteuerung und Zinskurvenpositionierung. Schuldnerbegrenzung: 10%. Forderungspapiere benchmarkfremder Schuldner: max. 10%. Durchschnittliche Ratingqualität: mindestens BBB. Fremdwährungsrisiken werden zu mindestens 90% gegen Schweizerfranken abgesichert. Umsetzung mittels Einsatz des Swiss Life iFunds (CH) Bond Global Corporates Short Term (CHF hedged); Anlagefonds schweizerischen Rechts der Kategorie "Übrige Fonds für traditionelle Anlagen".

Wertentwicklung in Referenzwährung (Basis 100)



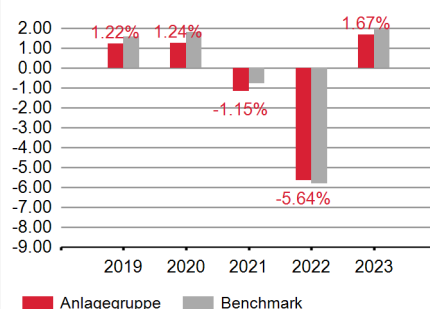
Performance in Referenzwährung

| | Kumulierte Performance | | | | Annualisierte Performance | | | |
|--------------|------------------------|---------|----------|--------|---------------------------|---------|----------|--------|
| | YTD | 1 Monat | 3 Monate | 1 Jahr | 3 Jahre | 5 Jahre | 10 Jahre | Aufl. |
| Anlagegruppe | 1.81% | 0.53% | 1.62% | 3.48% | -1.03% | -0.48% | -0.27% | -0.09% |
| Benchmark | 1.92% | 0.58% | 1.83% | 3.97% | -0.93% | -0.23% | -0.09% | 0.07% |

Statistische Angaben (annualisiert)

| | 1 Jahr | 3 Jahre | 5 Jahre | 10 Jahre | Aufl. |
|---------------------------------|--------|---------|---------|----------|-------|
| Volatilität Anlagegruppe (in %) | 1.37 | 2.13 | 2.22 | 1.67 | 1.61 |
| Volatilität Benchmark (in %) | 1.68 | 2.35 | 2.39 | 1.76 | 1.69 |
| Tracking Error ex post (in %) | 0.36 | 0.31 | 0.27 | 0.32 | 0.32 |
| Information Ratio | -1.34 | -0.32 | -0.92 | -0.55 | -0.49 |
| Sharpe Ratio | 1.41 | -0.81 | -0.28 | 0.02 | 0.12 |
| Korrelation | 0.99 | 0.99 | 1.00 | 0.98 | 0.98 |
| Beta | 0.81 | 0.90 | 0.92 | 0.93 | 0.94 |
| Jensen-Alpha | -0.02 | -0.27 | -0.28 | -0.16 | -0.13 |
| Maximum Drawdown (in %) | -0.53 | -7.22 | -7.61 | -8.08 | -8.08 |
| Recovery Period (Jahre) | 0.16 | - | - | - | - |

Performance



Produktinformationen

Valorennummer: 22073699
ISIN: CH0220736992
LEI: 2549003DSGO0RN37K507
Bloomberg-Code: SWLOGNT SW
Benchmark: BLOOMBERG GLO AGG CORP 1-3 YR IND HEDGED CHF
Währung: CHF
Domizil: Schweiz
Aufliedatum: 11/10/2013
Erstausgabepreis: 100.00
Jahresabschluss: 30.09
Ausgabe/Rücknahme: Täglich
Annahmeschluss: 13.00 Uhr
Ausgabe- / Rücknahmekommission: Keine

Ausschüttungspraxis: Thesaurierung
Asset Manager gemäss Swiss Life Best Select Invest Plus@: Swiss Life Asset Management AG

Überwachung Asset Manager: PPCmetrics unterstützt die laufende Überwachung des Asset Managers sowie die Beurteilung der Anlageresultate.

Kurspublikationen: Bloomberg: ASSL
www.swisslife.ch/anlagestiftung

Betriebsaufwandquote TER KGAST ex ante: 0.37%
ex post per: 30/09/2024 0.37%

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.

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 Branchen

| | Anlagegruppe | Benchmark |
|------------------------|--------------|-----------|
| Finanzwesen | 53.44% | 50.99% |
| Basiskonsumgüter | 11.59% | 12.11% |
| Nicht-Basiskonsumgüter | 8.52% | 9.88% |
| Kommunikation | 4.67% | 5.39% |
| Energie | 4.08% | 4.13% |
| Technologie | 3.75% | 4.08% |
| Industrie | 3.36% | 5.91% |
| Versorgungsbetriebe | 2.52% | 5.24% |
| Andere | 2.88% | 2.28% |
| Liquidität | 3.58% | - |
| Währungsabsicherung | 1.60% | - |

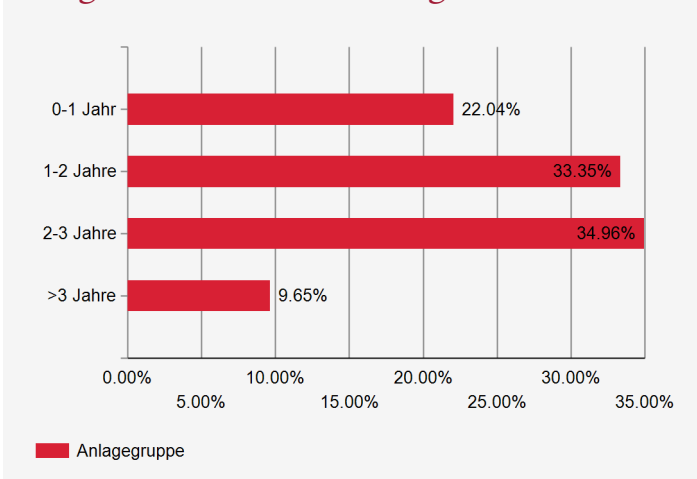
Grösste Schuldner und Rating

| | Rating | Anlagegruppe |
|------------------------------|--------|--------------|
| Banco Santander SA, Madrid | A- | 3.06% |
| Credit Agricole Group | BBB+ | 2.65% |
| Citigroup Inc | BBB+ | 2.33% |
| Barclays Capital PLC, London | BBB | 2.14% |
| Morgan Stanley NE US | A | 2.03% |

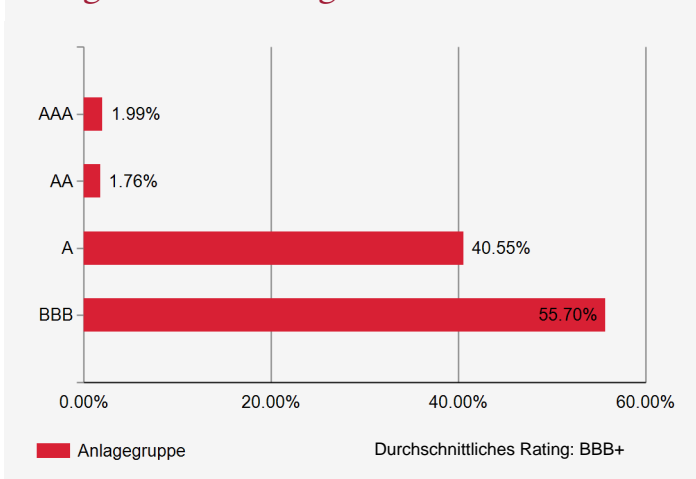
Weitere Angaben zu den Schuldnern

| | |
|----------------------------------|-------|
| Anzahl Schuldner | 149 |
| Anteil Benchmarkfremde Schuldner | 6.63% |

Fälligkeitstruktur der Anlagen



Anlagen nach Rating



Duration und Rendite auf Verfall

| | Anlagegruppe | Benchmark |
|-----------------------------------|--------------|-----------|
| Modified Duration* | 1.9 | 1.8 |
| Theoretische Rendite auf Verfall* | 3.76% | 3.89% |

* Vor Währungsabsicherung, unter Berücksichtigung der Derivate

Portfolio nach Währungen und Duration

| | Anlagegruppe | | Benchmark | |
|--------|--------------|----------|------------|----------|
| | Gewichtung | Duration | Gewichtung | Duration |
| USD | 58.79% | 1.89 | 60.04% | 1.88 |
| EUR | 25.44% | 1.97 | 29.79% | 1.96 |
| CHF | 11.25% | 1.31 | 0.47% | 1.91 |
| GBP | 3.47% | 1.47 | 3.86% | 1.89 |
| Andere | 1.05% | 2.00 | 5.84% | 1.97 |

Portfoliostruktur nach Ländern/Regionen

| | Anlagegruppe | Benchmark |
|-------------------------------|--------------|-----------|
| Vereinigte Staaten | 34.19% | 45.94% |
| Frankreich | 8.95% | 7.59% |
| Vereinigtes Königreich | 7.84% | 6.85% |
| Kanada | 7.56% | 5.77% |
| Deutschland | 6.45% | 6.20% |
| Schweiz | 6.14% | 2.05% |
| Spanien | 5.60% | 3.33% |
| Europäische Region (EUR) | 6.14% | 6.62% |
| Schwellenländer Asien Pazifik | 4.69% | 2.36% |
| Asien-Pazifik-Raum | 3.55% | 4.63% |
| Andere | 3.70% | 8.67% |
| Liquidität, Absicherung | 5.19% | - |

Anlagestiftung Swiss Life

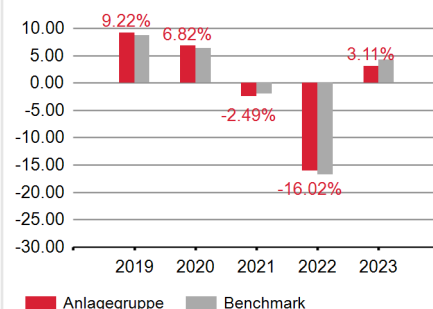
Obligationen Global Unternehmen (CHF hedged)

Nettovermögen (NAV) in Mio. CHF: 811.36
Nettovermögen pro Anspruch in CHF: 122.29

Anlagestrategie

Anlagen in Forderungspapiere von Unternehmen inklusive Agencies und Supranationals. Aktive Titelselektion, Durationsteuerung und Zinskurvenpositionierung. Schuldnerbegrenzung: 10%. Forderungspapiere benchmarkfremder Schuldner: max.10%. Durchschnittliche Ratingqualität: mindestens BBB. Fremdwährungsrisiken werden zu mindestens 90% gegen Schweizerfranken abgesichert. Umsetzung mittels Einsatz des Swiss Life iFunds (CH) Bond Global Corporates (CHF hedged); Anlagefonds schweizerischen Rechts der Kategorie "Übrige Fonds für traditionelle Anlagen".

Performance



Wertentwicklung in Referenzwährung (Basis 100)



Produktinformationen

Valorennummer: 11955702
ISIN: CH0119557020
LEI: 254900C3B00LU0UJ428
Bloomberg-Code: SWLGUNT SW
Benchmark: BLOOMBERG GLO AGG CORP IND HEDGED CHF
Währung: CHF
Domizil: Schweiz
Aufledgedatum: 14/12/2010
Erstausgabepreis: 100.00
Jahresabschluss: 30.09
Ausgabe/Rücknahme: Täglich
Annahmeschluss: 13.00 Uhr
Ausgabe- / Rücknahmekommission: Keine

Ausschüttungspraxis: Thesaurierung
Asset Manager gemäss Swiss Life Best Select Invest Plus@: Swiss Life Asset Management AG

Überwachung Asset Manager: PPCmetrics unterstützt die laufende Überwachung des Asset Managers sowie die Beurteilung der Anlageregebnisse.

Kurspublikationen: Bloomberg: ASSL
www.swisslife.ch/anlagestiftung

Betriebsaufwandquote TER KGAST
ex ante: 0.53%
ex post per: 30/09/2024 0.53%

Performance in Referenzwährung

| | Kumulierte Performance | | | | Annualisierte Performance | | | |
|--------------|------------------------|---------|----------|--------|---------------------------|---------|----------|-------|
| | YTD | 1 Monat | 3 Monate | 1 Jahr | 3 Jahre | 5 Jahre | 10 Jahre | Aufl. |
| Anlagegruppe | 2.30% | 0.98% | 3.46% | 8.00% | -4.07% | -1.55% | 0.16% | 1.47% |
| Benchmark | 2.01% | 1.22% | 3.81% | 8.31% | -4.05% | -1.56% | 0.30% | 1.44% |

Statistische Angaben (annualisiert)

| | 1 Jahr | 3 Jahre | 5 Jahre | 10 Jahre | Aufl. |
|---------------------------------|--------|---------|---------|----------|--------|
| Volatilität Anlagegruppe (in %) | 5.73 | 7.00 | 6.81 | 5.40 | 5.18 |
| Volatilität Benchmark (in %) | 6.50 | 7.83 | 7.56 | 5.83 | 5.37 |
| Tracking Error ex post (in %) | 0.83 | 1.00 | 0.94 | 0.86 | 0.96 |
| Information Ratio | -0.38 | -0.02 | 0.01 | -0.15 | 0.02 |
| Sharpe Ratio | 1.08 | -0.69 | -0.25 | 0.09 | 0.32 |
| Korrelation | 1.00 | 1.00 | 1.00 | 0.99 | 0.98 |
| Beta | 0.88 | 0.89 | 0.90 | 0.92 | 0.95 |
| Jensen-Alpha | 0.51 | -0.54 | -0.16 | -0.08 | 0.11 |
| Maximum Drawdown (in %) | -3.05 | -20.25 | -21.47 | -21.47 | -21.47 |
| Recovery Period (Jahre) | 0.27 | - | - | - | - |

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.

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

Obligationen Global Unternehmen (CHF hedged)

Portfoliostruktur nach Branchen

| | Anlagegruppe | Benchmark |
|------------------------|--------------|-----------|
| Finanzwesen | 46.83% | 38.35% |
| Basiskonsumgüter | 13.75% | 16.36% |
| Energie | 7.44% | 6.00% |
| Versorgungsbetriebe | 6.41% | 8.99% |
| Industrie | 5.32% | 7.20% |
| Nicht-Basiskonsumgüter | 5.09% | 7.61% |
| Kommunikation | 5.08% | 7.90% |
| Technologie | 4.98% | 4.64% |
| Andere | 2.00% | 2.95% |
| Liquidität | 2.54% | - |
| Währungsabsicherung | 0.57% | - |

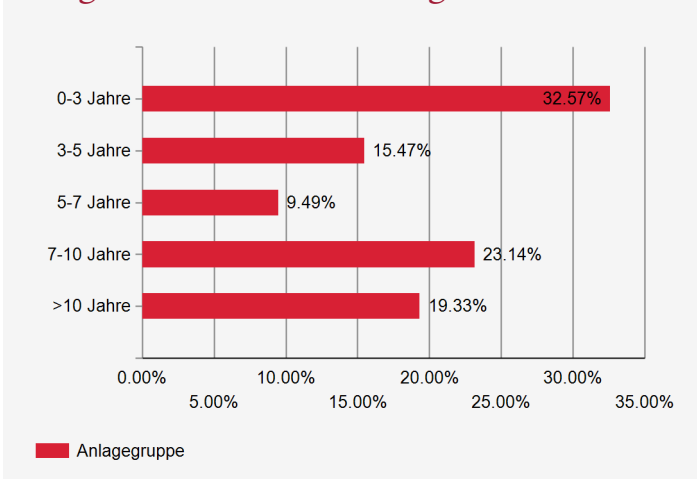
Grösste Schuldner und Rating

| | | Anlagegruppe |
|------------------------------|------|--------------|
| Porsche Automobil Holding SE | BBB | 2.26% |
| Banco Santander SA, Madrid | BBB+ | 2.26% |
| Groupe BPCE | BBB+ | 1.74% |
| Credit Agricole Group | BBB+ | 1.73% |
| Société Générale, Paris | BBB | 1.66% |

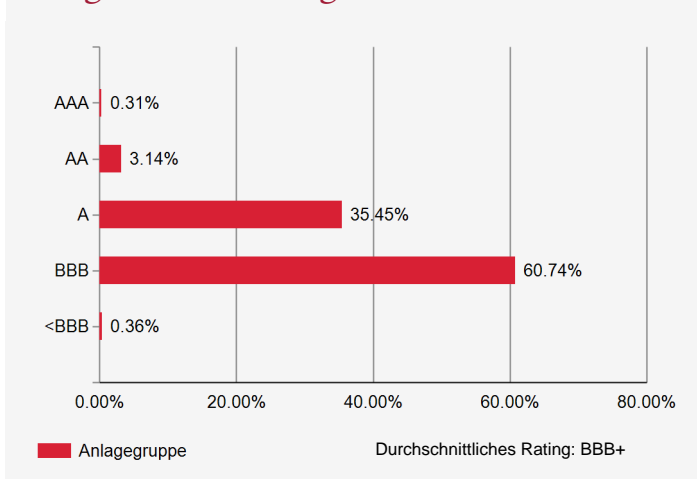
Weitere Angaben zu den Schuldnern

| | |
|----------------------------------|-------|
| Anzahl Schuldner | 231 |
| Anteil Benchmarkfremde Schuldner | 3.11% |

Fälligkeitstruktur der Anlagen



Anlagen nach Rating



Duration und Rendite auf Verfall

| | Anlagegruppe | Benchmark |
|-----------------------------------|--------------|-----------|
| Modified Duration* | 6.1 | 6.1 |
| Theoretische Rendite auf Verfall* | 4.71% | 4.65% |

* Vor Währungsabsicherung, unter Berücksichtigung der Derivate

Portfolio nach Währungen und Duration

| | Anlagegruppe | | Benchmark | |
|--------|--------------|----------|------------|----------|
| | Gewichtung | Duration | Gewichtung | Duration |
| USD | 56.90% | 7.88 | 67.08% | 6.74 |
| EUR | 28.77% | 3.60 | 23.88% | 4.44 |
| CHF | 5.81% | 2.18 | 0.37% | 4.39 |
| JPY | 2.48% | 2.04 | 0.70% | 4.16 |
| Andere | 6.03% | 4.29 | 7.97% | 5.64 |

Portfoliostruktur nach Ländern/Regionen

| | Anlagegruppe | Benchmark |
|-----------------------------|--------------|-----------|
| Vereinigte Staaten | 37.40% | 56.23% |
| Vereinigtes Königreich | 10.24% | 6.85% |
| Frankreich | 9.17% | 6.19% |
| Deutschland | 5.33% | 5.04% |
| Spanien | 4.30% | 2.20% |
| Japan | 4.15% | 3.37% |
| Schweiz | 3.99% | 1.45% |
| Europäische Region (EUR) | 9.45% | 5.87% |
| Asien-Pazifik-Raum | 3.23% | 2.21% |
| Europäische Region (Ex EUR) | 3.20% | 1.61% |
| Andere | 6.43% | 8.98% |
| Liquidität, Absicherung | 3.11% | - |



Anlagestiftung Swiss Life

Obligationen Emerging Markets Short Term (CHF hedged)

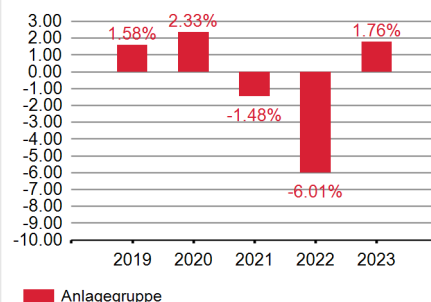
Nettovermögen (NAV) in Mio. CHF: 128.57

Nettovermögen pro Anspruch in CHF: 96.78

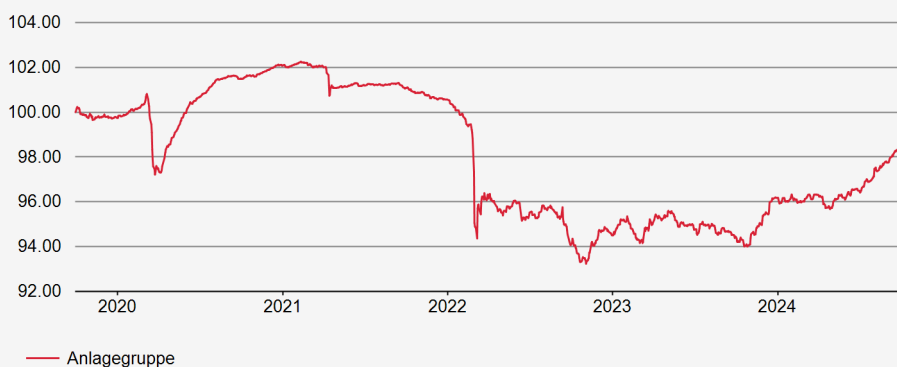
Anlagestrategie

Anlagen in auf US Dollar oder auf andere Hartwährungen lautende Forderungspapiere von Unternehmen und Staaten aus Schwellenländern (Emerging Markets) inklusive Agencies und Supranationals mit einer kurzen Restlaufzeit (mehrheitlich unter 3 Jahren). Aktive Titelselektion, Durationsteuerung und Zinskurvenpositionierung. Schuldnerbegrenzung: 10%. Durchschnittliche Ratingqualität: mindestens BBB-. Fremdwährungsrisiken werden zu mindestens 90% gegen Schweizerfranken abgesichert. Umsetzung mittels Einsatz des Swiss Life Funds (LUX) Bond Emerging Markets Short Term CHF AM Cap; Anlagefonds nach luxemburgischem Recht.

Performance



Wertentwicklung in Referenzwährung (Basis 100)



Die in der Vergangenheit erzielte Wertentwicklung ist kein Indikator für die zukünftige Wertentwicklung.

Produktinformationen

Valorennummer: 38013680

ISIN: CH0380136801

LEI: 254900EGYJLGZXIT6O90

Bloomberg-Code: SLOSTCH SW

Währung: CHF

Domizil: Schweiz

Aufgedatum: 29/09/2017

Erstausgabepreis: 100.00

Jahresabschluss: 30.09

Ausgabe/Rücknahme: Täglich

Annahmeschluss: 13.00 Uhr

Ausgabe- / Rücknahmekommission: Keine

Ausschüttungspraxis: Thesaurierung

Asset Manager gemäss

Swiss Life Best Select Invest Plus®:

Swiss Life Asset Management AG

Überwachung Asset Manager:

PPCmetrics unterstützt die laufende Überwachung des Asset Managers sowie die 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%

Performance in Referenzwährung

| | Kumulierte Performance | | | | Annualisierte Performance | | | |
|--------------|------------------------|---------|----------|--------|---------------------------|---------|----------|--------|
| | YTD | 1 Monat | 3 Monate | 1 Jahr | 3 Jahre | 5 Jahre | 10 Jahre | Aufl. |
| Anlagegruppe | 2.28% | 0.63% | 1.95% | 4.15% | -0.90% | -0.33% | - | -0.47% |

Statistische Angaben (annualisiert)

| | 1 Jahr | 3 Jahre | 5 Jahre | 10 Jahre | Aufl. |
|---------------------------------|--------|---------|---------|----------|-------|
| Volatilität Anlagegruppe (in %) | 1.94 | 2.66 | 2.65 | - | 2.29 |
| Sharpe Ratio | 1.33 | -0.60 | -0.18 | - | -0.14 |
| Maximum Drawdown (in %) | -0.68 | -7.78 | -8.82 | - | -8.82 |
| Recovery Period (Jahre) | 0.07 | - | - | - | - |

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.

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

Obligationen Emerging Markets Short Term (CHF hedged)

Portfoliostruktur nach Branchen

| | Anlagegruppe |
|-------------------------|--------------|
| Finanzwesen | 33.86% |
| Staatlich und staatsnah | 18.51% |
| Energie | 8.84% |
| Kommunikation | 8.25% |
| Basiskonsumgüter | 6.38% |
| Nicht-Basiskonsumgüter | 6.29% |
| Grundstoffe | 5.79% |
| Versorgungsbetriebe | 4.23% |
| Andere | 6.03% |
| Liquidität | 1.75% |
| Währungsabsicherung | 0.08% |

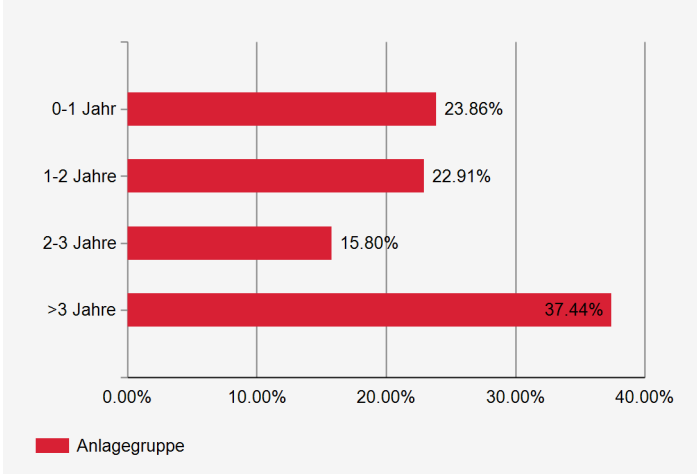
Grösste Schuldner und Rating

| | | Anlagegruppe |
|---------------------------|------|--------------|
| HDFC Bank Ltd | BBB- | 3.07% |
| First Abu Dhabi Bank PJSC | AA- | 3.05% |
| United Mexican States | BBB | 3.05% |
| OTP Bank Nyrt | BBB- | 2.73% |
| Reliance Industries Ltd | BBB | 2.39% |

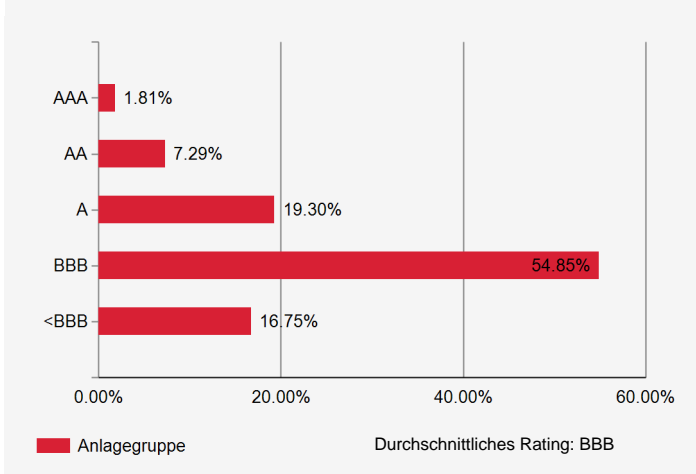
Weitere Angaben zu den Schuldnern

| | |
|------------------|----|
| Anzahl Schuldner | 94 |
|------------------|----|

Fälligkeitstruktur der Anlagen



Anlagen nach Rating



Duration und Rendite auf Verfall

| | Anlagegruppe |
|-----------------------------------|--------------|
| Modified Duration* | 2.1 |
| Theoretische Rendite auf Verfall* | 4.97% |

* Vor Währungsabsicherung, unter Berücksichtigung der Derivate

Portfolio nach Währungen und Duration

| | Anlagegruppe | |
|-----|--------------|----------|
| | Gewichtung | Duration |
| CHF | 99.70% | 0.07 |
| USD | 0.30% | 673.87 |
| EUR | 0.01% | 1040.17 |

Portfoliostruktur nach Ländern/Regionen

| | Anlagegruppe |
|-------------------------------|--------------|
| China | 10.93% |
| Indien | 9.69% |
| Vereinigte Arabische Emirate | 7.75% |
| Mexiko | 6.17% |
| Indonesien | 6.12% |
| Ungarn | 4.65% |
| Katar | 3.60% |
| Schwellenländer Asien Pazifik | 15.60% |
| Schwellenländer Lateinamerika | 13.57% |
| Schwellenländer Europa | 4.12% |
| Andere | 15.99% |
| Liquidität, Absicherung | 1.82% |

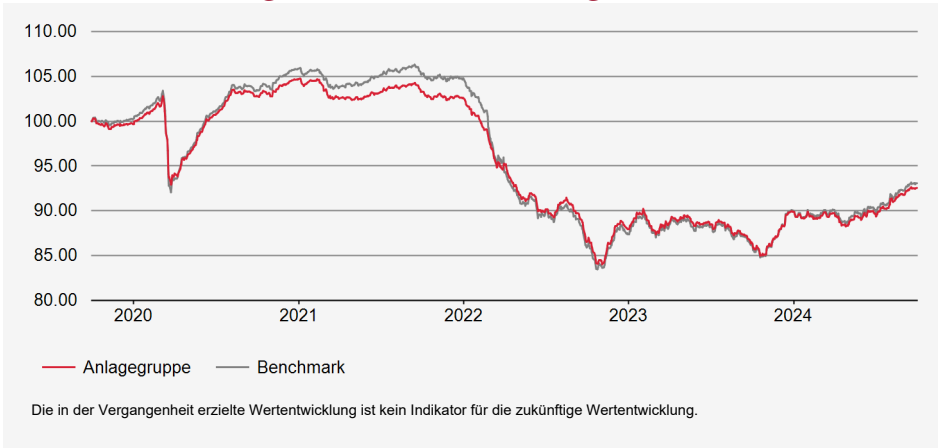
Anlagestiftung Swiss Life Obligationen Emerging Markets Unternehmen (CHF hedged)

Nettovermögen (NAV) in Mio. CHF: 352.54
Nettovermögen pro Anspruch in CHF: 94.60

Anlagestrategie

Anlagen in auf US Dollar oder auf andere Hartwährungen lautende Forderungspapiere von Unternehmen und Staaten, inklusive Agencies und Supranationals aus Schwellenländern (Emerging Markets). Aktive Titelselektion, Durationsteuerung und Zinskurvenpositionierung. Schuldnerbegrenzung: 10%. Forderungspapiere benchmarkfremder Schuldner: max.35%. Durchschnittliche Ratingqualität: mindestens BBB-. Fremdwährungsrisiken werden zu mindestens 90% gegen Schweizerfranken abgesichert. Umsetzung mittels Einsatz des Swiss Life Funds (LUX) Bond Emerging Markets Corporates CHF-hedged AM Cap; Anlagefonds nach luxemburgischem Recht.

Wertentwicklung in Referenzwährung (Basis 100)



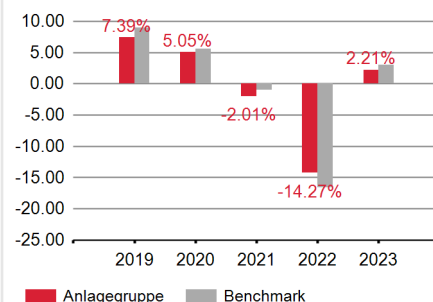
Performance in Referenzwährung

| | Kumulierte Performance | | | | Annualisierte Performance | | | |
|--------------|------------------------|---------|----------|--------|---------------------------|---------|----------|--------|
| | YTD | 1 Monat | 3 Monate | 1 Jahr | 3 Jahre | 5 Jahre | 10 Jahre | Aufl. |
| Anlagegruppe | 2.96% | 0.84% | 3.22% | 7.03% | -3.58% | -1.53% | - | -0.79% |
| Benchmark | 3.38% | 0.89% | 3.30% | 7.89% | -4.00% | -1.42% | - | -0.43% |

Statistische Angaben (annualisiert)

| | 1 Jahr | 3 Jahre | 5 Jahre | 10 Jahre | Aufl. |
|---------------------------------|--------|---------|---------|----------|--------|
| Volatilität Anlagegruppe (in %) | 4.86 | 6.11 | 6.39 | - | 5.59 |
| Volatilität Benchmark (in %) | 4.98 | 6.62 | 7.06 | - | 6.14 |
| Tracking Error ex post (in %) | 0.43 | 1.28 | 1.22 | - | 1.07 |
| Information Ratio | -2.01 | 0.33 | -0.09 | - | -0.34 |
| Sharpe Ratio | 1.09 | -0.71 | -0.27 | - | -0.12 |
| Korrelation | 1.00 | 0.98 | 0.99 | - | 0.99 |
| Beta | 0.97 | 0.91 | 0.89 | - | 0.90 |
| Jensen-Alpha | -0.69 | -0.02 | -0.28 | - | -0.39 |
| Maximum Drawdown (in %) | -1.86 | -18.64 | -19.77 | - | -19.77 |
| Recovery Period (Jahre) | 0.14 | - | - | - | - |

Performance



Produktinformationen

Valorenummer: 36974875

ISIN: CH0369748758

LEI: 254900R4DORKK6JJUG51

Bloomberg-Code: SLOEMCH SW

Benchmark: JP Morgan CEMBI Broad Diversified IG Index (CHF Hedged)

Währung: CHF

Domizil: Schweiz

Auflagedatum: 29/09/2017

Erstausgabepreis: 100.00

Jahresabschluss: 30.09

Ausgabe/Rücknahme: Täglich

Annahmeschluss: 13.00 Uhr

Ausgabe- / Rücknahmekommission: Keine

Ausschüttungspraxis: Thesaurierung

Asset Manager gemäss

Swiss Life Best Select Invest Plus@:
Swiss Life Asset Management AG

Überwachung Asset Manager:

PPCmetrics unterstützt die laufende Überwachung des Asset Managers sowie die Beurteilung der Anlageregebnisse.

Kurspublikationen: Bloomberg: ASSL
www.swisslife.ch/anlagestiftung

Betriebsaufwandquote TER KGAST

ex ante: 0.82%

ex post per: 30/09/2024 0.82%

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.

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

Obligationen Emerging Markets Unternehmen (CHF hedged)

Portfoliostruktur nach Branchen

| | Anlagegruppe | Benchmark |
|---------------------|--------------|-----------|
| Finanzwesen | 31.93% | 36.41% |
| Kommunikation | 12.02% | 9.03% |
| Versorgungsbetriebe | 10.70% | 10.48% |
| Energie | 9.55% | 11.44% |
| Basiskonsumgüter | 8.86% | 4.84% |
| Industrie | 6.65% | 4.08% |
| Technologie | 5.47% | 5.27% |
| Grundstoffe | 4.50% | 11.22% |
| Supranational | 1.66% | - |
| Andere | 8.01% | 7.24% |
| Liquidität | 0.57% | - |
| Währungsabsicherung | 0.07% | - |

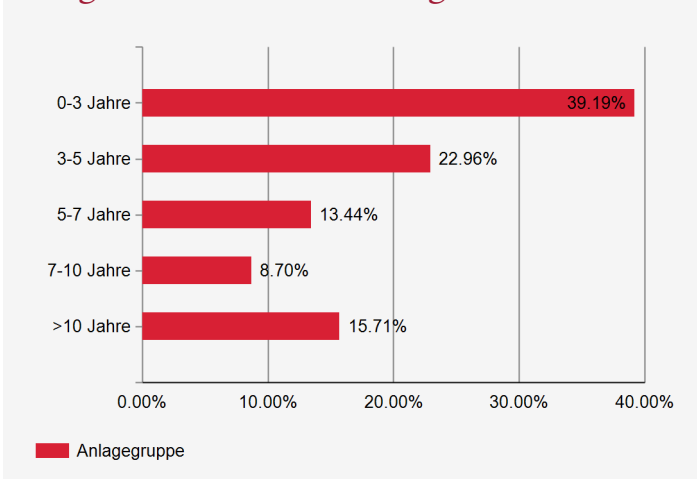
Grösste Schuldner und Rating

| | Rating | Anlagegruppe |
|---|--------|--------------|
| Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd | AA- | 3.53% |
| US Treasury N/B | AAA | 3.31% |
| Prosus NV | BBB | 2.32% |
| OTP Bank Nyrt | BBB- | 1.81% |
| HDFC Bank Ltd | BBB- | 1.77% |

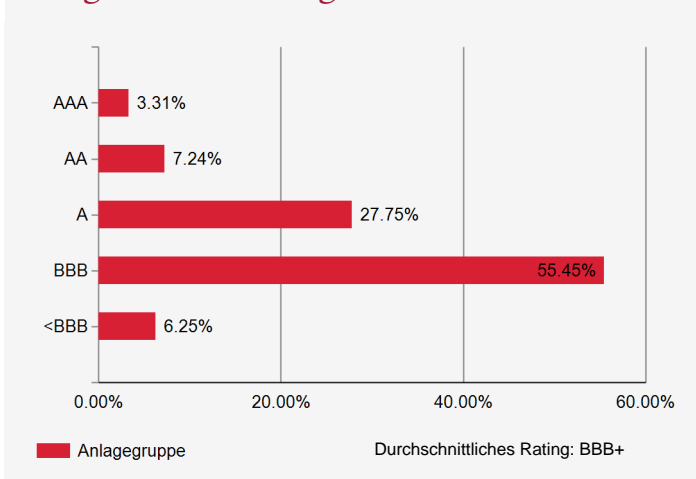
Weitere Angaben zu den Schuldnern

| | |
|----------------------------------|--------|
| Anzahl Schuldner | 149 |
| Anteil Benchmarkfremde Schuldner | 23.05% |

Fälligkeitstruktur der Anlagen



Anlagen nach Rating



Duration und Rendite auf Verfall

| | Anlagegruppe | Benchmark |
|-----------------------------------|--------------|-----------|
| Modified Duration* | 5.2 | 4.8 |
| Theoretische Rendite auf Verfall* | 5.78% | 5.19% |

* Vor Währungsabsicherung, unter Berücksichtigung der Derivate

Portfoliostruktur nach Ländern/Regionen

| | Anlagegruppe | Benchmark |
|------------------------------------|--------------|-----------|
| China | 9.52% | 13.52% |
| Südkorea | 6.91% | 7.63% |
| Vereinigte Arabische Emirate | 6.66% | 5.72% |
| Indien | 5.92% | 4.03% |
| Mexiko | 5.03% | 4.85% |
| Katar | 4.64% | 5.56% |
| Singapur | 4.59% | 3.93% |
| Schwellenländer Asien Pazifik | 18.84% | 19.75% |
| Schwellenländer Lateinamerika | 12.30% | 8.20% |
| Schwellenländer im mittleren Osten | 5.80% | 10.07% |
| Andere | 19.14% | 16.75% |
| Liquidität, Absicherung | 0.64% | - |

Nettovermögen (NAV) in Mio. CHF: 518.72
Nettovermögen pro Anspruch in CHF: 357.11

Anlagestrategie

Anlagen in Beteiligungspapiere von Gesellschaften, die im Swiss Performance Index (SPI) vertreten sind. Large Caps werden passiv abgedeckt, Small & Mid Caps werden aktiv verwaltet (Core-Satellite). Gesellschaftsbegrenzung: 5% (Ausnahme: sofern im Benchmark; max. 5%-Punkte mehr als Benchmarkgewichtung). Umsetzung mittels Einsatz der Swiss Life Index Funds (CH) Equity Switzerland Large Cap und SL iFunds Equity Switzerland Small & Mid Cap (CHF); Anlagenfonds schweizerischen Rechts der Kategorie "Übrige Fonds für traditionelle Anlagen".

Wertentwicklung in Referenzwährung (Basis 100)



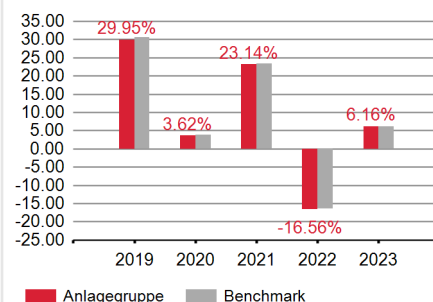
Performance in Referenzwährung

| | Kumulierte Performance | | | | Annualisierte Performance | | | |
|--------------|------------------------|---------|----------|--------|---------------------------|---------|----------|-------|
| | YTD | 1 Monat | 3 Monate | 1 Jahr | 3 Jahre | 5 Jahre | 10 Jahre | Aufl. |
| Anlagegruppe | 11.19% | -1.58% | 1.91% | 12.65% | 2.58% | 5.66% | 6.16% | 5.69% |
| Benchmark | 11.47% | -1.59% | 2.03% | 13.04% | 2.58% | 5.83% | 6.44% | 6.18% |

Statistische Angaben (annualisiert)

| | 1 Jahr | 3 Jahre | 5 Jahre | 10 Jahre | Aufl. |
|---------------------------------|--------|---------|---------|----------|--------|
| Volatilität Anlagegruppe (in %) | 10.94 | 12.45 | 12.74 | 12.14 | 12.84 |
| Volatilität Benchmark (in %) | 11.02 | 12.50 | 12.80 | 12.18 | 13.17 |
| Tracking Error ex post (in %) | 0.27 | 0.35 | 0.34 | 0.31 | 1.17 |
| Information Ratio | -1.44 | -0.02 | -0.49 | -0.91 | -0.49 |
| Sharpe Ratio | 0.95 | 0.15 | 0.42 | 0.52 | 0.41 |
| Korrelation | 1.00 | 1.00 | 1.00 | 1.00 | 1.00 |
| Beta | 0.99 | 1.00 | 0.99 | 1.00 | 0.97 |
| Jensen-Alpha | -0.30 | 0.00 | -0.14 | -0.25 | -0.32 |
| Maximum Drawdown (in %) | -6.52 | -21.88 | -25.88 | -25.88 | -54.46 |
| Recovery Period (Jahre) | 0.06 | - | 0.83 | 0.83 | 4.97 |

Performance



Produktinformationen

Valorennummer: 1245481

ISIN: CH0012454812

LEI: 254900UNZU5YPIKQTQ23

Bloomberg-Code: SWAAKCH SW

Benchmark: SPI® Total Return

Währung: CHF

Domizil: Schweiz

Aufgatedatum: 30/09/2001

Erstausgabepreis: 100.00

Jahresabschluss: 30.09

Ausgabe/Rücknahme: Täglich

Annahmeschluss: 13.00 Uhr

Ausgabe- / Rücknahmekommission: Keine

Ausschüttungspraxis: Thesaurierung

Asset Manager gemäss

Swiss Life Best Select Invest Plus® Large Caps (passiv)

Swiss Life Asset Management AG

Small&Mid Caps (aktiv)

Privatbank Von Graffenried AG

Externe Beratung:

PPCmetrics erbringt folgende Dienstleistungen: Beratung betreffend geeigneter Mandatsstrukturen (Core-Satellite), Unterstützung bei der Selektion geeigneter Asset Manager sowie Unterstützung bei der laufenden Überwachung der Asset Manager und Beurteilung der Anlageresultate.

Kurspublikationen: Bloomberg: ASSL
www.swisslife.ch/anlagestiftung

Betriebsaufwandsquote TER KGAST

ex ante: 0.47%

ex post per: 30/09/2024 0.51%

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.

Betriebsaufwandsquote TER KGAST: Die Betriebsaufwandsquote TER KGAST deckt sämtliche Kosten mit Ausnahme der Transaktionskosten und der transaktionsbezogenen steuerlichen Abgaben ab.

Performance: Gesamtertrag über einen bestimmten Betrachtungszeitraum auf der Basis von zeitgewichteten Renditen.

Statistische Angaben: Die Risikokennzahlen basieren auf logarithmierten, monatlichen zeitgewichteten Renditen.

Portfoliostruktur nach Branchen

| | Anlagegruppe | Benchmark |
|----------------------------|--------------|-----------|
| Gesundheitswesen | 33.76% | 34.11% |
| Finanzen | 17.90% | 19.68% |
| Nichtzyklische Konsumgüter | 16.48% | 16.48% |
| Industrieunternehmen | 14.17% | 13.48% |
| Roh- und Grundstoffe | 8.22% | 8.42% |
| Zyklische Konsumgüter | 4.92% | 5.14% |
| Informationstechnologie | 1.67% | 1.49% |
| Kommunikationsdienste | 0.87% | 0.97% |
| Versorgungsbetriebe | 0.39% | 0.22% |
| Energie | - | - |
| Liquidität | 1.63% | - |

Grösste Positionen

| | Anlagegruppe | Benchmark |
|------------------------------|--------------|-----------|
| NESTLE SA-REG | 13.78% | 13.86% |
| NOVARTIS AG-REG | 12.30% | 12.37% |
| ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN | 11.77% | 11.84% |
| UBS GROUP AG-REG | 5.21% | 5.24% |
| ABB LTD-REG | 4.84% | 4.87% |
| ZURICH INSURANCE GROUP AG | 4.62% | 4.65% |
| CIE FINANCIERE RICHEMO-A REG | 4.45% | 4.48% |
| SIKA AG-REG | 2.78% | 2.80% |
| HOLCIM LTD | 2.77% | 2.79% |
| ALCON INC | 2.61% | 2.62% |

Portfoliostruktur nach Unternehmensgrösse

| | Anlagegruppe | | Benchmark | |
|----------------------|--------------|--------|-----------|--------|
| | Anteil | Anzahl | Anteil | Anzahl |
| Grosse Unternehmen | 80.14% | 20 | 80.20% | 20 |
| Mittlere Unternehmen | 17.50% | 47 | 18.15% | 80 |
| Kleine Unternehmen | 0.74% | 4 | 1.65% | 106 |
| Liquidität | 1.63% | - | - | - |

Anlagestiftung Swiss Life

Aktien Schweiz Large Caps Indexiert

Nettovermögen (NAV) in Mio. CHF: 517.66
Nettovermögen pro Anspruch in CHF: 155.50

Anlagestrategie

Die Anlagegruppe wird mit einem indexierten Ansatz verwaltet und zeichnet sich durch eine breite Diversifikation und einen geringen Tracking Error aus. Das Anlageziel besteht darin, die Benchmark SPI® 20 Total Return nachzubilden. Umsetzung mittels Einsatz des Swiss Life Index Funds (CH) Equity Switzerland Large Cap; Anlagefonds schweizerischen Rechts der Kategorie "Übrige Fonds für traditionelle Anlagen.

Wertentwicklung in Referenzwährung (Basis 100)



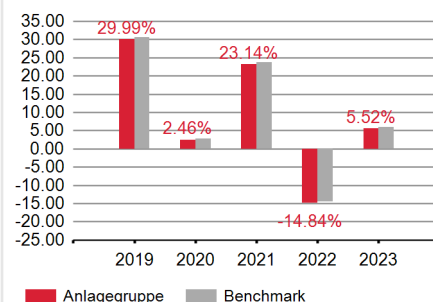
Performance in Referenzwährung

| | Kumulierte Performance | | | | Annualisierte Performance | | | |
|--------------|------------------------|---------|----------|--------|---------------------------|---------|----------|-------|
| | YTD | 1 Monat | 3 Monate | 1 Jahr | 3 Jahre | 5 Jahre | 10 Jahre | Aufl. |
| Anlagegruppe | 11.61% | -2.08% | 1.36% | 12.70% | 3.53% | 5.68% | - | 6.85% |
| Benchmark | 12.02% | -2.12% | 1.42% | 13.22% | 3.95% | 6.10% | - | 7.27% |

Statistische Angaben (annualisiert)

| | 1 Jahr | 3 Jahre | 5 Jahre | 10 Jahre | Aufl. |
|---------------------------------|--------|---------|---------|----------|--------|
| Volatilität Anlagegruppe (in %) | 11.36 | 12.34 | 12.48 | - | 12.32 |
| Volatilität Benchmark (in %) | 11.47 | 12.39 | 12.54 | - | 12.37 |
| Tracking Error ex post (in %) | 0.14 | 0.09 | 0.08 | - | 0.08 |
| Information Ratio | -3.72 | -4.62 | -5.00 | - | -5.21 |
| Sharpe Ratio | 0.92 | 0.22 | 0.43 | - | 0.55 |
| Korrelation | 1.00 | 1.00 | 1.00 | - | 1.00 |
| Beta | 0.99 | 1.00 | 1.00 | - | 1.00 |
| Jensen-Alpha | -0.41 | -0.40 | -0.39 | - | -0.39 |
| Maximum Drawdown (in %) | -6.92 | -19.89 | -25.04 | - | -25.04 |
| Recovery Period (Jahre) | 0.06 | 1.69 | 1.00 | - | 1.00 |

Performance



Produktinformationen

Valorennummer: 39561885

ISIN: CH0395618850

LEI: 254900P0FZIREAGSUQ60

Bloomberg-Code: SLASLCI SW

Benchmark: SPI® 20 Total Return

Währung: CHF

Domizil: Schweiz

Aufledgedatum: 01/02/2018

Erstausgabepreis: 100.00

Jahresabschluss: 30.09

Ausgabe/Rücknahme: Täglich

Annahmeschluss: 13.00 Uhr

Ausgabe- / Rücknahmekommission:
Keine

Ausschüttungspraxis: Thesaurierung

Asset Manager gemäss

Swiss Life Best Select Invest Plus®:
Swiss Life Asset Management AG

Externe Beratung:

PPCmetrics erbringt 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: 0.17%

ex post per: 30/09/2024 0.26%

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.

Performance: Gesamtertrag über einen bestimmten Betrachtungszeitraum auf der Basis von zeitgewichteten Renditen.

Statistische Angaben: Die Risikokennzahlen basieren auf logarithmierten, monatlichen zeitgewichteten Renditen.

Anlagestiftung Swiss Life

Aktien Schweiz Large Caps Indexiert



Portfoliostruktur nach Branchen

| | Anlagegruppe | Benchmark |
|----------------------------|--------------|-----------|
| Gesundheitswesen | 37.73% | 37.74% |
| Finanzen | 18.86% | 18.87% |
| Nichtzyklische Konsumgüter | 17.34% | 17.34% |
| Roh- und Grundstoffe | 9.86% | 9.86% |
| Industrieunternehmen | 8.52% | 8.52% |
| Zyklische Konsumgüter | 5.60% | 5.60% |
| Kommunikationsdienste | 1.09% | 1.09% |
| Informationstechnologie | 0.97% | 0.97% |
| Liquidität / Darlehen | 0.04% | - |

Grösste Positionen

| | Anlagegruppe | Benchmark |
|------------------------------|--------------|-----------|
| NESTLE SA-REG | 17.34% | 17.34% |
| NOVARTIS AG-REG | 15.47% | 15.48% |
| ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN | 14.81% | 14.81% |
| UBS GROUP AG-REG | 6.56% | 6.56% |
| ABB LTD-REG | 6.09% | 6.09% |
| ZURICH INSURANCE GROUP AG | 5.81% | 5.81% |
| CIE FINANCIERE RICHEMO-A REG | 5.60% | 5.60% |
| SIKA AG-REG | 3.50% | 3.50% |
| HOLCIM LTD | 3.48% | 3.49% |
| ALCON INC | 3.28% | 3.28% |

Haftungsausschluss: 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, c/o Swiss Life AG, Postfach, 8022 Zürich, Tel. 043 547 71 11 und unter www.swisslife.ch/anlagestiftung 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 Vorsorge dienen und Personen, die kollektive Anlagen für diese Einrichtungen verwalten, von der Eidgenössischen Finanzmarktaufsicht FINMA 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. Sämtliche Produkt- und Firmennamen sind MarkenTM oder eingetragene[®] Warenzeichen ihrer jeweiligen Inhaber. Ihre Verwendung stellt keine Zugehörigkeit zu ihnen und keine Zustimmung durch sie dar. **Quelle:** Swiss Life Asset Managers. Alle Rechte vorbehalten.

Anlagestiftung Swiss Life

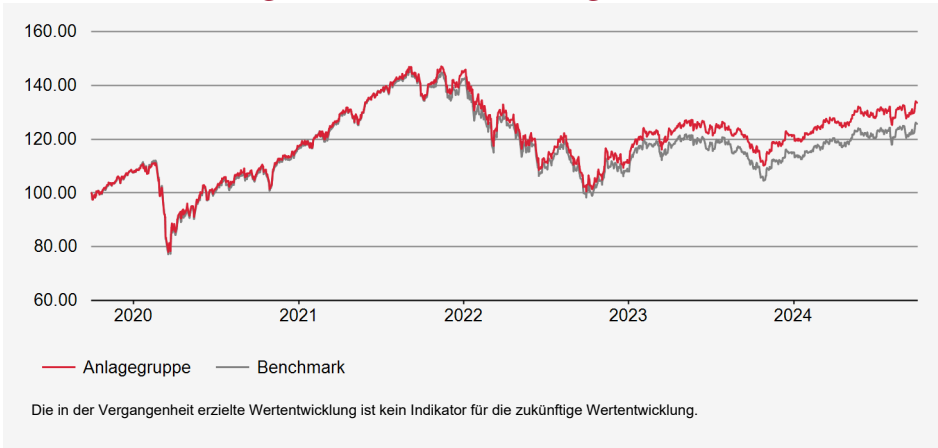
Aktien Schweiz Small & Mid Caps

Nettovermögen (NAV) in Mio. CHF: 137.24
Nettovermögen pro Anspruch in CHF: 131.27

Anlagestrategie

Anlagen in Beteiligungspapiere von Gesellschaften, die im Swiss Performance Index Extra vertreten sind. Aktive Branchen- und Titelselektion. Gesellschaftsbegrenzung: 5% (Ausnahme: sofern im Benchmark; max. 5%-Punkte mehr als Benchmarkgewichtung). Umsetzung mittels Einsatz des Swiss Life iFunds (CH) Equity Switzerland Small & Mid Cap (CHF); Anlagefonds schweizerischen Rechts der Kategorie "Übrige Fonds für traditionelle Anlagen".

Wertentwicklung in Referenzwährung (Basis 100)



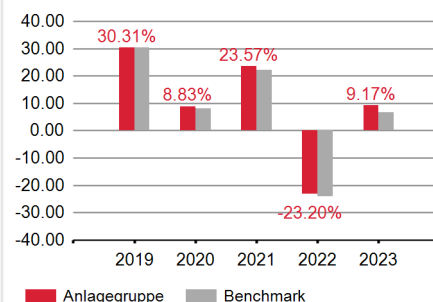
Performance in Referenzwährung

| | Kumulierte Performance | | | | Annualisierte Performance | | | |
|--------------|------------------------|---------|----------|--------|---------------------------|---------|----------|-------|
| | YTD | 1 Monat | 3 Monate | 1 Jahr | 3 Jahre | 5 Jahre | 10 Jahre | Aufl. |
| Anlagegruppe | 9.97% | 0.71% | 4.41% | 13.14% | -0.82% | 5.95% | - | 4.17% |
| Benchmark | 9.26% | 0.58% | 4.53% | 12.27% | -2.75% | 4.67% | - | 3.20% |

Statistische Angaben (annualisiert)

| | 1 Jahr | 3 Jahre | 5 Jahre | 10 Jahre | Aufl. |
|---------------------------------|--------|---------|---------|----------|--------|
| Volatilität Anlagegruppe (in %) | 10.41 | 14.78 | 15.59 | - | 15.37 |
| Volatilität Benchmark (in %) | 10.33 | 14.64 | 15.71 | - | 15.35 |
| Tracking Error ex post (in %) | 1.28 | 1.70 | 1.62 | - | 1.57 |
| Information Ratio | 0.69 | 1.14 | 0.79 | - | 0.62 |
| Sharpe Ratio | 1.04 | -0.10 | 0.36 | - | 0.27 |
| Korrelation | 0.99 | 0.99 | 0.99 | - | 0.99 |
| Beta | 1.00 | 1.00 | 0.99 | - | 1.00 |
| Jensen-Alpha | 0.88 | 1.94 | 1.33 | - | 0.98 |
| Maximum Drawdown (in %) | -6.63 | -31.60 | -31.60 | - | -31.60 |
| Recovery Period (Jahre) | 0.05 | - | - | - | - |

Performance



Produktinformationen

Valorennummer: 39561890
ISIN: CH0395618900
LEI: 254900QGENUS1GIJ4549
Bloomberg-Code: SWLASM SW
Benchmark: SPI EXTRA® Total Return
Währung: CHF
Domizil: Schweiz
Aufledgedatum: 01/02/2018
Erstausgabepreis: 100.00
Jahresabschluss: 30.09
Ausgabe/Rücknahme: Täglich
Annahmeschluss: 13.00 Uhr
Ausgabe- / Rücknahmekommission: Keine
Ausschüttungspraxis: Thesaurierung
Asset Manager gemäss Swiss Life Best Select Invest Plus®: Privatbank Von Graffenried AG

Externe Beratung: PPCmetrics erbringt 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: 0.95%
ex post per: 30/09/2024 0.94%

Portfoliostruktur nach Branchen

| | Anlagegruppe | Benchmark |
|----------------------------|--------------|-----------|
| Industrieunternehmen | 37.46% | 33.25% |
| Gesundheitswesen | 19.12% | 19.67% |
| Finanzen | 14.73% | 22.90% |
| Nichtzyklische Konsumgüter | 13.71% | 13.07% |
| Informationstechnologie | 4.56% | 3.58% |
| Zyklische Konsumgüter | 2.38% | 3.27% |
| Roh- und Grundstoffe | 1.99% | 2.68% |
| Versorger | 1.97% | 1.09% |
| Kommunikationsdienste | - | 0.50% |
| Energie | - | - |
| Liquidität | 4.08% | - |

Grösste Positionen

| | Anlagegruppe | Benchmark |
|-----------------------|--------------|-----------|
| LINDT & SPRÜNGLI | 6.77% | 7.12% |
| STRAUMANN HOLDING AG | 5.43% | 5.07% |
| SGS SA | 5.42% | 4.49% |
| SANDOZ GROUP AG | 4.91% | 4.72% |
| SCHINDLER HOLDING AG | 4.27% | 4.66% |
| VAT GROUP AG | 4.17% | 3.60% |
| JULIUS BAER GROUP LTD | 3.94% | 3.25% |
| BALOISE HOLDING AG | 2.87% | 2.33% |
| BELIMO HOLDING AG | 2.76% | 1.85% |
| SIEGFRIED HOLDING AG | 2.41% | 1.51% |

Portfoliostruktur nach Unternehmensgrösse

| | Anlagegruppe | | Benchmark | |
|----------------------|--------------|--------|-----------|--------|
| | Anteil | Anzahl | Anteil | Anzahl |
| Grosse Unternehmen | 12.18% | 3 | 9.78% | 2 |
| Mittlere Unternehmen | 80.04% | 45 | 82.01% | 78 |
| Kleine Unternehmen | 3.69% | 4 | 8.21% | 106 |
| Liquidität | 4.08% | - | - | - |

Anlagestiftung Swiss Life

Aktien Schweiz Protect Flex

Nettovermögen (NAV) in Mio. CHF: 175.59
Nettovermögen pro Anspruch in CHF: 116.85

Anlagestrategie

SMI-indexierte Anlagestrategie mit aktiv verwalteter Optionsabsicherungsstrategie. Anlageuniversum besteht aus Gesellschaften des SMI; die Gewichtung erfolgt nach der Marktkapitalisierung. Investitionen können in Form von Beteiligungspapieren, kollektiven Anlagen oder derivativen Instrumenten erfolgen. Der ergänzende Einsatz einer Absicherungsstrategie, bestehend aus Optionen, bewirkt bei stark sinkenden Märkten eine Verminderung der Kursverluste und bei stark steigenden Märkten eine Limitierung des Aufwärtspotentials. Je nach Markteinschätzung kann auf den Verkauf der Put-Option und/oder der Call-Option verzichtet werden. Umsetzung mittels Einsatz des SLF (CH) Equity Switzerland Protect Enhanced.

Wertentwicklung in Referenzwährung (Basis 100)



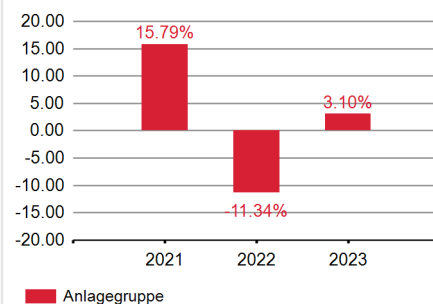
Performance in Referenzwährung

| | Kumulierte Performance | | | | Annualisierte Performance | | | |
|--------------|------------------------|---------|----------|--------|---------------------------|---------|----------|-------|
| | YTD | 1 Monat | 3 Monate | 1 Jahr | 3 Jahre | 5 Jahre | 10 Jahre | Aufl. |
| Anlagegruppe | 9.14% | -1.77% | 0.85% | 10.19% | 2.39% | - | - | 4.20% |

Statistische Angaben (annualisiert)

| | 1 Jahr | 3 Jahre | 5 Jahre | 10 Jahre | Aufl. |
|---------------------------------|--------|---------|---------|----------|--------|
| Volatilität Anlagegruppe (in %) | 8.57 | 8.92 | - | - | 8.97 |
| Sharpe Ratio | 0.96 | 0.19 | - | - | 0.40 |
| Maximum Drawdown (in %) | -4.84 | -15.35 | - | - | -15.35 |
| Recovery Period (Jahre) | 0.06 | 1.79 | - | - | 1.79 |

Performance



Produktinformationen

Valorennummer: 58002332

ISIN: CH0580023320

LEI: 254900ZUTROYHLYQ4E86

Bloomberg-Code: SLASPCF SW

Währung: CHF

Domizil: Schweiz

Aufledgedatum: 18/12/2020

Erstausgabepreis: 100.00

Jahresabschluss: 30.09

Ausgabe/Rücknahme: Täglich

Annahmeschluss: 13.00 Uhr

Ausgabe- / Rücknahmekommission: Keine

Ausschüttungspraxis: Thesaurierung

Asset Manager
Swisslife Asset Management AG

Kurspublikationen: Bloomberg: ASSL
www.swisslife.ch/anlagestiftung

Betriebsaufwandquote TER KGAST

ex ante: 0.45%

ex post per: 30/09/2024 0.45%

Betriebsaufwandquote TER KGAST: Die Betriebsaufwandquote TER KGAST deckt sämtliche Kosten mit Ausnahme der Transaktionskosten und der transaktionsbezogenen steuerlichen Abgaben ab.

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 Branchen

| | Anlagegruppe |
|----------------------------|--------------|
| Gesundheitswesen | 35.66% |
| Finanzen | 17.78% |
| Nichtzyklische Konsumgüter | 14.38% |
| Roh- und Grundstoffe | 9.28% |
| Industrieunternehmen | 8.10% |
| Zyklische Konsumgüter | 5.27% |
| Kommunikationsdienste | 1.03% |
| Informationstechnologie | 0.91% |
| Future auf Aktienindex | 0.07% |
| Liquidität / Darlehen | 7.51% |

Grösste Positionen

| | Anlagegruppe |
|------------------------------|--------------|
| NOVARTIS AG-REG | 14.61% |
| NESTLE SA-REG | 14.38% |
| ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN | 13.94% |
| UBS GROUP AG-REG | 6.18% |
| ABB LTD-REG | 5.81% |
| ZURICH INSURANCE GROUP AG | 5.47% |
| CIE FINANCIERE RICHEMO-A REG | 5.27% |
| SIKA AG-REG | 3.29% |
| HOLCIM LTD | 3.28% |
| ALCON INC | 3.09% |

Anlagestiftung Swiss Life

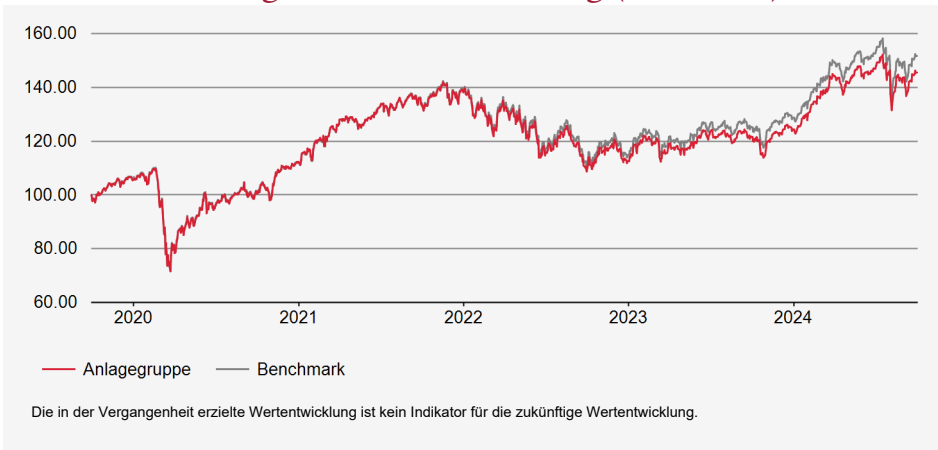
Aktien Ausland ESG

Nettovermögen (NAV) in Mio. CHF: 473.76
Nettovermögen pro Anspruch in CHF: 234.36

Anlagestrategie

Anlagen in Beteiligungspapiere von Gesellschaften mit Domizil im Ausland. Large & Mid Caps werden passiv abgedeckt, Small Caps sowie der Bereich Emerging Markets werden aktiv verwaltet (Core-Satellite). Gesellschaftsbegrenzung: 5% (Ausnahme: sofern Gewicht im Index mehr als 5%; dann max. 10%). Benchmarkfremde Gesellschaften: max. 10%. Umsetzung mittels Swiss Life iFunds (CH) Equity ESG Global ex Switzerland (CHF), Invesco Global Small Cap Equity Fund, Dimensional Global Small Cap Equity Fund, Amundi Emerging Markets Equity Focus Fund und Robeco Emerging Markets Equities Fund.

Wertentwicklung in Referenzwährung (Basis 100)



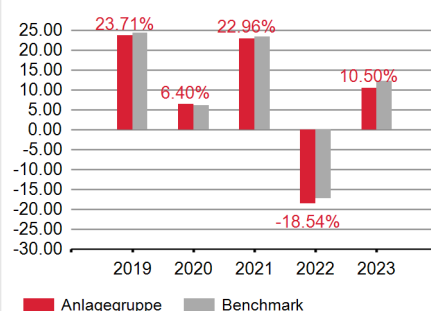
Performance in Referenzwährung

| | Kumulierte Performance | | | | Annualisierte Performance | | | |
|--------------|------------------------|---------|----------|--------|---------------------------|---------|----------|-------|
| | YTD | 1 Monat | 3 Monate | 1 Jahr | 3 Jahre | 5 Jahre | 10 Jahre | Aufl. |
| Anlagegruppe | 17.03% | 1.30% | -0.99% | 19.61% | 3.00% | 7.78% | 7.35% | 3.77% |
| Benchmark | 17.89% | 1.61% | -0.62% | 21.15% | 4.35% | 8.68% | 8.26% | 4.97% |

Statistische Angaben (annualisiert)

| | 1 Jahr | 3 Jahre | 5 Jahre | 10 Jahre | Aufl. |
|---------------------------------|--------|---------|---------|----------|--------|
| Volatilität Anlagegruppe (in %) | 11.34 | 14.16 | 16.33 | 14.81 | 15.45 |
| Volatilität Benchmark (in %) | 11.17 | 14.17 | 16.30 | 14.77 | 15.70 |
| Tracking Error ex post (in %) | 0.48 | 0.41 | 0.46 | 0.61 | 1.38 |
| Information Ratio | -3.22 | -3.30 | -1.94 | -1.50 | -0.87 |
| Sharpe Ratio | 1.45 | 0.16 | 0.45 | 0.50 | 0.22 |
| Korrelation | 1.00 | 1.00 | 1.00 | 1.00 | 1.00 |
| Beta | 1.01 | 1.00 | 1.00 | 1.00 | 0.98 |
| Jensen-Alpha | -1.81 | -1.34 | -0.91 | -0.93 | -1.12 |
| Maximum Drawdown (in %) | -13.61 | -23.39 | -34.66 | -34.66 | -60.40 |
| Recovery Period (Jahre) | - | 1.47 | 0.67 | 0.67 | 7.84 |

Performance



Produktinformationen

Valorennummer: 1245539

ISIN: CH0012455397

LEI: 2549000B6X3SG0K4LZ68

Bloomberg-Code: SWAAKAU SW

Benchmark: 80% MSCI World ex CH ESG Leaders, 15% MSCI AC World Small Cap in CHF, 5% MSCI Emerging Markets in CHF

Währung: CHF

Domizil: Schweiz

Aufledgedatum: 30/09/2001

Erstausgabepreis: 100.00

Jahresabschluss: 30.09

Ausgabe/Rücknahme: Täglich

Annahmeschluss: 13.00 Uhr

Ausgabe- / Rücknahmekommission: Keine

Ausschüttungspraxis: Thesaurierung

Asset Manager gemäss

Swiss Life Best Select Invest Plus®

Large&Mid Caps (passiv)

UBS AG

Small Caps (aktiv)

50% Invesco / 50% Dimensional

Emerging Markets (aktiv)

50% Amundi / 50% Robeco

Externe Beratung:

PPCmetrics erbringt folgende Dienstleistungen: Beratung betreffend geeigneter Mandatsstrukturen (Core-Satellite), Unterstützung bei der Selektion geeigneter Asset Manager sowie Unterstützung bei der laufenden Überwachung der Asset Manager und Beurteilung der Anlagesresultate.

Kurspublikationen: Bloomberg: ASSL
www.swisslife.ch/anlagestiftung

Betriebsaufwandquote TER KGAST

ex ante: 0.73%

ex post per: 30/09/2024 0.74%

Benchmark: Bis 31.03.2022 80% MSCI World ex CH in CHF, 15% MSCI AC World Small Cap in CHF, 5% MSCI Emerging Markets in CHF - Bis 31.12.2009 100% MSCI World, ex CH, in CHF.
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.
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 Branchen

| | Anlagegruppe | Benchmark |
|----------------------------|--------------|-----------|
| Informationstechnologie | 23.59% | 25.11% |
| Finanzen | 15.70% | 15.28% |
| Industrieunternehmen | 13.28% | 11.86% |
| Zyklische Konsumgüter | 11.46% | 11.25% |
| Gesundheitswesen | 10.45% | 10.64% |
| Kommunikationsdienste | 6.79% | 7.38% |
| Nichtzyklische Konsumgüter | 5.68% | 5.99% |
| Roh- und Grundstoffe | 4.53% | 4.50% |
| Immobilien | 3.44% | 3.22% |
| Energie | 2.82% | 2.80% |
| Versorgungsbetriebe | 1.82% | 1.97% |
| Liquidität | 0.40% | - |

Grösste Positionen

| | Anlagegruppe | Benchmark |
|-------------------------|--------------|-----------|
| MICROSOFT CORP | 5.88% | 6.78% |
| NVIDIA CORP | 5.78% | 6.67% |
| ALPHABET INC | 3.52% | 4.06% |
| TESLA INC | 1.45% | 1.68% |
| ELI LILLY & CO | 1.38% | 1.60% |
| VISA INC | 0.84% | 0.97% |
| MASTERCARD INC | 0.80% | 0.91% |
| PROCTER & GAMBLE CO/THE | 0.79% | 0.91% |
| HOME DEPOT INC/THE | 0.78% | 0.90% |
| JOHNSON & JOHNSON | 0.75% | 0.87% |

Portfoliostruktur nach Ländern/Regionen

| | Anlagegruppe | Benchmark |
|---------------------|--------------|-----------|
| USA | 66.65% | 67.84% |
| Japan | 6.30% | 6.73% |
| Grossbritannien | 4.19% | 3.67% |
| Kanada | 2.79% | 3.11% |
| Frankreich | 2.55% | 2.55% |
| Deutschland | 1.16% | 1.00% |
| Übriges Europa | 6.95% | 6.23% |
| Übrige Länder Asien | 6.16% | 6.29% |
| Übrige | 2.84% | 2.56% |
| Liquidität | 0.40% | - |

Portfoliostruktur nach Währungen

| | Anlagegruppe | Benchmark |
|--------|--------------|-----------|
| USD | 67.87% | 68.03% |
| EUR | 7.41% | 6.90% |
| JPY | 6.32% | 6.73% |
| GBP | 4.29% | 3.68% |
| CHF | 0.47% | 0.21% |
| Übrige | 13.63% | 14.43% |

Weitere Angaben zu den Gesellschaften

| | |
|---------------------------------------|-------|
| Anzahl Gesellschaften | 7'778 |
| Anteil Nicht-Benchmark-Gesellschaften | 6.07% |

Anlagestiftung Swiss Life

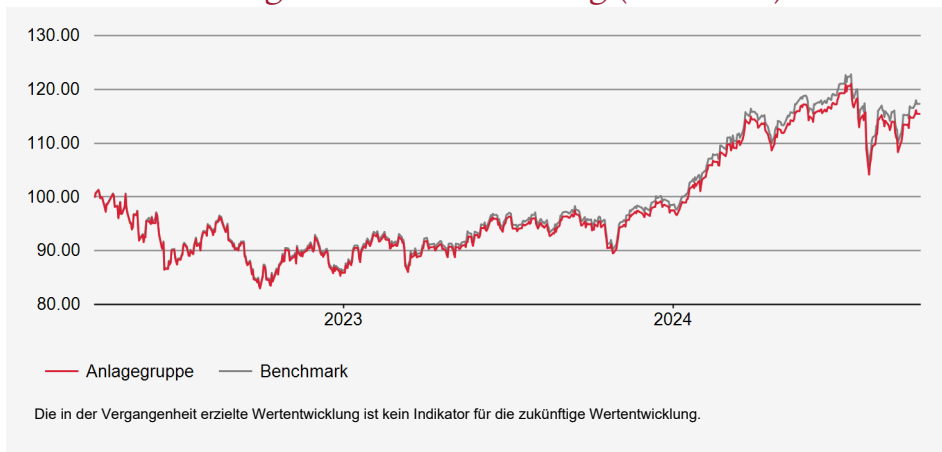
Aktien Ausland ESG Indexiert

Nettovermögen (NAV) in Mio. CHF: 610.15
Nettovermögen pro Anspruch in CHF: 115.44

Anlagestrategie

Anlagen in Beteiligungspapieren von Gesellschaften, die im MSCI World ex Switzerland ESG Leaders, in CHF enthalten sind. Zugelassen sind auch Beteiligungspapieren von Gesellschaften, die aufgrund von Benchmark-Anpassungen noch nicht oder nicht mehr in der Benchmark enthalten sind (max. Abweichung +0.5 Prozentpunkte). Umsetzung mittels Swiss Life iFunds (CH) Equity ESG Global ex Switzerland (CHF).

Wertentwicklung in Referenzwährung (Basis 100)



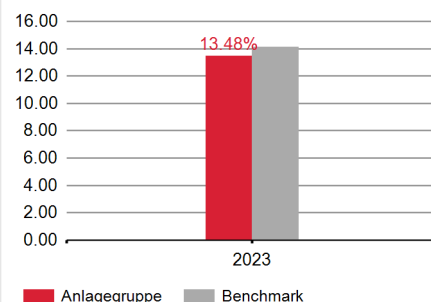
Performance in Referenzwährung

| | Kumulierte Performance | | | | Annualisierte Performance | | | |
|--------------|------------------------|---------|----------|--------|---------------------------|---------|----------|-------|
| | YTD | 1 Monat | 3 Monate | 1 Jahr | 3 Jahre | 5 Jahre | 10 Jahre | Aufl. |
| Anlagegruppe | 18.40% | 1.29% | -1.51% | 21.64% | - | - | - | 5.90% |
| Benchmark | 19.08% | 1.34% | -1.32% | 22.55% | - | - | - | 6.58% |

Statistische Angaben (annualisiert)

| | 1 Jahr | 3 Jahre | 5 Jahre | 10 Jahre | Aufl. |
|---------------------------------|--------|---------|---------|----------|--------|
| Volatilität Anlagegruppe (in %) | 11.39 | - | - | - | 14.83 |
| Volatilität Benchmark (in %) | 11.42 | - | - | - | 14.85 |
| Tracking Error ex post (in %) | 0.07 | - | - | - | 0.14 |
| Information Ratio | -13.29 | - | - | - | -4.70 |
| Sharpe Ratio | 1.59 | - | - | - | 0.31 |
| Korrelation | 1.00 | - | - | - | 1.00 |
| Beta | 1.00 | - | - | - | 1.00 |
| Jensen-Alpha | -0.86 | - | - | - | -0.67 |
| Maximum Drawdown (in %) | -13.92 | - | - | - | -18.04 |
| Recovery Period (Jahre) | - | - | - | - | 1.30 |

Performance



Produktinformationen

Valorennummer: 117189932
ISIN: CH1171899326
LEI: 254900Q154AKVWL8UQ41
Bloomberg-Code: SWAEICI SW
Benchmark: MSCI World ex Switzerland ESG Leaders Net Return
Währung: CHF
Domizil: Schweiz
Auflagedatum: 31/03/2022
Erstausgabepreis: 100.00
Jahresabschluss: 30.09
Ausgabe/Rücknahme: Täglich
Annahmeschluss: 13.00 Uhr
Ausgabe- / Rücknahmekommission: Keine
Ausschüttungspraxis: Thesaurierung
Asset Manager gemäss Swiss Life Best Select Invest Plus@: UBS AG

Externe Beratung: PPCmetrics erbringt 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: 0.52%
ex post per: 30/09/2024 0.52%

Portfoliostruktur nach Branchen

| | Anlagegruppe | Benchmark |
|----------------------------|--------------|-----------|
| Informationstechnologie | 27.69% | 27.88% |
| Finanzen | 14.82% | 14.89% |
| Gesundheitswesen | 11.22% | 11.27% |
| Industrieunternehmen | 10.64% | 10.70% |
| Zyklische Konsumgüter | 10.61% | 10.68% |
| Kommunikationsdienste | 8.01% | 8.05% |
| Nichtzyklische Konsumgüter | 6.19% | 6.24% |
| Roh- und Grundstoffe | 3.73% | 3.73% |
| Energie | 2.45% | 2.46% |
| Immobilien | 2.29% | 2.32% |
| Versorger | 1.74% | 1.78% |
| Liquidität | 0.60% | - |

Grösste Positionen

| | Anlagegruppe | Benchmark |
|-------------------------|--------------|-----------|
| MICROSOFT CORP | 8.42% | 8.48% |
| NVIDIA CORP | 8.28% | 8.34% |
| ALPHABET INC | 5.04% | 5.08% |
| TESLA INC | 2.08% | 2.10% |
| ELI LILLY & CO | 1.98% | 2.00% |
| VISA INC | 1.20% | 1.21% |
| MASTERCARD INC | 1.14% | 1.14% |
| PROCTER & GAMBLE CO/THE | 1.13% | 1.14% |
| HOME DEPOT INC/THE | 1.11% | 1.12% |
| JOHNSON & JOHNSON | 1.08% | 1.09% |

Portfoliostruktur nach Ländern/Regionen

| | Anlagegruppe | Benchmark |
|---------------------|--------------|-----------|
| USA | 73.77% | 74.18% |
| Japan | 6.24% | 6.24% |
| Grossbritannien | 3.61% | 3.66% |
| Kanada | 3.19% | 3.22% |
| Frankreich | 2.92% | 2.98% |
| Deutschland | 1.04% | 1.02% |
| Übriges Europa | 6.20% | 6.25% |
| Übrige Länder Asien | 2.42% | 2.44% |
| Übrige | - | - |
| Liquidität | 0.60% | - |

Portfoliostruktur nach Währungen

| | Anlagegruppe | Benchmark |
|--------|--------------|-----------|
| USD | 74.20% | 74.18% |
| EUR | 7.42% | 7.51% |
| JPY | 6.26% | 6.24% |
| GBP | 3.74% | 3.67% |
| Übrige | 8.38% | 8.39% |

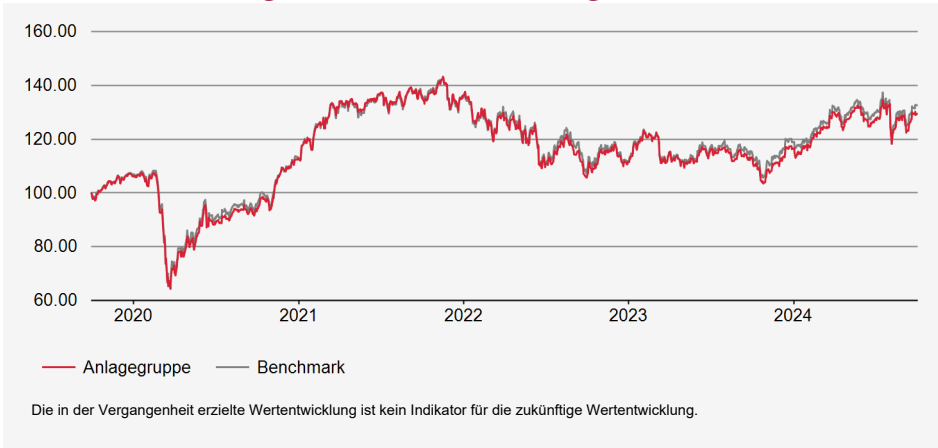
Anlagestiftung Swiss Life Aktien Global Small Caps

Nettovermögen (NAV) in Mio. CHF: 468.19
Nettovermögen pro Anspruch in CHF: 122.80

Anlagestrategie

Anlagen in kleinkapitalisierte Beteiligungspapiere weltweit. Aktive Länder-, Branchen- und Titelselektion. Gesellschaftsbegrenzung: 5%. Umsetzung mittels Invesco Global Small Cap Equity Fund und Dimensional Global Small Cap Equity Fund.

Wertentwicklung in Referenzwährung (Basis 100)



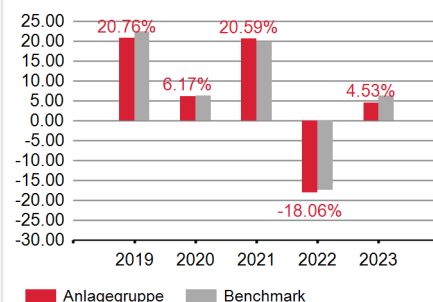
Performance in Referenzwährung

| | Kumulierte Performance | | | | Annualisierte Performance | | | |
|--------------|------------------------|---------|----------|--------|---------------------------|---------|----------|-------|
| | YTD | 1 Monat | 3 Monate | 1 Jahr | 3 Jahre | 5 Jahre | 10 Jahre | Aufl. |
| Anlagegruppe | 11.09% | 0.60% | 1.79% | 14.32% | -1.51% | 5.29% | - | 3.16% |
| Benchmark | 11.54% | 1.54% | 2.13% | 14.91% | -0.79% | 5.80% | - | 4.84% |

Statistische Angaben (annualisiert)

| | 1 Jahr | 3 Jahre | 5 Jahre | 10 Jahre | Aufl. |
|---------------------------------|--------|---------|---------|----------|--------|
| Volatilität Anlagegruppe (in %) | 14.43 | 15.99 | 20.19 | - | 19.31 |
| Volatilität Benchmark (in %) | 13.85 | 15.96 | 19.77 | - | 18.98 |
| Tracking Error ex post (in %) | 1.78 | 1.80 | 1.90 | - | 2.35 |
| Information Ratio | -0.33 | -0.40 | -0.27 | - | -0.71 |
| Sharpe Ratio | 0.82 | -0.14 | 0.25 | - | 0.17 |
| Korrelation | 0.99 | 0.99 | 1.00 | - | 0.99 |
| Beta | 1.03 | 1.00 | 1.02 | - | 1.01 |
| Jensen-Alpha | -1.05 | -0.73 | -0.60 | - | -1.72 |
| Maximum Drawdown (in %) | -12.07 | -27.71 | -40.05 | - | -41.83 |
| Recovery Period (Jahre) | - | - | 0.67 | - | 0.73 |

Performance



Produktinformationen

Valorennummer: 40068789
ISIN: CH0400687890
LEI: 254900XCUD9NTWJQU706
Bloomberg-Code: SWLAGSC SW
Benchmark: MSCI AC World Small Cap, in CHF
Währung: CHF
Domizil: Schweiz
Aufledgedatum: 28/02/2018
Erstausgabepreis: 100.00
Jahresabschluss: 30.09
Ausgabe/Rücknahme: Täglich
Annahmeschluss: 13.00 Uhr
Ausgabe- / Rücknahmekommission: Keine
Ausschüttungspraxis: Thesaurierung
Asset Manager gemäss Swiss Life Best Select Invest Plus@: 50% Invesco / 50% Dimensional

Externe Beratung:
PPCmetrics erbringt folgende Dienstleistungen: Beratung betreffend geeigneter Mandatsstrukturen, Unterstützung bei der Selektion geeigneter Asset Manager sowie Unterstützung bei der laufenden Überwachung der Asset Manager und Beurteilung der Anlageresultate.
Kurspublikationen: Bloomberg: ASSL
www.swisslife.ch/anlagestiftung
Betriebsaufwandquote TER KGAST ex ante: 0.84%
ex post per: 30/09/2024 0.84%

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.

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 Branchen

| | Anlagegruppe | Benchmark |
|----------------------------|--------------|-----------|
| Industrieunternehmen | 22.01% | 19.72% |
| Finanzen | 16.42% | 14.82% |
| Zyklische Konsumgüter | 12.64% | 13.48% |
| Informationstechnologie | 12.11% | 11.22% |
| Gesundheitswesen | 10.03% | 9.64% |
| Roh- und Grundstoffe | 6.80% | 7.91% |
| Immobilien | 6.29% | 8.59% |
| Nichtzyklische Konsumgüter | 4.46% | 4.89% |
| Energie | 3.87% | 3.96% |
| Kommunikationsdienste | 3.22% | 3.13% |
| Versorgungsbetriebe | 1.78% | 2.64% |
| Liquidität | 0.37% | - |

Grösste Positionen

| | Anlagegruppe | Benchmark |
|-----------------------------|--------------|-----------|
| TAYLOR MORRISON | 0.66% | 0.04% |
| CACTUS | 0.63% | 0.02% |
| PLANISWARE | 0.59% | 0.00% |
| WEATHERFORD INTERNAT | 0.56% | 0.03% |
| SPROUTS FARMERS MARKET | 0.54% | 0.06% |
| PIPER SANDLER | 0.49% | 0.03% |
| SIGMAROC | 0.46% | - |
| TMX | 0.44% | - |
| PINNACLE FINANCIAL PARTNERS | 0.44% | 0.04% |
| HELIOS TOWERS | 0.41% | 0.01% |

Portfoliostruktur nach Ländern/Regionen

| | Anlagegruppe | Benchmark |
|---------------------|--------------|-----------|
| USA | 60.31% | 56.65% |
| Japan | 7.69% | 11.61% |
| Grossbritannien | 6.55% | 4.95% |
| Kanada | 2.26% | 3.57% |
| Frankreich | 2.00% | 1.10% |
| Deutschland | 1.72% | 1.24% |
| Übriges Europa | 10.36% | 8.20% |
| Übrige Länder Asien | 5.56% | 8.66% |
| Übrige | 3.17% | 4.03% |
| Liquidität | 0.37% | - |

Portfoliostruktur nach Währungen

| | Anlagegruppe | Benchmark |
|--------|--------------|-----------|
| USD | 62.28% | 56.90% |
| EUR | 8.52% | 5.80% |
| JPY | 7.73% | 11.60% |
| GBP | 6.62% | 4.97% |
| CHF | 1.86% | 1.42% |
| Übrige | 12.99% | 19.31% |

Weitere Angaben zu den Gesellschaften

| | |
|---------------------------------------|--------|
| Anzahl Gesellschaften | 6'835 |
| Anteil Nicht-Benchmark-Gesellschaften | 23.05% |

Anlagestiftung Swiss Life

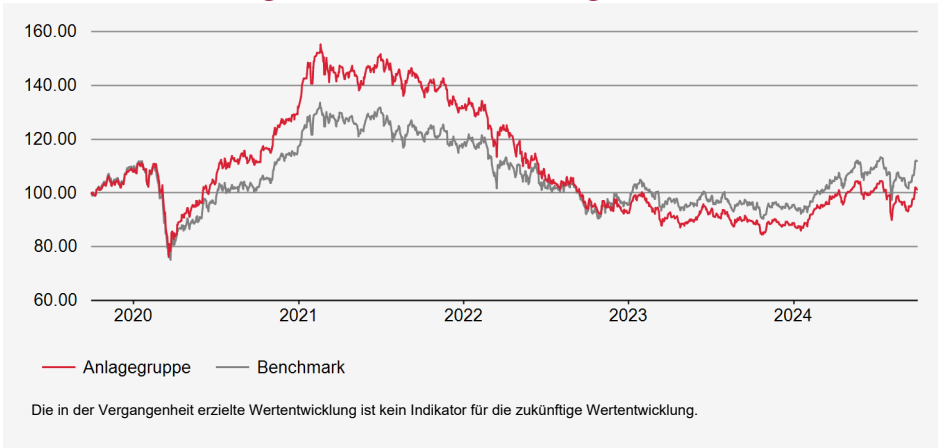
Aktien Emerging Markets ESG

Nettovermögen (NAV) in Mio. CHF: 261.74
Nettovermögen pro Anspruch in CHF: 86.75

Anlagestrategie

Anlagen in Beteiligungspapiere von Gesellschaften mit Domizil in Entwicklungsländern. Aktive Länder-, Branchen- und Titelselektion. Umsetzung mittels Einsatz des Fonds Amundi Emerging Markets Equity Focus und des fonds Robeco Emerging Markets Equities; SICAV nach luxemburgischem Recht gemäss UCITS.

Wertentwicklung in Referenzwährung (Basis 100)



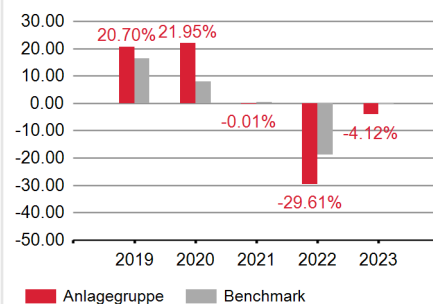
Performance in Referenzwährung

| | Kumulierte Performance | | | | Annualisierte Performance | | | |
|--------------|------------------------|---------|----------|--------|---------------------------|---------|----------|--------|
| | YTD | 1 Monat | 3 Monate | 1 Jahr | 3 Jahre | 5 Jahre | 10 Jahre | Aufl. |
| Anlagegruppe | 14.08% | 4.90% | -0.39% | 13.01% | -10.16% | 0.26% | - | -2.11% |
| Benchmark | 17.13% | 6.06% | 2.06% | 16.23% | -2.91% | 2.27% | - | 0.12% |

Statistische Angaben (annualisiert)

| | 1 Jahr | 3 Jahre | 5 Jahre | 10 Jahre | Aufl. |
|---------------------------------|--------|---------|---------|----------|--------|
| Volatilität Anlagegruppe (in %) | 12.18 | 13.88 | 16.60 | - | 16.59 |
| Volatilität Benchmark (in %) | 12.95 | 14.52 | 16.38 | - | 15.99 |
| Tracking Error ex post (in %) | 2.51 | 4.73 | 5.15 | - | 5.16 |
| Information Ratio | -1.29 | -1.54 | -0.39 | - | -0.43 |
| Sharpe Ratio | 0.88 | -0.82 | 0.01 | - | -0.12 |
| Korrelation | 0.98 | 0.94 | 0.95 | - | 0.95 |
| Beta | 0.92 | 0.90 | 0.96 | - | 0.99 |
| Jensen-Alpha | -2.09 | -7.62 | -1.94 | - | -2.23 |
| Maximum Drawdown (in %) | -13.87 | -40.72 | -45.54 | - | -45.54 |
| Recovery Period (Jahre) | - | - | - | - | - |

Performance



Produktinformationen

Valorennummer: 39561902
ISIN: CH0395619023
LEI: 254900OLXTUB1EYJLV86
Bloomberg-Code: SWLAKEM SW
Benchmark: MSCI Emerging Markets, in CHF
Währung: CHF
Domizil: Schweiz
Auflagedatum: 01/02/2018
Erstausgabepreis: 100.00
Jahresabschluss: 30.09
Ausgabe/Rücknahme: Täglich
Annahmeschluss: 13.00 Uhr
Ausgabe- / Rücknahmekommission: Keine
Ausschüttungspraxis: Thesaurierung
Asset Manager gemäss Swiss Life Best Select Invest Plus@: 50% Amundi / 50% Robeco

Externe Beratung:
 PPCmetrics erbringt folgende Dienstleistungen: Beratung betreffend geeigneter Mandatsstrukturen, Unterstützung bei der Selektion geeigneter Asset Manager sowie Unterstützung bei der laufenden Überwachung der Asset Manager und Beurteilung der Anlageresultate.
Kurspublikationen: Bloomberg: ASSL
www.swisslife.ch/anlagestiftung
Betriebsaufwandquote TER KGAST ex ante: 0.86%
ex post per: 30/09/2024 0.86%

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.

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 Branchen

| | Anlagegruppe | Benchmark |
|----------------------------|--------------|-----------|
| Finanzen | 18.23% | 22.92% |
| Informationstechnologie | 18.00% | 22.50% |
| Zyklische Konsumgüter | 13.17% | 13.79% |
| Kommunikationsdienste | 5.90% | 9.36% |
| Industrieunternehmen | 4.51% | 6.76% |
| Immobilien | 4.13% | 1.58% |
| Nichtzyklische Konsumgüter | 3.66% | 5.20% |
| Roh- und Grundstoffe | 3.28% | 6.63% |
| Versorgungsbetriebe | 2.54% | 2.92% |
| Energie | 2.17% | 4.77% |
| Gesundheitswesen | 1.36% | 3.57% |
| Liquidität | 22.99% | - |

Grösste Positionen

| | Anlagegruppe | Benchmark |
|--|--------------|-----------|
| TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFACTURING CO LT | 7.29% | 9.18% |
| SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD | 3.11% | 2.96% |
| ALIBABA GROUP HOLDING LTD | 2.44% | 2.51% |
| TENCENT HOLDINGS LTD | 2.08% | 2.22% |
| HDFC BANK LTD | 2.05% | 1.07% |
| NASPERS LTD | 1.55% | 0.26% |
| INFOSYS LTD | 1.48% | 0.46% |
| ICICI BANK LTD ADR | 1.32% | - |
| HON HAI PRECISION INDUSTRY CO LTD | 0.97% | 0.45% |
| SK HYNIX INC | 0.88% | 0.44% |

Portfoliostruktur nach Ländern/Regionen

| | Anlagegruppe | Benchmark |
|-----------------------|--------------|-----------|
| China | 18.60% | 27.24% |
| Indien | 14.90% | 19.63% |
| Taiwan | 11.59% | 17.79% |
| Korea | 10.07% | 10.53% |
| Brasilien | 4.51% | 4.85% |
| Südafrika | 2.84% | 3.03% |
| Übrige Länder Asien | 5.85% | 5.26% |
| Übrige Länder EMEA | 6.45% | 8.97% |
| Übrige Länder Amerika | 2.22% | 2.71% |
| Liquidität | 22.99% | - |

Portfoliostruktur nach Währungen

| | Anlagegruppe | Benchmark |
|--------|--------------|-----------|
| HKD | 13.74% | 21.19% |
| TWD | 12.26% | 17.82% |
| INR | 12.20% | 19.63% |
| KRW | 10.11% | 10.53% |
| USD | 6.25% | 3.00% |
| EUR | 1.19% | 0.46% |
| CHF | 0.00% | - |
| Übrige | 44.29% | 27.32% |

Weitere Angaben zu den Gesellschaften

| | |
|---------------------------------------|-------|
| Anzahl Gesellschaften | 265 |
| Anteil Nicht-Benchmark-Gesellschaften | 3.39% |

Anlagestiftung Swiss Life

Aktien Global Protect Flex (CHF hedged)

Nettovermögen (NAV) in Mio. CHF: 787.44
Nettovermögen pro Anspruch in CHF: 154.47

Anlagestrategie

Regelbasierte aktive Anlagestrategie mit ergänzender Absicherungsstrategie. Anlageuniversum besteht aus Gesellschaften der wichtigsten ausländischen Börsenindizes (S&P 500, Euro Stoxx 50, FTSE 100 und Nikkei 225) sowie dem SMI; die Gewichtung erfolgt nach der Marktkapitalisierung. Die Fremdwährungsrisiken werden zu mindestens 90% gegen CHF abgesichert. Investitionen können in Form von Beteiligungspapieren, kollektiven Anlagen oder derivativen Instrumenten erfolgen. Der ergänzende Einsatz einer Absicherungsstrategie, bestehend aus Optionen, bewirkt bei stark sinkenden Märkten eine Verminderung der Kursverluste und bei stark steigenden Märkten eine Limitierung des Aufwärtspotentials („Put Spread Collar“). Je nach Markteinschätzung kann auf den Verkauf der Put-Option und/oder der Call-Option verzichtet werden. Umsetzung mittels Einsatz des SLF (CH) Equity Global Protect (CHF hedged).

Wertentwicklung in Referenzwährung (Basis 100)



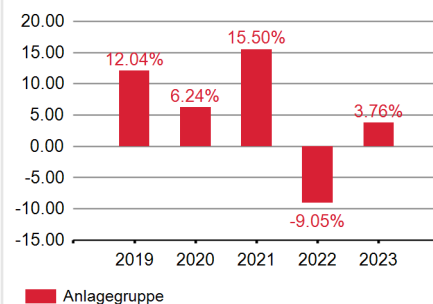
Performance in Referenzwährung

| | Kumulierte Performance | | | | Annualisierte Performance | | | |
|--------------|------------------------|---------|----------|--------|---------------------------|---------|----------|-------|
| | YTD | 1 Monat | 3 Monate | 1 Jahr | 3 Jahre | 5 Jahre | 10 Jahre | Aufl. |
| Anlagegruppe | 12.60% | 0.78% | 2.71% | 17.94% | 3.94% | 6.05% | - | 5.30% |

Statistische Angaben (annualisiert)

| | 1 Jahr | 3 Jahre | 5 Jahre | 10 Jahre | Aufl. |
|---------------------------------|--------|---------|---------|----------|--------|
| Volatilität Anlagegruppe (in %) | 7.68 | 10.30 | 9.88 | - | 8.45 |
| Sharpe Ratio | 1.95 | 0.31 | 0.58 | - | 0.64 |
| Maximum Drawdown (in %) | -6.62 | -14.58 | -15.99 | - | -15.99 |
| Recovery Period (Jahre) | 0.14 | 1.43 | 0.63 | - | 0.63 |

Performance



Produktinformationen

Valorennummer: 31952442
ISIN: CH0319524424
LEI: 254900LUAQC3MC0MWL48
Bloomberg-Code: SLAGPCH SW
Währung: CHF
Domizil: Schweiz
Aufgatedatum: 29/04/2016
Erstausgabepreis: 100.00
Jahresabschluss: 30.09
Ausgabe/Rücknahme: Täglich
Annahmeschluss: 13.00 Uhr
Ausgabe- / Rücknahmekommission: Keine
Ausschüttungspraxis: Thesaurierung
Asset Manager: Swiss Life Asset Management AG
Kurspublikationen: Bloomberg: ASSL
www.swisslife.ch/anlagestiftung
Betriebsaufwandquote TER KGAST ex ante: 0.60%
ex post per: 30/09/2024 0.60%

Betriebsaufwandquote TER KGAST: Die Betriebsaufwandquote TER KGAST deckt sämtliche Kosten mit Ausnahme der Transaktionskosten und der transaktionsbezogenen steuerlichen Abgaben ab.

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

Aktien Global Protect Flex (CHF hedged)

Portfoliostruktur nach Branchen

| | Anlagegruppe |
|----------------------------|--------------|
| Informationstechnologie | 16.09% |
| Finanzen | 15.02% |
| Gesundheitswesen | 12.68% |
| Industrieunternehmen | 12.46% |
| Nichtzyklische Konsumgüter | 7.75% |
| Zyklische Konsumgüter | 7.44% |
| Versorgungsbetriebe | 5.41% |
| Kommunikationsdienste | 5.05% |
| Roh- und Grundstoffe | 3.95% |
| Energie | 2.95% |
| Immobilien | 2.84% |
| Future auf Aktienindex | 0.78% |
| Liquidität / Darlehen | 7.57% |

Grösste Positionen

| | Anlagegruppe |
|-----------------------------|--------------|
| INTL BUSINESS MACHINES CORP | 0.79% |
| T-MOBILE US INC | 0.77% |
| WALMART INC | 0.74% |
| CHUBB LTD | 0.69% |
| CISCO SYSTEMS INC | 0.68% |
| JOHNSON & JOHNSON | 0.68% |
| PEPSICO INC | 0.66% |
| MOTOROLA SOLUTIONS INC | 0.61% |
| ACCENTURE PLC-CL A | 0.61% |
| ELI LILLY & CO | 0.61% |

Portfoliostruktur nach Ländern/Regionen

| | Anlagegruppe |
|-------------------------------|--------------|
| USA und Kanada | 67.57% |
| Europäische Region (EUR) | 10.15% |
| Asien-Pazifik-Raum | 7.88% |
| Europäische Region (Ex EUR) | 5.67% |
| Future auf Aktienindex | 0.78% |
| Schwellenländer Lateinamerika | 0.35% |
| Schwellenländer Europa | 0.03% |
| Liquidität / Darlehen | 7.57% |

Haftungsausschluss: 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, c/o Swiss Life AG, Postfach, 8022 Zürich, Tel. 043 547 71 11 und unter www.swisslife.ch/anlagestiftung 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 Vorsorge dienen und Personen, die kollektive Anlagen für diese Einrichtungen verwalten, von der Eidgenössischen Finanzmarktaufsicht FINMA 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. Sämtliche Produkt- und Firmennamen sind MarkenTM oder eingetragene[®] Warenzeichen ihrer jeweiligen Inhaber. Ihre Verwendung stellt keine Zugehörigkeit zu ihnen und keine Zustimmung durch sie dar. **Quelle:** Swiss Life Asset Managers. Alle Rechte vorbehalten.

Nettovermögen (NAV) in Mio. CHF: 3'906.41
Nettovermögen pro Anspruch in CHF: 208.02

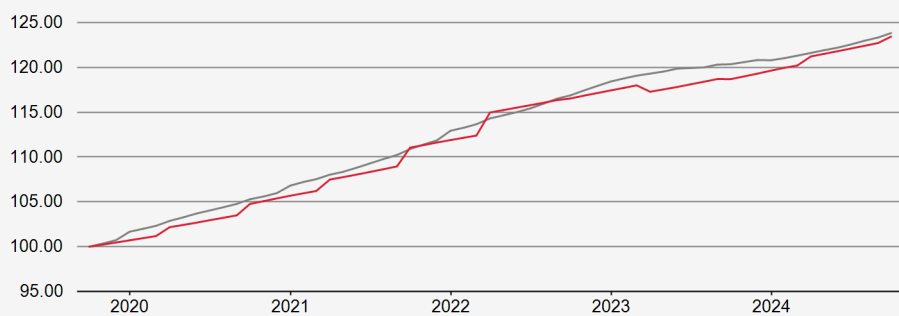


GRESB ist ein industriegetriebenes Unternehmen, das in Bezug auf die Umwelt, das Soziale und die Unternehmensführung die Performance von Immobilienfonds bewertet. GRESB prüft jährlich die Nachhaltigkeitsperformance von Immobilienanlagen in den Portfolios von Swiss Life Asset Managers.

Anlagestrategie

Investitionen erfolgen in direkt gehaltene Liegenschaften. Aktive Bewirtschaftung des Immobilien-Portfolios. Diversifikation hinsichtlich geografischer Lage, Nutzungsart, Grösse und Alter (Wohnen 65-100%, Kommerzielle Nutzung 0-35%, Projektentwicklungen 0-20%).
Ziel-Fremdfinanzierungsgrad: 0-30%.

Wertentwicklung in Referenzwährung (Basis 100)



— Anlagegruppe — Benchmark

Die in der Vergangenheit erzielte Wertentwicklung ist kein Indikator für die zukünftige Wertentwicklung.

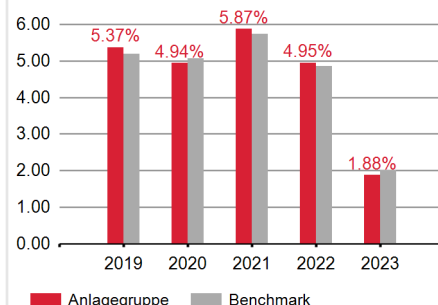
Performance in Referenzwährung

| | Kumulierte Performance | | | | Annualisierte Performance | | | |
|--------------|------------------------|---------|----------|--------|---------------------------|---------|----------|-------|
| | YTD | 1 Monat | 3 Monate | 1 Jahr | 3 Jahre | 5 Jahre | 10 Jahre | Aufl. |
| Anlagegruppe | 3.18% | 0.59% | 1.10% | 4.00% | 3.58% | 4.29% | 5.15% | 5.25% |
| Benchmark | 2.51% | 0.41% | 1.04% | 2.89% | 3.74% | 4.36% | 4.86% | 5.18% |

Statistische Angaben (annualisiert)

| | 1 Jahr | 3 Jahre | 5 Jahre | 10 Jahre | Aufl. |
|---------------------------------|--------|---------|---------|----------|-------|
| Volatilität Anlagegruppe (in %) | 0.66 | 1.35 | 1.42 | 1.68 | 1.57 |
| Volatilität Benchmark (in %) | 0.36 | 0.60 | 0.61 | 0.59 | 0.60 |
| Tracking Error ex post (in %) | 0.66 | 1.30 | 1.34 | 1.57 | 1.51 |
| Information Ratio | 1.67 | -0.12 | -0.05 | 0.19 | 0.05 |
| Sharpe Ratio | 3.70 | 2.10 | 2.87 | 3.17 | 3.39 |
| Korrelation | 0.31 | 0.43 | 0.46 | 0.44 | 0.36 |
| Beta | 0.51 | 0.76 | 0.85 | 1.02 | 0.83 |
| Jensen-Alpha | 1.80 | 0.58 | 0.58 | 0.19 | 0.98 |
| Maximum Drawdown (in %) | 0.00 | -0.85 | -0.85 | -0.85 | -0.85 |
| Recovery Period (Jahre) | - | 0.30 | 0.30 | 0.30 | 0.30 |

Performance



Produktinformationen

Valorennummer: 10615013

ISIN: CH0106150136

LEI: 254900H9DY0IX7641Z92

Bloomberg-Code: SWLIMMS SW

Benchmark: KGAST Immo-Index (CHF)

Währung: CHF

Domizil: Schweiz

Aufgagedatum: 30/11/2009

Erstausgabepreis: 100.00

Jahresabschluss: 30.09

Ausgabe: Zurzeit für Zeichnungen geschlossen

Rücknahme: Gemäss Prospekt

Rücknahmekommission: 3.00%

Ausschüttungspraxis: Thesaurierung

Asset Manager

Swiss Life Asset Management AG

Kurspublikationen: Bloomberg: ASSL
www.swisslife.ch/anlagestiftung

Management Fee: 0.50%

Liegenschaftsverwaltung in % der Nettomietzinseinnahmen max. 4.50%

Transaktionskommission für Akquisitionen und Desinvestitionen in % des Preises max. 2.00%

Bau- & Renovationshonorar in % der Baukosten max. 3.00%

Nebenkosten wie Handänderungskosten, Schätzungen etc. nach dem effektiven Aufwand.

Betriebsaufwandquote TER ISA

Basis GAV per: 30/09/2024 0.71%

Basis NAV per: 30/09/2024 0.89%

Rücknahme: Rücknahme per Ende Quartal mit Kündigungsfrist von sechs Monaten. Pro Anleger und Quartal max. CHF 30 Mio. (Cap).

Rücknahmekommission: Können Ansprüche valutigerecht weiterplatziert werden, entfällt die Rücknahmekommission.

Management Fee: Beinhaltet die Verwaltungskosten für Portfoliomanagement, Administration, Buchführung, NAV-Berechnung, ordentliche Revision, Aufsicht und Berichtswesen.

Betriebsaufwandquote TER ISA: Die Betriebsaufwandquote TER ISA deckt sämtliche Kosten mit Ausnahme der Transaktionskosten und der transaktionsbezogenen steuerlichen Abgaben ab.

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.

Liegenschaftsertrag nach Nutzungsart

| | |
|-----------------------------|--------|
| Wohnen | 70.93% |
| Büro | 6.56% |
| Verkauf | 14.26% |
| Parking | 6.22% |
| Nebennutzungen | 2.03% |
| Davon Projektentwicklungen* | 2.78% |

*in % des Marktwertes

Geografische Verteilung der Liegenschaften*

| | |
|-----------------|--------|
| Zürich | 39.60% |
| Bern | 5.53% |
| Innerschweiz | 4.12% |
| Westschweiz | 5.03% |
| Nordwestschweiz | 17.12% |
| Ostschweiz | 6.32% |
| Südschweiz | 4.11% |
| Genfersee | 18.17% |

*gemäss Monitoring-Regionen von Wüest Partner AG

Kennzahlen zu den Liegenschaften

| | |
|-----------------------|----------|
| Verkehrswert* | 4'872.72 |
| Anzahl Liegenschaften | 293 |
| Vermietungsquote | 98.38% |

*in Mio. CHF

Weitere Kennzahlen

| | |
|-------------------------|--------|
| Fremdfinanzierung* | 846.0 |
| Fremdfinanzierungsquote | 17.36% |
| Liquide Mittel* | 8.6 |

*in Mio. CHF

Altersstruktur der Liegenschaften

| | |
|-----------|--------|
| 2020-2024 | 6.32% |
| 2010-2019 | 11.11% |
| 2000-2009 | 9.36% |
| 1990-1999 | 8.20% |
| 1980-1989 | 9.59% |
| 1970-1979 | 21.42% |
| 1960-1969 | 11.64% |
| vor 1960 | 22.36% |

Nettovermögen (NAV) in Mio. CHF: 544.29
Nettovermögen pro Anspruch in CHF: 137.25

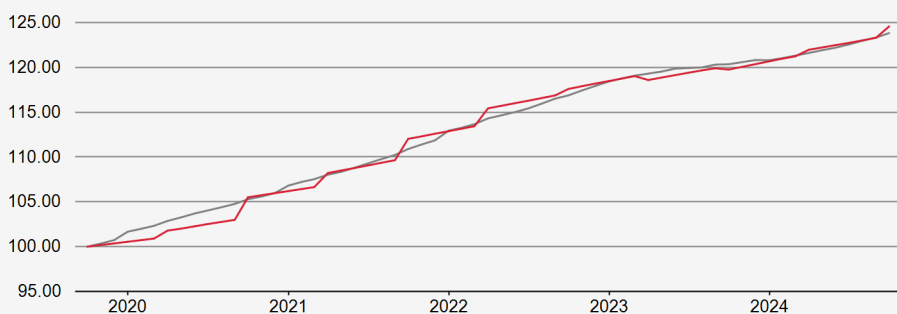


GRESB ist ein industriegetriebenes Unternehmen, das in Bezug auf die Umwelt, das Soziale und die Unternehmensführung die Performance von Immobilienfonds bewertet. GRESB prüft jährlich die Nachhaltigkeitsperformance von Immobilienanlagen in den Portfolios von Swiss Life Asset Managers.

Anlagestrategie

Investitionen erfolgen in direkt gehaltene Immobilien in der Schweiz im Bereich „Alter und Gesundheit“: Wohnen ohne stationäre Pflegeangebote: 20-90%, Pflegeeinrichtungen /Altersheime: 0-50%, Gesundheitsimmobilien (Paramedizin, Reha, Arzthäuser, Spitäler): 0-50%, Weitere Nutzungen: 0-50%, Projektentwicklungen: 0-30%.
 Ziel-Fremdfinanzierungsgrad: 0-30%.

Wertentwicklung in Referenzwährung (Basis 100)



— Anlagegruppe — Benchmark

Die in der Vergangenheit erzielte Wertentwicklung ist kein Indikator für die zukünftige Wertentwicklung.

Performance in Referenzwährung

| | Kumulierte Performance | | | | Annualisierte Performance | | | |
|--------------|------------------------|---------|----------|--------|---------------------------|---------|----------|-------|
| | YTD | 1 Monat | 3 Monate | 1 Jahr | 3 Jahre | 5 Jahre | 10 Jahre | Aufl. |
| Anlagegruppe | 3.24% | 1.04% | 1.51% | 4.03% | 3.60% | 4.48% | - | 4.74% |
| Benchmark | 2.51% | 0.41% | 1.04% | 2.89% | 3.74% | 4.36% | - | 4.54% |

Statistische Angaben (annualisiert)

| | 1 Jahr | 3 Jahre | 5 Jahre | 10 Jahre | Aufl. |
|---------------------------------|--------|---------|---------|----------|-------|
| Volatilität Anlagegruppe (in %) | 0.86 | 1.11 | 1.63 | - | 1.70 |
| Volatilität Benchmark (in %) | 0.36 | 0.60 | 0.61 | - | 0.59 |
| Tracking Error ex post (in %) | 0.76 | 1.06 | 1.54 | - | 1.63 |
| Information Ratio | 1.50 | -0.13 | 0.08 | - | 0.12 |
| Sharpe Ratio | 2.88 | 2.57 | 2.61 | - | 2.80 |
| Korrelation | 0.51 | 0.50 | 0.43 | - | 0.39 |
| Beta | 1.10 | 0.74 | 0.91 | - | 0.90 |
| Jensen-Alpha | 1.00 | 0.65 | 0.53 | - | 0.67 |
| Maximum Drawdown (in %) | 0.00 | -0.60 | -0.60 | - | -0.60 |
| Recovery Period (Jahre) | - | 0.22 | 0.22 | - | 0.22 |

Anlagestrategie: In der Portfolioaufbauphase kann von diesen Zielwerten abgewichen werden.

Rücknahme: Rücknahme per Ende Quartal mit Kündigungsfrist von sechs Monaten. Pro Anleger und Quartal max. CHF 2 Mio. (Cap).

Rücknahmekommission: Können Ansprüche valutigerecht weiterplatziert werden, entfällt die Rücknahmekommission.

Management Fee: Beinhaltet die Verwaltungskosten für Portfoliomanagement, Administration, Buchführung, NAV-Berechnung, ordentliche Revision, Aufsicht und Berichtswesen.

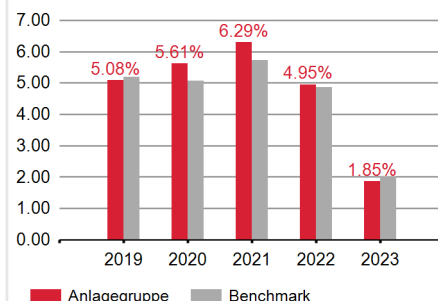
Betriebsaufwandquote TER ISA: Die Betriebsaufwandquote TER ISA deckt sämtliche Kosten mit Ausnahme der Transaktionskosten und der transaktionsbezogenen steuerlichen Abgaben ab.

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.

Performance



Produktinformationen

Valorennummer: 38555648

ISIN: CH0385556482

LEI: 254900NECAZFGP93OC21

Bloomberg-Code: SLISAUG SW

Benchmark: KGAST Immo-Index (CHF)

Währung: CHF

Domizil: Schweiz

Aufgagedatum: 30/11/2017

Erstausgabepreis: 100.00

Jahresabschluss: 30.09

Ausgabe: Zurzeit für Zeichnungen geschlossen

Rücknahme: Gemäss Prospekt

Rücknahmekommission: 3.00%

Ausschüttungspraxis: Thesaurierung

Asset Manager

Swiss Life Asset Management AG

Kurspublikationen: Bloomberg: ASSL
www.swisslife.ch/anlagestiftung

Management Fee: 0.60%

Liegenschaftsverwaltung in % der Nettomietzinseinnahmen max. 4.50%

Transaktionskommission für Akquisitionen und Desinvestitionen in % des Preises max. 2.00%

Bau- & Renovationshonorar in % der Baukosten max. 3.00%

Nebenkosten wie Handänderungskosten, Schätzungen etc. nach dem effektiven Aufwand.

Betriebsaufwandquote TER ISA

Basis GAV per: 30/09/2024 0.74%

Basis NAV per: 30/09/2024 0.85%

Liegenschaftsertrag nach Nutzungsart

| | |
|-------------------------------------|--------|
| Wohnen ohne stationäres Angebot | 76.32% |
| Pflegeeinrichtungen und Altersheime | 12.95% |
| Gesundheitsimmobilien | - |
| Services und Verkauf | 5.40% |
| Nebennutzungen und Parking | 5.34% |
| Davon Projektentwicklungen* | 1.86% |

*in % des Marktwertes

Geografische Verteilung der Liegenschaften*

| | |
|-----------------|--------|
| Zürich | 62.88% |
| Bern | 11.01% |
| Innerschweiz | - |
| Westschweiz | - |
| Nordwestschweiz | 16.89% |
| Ostschweiz | 2.30% |
| Südschweiz | 6.92% |
| Genfersee | - |

*gemäss Monitoring-Regionen von Wüest Partner AG

Kennzahlen zu den Liegenschaften

| | |
|-----------------------|--------|
| Verkehrswert* | 622.33 |
| Anzahl Liegenschaften | 16 |
| Vermietungsquote | 98.51% |

*in Mio. CHF

Weitere Kennzahlen

| | |
|-------------------------|--------|
| Fremdfinanzierung* | 63.3 |
| Fremdfinanzierungsquote | 10.17% |
| Liquide Mittel* | 0.1 |

*in Mio. CHF

Altersstruktur der Liegenschaften

| | |
|-----------|--------|
| 2020-2024 | 59.06% |
| 2010-2019 | 19.49% |
| 2000-2009 | 17.20% |
| 1990-1999 | 1.46% |
| 1980-1989 | - |
| 1970-1979 | - |
| 1960-1969 | - |
| vor 1960 | 2.80% |

Nettovermögen (NAV) in Mio. CHF: 1'889.05
Nettovermögen pro Anspruch in CHF: 182.64

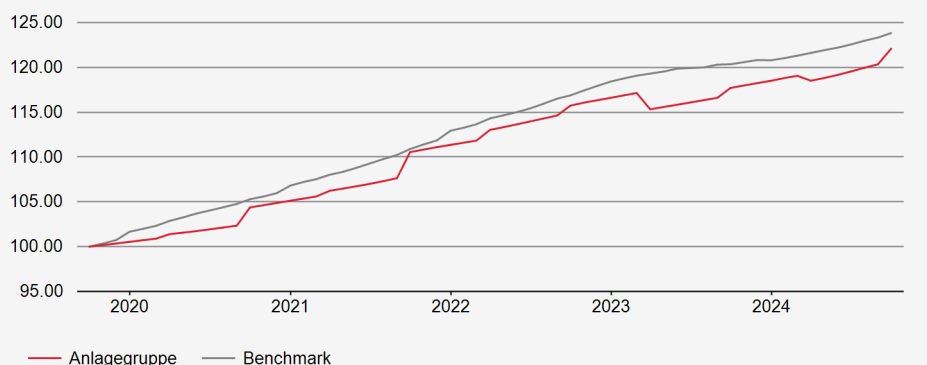


GRESB ist ein industriegetriebenes Unternehmen, das in Bezug auf die Umwelt, das Soziale und die Unternehmensführung die Performance von Immobilienfonds bewertet. GRESB prüft jährlich die Nachhaltigkeitsperformance von Immobilienanlagen in den Portfolios von Swiss Life Asset Managers.

Anlagestrategie

Investitionen erfolgen in direkt gehaltene Liegenschaften. Aktive Bewirtschaftung des Immobilien-Portfolios. Diversifikation hinsichtlich geografischer Lage, Nutzungsart, Grösse und Alter (Kommerzielle Nutzung 60-90%, Wohnen 10-40%, Projektentwicklungen 0-20%). Ziel-Fremdfinanzierungsgrad: 0-30%.

Wertentwicklung in Referenzwährung (Basis 100)



Die in der Vergangenheit erzielte Wertentwicklung ist kein Indikator für die zukünftige Wertentwicklung.

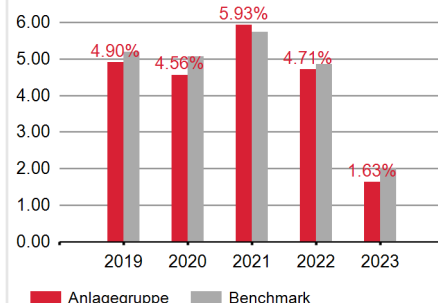
Performance in Referenzwährung

| | Kumulierte Performance | | | | Annualisierte Performance | | | |
|--------------|------------------------|---------|----------|--------|---------------------------|---------|----------|-------|
| | YTD | 1 Monat | 3 Monate | 1 Jahr | 3 Jahre | 5 Jahre | 10 Jahre | Aufl. |
| Anlagegruppe | 3.03% | 1.45% | 2.14% | 3.73% | 3.36% | 4.06% | 4.65% | 4.77% |
| Benchmark | 2.51% | 0.41% | 1.04% | 2.89% | 3.74% | 4.36% | 4.86% | 5.13% |

Statistische Angaben (annualisiert)

| | 1 Jahr | 3 Jahre | 5 Jahre | 10 Jahre | Aufl. |
|---------------------------------|--------|---------|---------|----------|-------|
| Volatilität Anlagegruppe (in %) | 1.44 | 1.53 | 1.78 | 1.65 | 1.56 |
| Volatilität Benchmark (in %) | 0.36 | 0.60 | 0.61 | 0.59 | 0.63 |
| Tracking Error ex post (in %) | 1.32 | 1.56 | 1.74 | 1.58 | 1.53 |
| Information Ratio | 0.63 | -0.25 | -0.17 | -0.13 | -0.24 |
| Sharpe Ratio | 1.50 | 1.70 | 2.16 | 2.95 | 3.14 |
| Korrelation | 0.52 | 0.30 | 0.35 | 0.37 | 0.33 |
| Beta | 1.91 | 0.59 | 0.79 | 0.84 | 0.72 |
| Jensen-Alpha | -0.45 | 0.86 | 0.61 | 0.61 | 1.14 |
| Maximum Drawdown (in %) | -0.67 | -1.78 | -1.78 | -1.78 | -1.78 |
| Recovery Period (Jahre) | 0.21 | 0.50 | 0.50 | 0.50 | 0.50 |

Performance



Produktinformationen

Valorennummer: 13683758
ISIN: CH0136837587
LEI: 254900ZBV80MWE4EZ391
Bloomberg-Code: SWLGSCH SW
Benchmark: KGAST Immo-Index (CHF)
Währung: CHF
Domizil: Schweiz
Aufgagedatum: 31/10/2011
Erstausgabepreis: 100.00
Jahresabschluss: 30.09
Ausgabe: Zurzeit für Zeichnungen geschlossen
Rücknahme: Gemäss Prospekt
Rücknahmekommission: 3.00%
Ausschüttungspraxis: Thesaurierung
Asset Manager
 Swiss Life Asset Management AG
Kurspublikationen: Bloomberg: ASSL
www.swisslife.ch/anlagestiftung
Management Fee: 0.50%

Liegenschaftsverwaltung in % der Nettomietzinseinnahmen max. 4.50%
Transaktionskommission für Akquisitionen und Desinvestitionen in % des Preises max. 2.00%
Bau- & Renovationshonorar in % der Baukosten max. 3.00%
 Nebenkosten wie Handänderungskosten, Schätzungen etc. nach dem effektiven Aufwand.
Betriebsaufwandquote TER ISA
Basis GAV per: 30/09/2024 0.70%
Basis NAV per: 30/09/2024 0.95%

Rücknahme: Rücknahme per Ende Quartal mit Kündigungsfrist von sechs Monaten. Pro Anleger und Quartal max. CHF 20 Mio. (Cap).

Rücknahmekommission: Können Ansprüche valutigerecht weiterplatziert werden, entfällt die Rücknahmekommission.

Management Fee: Beinhaltet die Verwaltungskosten für Portfoliomanagement, Administration, Buchführung, NAV-Berechnung, ordentliche Revision, Aufsicht und Berichtswesen.

Betriebsaufwandquote TER ISA: Die Betriebsaufwandquote TER ISA deckt sämtliche Kosten mit Ausnahme der Transaktionskosten und der transaktionsbezogenen steuerlichen Abgaben ab.

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.

Liegenschaftsertrag nach Nutzungsart

| | |
|----------------|--------|
| Wohnen | 13.10% |
| Büro | 40.74% |
| Verkauf | 36.45% |
| Parking | 4.52% |
| Nebennutzungen | 5.20% |

Davon Projektentwicklungen* -

*in % des Marktwertes

Geografische Verteilung der Liegenschaften*

| | |
|-----------------|--------|
| Zürich | 42.38% |
| Bern | 5.37% |
| Innerschweiz | 11.24% |
| Westschweiz | 2.81% |
| Nordwestschweiz | 8.02% |
| Ostschweiz | 6.41% |
| Südschweiz | 1.64% |
| Genfersee | 22.13% |

*gemäss Monitoring-Regionen von Wüest Partner AG

Kennzahlen zu den Liegenschaften

| | |
|-----------------------|----------|
| Verkehrswert* | 2'524.29 |
| Anzahl Liegenschaften | 108 |
| Vermietungsquote | 96.22% |

*in Mio. CHF

Weitere Kennzahlen

| | |
|-------------------------|--------|
| Fremdfinanzierung* | 598.2 |
| Fremdfinanzierungsquote | 23.70% |
| Liquide Mittel* | 12.6 |

*in Mio. CHF

Altersstruktur der Liegenschaften

| | |
|-----------|--------|
| 2020-2024 | 4.03% |
| 2010-2019 | 2.73% |
| 2000-2009 | 1.43% |
| 1990-1999 | 14.07% |
| 1980-1989 | 16.62% |
| 1970-1979 | 25.28% |
| 1960-1969 | 9.58% |
| vor 1960 | 26.26% |

Anlagestiftung Swiss Life

Immobilienfonds Schweiz Indexiert

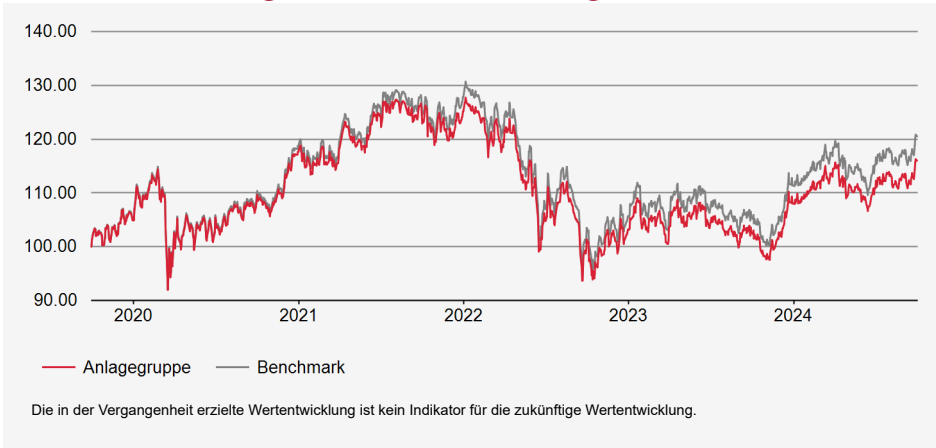


Nettovermögen (NAV) in Mio. CHF: 416.61
Nettovermögen pro Anspruch in CHF: 169.45

Anlagestrategie

Die Anlagegruppe investiert in Immobilien-Anlagefonds, die schweizerischen Rechts sind, auf CHF lauten und ausschliesslich in schweizerische Liegenschaften anlegen. Die Anlagegruppe wird mit einem indexierten Ansatz verwaltet. Das Anlageziel besteht darin, die Benchmark SXI Real Estate® Funds Broad Total Return nachzubilden. Umsetzung mittels Einsatz des Swiss Life Index Funds III (CH) Real Estate Switzerland.

Wertentwicklung in Referenzwährung (Basis 100)



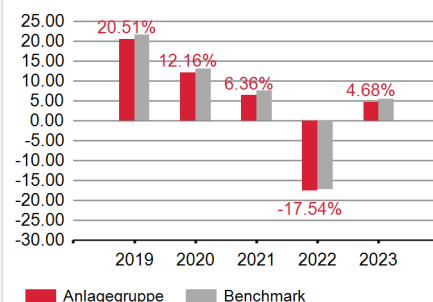
Performance in Referenzwährung

| | Kumulierte Performance | | | | Annualisierte Performance | | | |
|--------------|------------------------|---------|----------|--------|---------------------------|---------|----------|-------|
| | YTD | 1 Monat | 3 Monate | 1 Jahr | 3 Jahre | 5 Jahre | 10 Jahre | Aufl. |
| Anlagegruppe | 7.36% | 2.59% | 4.59% | 13.07% | -2.32% | 3.00% | 4.33% | 3.95% |
| Benchmark | 8.24% | 2.62% | 4.67% | 14.33% | -1.46% | 3.80% | 5.25% | 4.80% |

Statistische Angaben (annualisiert)

| | 1 Jahr | 3 Jahre | 5 Jahre | 10 Jahre | Aufl. |
|---------------------------------|--------|---------|---------|----------|--------|
| Volatilität Anlagegruppe (in %) | 10.53 | 10.06 | 9.95 | 9.00 | 8.31 |
| Volatilität Benchmark (in %) | 10.95 | 10.42 | 10.24 | 9.28 | 8.58 |
| Tracking Error ex post (in %) | 0.60 | 0.53 | 0.44 | 0.48 | 0.49 |
| Information Ratio | -2.09 | -1.62 | -1.81 | -1.94 | -1.71 |
| Sharpe Ratio | 1.03 | -0.30 | 0.28 | 0.50 | 0.49 |
| Korrelation | 1.00 | 1.00 | 1.00 | 1.00 | 1.00 |
| Beta | 0.96 | 0.96 | 0.97 | 0.97 | 0.97 |
| Jensen-Alpha | -0.77 | -0.94 | -0.69 | -0.75 | -0.68 |
| Maximum Drawdown (in %) | -7.79 | -26.64 | -26.64 | -26.64 | -26.64 |
| Recovery Period (Jahre) | 0.29 | - | - | - | - |

Performance



Produktinformationen

Valorennummer: 12468379
ISIN: CH0124683795
LEI: 254900VB5XEQLYLQJ518
Bloomberg-Code: SWLIMSC SW
Benchmark: SXI Real Estate® Funds Broad Total Return
Währung: CHF
Domizil: Schweiz
Aufdatedatum: 28/02/2011
Erstausgabepreis: 100.00
Jahresabschluss: 30.09
Ausgabe/Rücknahme: Täglich
Annahmeschluss: 13.00 Uhr
Ausgabe- / Rücknahmekommission: Keine
Ausschüttungspraxis: Thesaurierung
Asset Manager
 Swiss Life Asset Management AG
Kurspublikationen: Bloomberg: ASSL
www.swisslife.ch/anlagestiftung
Betriebsaufwandquote TER KGAST
ex ante: 1.00%
ex post per: 30/09/2024 1.12%

Betriebsaufwandquote TER KGAST: Die Betriebsaufwandquote TER KGAST deckt sämtliche Kosten mit Ausnahme der Transaktionskosten und der transaktionsbezogenen steuerlichen Abgaben ab.

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

Immobilienfonds Schweiz Indexiert



Grösste Positionen

| | |
|------------------------------|--------|
| UBS PRPRTY FD SW MIXD SIMA | 16.48% |
| CREDIT SUISSE REAL EST SIAT | 6.00% |
| UBS PRPRTY FD SW RESIDTL ANF | 4.98% |
| CS REAL ESTATE LIVINGPLUS | 4.86% |
| SWISS L REF CH ESG SWISS PRO | 3.93% |
| ED DE ROTHSCHILD REAL ESTATE | 3.80% |
| CS REAL ESTATE FD GREEN PROP | 3.68% |
| LA FONCIERE | 3.19% |
| IMMOFONDS | 3.18% |
| UBS PRPRTY FD LEMAN RESD FON | 3.00% |

Anlagestiftung Swiss Life

Immobilien Europa Industrie und Logistik ESG (CHF)



Nettovermögen (NAV) in Mio. CHF: 16.44
Nettovermögen pro Anspruch in CHF: 96.77

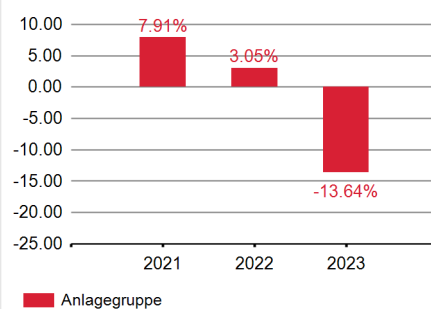
Anlagestrategie

Investitionen in Industrie- und Logistikobjekte. Vorgesehene Allokation in beide Nutzungsarten je 40-60%. Länderallokation mit Schwerpunkt in Deutschland und Frankreich sowie einer Beimischung im übrigen Europa, insbesondere im Vereinigten Königreich, Benelux und der Schweiz. Ziel-Fremdfinanzierungsgrad: 30%. Fremdwährungsrisiken werden zu mindestens 80% gegen Schweizerfranken abgesichert. Aktives Management des Immobilien-Portfolios im Zielfonds. Umsetzung mittels Einsatz des Swiss Life Real Estate Funds (LUX) S.A., SICAV-SIF – ESG European Industrial & Logistics; SICAV nach luxemburgischem Recht.

Wertentwicklung in Referenzwährung (Basis 100)



Performance



Produktinformationen

Valorennummer: 56847985
ISIN: CH0568479858
LEI: 254900AOBOVBYIND4J79
Bloomberg-Code: SLIEILC SW
Währung: CHF
Domizil: Schweiz
Aufledgedatum: 11/12/2020
Erstausgabepreis: 100.00
Jahresabschluss: 30.09
Rücknahmekommission: 1.00%
Ausgabe: Quartalsweise, 5 Bankwerktage vor Quartalsende (Ultimo -5)
Rücknahme: 31.03. / 30.09. mit siebenmonatiger Kündigungsfrist

Ausschüttungspraxis: Thesaurierend
Asset Manager

Swiss Life Asset Management AG
Kurspublikationen: Bloomberg: ASSL
www.swisslife.ch/anlagestiftung

Betriebsaufwandquote TER KGAST
ex ante: 1.54%
ex post per: 30/09/2024 1.54%

Performance in Referenzwährung

| | Kumulierte Performance | | | | Annualisierte Performance | | | |
|--------------|------------------------|---------|----------|--------|---------------------------|---------|----------|--------|
| | YTD | 1 Monat | 3 Monate | 1 Jahr | 3 Jahre | 5 Jahre | 10 Jahre | Aufl. |
| Anlagegruppe | 0.73% | -0.85% | -1.25% | 0.59% | -3.54% | - | - | -0.86% |

Statistische Angaben (annualisiert)

| | 1 Jahr | 3 Jahre | 5 Jahre | 10 Jahre | Aufl. |
|---------------------------------|--------|---------|---------|----------|--------|
| Volatilität Anlagegruppe (in %) | 7.25 | 7.24 | - | - | 7.46 |
| Sharpe Ratio | -0.12 | -0.59 | - | - | -0.17 |
| Maximum Drawdown (in %) | -4.73 | -13.64 | - | - | -13.64 |
| Recovery Period (Jahre) | - | - | - | - | - |

Rücknahmekommission: Rücknahmekommission in Abhängigkeit der Haltedauer (während der Investitionsphase bis 5%), 24 Monate nach vollständig erfolgtem Abruf der Kapitalzusage (max. 3 Jahre) beträgt die Rücknahmekommission 1.00%. Falls Ansprüche valutigerecht weiterplatziert werden, entfällt die Rücknahmekommission.

Betriebsaufwandquote TER KGAST: Indikativer Wert zwischen 1.00% und 1.40%.

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.

Liegenschaftsertrag nach Nutzungsart

| | |
|-----------|--------|
| Logistik | 52.32% |
| Industrie | 47.68% |

Geografische Verteilung der Liegenschaften

| | |
|------------------------|--------|
| Deutschland | 66.01% |
| Österreich | 18.74% |
| Niederlande | 8.08% |
| Frankreich | 7.17% |
| Vereinigtes Königreich | - |

Kennzahlen zu den Liegenschaften

| | |
|-----------------------|--------|
| Verkehrswert* | 591.57 |
| Anzahl Liegenschaften | 21 |
| Vermietungsquote | 99.20% |

Weitere Kennzahlen

| | |
|-------------------------|--------|
| Fremdfinanzierungsquote | 31.20% |
|-------------------------|--------|

*in Mio. EUR

Die Daten auf dieser Seite beziehen sich auf den zugrundeliegenden Zielfonds per 30/09/2024. Auf Stufe Anlagegruppe können diese aufgrund einer möglichen Liquiditätshaltung geringfügig abweichen.

Anlagestiftung Swiss Life

Immobilien Europa Industrie und Logistik ESG (EUR)



Nettovermögen (NAV) in Mio. EUR: 166.25
Nettovermögen pro Anspruch in EUR: 98.66

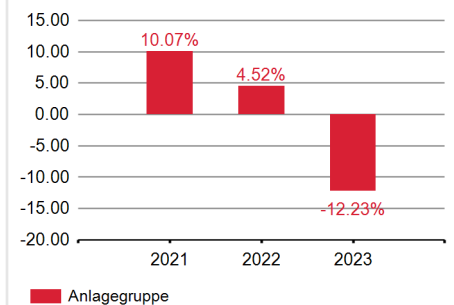
Anlagestrategie

Investitionen in Industrie- und Logistikobjekte. Vorgesehene Allokation in beide Nutzungsarten je 40-60%. Länderallokation mit Schwerpunkt in Deutschland und Frankreich sowie einer Beimischung im übrigen Europa, insbesondere im Vereinigten Königreich, Benelux und der Schweiz. Ziel-Fremdfinanzierungsgrad: 30%. Aktives Management des Immobilien-Portfolios im Zielfonds. Umsetzung mittels Einsatz des Swiss Life Real Estate Funds (LUX) S.A., SICAV-SIF – ESG European Industrial & Logistics; SICAV nach luxemburgischem Recht.

Wertentwicklung in Referenzwährung (Basis 100)



Performance



Produktinformationen

Valorennummer: 56848140
ISIN: CH0568481409
LEI: 254900I0ML8QYK4H7G51
Bloomberg-Code: SLIELE SW
Währung: EUR
Domizil: Schweiz
Aufledgedatum: 11/12/2020
Erstausgabepreis: 100.00
Jahresabschluss: 30.09
Rücknahmekommission: 1.00%
Ausgabe: Quartalsweise, 5 Bankwerktage vor Quartalsende (Ultimo -5)
Rücknahme: 31.03. / 30.09. mit siebenmonatiger Kündigungsfrist
Ausschüttungspraxis: Ausschüttend
Letzte Ausschüttung per: 21/02/2024 EUR 4.55
Asset Manager
 Swiss Life Asset Management AG
Kurspublikationen: Bloomberg: ASSL
www.swisslife.ch/anlagestiftung
Betriebsaufwandquote TER KGAST
ex ante: 1.60%
ex post per: 30/09/2024 1.60%

Performance in Referenzwährung

| | Kumulierte Performance | | | | Annualisierte Performance | | | |
|--------------|------------------------|---------|----------|--------|---------------------------|---------|----------|-------|
| | YTD | 1 Monat | 3 Monate | 1 Jahr | 3 Jahre | 5 Jahre | 10 Jahre | Aufl. |
| Anlagegruppe | 2.30% | -0.71% | -0.33% | 3.10% | -1.82% | - | - | 0.86% |

Statistische Angaben (annualisiert)

| | 1 Jahr | 3 Jahre | 5 Jahre | 10 Jahre | Aufl. |
|---------------------------------|--------|---------|---------|----------|--------|
| Volatilität Anlagegruppe (in %) | 7.23 | 7.46 | - | - | 7.99 |
| Sharpe Ratio | -0.10 | -0.50 | - | - | -0.07 |
| Maximum Drawdown (in %) | -4.40 | -12.91 | - | - | -12.91 |
| Recovery Period (Jahre) | - | - | - | - | - |

Rücknahmekommission: Rücknahmekommission in Abhängigkeit der Haltedauer (während der Investitionsphase bis 5%), 24 Monate nach vollständig erfolgtem Abruf der Kapitalzusage (max. 3 Jahre) beträgt die Rücknahmekommission 1.00%. Falls Ansprüche valutagerecht weiterplatziert werden, entfällt die Rücknahmekommission.

Betriebsaufwandquote TER KGAST: Indikatorischer Wert zwischen 1.00% und 1.40%.

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

Immobilien Europa Industrie und Logistik ESG (EUR)



Liegenschaftsertrag nach Nutzungsart

| | |
|-----------|--------|
| Logistik | 52.32% |
| Industrie | 47.68% |

Geografische Verteilung der Liegenschaften

| | |
|------------------------|--------|
| Deutschland | 66.01% |
| Österreich | 18.74% |
| Niederlande | 8.08% |
| Frankreich | 7.17% |
| Vereinigtes Königreich | - |

Kennzahlen zu den Liegenschaften

| | |
|-----------------------|--------|
| Verkehrswert* | 591.57 |
| Anzahl Liegenschaften | 21 |
| Vermietungsquote | 99.20% |

Weitere Kennzahlen

| | |
|-------------------------|--------|
| Fremdfinanzierungsquote | 31.20% |
|-------------------------|--------|

*in Mio. EUR

Die Daten auf dieser Seite beziehen sich auf den zugrundeliegenden Zielfonds per 30/09/2024. Auf Stufe Anlagegruppe können diese aufgrund einer möglichen Liquiditätshaltung geringfügig abweichen.

30. September 2024

Anlagestiftung Swiss Life Infrastruktur Global ESG (CHF hedged)



Nettovermögen (NAV) in Mio. CHF: 201.23
Nettovermögen pro Anspruch in CHF: 111.59

Management Kommentar und Ausblick

Während des Berichtszeitraums Q3 2024 kam es zu keinen weiteren Kapitalabrufen der Anleger. Über die Anlagegruppe Infrastruktur Global ESG (EUR) wurde jedoch weiter in Zielinvestments investiert. Dabei handelte es sich um Investitionen in Zielfonds und Kapitalabrufe zweier Direktanlagen. Das Anlagegruppenvermögen hat sich im dritten Quartal 2024 positiv entwickelt. Einen leicht negativen Effekt auf die Gesamtbewertung hatten die Fremdwährungen im Anlagegruppenvermögen. Im vierten Quartal 2024 wird es voraussichtlich zu einem weiteren Kapitalabruf der Anleger kommen.

Anlagestrategie

Erwerb von Ansprüchen der Anlagegruppe Infrastruktur Global ESG (EUR) und Durchführung von Währungsabsicherungen zur Minderung der daraus entstehenden Fremdwährungsrisiken. Die Anlagegruppe hält zur Sicherstellung die für die Währungsabsicherung notwendige Liquidität. Der Anlageertrag der Anlageklasse EUR wird mittels Kapitalanlagenlagen in Infrastrukturinvestments erreicht. Dabei soll ein konservatives bis ausgewogenes Rendite-Risiko-Spektrum abgedeckt werden. (Vgl. Prospekt Anlagegruppe Infrastruktur Global ESG (CHF hedged) Punkt 2.3).

Performance in Referenzwährung

| | Kumulierte Performance | | | Annualisierte Performance | | | |
|--------------|------------------------|----------|--------|---------------------------|---------|----------|-------|
| | YTD | 3 Monate | 1 Jahr | 3 Jahre | 5 Jahre | 10 Jahre | Aufl. |
| Anlagegruppe | -0.37% | 0.01% | 0.11% | 3.08% | - | - | 3.33% |

Indikative Kennzahlen

| | |
|---|-------|
| Kapitalzusagen Anleger* | 259.1 |
| Abgerufenes Kapital* | 191.3 |
| Nettovermögen (NAV)* | 201.2 |
| Kapitalzusagen Portfolio Investments* | 234.8 |
| Anzahl Portfolio Investments (Durchsicht) | 15 |
| Anzahl Beteiligungen (Durchsicht) | 30 |

*in Mio. CHF

Produktinformationen

Valorennummer: 56897992

ISIN: CH0568979923

Bloomberg-Code: SWGCHCH SW

Währung: CHF

Domizil: Schweiz

Aufledgedatum: 26/05/2021

Erstausgabepreis: 100.00

Jahresabschluss: 30.09

Ausschüttungspraxis: Thesaurierend

Asset Manager:

Swiss Life Asset Management AG

Administrator:

Northern Trust Global Services SE
Leudelange Luxembourg
Zweigniederlassung Basel

Revisionsstelle:

PricewaterhouseCoopers AG

Depotbank:

UBS Switzerland AG

Kurspublikationen: Bloomberg: ASSL

www.swisslife.ch/anlagestiftung

Betriebsaufwandquote TER KGAST

ex ante: 1.46%

ex post per: 30/09/2024 1.46%

Rücknahme von Ansprüchen: Die Rücknahme von Ansprüchen erfolgt jeweils jährlich per 30. September (Rücknahmeterrin), unter Einhaltung einer neunmonatigen Kündigungsfrist, erstmals per 30. September 2025, wobei die Rücknahmebegrenzungen der Anlagegruppe Infrastruktur Global (EUR) zu berücksichtigen sind.

Portfolio Investments*

| | Kapitalzusagen | Nettovermögen |
|--|----------------|---------------|
| Swiss Life Funds (LUX) ESG Global Infrastructure Opportunities III | 30.86% | 34.36% |
| Swiss Life Funds (LUX) ESG GIO III Co-Invest | 11.70% | 12.57% |
| FONTAVIS ESG Renewable Infrastructure Fund II («FORTE II») | 9.58% | 7.58% |
| Swiss Life Funds (LUX) ESG Global Infrastructure Opportunities Growth II | 8.51% | 3.39% |
| FONTAVIS ESG Renewable Infrastructure Fund Europe («FORTE») | 5.32% | 7.21% |
| Co-Investment Transition Network Operator Ampriom | 5.32% | 3.46% |
| Co-Investment District Heating UK | 4.99% | 5.43% |
| Co-Investment Saffir (offshore Norway) | 4.69% | 5.03% |
| Co-Investment TTT via Bazalgette (Investments) Ltd | 3.72% | 4.54% |
| Co-Investment JFK via JLC Terminal One Co-Invest L.P. | 3.40% | 2.21% |
| Andere | 11.91% | 14.22% |

*Ohne Liquidität

Assets nach Sektoren*

| | |
|-------------------------------|--------|
| Erneuerbare Energie / Energie | 32.49% |
| Kommunikation | 31.10% |
| Transport | 12.82% |
| Soziale Infrastruktur | 12.42% |
| Versorger | 11.17% |
| Andere | - |

*Ohne Liquidität

Assets nach Region*

| | |
|--------------------------------|--------|
| Europa (inkl. Grossbritannien) | 79.96% |
| Nord Amerika | 18.49% |
| Schweiz | 1.55% |
| Sonstige Regionen | - |

*Ohne Liquidität

Assets nach Stadium*

| | |
|------------|--------|
| Brownfield | 91.33% |
| Greenfield | 8.67% |

*Ohne Liquidität

Assets nach Währung*

| | |
|-----|--------|
| EUR | 60.76% |
| USD | 19.53% |
| GBP | 18.16% |
| CHF | 1.55% |

*Ohne Liquidität

30. September 2024

Anlagestiftung Swiss Life Infrastruktur Global ESG (EUR)



Nettovermögen (NAV) in Mio. EUR: 430.97
Nettovermögen pro Anspruch in EUR: 118.40

Management Kommentar und Ausblick

Während des Berichtszeitraums Q3 2024 konnte die Anlagegruppe Infrastruktur Global ESG (EUR) ca. EUR 10 Mio. in ihre Zielinvestments investieren. Dabei handelte es sich um Kapitalabrufe der Zielfonds (ca. EUR 7 Mio.) und zweier Direktanlagen (ca. EUR 3 Mio.). Weiterhin hat sich das Anlagegruppenvermögen im Berichtszeitraum stabil positiv entwickelt. Im vierten Quartal 2024 wird es voraussichtlich zu einem weiteren Kapitalabruf der Anleger kommen. Das Portfoliomanagement prüft neue Kapitalallokationen im Fonds- und Direktanlagenbereich.

Anlagestrategie

Partizipation an mehreren diversifizierten Infrastrukturfonds und Direktanlagen in OECD-Ländern, die von Swiss Life verwaltet werden. Fokus auf Core/Core+ Strategien und regelmässige Ausschüttungen aus dem operativen Geschäft. Diversifikation nach Ländern, Regionen, Standorten, Sektoren, Technologien, Anlagenalter und Cashflow-Profilen. Investmentprozess berücksichtigt Risiko- und Finanzfaktoren sowie ESG Kriterien. (Vgl. Prospekt Anlagegruppe Infrastruktur Global ESG (EUR) Punkt 2.3).

Performance in Referenzwährung

| | Kumulierte Performance | | | Annualisierte Performance | | | |
|--------------|------------------------|----------|--------|---------------------------|---------|----------|-------|
| | YTD | 3 Monate | 1 Jahr | 3 Jahre | 5 Jahre | 10 Jahre | Aufl. |
| Anlagegruppe | 1.71% | 0.76% | 2.86% | 5.14% | - | - | 5.33% |

Indikative Kennzahlen

| | |
|---|-------|
| Kapitalzusagen Anleger* | 502.3 |
| Abgerufenes Kapital* | 395.8 |
| Nettovermögen (NAV)* | 431.0 |
| Kapitalzusagen Portfolio Investments* | 470.0 |
| Anzahl Portfolio Investments (Durchsicht) | 15 |
| Anzahl Beteiligungen (Durchsicht) | 30 |

*in Mio. EUR

Produktinformationen

Valorennummer: 56897994

ISIN: CH0568979949

Bloomberg-Code: SWLIGE1 SW

Währung: EUR

Domizil: Schweiz

Auflegedatum: 26/05/2021

Erstausgabepreis: 100.00

Jahresabschluss: 30.09

Ausschüttungspraxis: Ausschüttend

Letzte Ausschüttung per:
21/02/2024 EUR 0.60

Asset Manager:
Swiss Life Asset Management AG

Administrator:
Northern Trust Global Services SE
Leudelange Luxembourg
Zweigniederlassung Basel

Revisionsstelle:
PricewaterhouseCoopers AG

Depotbank:
UBS Switzerland AG

Kurspublikationen: Bloomberg: ASSL
www.swisslife.ch/anlagestiftung

Betriebsaufwandquote TER KGAST
ex ante: 1.56%
ex post per: 30/09/2024 1.56%

Rücknahme von Ansprüchen: Die Rücknahme von Ansprüchen erfolgt jeweils jährlich per 30. September (Rücknahmetermine), unter Einhaltung einer sechsmonatigen Kündigungsfrist, erstmals per 30. September 2025; jährliche Rücknahmen sind begrenzt auf 20% (resp. maximal EUR 50 Mio.) des investierten Kapitals.

Portfolio Investments*

| | Kapitalzusagen | Nettovermögen |
|--|----------------|---------------|
| Swiss Life Funds (LUX) ESG Global Infrastructure Opportunities III | 30.86% | 34.36% |
| Swiss Life Funds (LUX) ESG GIO III Co-Invest | 11.70% | 12.57% |
| FONTAVIS ESG Renewable Infrastructure Fund II («FORTE II») | 9.58% | 7.58% |
| Swiss Life Funds (LUX) ESG Global Infrastructure Opportunities Growth II | 8.51% | 3.39% |
| FONTAVIS ESG Renewable Infrastructure Fund Europe («FORTE») | 5.32% | 7.21% |
| Co-Investment Transition Network Operator Ampriom | 5.32% | 3.46% |
| Co-Investment District Heating UK | 4.99% | 5.43% |
| Co-Investment Saffir (offshore Norway) | 4.69% | 5.03% |
| Co-Investment TTT via Bazalgette (Investments) Ltd | 3.72% | 4.54% |
| Co-Investment JFK via JLC Terminal One Co-Invest L.P. | 3.40% | 2.21% |
| Andere | 11.91% | 14.22% |

*Ohne Liquidität

Assets nach Sektoren*

| | |
|-------------------------------|--------|
| Erneuerbare Energie / Energie | 32.49% |
| Kommunikation | 31.10% |
| Transport | 12.82% |
| Soziale Infrastruktur | 12.42% |
| Versorger | 11.17% |
| Andere | - |

*Ohne Liquidität

Assets nach Region*

| | |
|--------------------------------|--------|
| Europa (inkl. Grossbritannien) | 79.96% |
| Nord Amerika | 18.49% |
| Schweiz | 1.55% |
| Sonstige Regionen | - |

*Ohne Liquidität

Assets nach Stadium*

| | |
|------------|--------|
| Brownfield | 91.33% |
| Greenfield | 8.67% |

*Ohne Liquidität

Assets nach Währung*

| | |
|-----|--------|
| EUR | 60.76% |
| USD | 19.53% |
| GBP | 18.16% |
| CHF | 1.55% |

*Ohne Liquidität

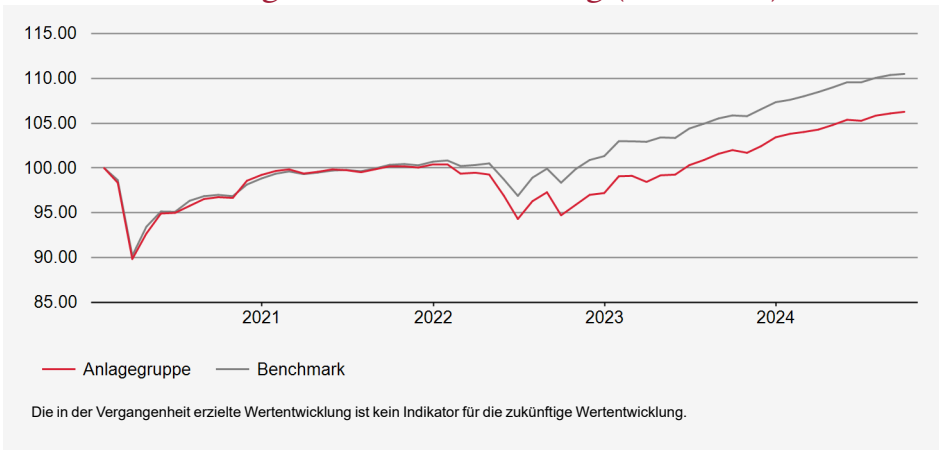
Anlagestiftung Swiss Life Senior Secured Loans (CHF hedged)

Nettovermögen (NAV) in Mio. CHF: 143.61
Nettovermögen pro Anspruch in CHF: 106.27

Anlagestrategie

Die Anlagegruppe strebt stabile hohe Erträge bei einer minimalen Preisvolatilität und einer geringen Zinsduration an. Die Anlagegruppe investiert vorwiegend in erstrangige Senior Secured Loans von Unternehmen aus entwickelten Ländern. Mindestens 85% werden in erstrangigen Senior Secured Loans angelegt. Höchstens 5% werden beim selben Schuldner angelegt. Höchstens 25% werden in derselben Industriegruppe angelegt. Fremdwährungsrisiken werden zu mindestens 90% gegen Schweizerfranken abgesichert. Umsetzung mittels Einsatz des Swiss Life Loan Fund (LUX) S.A., SICAV-SIF Senior Secured Loans V AM-Shares (CHF hedged); Anlagfonds nach luxemburgischem Recht.

Wertentwicklung in Referenzwährung (Basis 100)



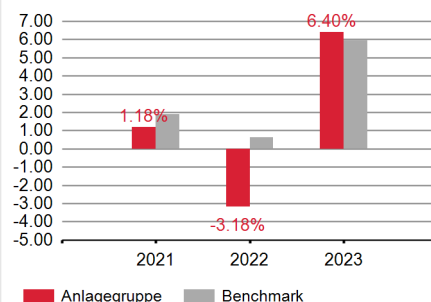
Performance in Referenzwährung

| | Kumulierte Performance | | | | Annualisierte Performance | | | |
|--------------|------------------------|---------|----------|--------|---------------------------|---------|----------|-------|
| | YTD | 1 Monat | 3 Monate | 1 Jahr | 3 Jahre | 5 Jahre | 10 Jahre | Aufl. |
| Anlagegruppe | 2.75% | 0.17% | 0.95% | 4.19% | 1.98% | - | - | 1.31% |
| Benchmark | 2.94% | 0.11% | 0.85% | 4.37% | 3.26% | - | - | 2.16% |

Statistische Angaben (annualisiert)

| | 1 Jahr | 3 Jahre | 5 Jahre | 10 Jahre | Aufl. |
|---------------------------------|--------|---------|---------|----------|--------|
| Volatilität Anlagegruppe (in %) | 1.20 | 3.62 | - | - | 5.63 |
| Volatilität Benchmark (in %) | 0.89 | 2.81 | - | - | 5.24 |
| Tracking Error ex post (in %) | 0.47 | 1.05 | - | - | 1.02 |
| Information Ratio | -0.40 | -1.21 | - | - | -0.84 |
| Sharpe Ratio | 2.18 | 0.35 | - | - | 0.19 |
| Korrelation | 0.94 | 0.98 | - | - | 0.98 |
| Beta | 1.28 | 1.26 | - | - | 1.06 |
| Jensen-Alpha | -0.99 | -1.94 | - | - | -0.96 |
| Maximum Drawdown (in %) | -0.29 | -6.07 | - | - | -10.15 |
| Recovery Period (Jahre) | 0.08 | 1.08 | - | - | 1.50 |

Performance



Produktinformationen

Valorennummer: 51215713

ISIN: CH0512157139

LEI: 254900TFN2RL5B1QJ986

Bloomberg-Code: SWSSLCH SW

Benchmark: JPM Lev Loans Upper Tier (80% US + 20% EU) CHFh

Währung: CHF

Domizil: Schweiz

Aufgatedatum: 31/01/2020

Erstausgabepreis: 100.00

Jahresabschluss: 30.09

Ausgabe/Rücknahme: Monatlich

Annahmeschluss: 14.30 Uhr

Zeichnungen: Ultimo - 2

Rücknahmen: Ultimo - 5

Ausgabe- / Rücknahmekommission: Keine

Ausschüttungspraxis: Thesaurierung

Asset Manager gemäss Swiss Life Best Select Invest Plus®: Swiss Life Asset Management AG

Überwachung Asset Manager: PPCmetrics unterstützt die laufende Überwachung des Asset Managers sowie die Beurteilung der Anlageresultate.

Kurspublikationen: Bloomberg: ASSL
www.swisslife.ch/anlagestiftung

Betriebsaufwandquote TER KGAST

ex ante: 0.61%

ex post per: 30/09/2024 0.61%

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.

Annahmeschluss: Ultimo = letzter Bankwerktag des Monats

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 Senior Secured Loans (CHF hedged)

Portfoliostruktur nach Branchen

| | Anlagegruppe | Benchmark |
|---------------------------|--------------|-----------|
| Dienstleistungen | 16.71% | 9.93% |
| Technologie | 9.32% | 7.68% |
| Gesundheitswesen | 8.16% | 8.58% |
| Finanzwesen | 7.67% | 5.41% |
| Glücksspiel/Freizeit | 7.31% | 10.54% |
| Chemikalien | 6.94% | 6.06% |
| Baugewerbe | 5.48% | 4.05% |
| Kabel und Satellit | 5.04% | 4.18% |
| Automobile | 3.96% | 4.02% |
| Lebensmittel und Getränke | 3.73% | 4.87% |
| Andere | 21.99% | 34.70% |
| Liquidität | 3.68% | - |

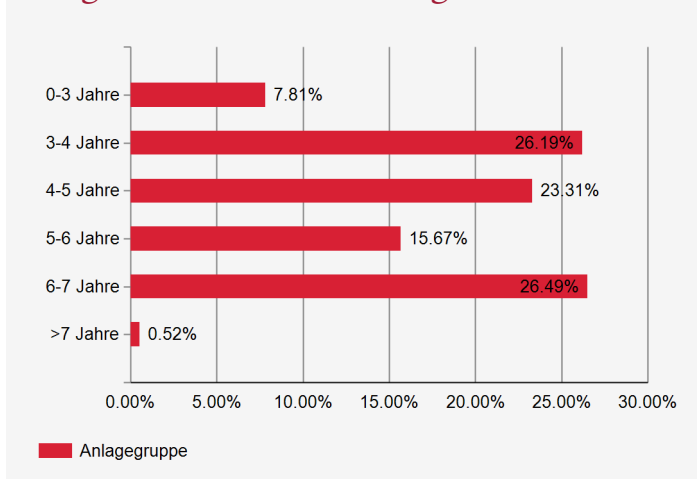
Grösste Schuldner und Rating

| | Rating | Anlagegruppe |
|------------------|--------|--------------|
| Action Nederland | BB | 1.50% |
| INEOS Quattro | BB | 1.47% |
| Entain | BB- | 1.42% |
| Belron | BB- | 1.41% |
| Asurion | B+ | 1.39% |

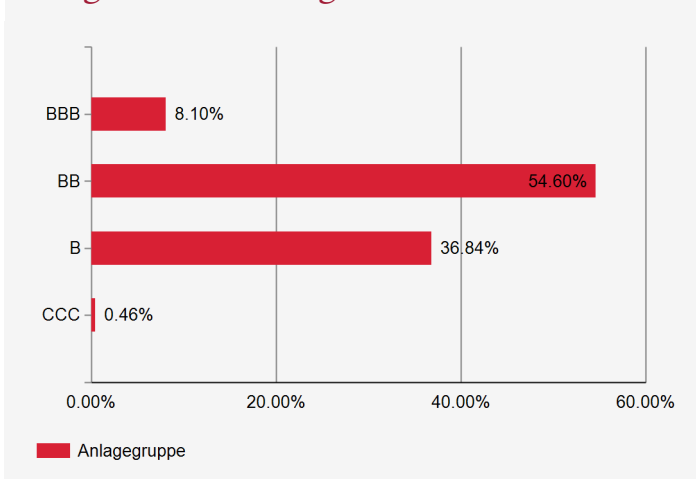
Weitere Angaben zu den Schuldnern

| | |
|------------------|-----|
| Anzahl Schuldner | 223 |
|------------------|-----|

Fälligkeitstruktur der Anlagen



Anlagen nach Rating



Portfeuillestruktur nach Währungen / Rendite (ohne Liquidität)

| | Anlagegruppe | | Benchmark | |
|--------------|--------------|---------|------------|---------|
| | Gewichtung | Rendite | Gewichtung | Rendite |
| USD | 69.03% | 7.85% | 80.00% | 7.19% |
| EUR | 30.97% | 7.02% | 20.00% | 6.52% |
| Durchschnitt | - | 7.59% | - | 7.06% |

Portfoliostruktur nach Ländern/Regionen

| | Anlagegruppe | Benchmark |
|------------------------|--------------|-----------|
| Vereinigte Staaten | 57.71% | 83.34% |
| Vereinigtes Königreich | 8.92% | 5.66% |
| Niederlande | 6.14% | 2.11% |
| Deutschland | 3.90% | 0.40% |
| Luxemburg | 3.89% | 0.29% |
| Belgien | 2.76% | 1.09% |
| Frankreich | 1.84% | - |
| Schweiz | 1.82% | 0.17% |
| Spanien | 1.62% | 0.81% |
| Kanada | 1.41% | 2.39% |
| Andere | 6.32% | 3.75% |
| Liquidität | 3.68% | - |

Anlagestiftung Swiss Life Hypotheke Schweiz ESG

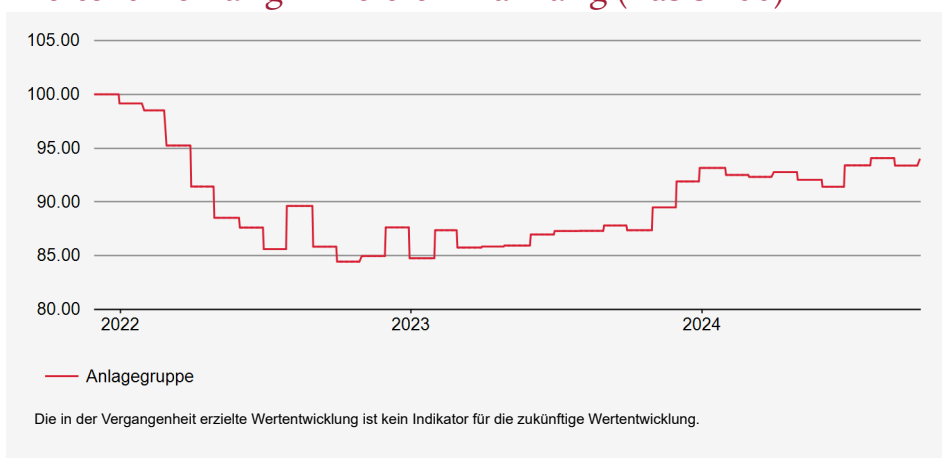


Nettovermögen (NAV) in Mio. CHF: 219.34
Nettovermögen pro Anspruch in CHF: 93.95

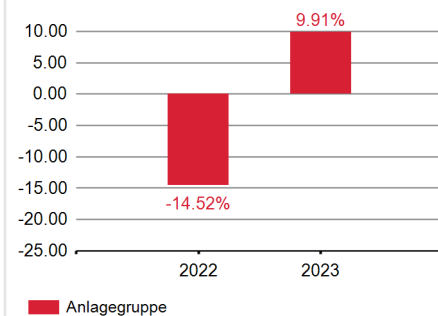
Anlagestrategie

Investitionen in nachhaltige Schweizer Hypotheken: mindestens 85% nach Abzug der flüssigen Mittel. Zielduration von 8. Umsetzung mittels Einsatz des «Swiss Life ESG Mortgage Fund» Teilvermögen des Swiss Life Mortgage Funds, ein vertraglicher Umbrella-Fonds schweizerischen Rechts.

Wertentwicklung in Referenzwährung (Basis 100)



Performance



Produktinformationen

Valorennummer: 112778762

ISIN: CH1127787625

LEI: 254900V4K2D79T13EF45

Bloomberg-Code: SLHSECH SW

Währung: CHF

Domizil: Schweiz

Aufgagedatum: 30/11/2021

Erstausgabepreis: 100.00

Jahresabschluss: 30.9

Ausgabe/Rücknahme: Monatlich

Ausgabe- / Rücknahmekommission:
Keine

Ausschüttungspraxis: Thesaurierung

Asset Manager:

Swiss Life Asset Management AG

Kurspublikationen: Bloomberg: ASSL
www.swisslife.ch/anlagestiftung

Betriebsaufwandquote TER KGAST

ex ante: 0.57%

ex post per: 30/09/2023 0.57%

Performance in Referenzwährung

| | Kumulierte Performance | | | | Annualisierte Performance | | | |
|--------------|------------------------|---------|----------|--------|---------------------------|---------|----------|--------|
| | YTD | 1 Monat | 3 Monate | 1 Jahr | 3 Jahre | 5 Jahre | 10 Jahre | Aufl. |
| Anlagegruppe | 0.85% | 0.61% | 0.59% | 7.53% | - | - | - | -2.18% |

Statistische Angaben

| | |
|---|-------|
| Durchschnittliche Restlaufzeit (Jahre) | 8.41 |
| Modified Duration (exkl. Forward Hypotheken)* | 7.13 |
| Modified Duration (inkl. Forward Hypotheken)* | 7.61 |
| Bruttorendite auf Verfall | 1.60% |
| Durchschnittliche Belehnung | 59% |
| Anzahl Hypotheken | 699 |
| Rendite-Differenz zu Schweizer Staatsanleihen | 1.20% |

*inkl. Liquidität

Ausgabe: Monatlich, unter Einhaltung einer 1-monatigen Zeichnungsfrist.

Rückgabe: Monatlich, unter Einhaltung einer 6-monatigen Kündigungsfrist. Erstmalige Rückgabe 30. Januar 2024

Performance: Gesamtertrag über einen bestimmten Betrachtungszeitraum auf der Basis von zeitgewichteten Renditen.

Statistische Angaben: Die Risikokennzahlen basieren auf logarithmierten, monatlichen zeitgewichteten Renditen.

Vermögensstruktur

| | |
|----------------|--------|
| Hypotheken | 94.00% |
| Geldmarktfonds | 3.14% |
| Liquidität | 2.86% |
| Derivate | 0.00% |

Verteilung nach Belehnungshöhe

| | |
|----------|--------|
| <40% | 8.89% |
| 40 - 50% | 14.10% |
| 50 - 60% | 13.86% |
| 60 - 70% | 51.47% |
| >70% | 11.68% |

Art der Pfandobjekte

| | |
|-------------------------------------|--------|
| EINFAMILIENHÄUSER | 35.00% |
| EIGENTUMSWOHNUNGEN | 52.94% |
| MEHRFAMILIENHÄUSER | 7.43% |
| KOMMERZIELL GENUTZTE LIEGENSCHAFTEN | 4.62% |

Hypothekenarten

| | |
|---------------------|--------|
| Festhypotheken | 98.39% |
| Saron Hypotheken | 1.38% |
| Variable Hypotheken | 0.23% |

Hypotheken mit Zahlungsausständen grösser 90 Tage

| | |
|--|---|
| Durchschnittliche Belehnung | - |
| Anzahl Hypothekarschuldner | - |
| Relativer Gesamtwert der Hypotheken mit Zahlungsausständen | - |

Geografische Verteilung der Liegenschaften

| | |
|-------------------|--------|
| Zürich | 27.18% |
| Espace Mittelland | 15.86% |
| Innerschweiz | 8.00% |
| Nordwestschweiz | 6.89% |
| Ostschweiz | 1.92% |
| Tessin | 1.08% |
| Genferseeregion | 39.07% |

Verfallstruktur der Hypotheken

| | |
|-------------|--------|
| 1-3 JAHRE | 7.80% |
| 3-5 JAHRE | 17.88% |
| 5-7 JAHRE | 5.09% |
| 7-10 JAHRE | 49.62% |
| 10-15 JAHRE | 12.46% |
| >15 JAHRE | 7.16% |

ESG Verteilung

| | |
|-----------------------|--------|
| Minergie | 51.89% |
| GEAK | 45.41% |
| THPE | 2.61% |
| Kein Label/Zertifikat | 0.09% |

Anlagestiftung Swiss Life BVG-Mix 15

Nettovermögen (NAV) in Mio. CHF: 229.47
Nettovermögen pro Anspruch in CHF: 176.11

Anlagestrategie

Anlagen in alle vom BVG zugelassenen Anlagekategorien (strategischer Aktienanteil: 15%). Aktive Asset Allocation. Begrenzung für Beteiligungspapiere: 20%. Begrenzung für Fremdwährungen: 30%. Durchschnittliche Ratingqualität der Obligationen: mindestens BBB+. Umsetzung mittels Einsatz artreiner Kollektivanlagen. Empfohlene Schwankungsreserven: über 6.5%.

Wertentwicklung in Referenzwährung (Basis 100)



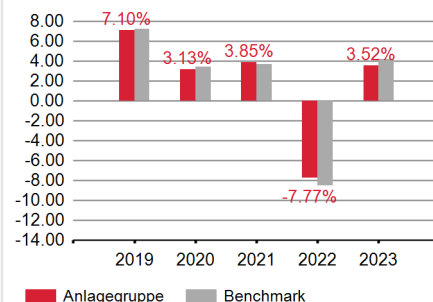
Performance in Referenzwährung

| | Kumulierte Performance | | | | Annualisierte Performance | | | |
|--------------|------------------------|---------|----------|--------|---------------------------|---------|----------|-------|
| | YTD | 1 Monat | 3 Monate | 1 Jahr | 3 Jahre | 5 Jahre | 10 Jahre | Aufl. |
| Anlagegruppe | 4.03% | 0.40% | 1.70% | 6.35% | 0.16% | 1.41% | 2.07% | 2.70% |
| Benchmark | 4.15% | 0.51% | 1.72% | 6.74% | 0.13% | 1.41% | 2.24% | 3.00% |

Statistische Angaben (annualisiert)

| | 1 Jahr | 3 Jahre | 5 Jahre | 10 Jahre | Aufl. |
|---------------------------------|--------|---------|---------|----------|-------|
| Volatilität Anlagegruppe (in %) | 2.43 | 3.57 | 3.75 | 3.07 | 2.82 |
| Volatilität Benchmark (in %) | 2.78 | 4.08 | 4.10 | 3.21 | 2.87 |
| Tracking Error ex post (in %) | 0.46 | 0.65 | 0.56 | 0.52 | 0.57 |
| Information Ratio | -0.85 | 0.04 | 0.01 | -0.33 | -0.51 |
| Sharpe Ratio | 1.92 | -0.15 | 0.33 | 0.76 | 0.89 |
| Korrelation | 0.99 | 0.99 | 0.99 | 0.99 | 0.98 |
| Beta | 0.87 | 0.87 | 0.91 | 0.94 | 0.97 |
| Jensen-Alpha | 0.31 | -0.05 | 0.12 | -0.03 | -0.20 |
| Maximum Drawdown (in %) | -1.09 | -9.12 | -9.12 | -9.12 | -9.12 |
| Recovery Period (Jahre) | 0.07 | - | - | - | - |

Performance



Produktinformationen

Valorennummer: 1564965

ISIN: CH0015649657

LEI: 254900RW4KJYAQTH6Y97

Bloomberg-Code: SWABM15 SW

Benchmark: Customized

Währung: CHF

Domizil: Schweiz

Aufledgedatum: 30/06/2003

Erstausgabepreis: 100.00

Jahresabschluss: 30.09

Ausgabe/Rücknahme: Täglich

Annahmeschluss: 12.00 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: 0.57%

ex post per: 30/09/2024 0.60%

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.

Portfoliostruktur nach Anlagekategorien

| | Anlagegruppe | Benchmark | max. BVV2 |
|--|--------------|-----------|-----------|
| Liquidität | 2.03% | 2.00% | - |
| Hypotheken Schweiz | 12.15% | 13.00% | - |
| Obligationen CHF Inland | 11.08% | 13.00% | - |
| Obligationen CHF Ausland | 5.70% | 6.00% | - |
| Obligationen Fremdwährungen (CHF hedged) | 30.20% | 28.00% | - |
| Aktien Schweiz | 8.08% | 8.00% | - |
| Aktien Ausland | 6.97% | 7.00% | - |
| Aktien Ausland (CHF hedged) | - | - | - |
| Immobilien Schweiz | 18.08% | 15.00% | 30.00% |
| Immobilien Ausland (CHF hedged) | 3.39% | 3.00% | 10.00% |
| Alternative Anlagen (CHF hedged) | 2.33% | 5.00% | 15.00% |
| Total Aktien (In- und Ausland) | 15.04% | 15.00% | 50.00% |
| Total Fremdwährungen | 6.97% | 7.00% | 30.00% |

Grösste Aktienpositionen

| | |
|------------------------------|-------|
| NESTLE SA-REG | 1.11% |
| NOVARTIS AG-REG | 0.99% |
| ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN | 0.95% |
| UBS GROUP AG-REG | 0.42% |
| MICROSOFT CORP | 0.41% |
| NVIDIA CORP | 0.40% |
| ABB LTD-REG | 0.39% |
| ZURICH INSURANCE GROUP AG | 0.37% |
| CIE FINANCIERE RICHEMO-A REG | 0.36% |
| ALPHABET INC | 0.25% |

Benchmarkzusammensetzung

| | |
|---|--------|
| 1M Saron | 2.00% |
| SBI Domestic AAA-A 1-3Y | 13.00% |
| SBI Domestic AAA-BBB | 13.00% |
| SBI Foreign AAA-BBB | 6.00% |
| Bloomberg Gl. Agg. Treas. ex CH TR (CHF hedged) | 5.00% |
| Bloomberg Gl. Agg. Corp. TR (CHF hedged) | 12.00% |
| Bloomberg Gl. Agg. Corp. Short Term TR (CHF hedged) | 7.00% |
| JP Morgan CEMBI Broad Div IG Index (CHF hedged) | 4.00% |
| Swiss Performance Index | 8.00% |
| MSCI World ex CH ESG Leaders, in CHF | 5.60% |
| MSCI AC World Small Cap, in CHF | 1.05% |
| MSCI Emerging Markets, in CHF | 0.35% |
| KGAST Immo-Index | 15.00% |
| SL REF (LUX) German Core Real Estate (CHF hedged) | 3.00% |
| HFRX Global Hedge Funds (CHF hedged) | 5.00% |

Portfoliostruktur nach Währungen

| | |
|--------|--------|
| CHF | 93.04% |
| USD | 4.73% |
| EUR | 0.52% |
| JPY | 0.44% |
| Übrige | 1.28% |

Eigenschaften der festverzinslichen Anlagen

| | |
|---------------------------|------|
| Modified Duration | 4.72 |
| Durchschnittliches Rating | A+ |

Nettovermögen (NAV) in Mio. CHF: 703.90
Nettovermögen pro Anspruch in CHF: 200.31

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)



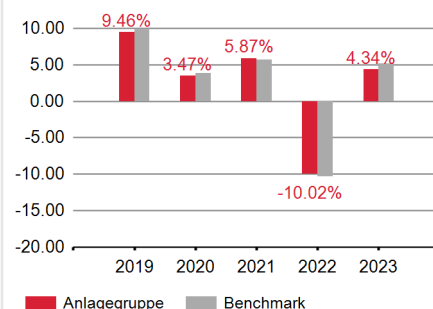
Performance in Referenzwährung

| | Kumulierte Performance | | | | Annualisierte Performance | | | |
|--------------|------------------------|---------|----------|--------|---------------------------|---------|----------|-------|
| | YTD | 1 Monat | 3 Monate | 1 Jahr | 3 Jahre | 5 Jahre | 10 Jahre | Aufl. |
| Anlagegruppe | 5.29% | 0.35% | 1.63% | 7.84% | 0.22% | 1.84% | 2.55% | 3.06% |
| Benchmark | 5.58% | 0.49% | 1.73% | 8.39% | 0.40% | 1.99% | 2.89% | 3.55% |

Statistische Angaben (annualisiert)

| | 1 Jahr | 3 Jahre | 5 Jahre | 10 Jahre | Aufl. |
|---------------------------------|--------|---------|---------|----------|--------|
| Volatilität Anlagegruppe (in %) | 3.31 | 4.81 | 5.10 | 4.29 | 4.09 |
| Volatilität Benchmark (in %) | 3.60 | 5.24 | 5.46 | 4.42 | 4.09 |
| Tracking Error ex post (in %) | 0.41 | 0.59 | 0.55 | 0.52 | 0.58 |
| Information Ratio | -1.33 | -0.31 | -0.28 | -0.67 | -0.83 |
| Sharpe Ratio | 1.83 | -0.10 | 0.33 | 0.66 | 0.69 |
| Korrelation | 1.00 | 1.00 | 1.00 | 0.99 | 0.99 |
| Beta | 0.92 | 0.91 | 0.93 | 0.96 | 0.99 |
| Jensen-Alpha | 0.04 | -0.21 | -0.03 | -0.23 | -0.46 |
| Maximum Drawdown (in %) | -1.88 | -11.75 | -11.75 | -11.75 | -14.16 |
| Recovery Period (Jahre) | 0.04 | - | - | - | 0.98 |

Performance



Produktinformationen

Valorennummer: 1245601

ISIN: CH0012456015

LEI: 5493000KUC3Z24U77V93

Bloomberg-Code: SWABM25 SW

Benchmark: Customized

Währung: CHF

Domizil: Schweiz

Aufledgedatum: 30/09/2001

Erstausgabepreis: 100.00

Jahresabschluss: 30.09

Ausgabe/Rücknahme: Täglich

Annahmeschluss: 12.00 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: 30/09/2024 0.59%

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.

Portfoliostruktur nach Anlagekategorien

| | Anlagegruppe | Benchmark | max. BVV2 |
|--|--------------|-----------|-----------|
| Liquidität | 1.96% | 2.00% | - |
| Hypotheken Schweiz | 0.89% | - | - |
| Obligationen CHF Inland | 15.00% | 16.00% | - |
| Obligationen CHF Ausland | 9.07% | 9.00% | - |
| Obligationen Fremdwährungen (CHF hedged) | 26.85% | 28.00% | - |
| Aktien Schweiz | 13.23% | 13.00% | - |
| Aktien Ausland | 12.02% | 12.00% | - |
| Aktien Ausland (CHF hedged) | - | - | - |
| Immobilien Schweiz | 15.28% | 13.00% | 30.00% |
| Immobilien Ausland (CHF hedged) | 3.22% | 2.00% | 10.00% |
| Alternative Anlagen (CHF hedged) | 2.47% | 5.00% | 15.00% |
| Total Aktien (In- und Ausland) | 25.25% | 25.00% | 50.00% |
| Total Fremdwährungen | 12.02% | 12.00% | 30.00% |

Grösste Aktienpositionen

| | |
|------------------------------|-------|
| NESTLE SA-REG | 1.82% |
| NOVARTIS AG-REG | 1.63% |
| ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN | 1.56% |
| MICROSOFT CORP | 0.71% |
| NVIDIA CORP | 0.70% |
| UBS GROUP AG-REG | 0.69% |
| ABB LTD-REG | 0.64% |
| ZURICH INSURANCE GROUP AG | 0.61% |
| CIE FINANCIERE RICHEMO-A REG | 0.59% |
| ALPHABET INC | 0.42% |

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% |

Portfoliostruktur nach Währungen

| | |
|--------|--------|
| CHF | 87.98% |
| USD | 8.16% |
| EUR | 0.89% |
| JPY | 0.76% |
| Übrige | 2.21% |

Eigenschaften der festverzinslichen Anlagen

| | |
|---------------------------|------|
| Modified Duration | 5.82 |
| Durchschnittliches Rating | A |

Anlagestiftung Swiss Life BVG-Mix 35

Nettovermögen (NAV) in Mio. CHF: 403.62
Nettovermögen pro Anspruch in CHF: 213.34

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)



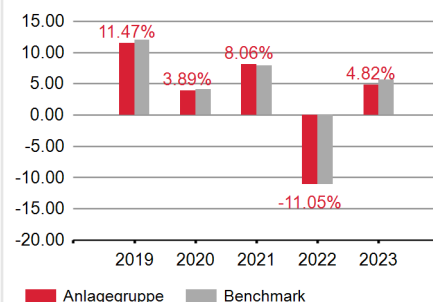
Performance in Referenzwährung

| | Kumulierte Performance | | | | Annualisierte Performance | | | |
|--------------|------------------------|---------|----------|--------|---------------------------|---------|----------|-------|
| | YTD | 1 Monat | 3 Monate | 1 Jahr | 3 Jahre | 5 Jahre | 10 Jahre | Aufl. |
| Anlagegruppe | 6.38% | 0.25% | 1.48% | 8.88% | 0.54% | 2.51% | 3.12% | 3.35% |
| Benchmark | 6.76% | 0.42% | 1.58% | 9.49% | 0.86% | 2.75% | 3.53% | 3.89% |

Statistische Angaben (annualisiert)

| | 1 Jahr | 3 Jahre | 5 Jahre | 10 Jahre | Aufl. |
|---------------------------------|--------|---------|---------|----------|--------|
| Volatilität Anlagegruppe (in %) | 4.11 | 5.72 | 6.06 | 5.27 | 5.20 |
| Volatilität Benchmark (in %) | 4.35 | 6.11 | 6.46 | 5.40 | 5.19 |
| Tracking Error ex post (in %) | 0.38 | 0.59 | 0.61 | 0.58 | 0.63 |
| Information Ratio | -1.64 | -0.55 | -0.40 | -0.71 | -0.84 |
| Sharpe Ratio | 1.71 | -0.03 | 0.38 | 0.64 | 0.59 |
| Korrelation | 1.00 | 1.00 | 1.00 | 0.99 | 0.99 |
| Beta | 0.94 | 0.93 | 0.94 | 0.97 | 0.99 |
| Jensen-Alpha | -0.15 | -0.31 | -0.07 | -0.30 | -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

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: 0.57%

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.

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 | 3.26% | 2.00% | - |
| Hypotheken Schweiz | 0.60% | - | - |
| Obligationen CHF Inland | 13.10% | 14.00% | - |
| Obligationen CHF Ausland | 7.13% | 7.00% | - |
| Obligationen Fremdwährungen (CHF hedged) | 24.95% | 24.00% | - |
| Aktien Schweiz | 17.88% | 18.00% | - |
| Aktien Ausland | 16.98% | 17.00% | - |
| Aktien Ausland (CHF hedged) | - | - | - |
| Immobilien Schweiz | 11.74% | 11.00% | 30.00% |
| Immobilien Ausland (CHF hedged) | 2.06% | 2.00% | 10.00% |
| Alternative Anlagen (CHF hedged) | 2.29% | 5.00% | 15.00% |
| Total Aktien (In- und Ausland) | 34.87% | 35.00% | 50.00% |
| Total Fremdwährungen | 16.98% | 17.00% | 30.00% |

Grösste Aktienpositionen

| | |
|------------------------------|-------|
| NESTLE SA-REG | 2.46% |
| NOVARTIS AG-REG | 2.20% |
| ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN | 2.10% |
| MICROSOFT CORP | 1.00% |
| NVIDIA CORP | 0.98% |
| UBS GROUP AG-REG | 0.93% |
| ABB LTD-REG | 0.87% |
| ZURICH INSURANCE GROUP AG | 0.83% |
| CIE FINANCIERE RICHEMO-A REG | 0.80% |
| ALPHABET INC | 0.60% |

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 | 83.02% |
| USD | 11.53% |
| EUR | 1.26% |
| JPY | 1.07% |
| Übrige | 3.12% |

Eigenschaften der festverzinslichen Anlagen

| | |
|---------------------------|------|
| Modified Duration | 5.68 |
| Durchschnittliches Rating | A |

Anlagestiftung Swiss Life BVG-Mix 45

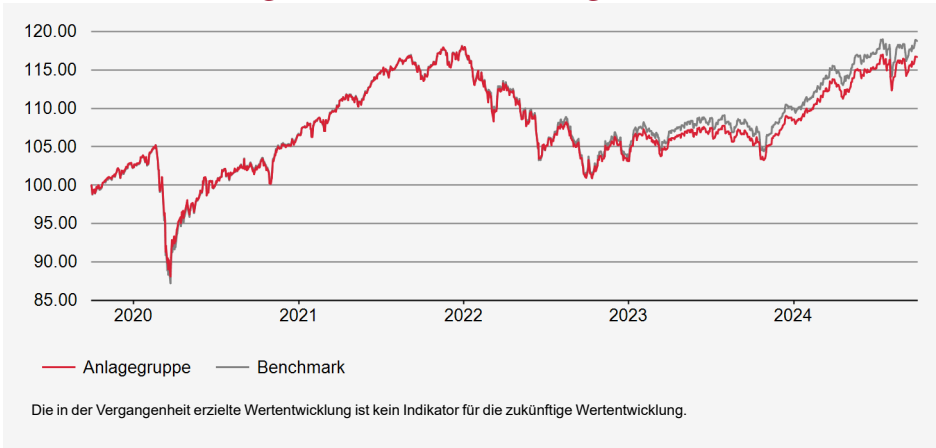


Nettovermögen (NAV) in Mio. CHF: 677.25
Nettovermögen pro Anspruch in CHF: 223.29

Anlagestrategie

Anlagen in alle vom BVG zugelassenen Anlagekategorien (strategischer Aktienanteil: 45%). Aktive Asset Allocation. Begrenzung für Beteiligungspapiere: 50%. Begrenzung für Fremdwährungen: 30%. Durchschnittliche Ratingqualität der Obligationen: mindestens BBB+. Umsetzung mittels Einsatz artreiner Kollektivanlagen. Empfohlene Schwankungsreserven: über 20%.

Wertentwicklung in Referenzwährung (Basis 100)



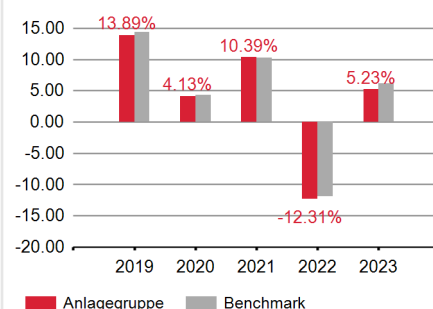
Performance in Referenzwährung

| | Kumulierte Performance | | | | Annualisierte Performance | | | |
|--------------|------------------------|---------|----------|--------|---------------------------|---------|----------|-------|
| | YTD | 1 Monat | 3 Monate | 1 Jahr | 3 Jahre | 5 Jahre | 10 Jahre | Aufl. |
| Anlagegruppe | 7.50% | 0.21% | 1.35% | 10.00% | 0.75% | 3.13% | 3.62% | 3.55% |
| Benchmark | 7.95% | 0.35% | 1.44% | 10.62% | 1.31% | 3.50% | 4.16% | 4.21% |

Statistische Angaben (annualisiert)

| | 1 Jahr | 3 Jahre | 5 Jahre | 10 Jahre | Aufl. |
|---------------------------------|--------|---------|---------|----------|--------|
| Volatilität Anlagegruppe (in %) | 5.00 | 6.71 | 7.20 | 6.41 | 6.44 |
| Volatilität Benchmark (in %) | 5.17 | 7.05 | 7.52 | 6.47 | 6.42 |
| Tracking Error ex post (in %) | 0.32 | 0.56 | 0.56 | 0.58 | 0.67 |
| Information Ratio | -1.92 | -1.00 | -0.65 | -0.94 | -0.97 |
| Sharpe Ratio | 1.61 | 0.01 | 0.41 | 0.60 | 0.51 |
| Korrelation | 1.00 | 1.00 | 1.00 | 1.00 | 0.99 |
| Beta | 0.97 | 0.95 | 0.96 | 0.99 | 1.00 |
| Jensen-Alpha | -0.31 | -0.52 | -0.21 | -0.48 | -0.64 |
| Maximum Drawdown (in %) | -3.98 | -14.55 | -16.22 | -16.22 | -28.27 |
| Recovery Period (Jahre) | - | - | 0.67 | 0.67 | 3.76 |

Performance



Produktinformationen

Valorennummer: 1245607

ISIN: CH0012456072

LEI: 2549001XL79VZWJO5Q69

Bloomberg-Code: SWABM45 SW

Benchmark: Customized

Währung: CHF

Domizil: Schweiz

Aufgagedatum: 30/09/2001

Erstausgabepreis: 100.00

Jahresabschluss: 30.09

Ausgabe/Rücknahme: Täglich

Annahmeschluss: 12.00 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: 0.58%

ex post per: 30/09/2024 0.59%

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.

Portfoliostruktur nach Anlagekategorien

| | Anlagegruppe | Benchmark | max. BVV2 |
|--|--------------|-----------|-----------|
| Liquidität | 2.34% | 2.00% | - |
| Hypotheken Schweiz | 0.59% | - | - |
| Obligationen CHF Inland | 10.84% | 12.00% | - |
| Obligationen CHF Ausland | 4.96% | 5.00% | - |
| Obligationen Fremdwährungen (CHF hedged) | 21.35% | 20.00% | - |
| Aktien Schweiz | 23.11% | 23.00% | - |
| Aktien Ausland | 21.99% | 22.00% | - |
| Aktien Ausland (CHF hedged) | - | - | - |
| Immobilien Schweiz | 10.45% | 9.00% | 30.00% |
| Immobilien Ausland (CHF hedged) | 1.80% | 2.00% | 10.00% |
| Alternative Anlagen (CHF hedged) | 2.58% | 5.00% | 15.00% |
| Total Aktien (In- und Ausland) | 45.10% | 45.00% | 50.00% |
| Total Fremdwährungen | 21.99% | 22.00% | 30.00% |

Grösste Aktienpositionen

| | |
|------------------------------|-------|
| NESTLE SA-REG | 3.18% |
| NOVARTIS AG-REG | 2.84% |
| ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN | 2.72% |
| MICROSOFT CORP | 1.29% |
| NVIDIA CORP | 1.27% |
| UBS GROUP AG-REG | 1.20% |
| ABB LTD-REG | 1.12% |
| ZURICH INSURANCE GROUP AG | 1.07% |
| CIE FINANCIERE RICHEMO-A REG | 1.03% |
| ALPHABET INC | 0.77% |

Benchmarkzusammensetzung

| | |
|---|--------|
| 1M Saron | 2.00% |
| SBI Domestic AAA-BBB | 12.00% |
| SBI Foreign AAA-BBB | 5.00% |
| Bloomberg Gl. Agg. Treas. ex CH TR (CHF hedged) | 2.50% |
| Bloomberg Gl. Agg. Corp. TR (CHF hedged) | 6.50% |
| Bloomberg Gl. Agg. Corp. Short Term TR (CHF hedged) | 7.00% |
| JP Morgan CEMBI Broad Div IG Index (CHF hedged) | 4.00% |
| Swiss Performance Index | 23.00% |
| MSCI World ex CH ESG Leaders, in CHF | 17.60% |
| MSCI AC World Small Cap, in CHF | 3.30% |
| MSCI Emerging Markets, in CHF | 1.10% |
| KGAST Immo-Index | 9.00% |
| SL REF (LUX) German Core Real Estate (CHF hedged) | 2.00% |
| HFRX Global Hedge Funds (CHF hedged) | 5.00% |

Portfoliostruktur nach Währungen

| | |
|--------|--------|
| CHF | 78.01% |
| USD | 14.92% |
| EUR | 1.63% |
| JPY | 1.39% |
| Übrige | 4.05% |

Eigenschaften der festverzinslichen Anlagen

| | |
|---------------------------|------|
| Modified Duration | 5.74 |
| Durchschnittliches Rating | A |

30. September 2024

Anlagestiftung Swiss Life BVG-Mix 75



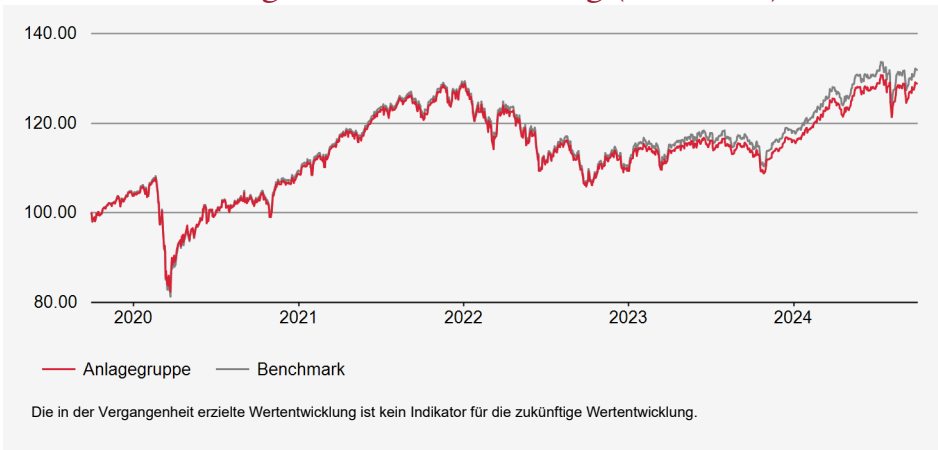
(Aktien- und Fremdwährungsquote gemäss BVV2 überschritten)

Nettovermögen (NAV) in Mio. CHF: 286.50
Nettovermögen pro Anspruch in CHF: 140.48

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)



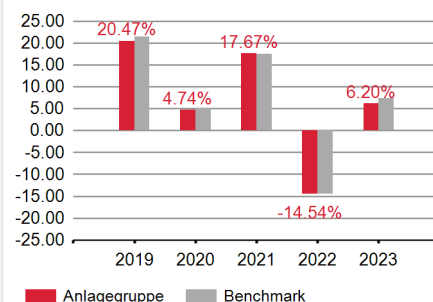
Performance in Referenzwährung

| | Kumulierte Performance | | | | Annualisierte Performance | | | |
|--------------|------------------------|---------|----------|--------|---------------------------|---------|----------|-------|
| | YTD | 1 Monat | 3 Monate | 1 Jahr | 3 Jahre | 5 Jahre | 10 Jahre | Aufl. |
| Anlagegruppe | 10.90% | 0.01% | 0.88% | 13.09% | 1.91% | 5.19% | - | 5.91% |
| Benchmark | 11.54% | 0.16% | 1.07% | 14.00% | 2.47% | 5.68% | - | 6.47% |

Statistische Angaben (annualisiert)

| | 1 Jahr | 3 Jahre | 5 Jahre | 10 Jahre | Aufl. |
|---------------------------------|--------|---------|---------|----------|--------|
| Volatilität Anlagegruppe (in %) | 7.75 | 9.59 | 10.40 | - | 10.44 |
| Volatilität Benchmark (in %) | 7.92 | 10.05 | 10.92 | - | 10.89 |
| Tracking Error ex post (in %) | 0.29 | 0.70 | 0.86 | - | 0.80 |
| Information Ratio | -3.17 | -0.81 | -0.57 | - | -0.69 |
| Sharpe Ratio | 1.40 | 0.12 | 0.47 | - | 0.55 |
| Korrelation | 1.00 | 1.00 | 1.00 | - | 1.00 |
| Beta | 0.98 | 0.95 | 0.95 | - | 0.96 |
| Jensen-Alpha | -0.63 | -0.48 | -0.22 | - | -0.28 |
| Maximum Drawdown (in %) | -7.18 | -17.76 | -23.54 | - | -23.54 |
| Recovery Period (Jahre) | - | 1.76 | 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
Erstausgabepreis: 100.00
Jahresabschluss: 30.09
Ausgabe/Rücknahme: Täglich
Annahmeschluss: 12.00 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: 0.62%
ex post per: 30/09/2024 0.61%

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 | 3.80% | 2.00% | - |
| Hypotheken Schweiz | 0.24% | - | - |
| Obligationen Fremdwährungen (CHF hedged) | 15.11% | 13.00% | - |
| Aktien Schweiz | 36.89% | 38.00% | - |
| Aktien Ausland | 36.95% | 37.00% | - |
| Aktien Ausland (CHF hedged) | - | - | - |
| Immobilien Schweiz | 4.74% | 5.00% | 30.00% |
| Immobilien Ausland (CHF hedged) | 0.25% | - | 10.00% |
| Alternative Anlagen (CHF hedged) | 2.01% | 5.00% | 15.00% |
| Total Aktien (In- und Ausland) | 73.84% | 75.00% | 50.00% |
| Total Fremdwährungen | 36.95% | 37.00% | 30.00% |

Grösste Aktienpositionen

| | |
|------------------------------|-------|
| NESTLE SA-REG | 5.08% |
| NOVARTIS AG-REG | 4.54% |
| ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN | 4.34% |
| MICROSOFT CORP | 2.17% |
| NVIDIA CORP | 2.14% |
| UBS GROUP AG-REG | 1.92% |
| ABB LTD-REG | 1.79% |
| ZURICH INSURANCE GROUP AG | 1.70% |
| CIE FINANCIERE RICHEMO-A REG | 1.64% |
| ALPHABET INC | 1.30% |

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 | 63.05% |
| USD | 25.08% |
| EUR | 2.74% |
| JPY | 2.34% |
| Übrige | 6.80% |

Eigenschaften der festverzinslichen Anlagen

| | |
|---------------------------|------|
| Modified Duration | 4.57 |
| Durchschnittliches Rating | A- |

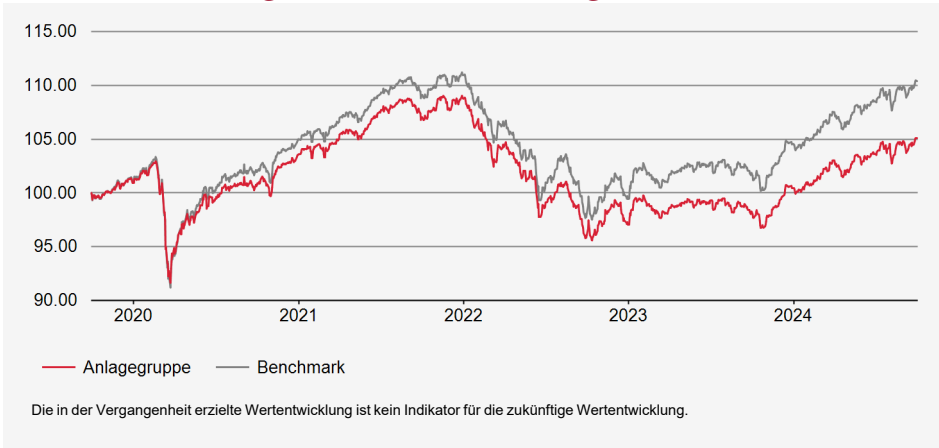
Anlagestiftung Swiss Life BVG-Mix 25 P

Nettovermögen (NAV) in Mio. CHF: 703.90
Nettovermögen pro Anspruch in CHF: 169.99

Anlagestrategie

Die Anlagegruppe BVG-Mix 25 P investiert im Durchschnitt ca. 25% in Aktien. Etwas über die Hälfte des Aktienanteils wird in schweizerische Dividendenpapiere angelegt, der Rest entfällt auf ausländische Gesellschaften. Durchschnittlich sind rund 53% des Vermögens in Obligationen investiert. Es gelten folgende Höchstgrenzen: 35% Aktien, 30% Fremdwährungen. BVG-Mix 25 P eignet sich für Anleger, die bereit sind, Kursschwankungen in Kauf zu nehmen. Wir empfehlen einen Anlagehorizont von über fünf Jahren.

Wertentwicklung in Referenzwährung (Basis 100)



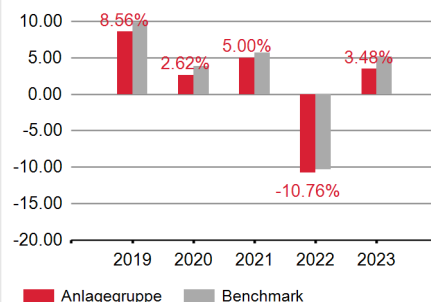
Performance in Referenzwährung

| | Kumulierte Performance | | | | Annualisierte Performance | | | |
|--------------|------------------------|---------|----------|--------|---------------------------|---------|----------|-------|
| | YTD | 1 Monat | 3 Monate | 1 Jahr | 3 Jahre | 5 Jahre | 10 Jahre | Aufl. |
| Anlagegruppe | 4.63% | 0.28% | 1.42% | 6.95% | -0.61% | 1.00% | 1.70% | 2.44% |
| Benchmark | 5.58% | 0.49% | 1.73% | 8.39% | 0.40% | 1.99% | 2.89% | 3.76% |

Statistische Angaben (annualisiert)

| | 1 Jahr | 3 Jahre | 5 Jahre | 10 Jahre | Aufl. |
|---------------------------------|--------|---------|---------|----------|--------|
| Volatilität Anlagegruppe (in %) | 3.31 | 4.81 | 5.10 | 4.28 | 4.09 |
| Volatilität Benchmark (in %) | 3.60 | 5.24 | 5.46 | 4.42 | 4.10 |
| Tracking Error ex post (in %) | 0.42 | 0.59 | 0.55 | 0.52 | 0.59 |
| Information Ratio | -3.45 | -1.72 | -1.80 | -2.29 | -2.26 |
| Sharpe Ratio | 1.58 | -0.27 | 0.17 | 0.46 | 0.55 |
| Korrelation | 1.00 | 1.00 | 1.00 | 0.99 | 0.99 |
| Beta | 0.92 | 0.91 | 0.93 | 0.96 | 0.99 |
| Jensen-Alpha | -0.86 | -1.03 | -0.87 | -1.07 | -1.28 |
| Maximum Drawdown (in %) | -1.93 | -12.33 | -12.33 | -12.33 | -15.36 |
| Recovery Period (Jahre) | 0.07 | - | - | - | 1.67 |

Performance



Produktinformationen

Valorennummer: 1436904

ISIN: CH0014369042

LEI: 5493000KUC3Z24U77V93

Bloomberg-Code: SLVOR25 SW

Benchmark: Customized

Währung: CHF

Domizil: Schweiz

Aufgatedatum: 30/09/2002

Erstausgabepreis: 100.00

Jahresabschluss: 30.09

Ausgabe/Rücknahme: Täglich

Annahmeschluss: 12.00 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: 1.39%

ex post per: 30/09/2024 1.42%

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.

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 | 1.96% | 2.00% | - |
| Hypotheken Schweiz | 0.89% | - | - |
| Obligationen CHF Inland | 15.00% | 16.00% | - |
| Obligationen CHF Ausland | 9.07% | 9.00% | - |
| Obligationen Fremdwährungen (CHF hedged) | 26.85% | 28.00% | - |
| Aktien Schweiz | 13.23% | 13.00% | - |
| Aktien Ausland | 12.02% | 12.00% | - |
| Aktien Ausland (CHF hedged) | - | - | - |
| Immobilien Schweiz | 15.28% | 13.00% | 30.00% |
| Immobilien Ausland (CHF hedged) | 3.22% | 2.00% | 10.00% |
| Alternative Anlagen (CHF hedged) | 2.47% | 5.00% | 15.00% |
| Total Aktien (In- und Ausland) | 25.25% | 25.00% | 50.00% |
| Total Fremdwährungen | 12.02% | 12.00% | 30.00% |

Grösste Aktienpositionen

| | |
|------------------------------|-------|
| NESTLE SA-REG | 1.82% |
| NOVARTIS AG-REG | 1.63% |
| ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN | 1.56% |
| MICROSOFT CORP | 0.71% |
| NVIDIA CORP | 0.70% |
| UBS GROUP AG-REG | 0.69% |
| ABB LTD-REG | 0.64% |
| ZURICH INSURANCE GROUP AG | 0.61% |
| CIE FINANCIERE RICHEMO-A REG | 0.59% |
| ALPHABET INC | 0.42% |

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% |

Portfoliostruktur nach Währungen

| | |
|--------|--------|
| CHF | 87.98% |
| USD | 8.16% |
| EUR | 0.89% |
| JPY | 0.76% |
| Übrige | 2.21% |

Eigenschaften der festverzinslichen Anlagen

| | |
|---------------------------|------|
| Modified Duration | 5.82 |
| Durchschnittliches Rating | A |

Nettovermögen (NAV) in Mio. CHF: 403.62
Nettovermögen pro Anspruch in CHF: 185.60

Anlagestrategie

Die Anlagegruppe BVG-Mix 35 P investiert im Durchschnitt ca. 35% in Aktien. Etwas über die Hälfte des Aktienanteils wird in schweizerische Dividendenpapiere angelegt, der Rest entfällt auf ausländische Gesellschaften. Durchschnittlich sind rund 45% des Vermögens in Obligationen investiert. Es gelten folgende Höchstgrenzen: 45% Aktien, 30% Fremdwährungen. BVG-Mix 35 P eignet sich für Anleger, die bereit sind, mittlere Kursschwankungen in Kauf zu nehmen. Wir empfehlen einen Anlagehorizont von über sieben Jahren.

Wertentwicklung in Referenzwährung (Basis 100)



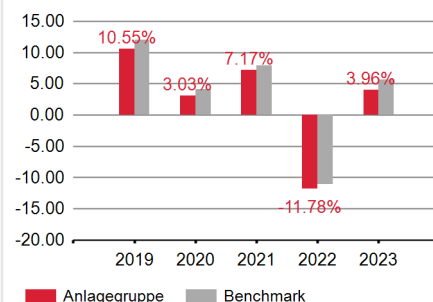
Performance in Referenzwährung

| | Kumulierte Performance | | | | Annualisierte Performance | | | |
|--------------|------------------------|---------|----------|--------|---------------------------|---------|----------|-------|
| | YTD | 1 Monat | 3 Monate | 1 Jahr | 3 Jahre | 5 Jahre | 10 Jahre | Aufl. |
| Anlagegruppe | 5.71% | 0.18% | 1.26% | 7.98% | -0.29% | 1.66% | 2.26% | 2.85% |
| Benchmark | 6.76% | 0.42% | 1.58% | 9.49% | 0.86% | 2.75% | 3.53% | 4.26% |

Statistische Angaben (annualisiert)

| | 1 Jahr | 3 Jahre | 5 Jahre | 10 Jahre | Aufl. |
|---------------------------------|--------|---------|---------|----------|--------|
| Volatilität Anlagegruppe (in %) | 4.11 | 5.72 | 6.06 | 5.27 | 5.16 |
| Volatilität Benchmark (in %) | 4.35 | 6.11 | 6.46 | 5.40 | 5.16 |
| Tracking Error ex post (in %) | 0.37 | 0.58 | 0.60 | 0.58 | 0.66 |
| Information Ratio | -4.05 | -1.98 | -1.80 | -2.19 | -2.16 |
| Sharpe Ratio | 1.50 | -0.17 | 0.25 | 0.48 | 0.51 |
| Korrelation | 1.00 | 1.00 | 1.00 | 0.99 | 0.99 |
| Beta | 0.94 | 0.93 | 0.94 | 0.97 | 0.99 |
| Jensen-Alpha | -1.06 | -1.14 | -0.92 | -1.15 | -1.38 |
| Maximum Drawdown (in %) | -2.97 | -13.60 | -13.60 | -13.60 | -22.51 |
| Recovery Period (Jahre) | - | - | - | - | 3.44 |

Performance



Produktinformationen

Valorennummer: 1436916

ISIN: CH0014369166

LEI: 254900SR5GM6HP44F130

Bloomberg-Code: SLVOR35 SW

Benchmark: Customized

Währung: CHF

Domizil: Schweiz

Aufledgedatum: 30/09/2002

Erstausgabepreis: 100.00

Jahresabschluss: 30.09

Ausgabe/Rücknahme: Täglich

Annahmeschluss: 12.00 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: 1.40%

ex post per: 30/09/2024 1.40%

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.

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 | 3.26% | 2.00% | - |
| Hypotheken Schweiz | 0.60% | - | - |
| Obligationen CHF Inland | 13.10% | 14.00% | - |
| Obligationen CHF Ausland | 7.13% | 7.00% | - |
| Obligationen Fremdwährungen (CHF hedged) | 24.95% | 24.00% | - |
| Aktien Schweiz | 17.88% | 18.00% | - |
| Aktien Ausland | 16.98% | 17.00% | - |
| Aktien Ausland (CHF hedged) | - | - | - |
| Immobilien Schweiz | 11.74% | 11.00% | 30.00% |
| Immobilien Ausland (CHF hedged) | 2.06% | 2.00% | 10.00% |
| Alternative Anlagen (CHF hedged) | 2.29% | 5.00% | 15.00% |
| Total Aktien (In- und Ausland) | 34.87% | 35.00% | 50.00% |
| Total Fremdwährungen | 16.98% | 17.00% | 30.00% |

Grösste Aktienpositionen

| | |
|------------------------------|-------|
| NESTLE SA-REG | 2.46% |
| NOVARTIS AG-REG | 2.20% |
| ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN | 2.10% |
| MICROSOFT CORP | 1.00% |
| NVIDIA CORP | 0.98% |
| UBS GROUP AG-REG | 0.93% |
| ABB LTD-REG | 0.87% |
| ZURICH INSURANCE GROUP AG | 0.83% |
| CIE FINANCIERE RICHEMO-A REG | 0.80% |
| ALPHABET INC | 0.60% |

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 | 83.02% |
| USD | 11.53% |
| EUR | 1.26% |
| JPY | 1.07% |
| Übrige | 3.12% |

Eigenschaften der festverzinslichen Anlagen

| | |
|---------------------------|------|
| Modified Duration | 5.68 |
| Durchschnittliches Rating | A |

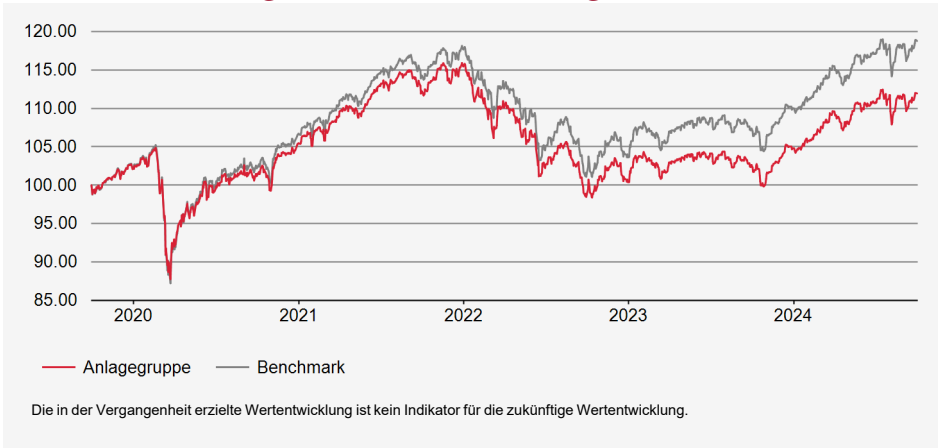
Anlagestiftung Swiss Life BVG-Mix 45 P

Nettovermögen (NAV) in Mio. CHF: 677.25
Nettovermögen pro Anspruch in CHF: 200.74

Anlagestrategie

Die Anlagegruppe BVG-Mix 45 P investiert im Durchschnitt ca. 45% in Aktien. Etwas über die Hälfte des Aktienanteils wird in schweizerische Dividendenpapiere angelegt, der Rest entfällt auf ausländische Gesellschaften. Durchschnittlich sind rund 37% des Vermögens in Obligationen investiert. Es gelten folgende Höchstgrenzen: 50% Aktien, 30% Fremdwährungen. BVG-Mix 45 P eignet sich für Anleger, die bereit sind, grössere Kursschwankungen in Kauf zu nehmen. Wir empfehlen einen Anlagehorizont von über zehn Jahren.

Wertentwicklung in Referenzwährung (Basis 100)



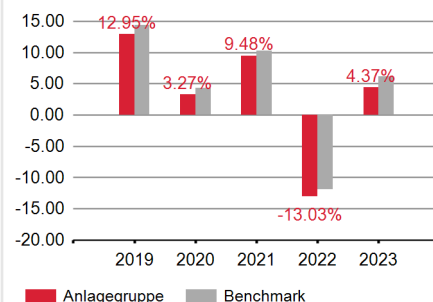
Performance in Referenzwährung

| | Kumulierte Performance | | | | Annualisierte Performance | | | |
|--------------|------------------------|---------|----------|--------|---------------------------|---------|----------|-------|
| | YTD | 1 Monat | 3 Monate | 1 Jahr | 3 Jahre | 5 Jahre | 10 Jahre | Aufl. |
| Anlagegruppe | 6.82% | 0.14% | 1.13% | 9.09% | -0.08% | 2.28% | 2.76% | 3.22% |
| Benchmark | 7.95% | 0.35% | 1.44% | 10.62% | 1.31% | 3.50% | 4.16% | 4.74% |

Statistische Angaben (annualisiert)

| | 1 Jahr | 3 Jahre | 5 Jahre | 10 Jahre | Aufl. |
|---------------------------------|--------|---------|---------|----------|--------|
| Volatilität Anlagegruppe (in %) | 5.01 | 6.71 | 7.20 | 6.41 | 6.34 |
| Volatilität Benchmark (in %) | 5.17 | 7.05 | 7.52 | 6.47 | 6.33 |
| Tracking Error ex post (in %) | 0.32 | 0.55 | 0.56 | 0.58 | 0.68 |
| Information Ratio | -4.82 | -2.51 | -2.16 | -2.42 | -2.26 |
| Sharpe Ratio | 1.44 | -0.12 | 0.29 | 0.47 | 0.47 |
| Korrelation | 1.00 | 1.00 | 1.00 | 1.00 | 0.99 |
| Beta | 0.97 | 0.95 | 0.96 | 0.99 | 1.00 |
| Jensen-Alpha | -1.24 | -1.36 | -1.07 | -1.34 | -1.51 |
| Maximum Drawdown (in %) | -4.02 | -15.10 | -16.28 | -16.28 | -29.17 |
| Recovery Period (Jahre) | - | - | 0.74 | 0.74 | 3.98 |

Performance



Produktinformationen

Valorennummer: 1436925

ISIN: CH0014369257

LEI: 2549001XL79VZWJO5Q69

Bloomberg-Code: SLVOR45 SW

Benchmark: Customized

Währung: CHF

Domizil: Schweiz

Aufledgedatum: 30/09/2002

Erstausgabepreis: 100.00

Jahresabschluss: 30.09

Ausgabe/Rücknahme: Täglich

Annahmeschluss: 12.00 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: 1.41%

ex post per: 30/09/2024 1.42%

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.

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 | 2.34% | 2.00% | - |
| Hypotheken Schweiz | 0.59% | - | - |
| Obligationen CHF Inland | 10.84% | 12.00% | - |
| Obligationen CHF Ausland | 4.96% | 5.00% | - |
| Obligationen Fremdwährungen (CHF hedged) | 21.35% | 20.00% | - |
| Aktien Schweiz | 23.11% | 23.00% | - |
| Aktien Ausland | 21.99% | 22.00% | - |
| Aktien Ausland (CHF hedged) | - | - | - |
| Immobilien Schweiz | 10.45% | 9.00% | 30.00% |
| Immobilien Ausland (CHF hedged) | 1.80% | 2.00% | 10.00% |
| Alternative Anlagen (CHF hedged) | 2.58% | 5.00% | 15.00% |
| Total Aktien (In- und Ausland) | 45.10% | 45.00% | 50.00% |
| Total Fremdwährungen | 21.99% | 22.00% | 30.00% |

Grösste Aktienpositionen

| | |
|------------------------------|-------|
| NESTLE SA-REG | 3.18% |
| NOVARTIS AG-REG | 2.84% |
| ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN | 2.72% |
| MICROSOFT CORP | 1.29% |
| NVIDIA CORP | 1.27% |
| UBS GROUP AG-REG | 1.20% |
| ABB LTD-REG | 1.12% |
| ZURICH INSURANCE GROUP AG | 1.07% |
| CIE FINANCIERE RICHEMO-A REG | 1.03% |
| ALPHABET INC | 0.77% |

Benchmarkzusammensetzung

| | |
|---|--------|
| 1M Saron | 2.00% |
| SBI Domestic AAA-BBB | 12.00% |
| SBI Foreign AAA-BBB | 5.00% |
| Bloomberg Gl. Agg. Treas. ex CH TR (CHF hedged) | 2.50% |
| Bloomberg Gl. Agg. Corp. TR (CHF hedged) | 6.50% |
| Bloomberg Gl. Agg. Corp. Short Term TR (CHF hedged) | 7.00% |
| JP Morgan CEMBI Broad Div IG Index (CHF hedged) | 4.00% |
| Swiss Performance Index | 23.00% |
| MSCI World ex CH ESG Leaders, in CHF | 17.60% |
| MSCI AC World Small Cap, in CHF | 3.30% |
| MSCI Emerging Markets, in CHF | 1.10% |
| KGAST Immo-Index | 9.00% |
| SL REF (LUX) German Core Real Estate (CHF hedged) | 2.00% |
| HFRX Global Hedge Funds (CHF hedged) | 5.00% |

Portfoliostruktur nach Währungen

| | |
|--------|--------|
| CHF | 78.01% |
| USD | 14.92% |
| EUR | 1.63% |
| JPY | 1.39% |
| Übrige | 4.05% |

Eigenschaften der festverzinslichen Anlagen

| | |
|---------------------------|------|
| Modified Duration | 5.74 |
| Durchschnittliches Rating | A |

Anlagestiftung Swiss Life

Obligationen CHF Inland PM

Nettovermögen (NAV) in Mio. CHF: 800.71
Nettovermögen pro Anspruch in CHF: 147.54

Anlagestrategie

Anlagen in auf CHF lautende Forderungspapiere von Schuldern mit Domizil hauptsächlich in der Schweiz. Aktive Titelselektion, Durationsteuerung und Zinskurvenpositionierung. Schuldnerbegrenzung: 10% (Ausnahmen: bis 25% in jedes Pfandbriefinstitut, Schweizerische Eidgenossenschaft ohne Begrenzung). Referenz-Indexfremde Schuldner: max. 10%. Durchschnittliche Ratingqualität: mindestens A+. Umsetzung mittels Einsatz des Swiss Life iFunds (CH) Bond Swiss Francs Domestic (CHF); Anlagefonds schweizerischen Rechts der Kategorie "Übrige Fonds für traditionelle Anlagen".

Wertentwicklung in Referenzwährung (Basis 100)



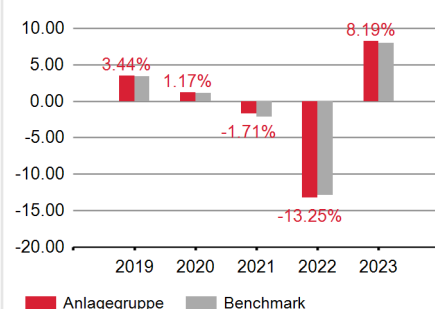
Performance in Referenzwährung

| | Kumulierte Performance | | | | Annualisierte Performance | | | |
|--------------|------------------------|---------|----------|--------|---------------------------|---------|----------|-------|
| | YTD | 1 Monat | 3 Monate | 1 Jahr | 3 Jahre | 5 Jahre | 10 Jahre | Aufl. |
| Anlagegruppe | 4.36% | 0.74% | 2.43% | 8.50% | -0.71% | -0.93% | 0.76% | 2.27% |
| Benchmark | 4.13% | 0.69% | 2.29% | 8.17% | -0.71% | -1.03% | 0.66% | 2.10% |

Statistische Angaben (annualisiert)

| | 1 Jahr | 3 Jahre | 5 Jahre | 10 Jahre | Aufl. |
|---------------------------------|--------|---------|---------|----------|--------|
| Volatilität Anlagegruppe (in %) | 3.64 | 6.04 | 5.75 | 4.74 | 4.06 |
| Volatilität Benchmark (in %) | 3.64 | 5.85 | 5.49 | 4.58 | 4.01 |
| Tracking Error ex post (in %) | 0.18 | 0.43 | 0.46 | 0.37 | 0.43 |
| Information Ratio | 1.83 | 0.01 | 0.23 | 0.25 | 0.39 |
| Sharpe Ratio | 1.83 | -0.23 | -0.19 | 0.22 | 0.55 |
| Korrelation | 1.00 | 1.00 | 1.00 | 1.00 | 0.99 |
| Beta | 1.00 | 1.03 | 1.04 | 1.03 | 1.01 |
| Jensen-Alpha | 0.34 | 0.05 | 0.16 | 0.06 | 0.15 |
| Maximum Drawdown (in %) | -2.14 | -16.04 | -17.99 | -19.21 | -19.21 |
| Recovery Period (Jahre) | 0.41 | - | - | - | - |

Performance



Produktinformationen

Valorennummer: 3026053
ISIN: CH0030260530
LEI: 254900M0YGKYAE29FA28
Bloomberg-Code: SLOCIPM SW
Benchmark: SBI Domestic AAA - BBB TR
Währung: CHF
Domizil: Schweiz
Aufledgedatum: 31/05/2007
Erstausgabepreis: 100.00
Jahresabschluss: 30.09
Ausgabe/Rücknahme: Täglich
Annahmeschluss: 13.00 Uhr
Ausgabe- / Rücknahmekommission: Keine
Ausschüttungspraxis: Thesaurierung
Asset Manager gemäss Swiss Life Best Select Invest Plus®: Swiss Life Asset Management AG
Überwachung Asset Manager: PPCmetrics unterstützt die laufende Überwachung des Asset Managers sowie die Beurteilung der Anlageresultate.
Kurspublikationen: Bloomberg: ASSL
www.swisslife.ch/anlagestiftung
Betriebsaufwandquote TER KGAST ex ante: 0.08%
ex post per: 30/09/2024 0.08%

PM-Tranche: Der Erwerb dieser Tranche ist nur im Rahmen einer speziellen Vereinbarung mit Swiss Life Asset Management AG möglich.

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.

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 Branchen

| | Anlagegruppe | Benchmark |
|-------------------------|--------------|-----------|
| Pfandbriefinstitute | 30.54% | 39.43% |
| Finanzwesen | 27.73% | 15.82% |
| Staatlich und staatsnah | 23.04% | 29.83% |
| Basiskonsumgüter | 7.93% | 7.01% |
| Versorgungsbetriebe | 5.13% | 2.49% |
| Industrie | 2.79% | 2.75% |
| Nicht-Basiskonsumgüter | 1.38% | 0.38% |
| Kommunikation | 0.50% | 0.92% |
| Andere | 0.23% | 1.38% |
| Liquidität | 0.73% | - |

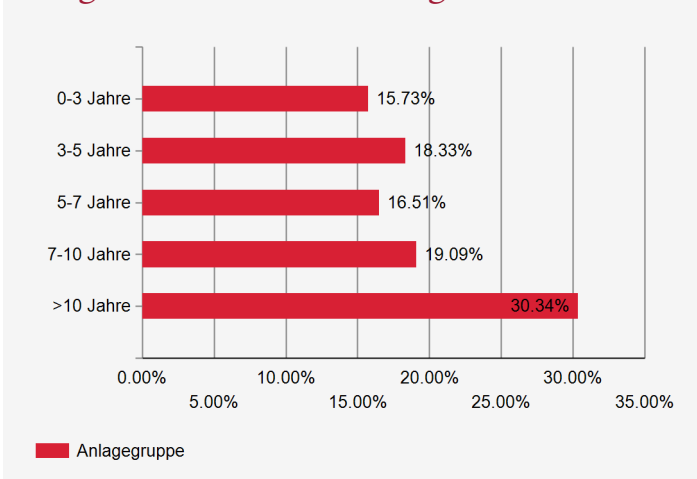
Grösste Schuldner und Rating

| | Rating | Anlagegruppe |
|--------------------|--------|--------------|
| Pfandbriefbank | AAA | 16.94% |
| Pfandbriefzentrale | AAA | 13.45% |
| Eidgenossenschaft | AAA | 13.37% |
| Stadt Zürich | AAA | 2.62% |
| UBS Group AG | AA- | 2.54% |

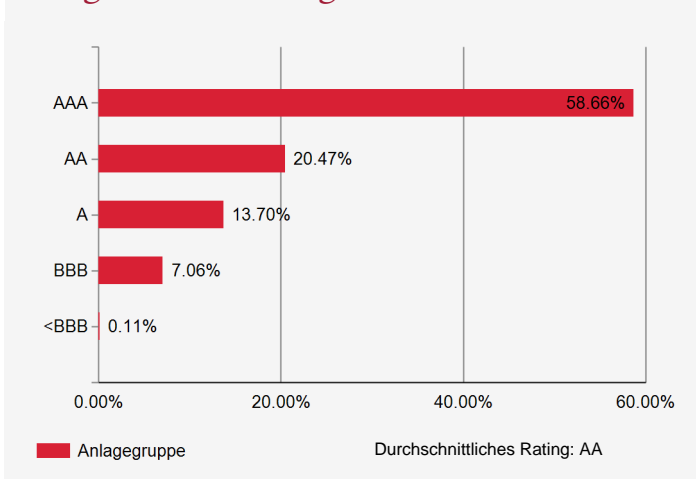
Weitere Angaben zu den Schuldnern

| | |
|----------------------------------|-------|
| Anzahl Schuldner | 113 |
| Anteil Benchmarkfremde Schuldner | 0.15% |

Fälligkeitstruktur der Anlagen



Anlagen nach Rating



Duration und Rendite auf Verfall

| | Anlagegruppe | Benchmark |
|-----------------------------------|--------------|-----------|
| Modified Duration* | 8.0 | 8.0 |
| Theoretische Rendite auf Verfall* | 0.89% | 0.79% |

* Vor Währungsabsicherung, unter Berücksichtigung der Derivate

Anlagestiftung Swiss Life

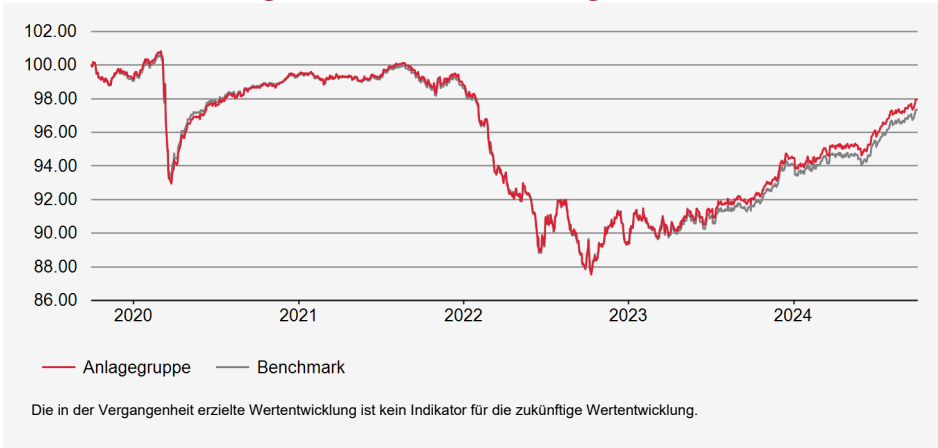
Obligationen CHF Ausland PM

Nettovermögen (NAV) in Mio. CHF: 305.94
Nettovermögen pro Anspruch in CHF: 136.40

Anlagestrategie

Anlagen in auf CHF lautende Forderungspapiere von Schuldern, die vorwiegend im Ausland domiziliert sind. Aktive Titelselektion, Durationsteuerung und Zinskurvenpositionierung. Schuldnerbegrenzung: 10%. Forderungspapiere benchmarkfremder Schuldner: max. 20%. Durchschnittliche Ratingqualität: mindestens A. Umsetzung mittels Einsatz des Swiss Life iFunds (CH) Bond Swiss Francs Foreign (CHF); Anlagefonds schweizerischen Rechts der Kategorie "Übrige Fonds für traditionelle Anlagen".

Wertentwicklung in Referenzwährung (Basis 100)



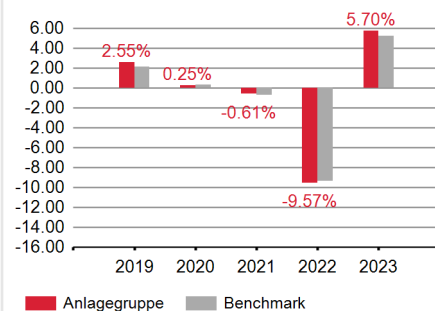
Performance in Referenzwährung

| | Kumulierte Performance | | | | Annualisierte Performance | | | |
|--------------|------------------------|---------|----------|--------|---------------------------|---------|----------|-------|
| | YTD | 1 Monat | 3 Monate | 1 Jahr | 3 Jahre | 5 Jahre | 10 Jahre | Aufl. |
| Anlagegruppe | 3.68% | 0.72% | 1.93% | 6.40% | -0.43% | -0.41% | 0.50% | 1.81% |
| Benchmark | 3.48% | 0.68% | 1.93% | 6.22% | -0.58% | -0.54% | 0.37% | 1.68% |

Statistische Angaben (annualisiert)

| | 1 Jahr | 3 Jahre | 5 Jahre | 10 Jahre | Aufl. |
|---------------------------------|--------|---------|---------|----------|--------|
| Volatilität Anlagegruppe (in %) | 1.97 | 3.92 | 4.47 | 3.40 | 3.47 |
| Volatilität Benchmark (in %) | 2.01 | 3.90 | 4.26 | 3.26 | 3.25 |
| Tracking Error ex post (in %) | 0.12 | 0.25 | 0.35 | 0.32 | 0.96 |
| Information Ratio | 1.58 | 0.63 | 0.36 | 0.41 | 0.13 |
| Sharpe Ratio | 2.39 | -0.29 | -0.13 | 0.24 | 0.51 |
| Korrelation | 1.00 | 1.00 | 1.00 | 1.00 | 0.96 |
| Beta | 0.98 | 1.00 | 1.05 | 1.04 | 1.03 |
| Jensen-Alpha | 0.29 | 0.16 | 0.16 | 0.10 | 0.07 |
| Maximum Drawdown (in %) | -0.97 | -12.02 | -13.18 | -13.71 | -13.71 |
| Recovery Period (Jahre) | 0.15 | - | - | - | - |

Performance



Produktinformationen

Valorennummer: 3026054
ISIN: CH0030260548
LEI: 2549002XPEQH1AZYBW05
Bloomberg-Code: SLOCAPM SW
Benchmark: SBI Foreign AAA - BBB TR
Währung: CHF
Domizil: Schweiz
Aufledgedatum: 31/05/2007
Erstausgabepreis: 100.00
Jahresabschluss: 30.09
Ausgabe/Rücknahme: Täglich
Annahmeschluss: 13.00 Uhr
Ausgabe- / Rücknahmekommission: Keine
Ausschüttungspraxis: Thesaurierung
Asset Manager gemäss Swiss Life Best Select Invest Plus®: Swiss Life Asset Management AG
Überwachung Asset Manager: PPCmetrics unterstützt die laufende Überwachung des Asset Managers sowie die Beurteilung der Anlageresultate.
Kurspublikationen: Bloomberg: ASSL
www.swisslife.ch/anlagestiftung
Betriebsaufwandquote TER KGAST ex ante: 0.08%
ex post per: 30/09/2024 0.08%

PM-Tranche: Der Erwerb dieser Tranche ist nur im Rahmen einer speziellen Vereinbarung mit Swiss Life Asset Management AG möglich.

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.

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 Branchen

| | Anlagegruppe | Benchmark |
|-------------------------|--------------|-----------|
| Finanzwesen | 65.90% | 48.12% |
| Staatlich und staatsnah | 7.70% | 15.55% |
| Pfandbriefinstitute | 6.20% | 16.72% |
| Nicht-Basiskonsumgüter | 3.74% | 3.49% |
| Versorgungsbetriebe | 3.73% | 2.78% |
| Industrie | 3.01% | 5.30% |
| Basiskonsumgüter | 2.62% | 4.04% |
| Energie | 1.06% | 1.23% |
| Supranational | 4.73% | - |
| Andere | 1.43% | 2.78% |
| Liquidität | -0.13% | - |

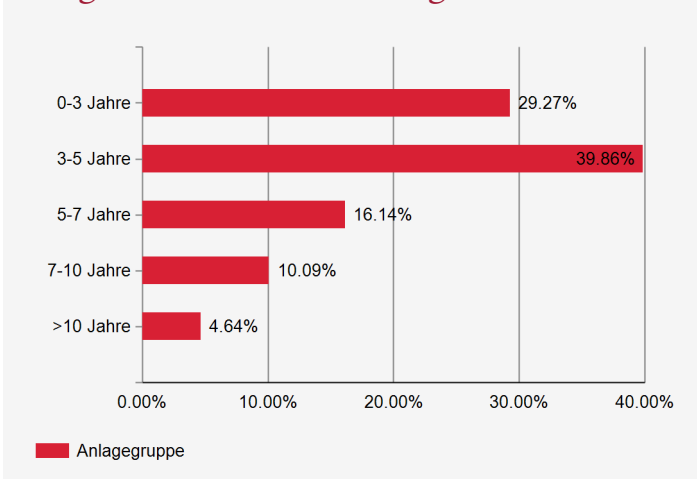
Grösste Schuldner und Rating

| | Rating | Anlagegruppe |
|----------------------------|--------|--------------|
| Banco Santander SA, Madrid | A+ | 4.35% |
| Bank of Nova Scotia/The | AA | 3.95% |
| Groupe BPCE | AA- | 3.83% |
| Müchener Hypothekenbank | AA | 3.71% |
| Credit Agricole Group | AA- | 3.28% |

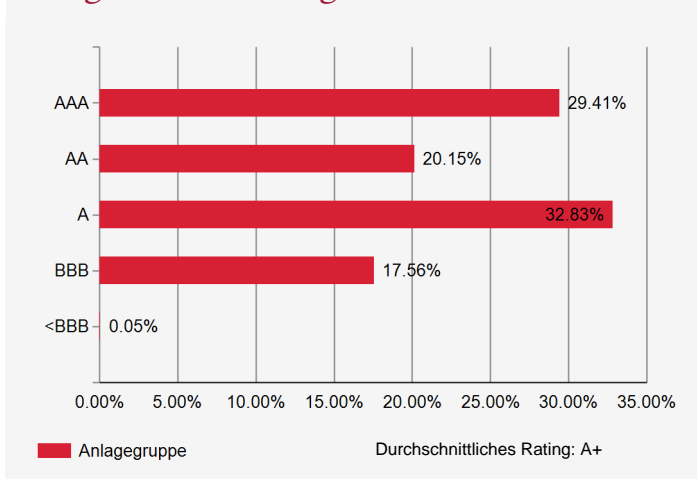
Weitere Angaben zu den Schuldnern

| | |
|----------------------------------|-------|
| Anzahl Schuldner | 113 |
| Anteil Benchmarkfremde Schuldner | 2.41% |

Fälligkeitstruktur der Anlagen



Anlagen nach Rating



Duration und Rendite auf Verfall

| | Anlagegruppe | Benchmark |
|-----------------------------------|--------------|-----------|
| Modified Duration* | 4.2 | 4.2 |
| Theoretische Rendite auf Verfall* | 1.17% | 1.05% |

* Vor Währungsabsicherung, unter Berücksichtigung der Derivate

Portfoliostruktur nach Ländern/Regionen

| | Anlagegruppe | Benchmark |
|-------------------------------|--------------|-----------|
| Frankreich | 16.28% | 16.23% |
| Deutschland | 14.97% | 13.38% |
| Kanada | 12.68% | 11.86% |
| Vereinigte Staaten | 9.95% | 12.19% |
| Australien | 6.08% | 6.67% |
| Spanien | 5.98% | 4.65% |
| Vereinigtes Königreich | 4.71% | 4.45% |
| Europäische Region (Ex EUR) | 8.54% | 6.59% |
| Europäische Region (EUR) | 5.45% | 9.60% |
| Schwellenländer Lateinamerika | 5.39% | 4.05% |
| Andere | 10.11% | 10.35% |
| Liquidität, Absicherung | -0.13% | - |

Anlagestiftung Swiss Life

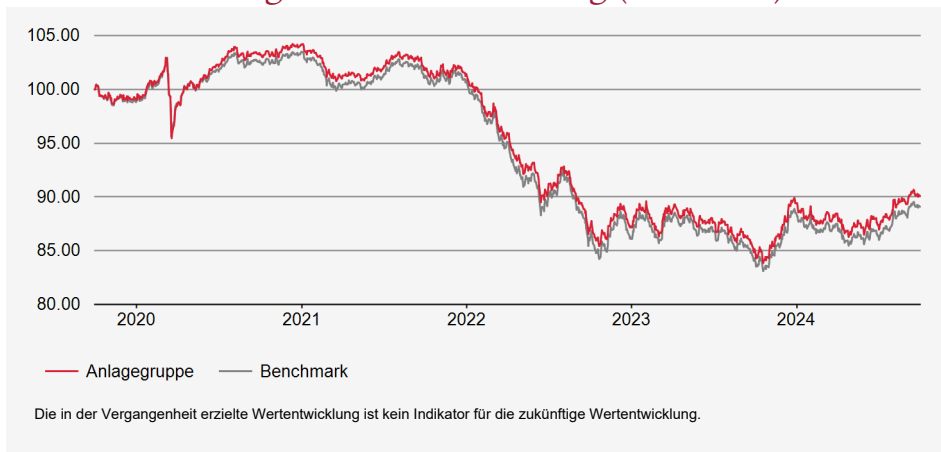
Obligationen Global PM (CHF hedged)

Nettovermögen (NAV) in Mio. CHF: 149.41
Nettovermögen pro Anspruch in CHF: 121.00

Anlagestrategie

Anlagen in Forderungspapiere von Schuldern mit Domizil im In- oder Ausland (seit 1.1.2011 CHF hedged). Aktive Titelselektion, Durationsteuerung und Zinskurvenpositionierung. Schuldnerbegrenzung: 10% (Ausnahme: sofern in der Benchmark vertreten, max. 5%-Punkte mehr als Benchmarkgewichtung). Forderungspapiere benchmarkfremder Schuldner: max.10%. Durchschnittliche Ratingqualität: mindestens A-. Fremdwährungsrisiken werden zu mindestens 90% gegen Schweizerfranken abgesichert. Umsetzung mittels Einsatz Swiss Life iFunds (CH) Bond Global Aggregate (CHF hedged); Anlagefonds schweizerischen Rechts der Kategorie "Übrige Fonds für traditionelle Anlagen".

Wertentwicklung in Referenzwährung (Basis 100)



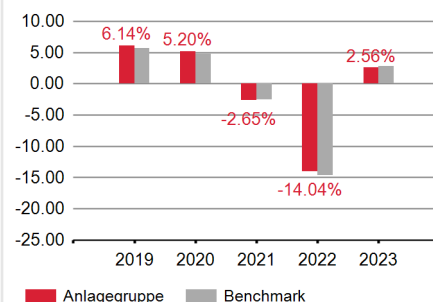
Performance in Referenzwährung

| | Kumulierte Performance | | | | Annualisierte Performance | | | |
|--------------|------------------------|---------|----------|--------|---------------------------|---------|----------|-------|
| | YTD | 1 Monat | 3 Monate | 1 Jahr | 3 Jahre | 5 Jahre | 10 Jahre | Aufl. |
| Anlagegruppe | 0.75% | 0.83% | 3.08% | 5.80% | -3.98% | -2.06% | -0.04% | 1.10% |
| Benchmark | 0.65% | 0.88% | 3.15% | 5.68% | -4.11% | -2.28% | -0.18% | 0.84% |

Statistische Angaben (annualisiert)

| | 1 Jahr | 3 Jahre | 5 Jahre | 10 Jahre | Aufl. |
|---------------------------------|--------|---------|---------|----------|--------|
| Volatilität Anlagegruppe (in %) | 5.46 | 5.87 | 5.24 | 4.26 | 5.61 |
| Volatilität Benchmark (in %) | 5.37 | 6.12 | 5.38 | 4.35 | 5.62 |
| Tracking Error ex post (in %) | 0.28 | 0.58 | 0.51 | 0.56 | 1.37 |
| Information Ratio | 0.41 | 0.22 | 0.42 | 0.25 | 0.19 |
| Sharpe Ratio | 0.76 | -0.81 | -0.43 | 0.06 | 0.19 |
| Korrelation | 1.00 | 1.00 | 1.00 | 0.99 | 0.97 |
| Beta | 1.02 | 0.95 | 0.97 | 0.97 | 0.97 |
| Jensen-Alpha | 0.05 | -0.10 | 0.14 | 0.14 | 0.29 |
| Maximum Drawdown (in %) | -4.04 | -18.05 | -19.52 | -19.52 | -19.52 |
| Recovery Period (Jahre) | 0.36 | - | - | - | - |

Performance



Produktinformationen

Valorennummer: 3026055
ISIN: CH0030260555
LEI: 254900F82G5L48XPDV74
Bloomberg-Code: SLOFGPM SW
Benchmark: BLOOMBERG GLO AGG EX SEC EX CNY HEDGED CHF
Währung: CHF
Domizil: Schweiz
Aufliedatum: 31/05/2007
Erstausgabepreis: 100.00
Jahresabschluss: 30.09
Ausgabe/Rücknahme: Täglich
Annahmeschluss: 13.00 Uhr
Ausgabe- / Rücknahmekommission: Keine
Ausschüttungspraxis: Thesaurierung
Asset Manager gemäss Swiss Life Best Select Invest Plus@: Swiss Life Asset Management AG
Überwachung Asset Manager: PPCmetrics unterstützt die laufende Überwachung des Asset Managers sowie die Beurteilung der Anlageregebnisse.
Kurspublikationen: Bloomberg: ASSL
www.swisslife.ch/anlagestiftung
Betriebsaufwandquote TER KGAST ex ante: 0.15%
ex post per: 30/09/2024 0.15%

PM-Tranche: Der Erwerb dieser Tranche ist nur im Rahmen einer speziellen Vereinbarung mit Swiss Life Asset Management AG möglich.

Benchmark: Die Benchmark wurde per 1. Juli 2012 gewechselt. Für Informationen betreffend die frühere Benchmark wenden Sie sich bitte an die Anlagestiftung Swiss Life.

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.

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

Obligationen Global PM (CHF hedged)

Portfoliostruktur nach Branchen

| | Anlagegruppe | Benchmark |
|-------------------------|--------------|-----------|
| Staatlich und staatsnah | 52.04% | 72.55% |
| Finanzwesen | 18.94% | 11.42% |
| Basiskonsumgüter | 6.85% | 4.01% |
| Kommunikation | 2.81% | 1.95% |
| Nicht-Basiskonsumgüter | 2.40% | 1.81% |
| Versorgungsbetriebe | 1.94% | 2.71% |
| Technologie | 1.48% | 1.10% |
| Energie | 1.38% | 1.67% |
| Supranational | 5.05% | - |
| Andere | 1.94% | 2.78% |
| Liquidität | 5.26% | - |
| Währungsabsicherung | -0.09% | - |

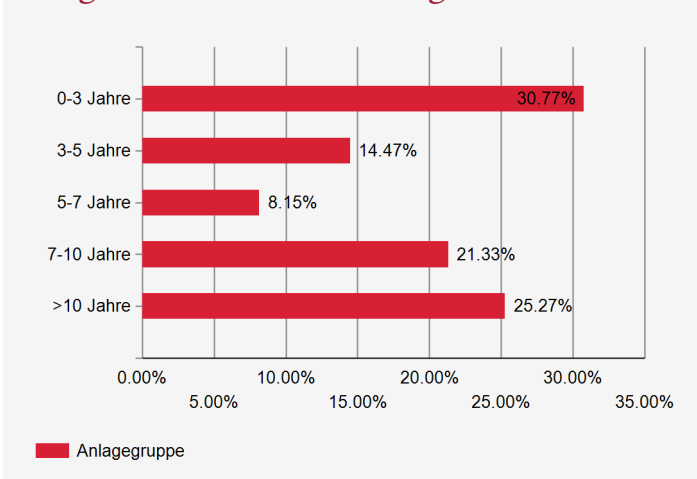
Grösste Schuldner und Rating

| | Rating | Anlagegruppe |
|-----------------|--------|--------------|
| Japan | A+ | 17.44% |
| US Treasury N/B | AAA | 8.85% |
| Italien | BBB | 5.45% |
| Spanien | A | 2.56% |
| BNG Bank NV | AAA | 1.97% |

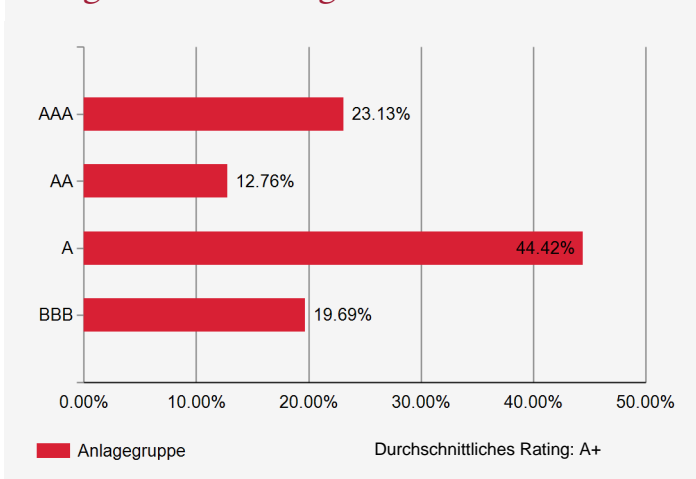
Weitere Angaben zu den Schuldnern

| | |
|----------------------------------|-------|
| Anzahl Schuldner | 149 |
| Anteil Benchmarkfremde Schuldner | 0.00% |

Fälligkeitstruktur der Anlagen



Anlagen nach Rating



Duration und Rendite auf Verfall

| | Anlagegruppe | Benchmark |
|-----------------------------------|--------------|-----------|
| Modified Duration* | 7.2 | 6.9 |
| Theoretische Rendite auf Verfall* | 3.47% | 3.42% |

* Vor Währungsabsicherung, unter Berücksichtigung der Derivate

Portfoliostruktur nach Ländern/Regionen

| | Anlagegruppe | Benchmark |
|-------------------------------|--------------|-----------|
| Vereinigte Staaten | 25.14% | 37.17% |
| Japan | 20.41% | 13.69% |
| Kanada | 8.10% | 4.37% |
| Italien | 6.81% | 4.00% |
| Deutschland | 5.41% | 5.87% |
| Frankreich | 5.24% | 6.18% |
| Vereinigtes Königreich | 3.78% | 5.48% |
| Europäische Region (EUR) | 11.10% | 8.90% |
| Europäische Region (Ex EUR) | 3.57% | 1.59% |
| Schwellenländer Lateinamerika | 1.66% | 0.04% |
| Andere | 3.61% | 12.72% |
| Liquidität, Absicherung | 5.17% | - |

Anlagestiftung Swiss Life

Obligationen Global Staaten+ PM (CHF hedged)

Nettovermögen (NAV) in Mio. CHF: 866.06
Nettovermögen pro Anspruch in CHF: 112.07

Anlagestrategie

Anlagen in Forderungspapiere von Staaten und staatsnahen Institutionen. Aktive Titelselektion, Durationsteuerung und Zinskurvenpositionierung. Schuldnerbegrenzung: 10% (Ausnahme: sofern in der Benchmark vertreten, max. 5%-Punkte mehr als Benchmarkgewichtung). Forderungspapiere benchmarkfremder Schuldner: max. 10%. Durchschnittliche Ratingqualität: mindestens A+. Fremdwährungsrisiken werden zu mindestens 90% gegen Schweizerfranken abgesichert. Umsetzung mittels Einsatz des Swiss Life iFunds (CH) Bond Global Government+ (CHF hedged); Anlagefonds schweizerischen Rechts der Kategorie "Übrige Fonds für traditionelle Anlagen".

Wertentwicklung in Referenzwährung (Basis 100)



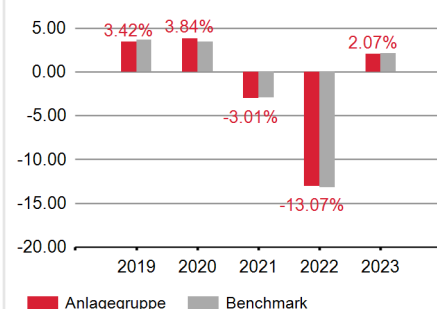
Performance in Referenzwährung

| | Kumulierte Performance | | | | Annualisierte Performance | | | |
|--------------|------------------------|---------|----------|--------|---------------------------|---------|----------|-------|
| | YTD | 1 Monat | 3 Monate | 1 Jahr | 3 Jahre | 5 Jahre | 10 Jahre | Aufl. |
| Anlagegruppe | 0.56% | 0.64% | 2.82% | 5.02% | -3.85% | -2.51% | -0.37% | 0.83% |
| Benchmark | 0.56% | 0.72% | 2.78% | 4.79% | -3.81% | -2.58% | -0.41% | 0.59% |

Statistische Angaben (annualisiert)

| | 1 Jahr | 3 Jahre | 5 Jahre | 10 Jahre | Aufl. |
|---------------------------------|--------|---------|---------|----------|--------|
| Volatilität Anlagegruppe (in %) | 4.88 | 5.04 | 4.33 | 3.71 | 3.57 |
| Volatilität Benchmark (in %) | 4.60 | 5.15 | 4.39 | 3.80 | 3.53 |
| Tracking Error ex post (in %) | 0.34 | 0.57 | 0.60 | 0.59 | 0.69 |
| Information Ratio | 0.68 | -0.07 | 0.13 | 0.07 | 0.35 |
| Sharpe Ratio | 0.70 | -0.92 | -0.62 | -0.02 | 0.29 |
| Korrelation | 1.00 | 0.99 | 0.99 | 0.99 | 0.98 |
| Beta | 1.06 | 0.97 | 0.98 | 0.96 | 0.99 |
| Jensen-Alpha | 0.04 | -0.17 | 0.01 | 0.04 | 0.25 |
| Maximum Drawdown (in %) | -3.60 | -17.01 | -19.23 | -19.23 | -19.23 |
| Recovery Period (Jahre) | 0.28 | - | - | - | - |

Performance



Produktinformationen

Valorennummer: 11956107

ISIN: CH0119561071

LEI: 254900H7WEVS3K9ANR90

Bloomberg-Code: SWLGS PM SW

Benchmark: BLOOMBERG GLOBAL AGG TREAS EX CHF TR HEDGED CHF

Währung: CHF

Domizil: Schweiz

Auflagedatum: 14/12/2010

Erstausgabepreis: 100.00

Jahresabschluss: 30.09

Ausgabe/Rücknahme: Täglich

Annahmeschluss: 13.00 Uhr

Ausgabe- / Rücknahmekommission: Keine

Ausschüttungspraxis: Thesaurierung

Asset Manager gemäss

Swiss Life Best Select Invest Plus@: Swiss Life Asset Management AG

Überwachung Asset Manager: PPCmetrics unterstützt die laufende Überwachung des Asset Managers sowie die Beurteilung der Anlageresultate.

Kurspublikationen: Bloomberg: ASSL
www.swisslife.ch/anlagestiftung

Betriebsaufwandquote TER KGAST

ex ante: 0.15%

ex post per: 30/09/2024 0.15%

PM-Tranche: Der Erwerb dieser Tranche ist nur im Rahmen einer speziellen Vereinbarung mit Swiss Life Asset Management AG möglich.

Benchmark: Die Benchmark wurde per 1. Juli 2012 gewechselt. Für Informationen betreffend die frühere Benchmark wenden Sie sich bitte an die Anlagestiftung Swiss Life.

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.

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

Obligationen Global Staaten+ PM (CHF hedged)

Portfoliostruktur nach Branchen

| | Anlagegruppe | Benchmark |
|-------------------------|--------------|-----------|
| Staatlich und staatsnah | 76.59% | 100.00% |
| Finanzwesen | 6.78% | - |
| Pfandbriefinstitute | 3.56% | - |
| Industrie | 0.08% | - |
| Supranational | 4.27% | - |
| Liquidität | 8.59% | - |
| Währungsabsicherung | 0.11% | - |

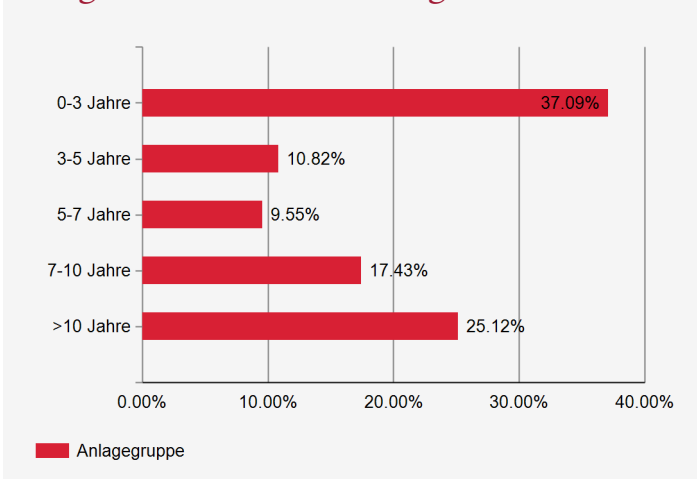
Grösste Schuldner und Rating

| | | Anlagegruppe |
|----------------------------|------|--------------|
| Japan | A+ | 21.87% |
| US Treasury N/B | AAA | 14.44% |
| Italien | BBB- | 5.73% |
| People's Republic of China | A+ | 5.38% |
| Spanien | A- | 4.64% |

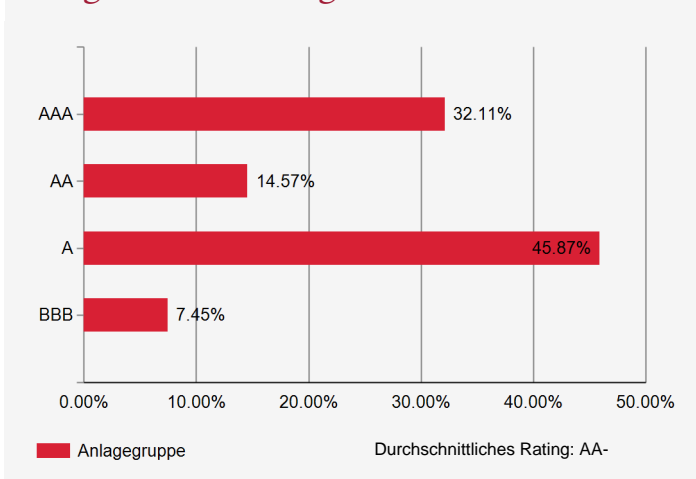
Weitere Angaben zu den Schuldnern

| | |
|----------------------------------|-------|
| Anzahl Schuldner | 65 |
| Anteil Benchmarkfremde Schuldner | 3.30% |

Fälligkeitstruktur der Anlagen



Anlagen nach Rating



Duration und Rendite auf Verfall

| | Anlagegruppe | Benchmark |
|-----------------------------------|--------------|-----------|
| Modified Duration* | 7.4 | 7.3 |
| Theoretische Rendite auf Verfall* | 3.03% | 2.92% |

* Vor Währungsabsicherung, unter Berücksichtigung der Derivate

Portfolio nach Währungen und Duration

| | Anlagegruppe | | Benchmark | |
|--------|--------------|----------|------------|----------|
| | Gewichtung | Duration | Gewichtung | Duration |
| JPY | 31.78% | 4.73 | 17.98% | 8.92 |
| EUR | 21.87% | 10.03 | 23.12% | 7.17 |
| USD | 18.19% | 12.31 | 33.43% | 6.01 |
| GBP | 9.08% | 8.72 | 5.54% | 8.99 |
| Andere | 19.07% | 7.28 | 19.94% | 7.11 |

Portfoliostruktur nach Ländern/Regionen

| | Anlagegruppe | Benchmark |
|-----------------------------|--------------|-----------|
| Japan | 24.39% | 17.98% |
| Vereinigte Staaten | 15.99% | 33.43% |
| Italien | 6.33% | 5.02% |
| China | 5.95% | 9.51% |
| Spanien | 5.28% | 3.28% |
| Vereinigtes Königreich | 4.97% | 5.54% |
| Deutschland | 3.73% | 4.37% |
| Europäische Region (EUR) | 10.92% | 9.68% |
| Europäische Region (Ex EUR) | 4.94% | 0.45% |
| Asien-Pazifik-Raum | 1.84% | 1.35% |
| Andere | 6.95% | 9.40% |
| Liquidität, Absicherung | 8.71% | - |



Anlagestiftung Swiss Life Obligationen Global Unternehmen Short Term PM (CHF hedged)

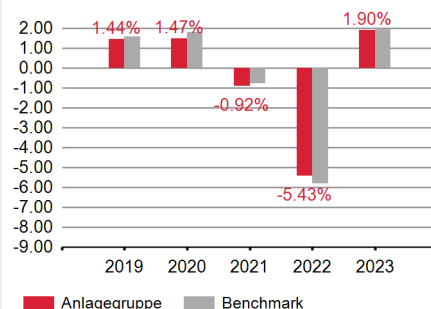
SwissLife

Nettovermögen (NAV) in Mio. CHF: 1'376.35
Nettovermögen pro Anspruch in CHF: 101.54

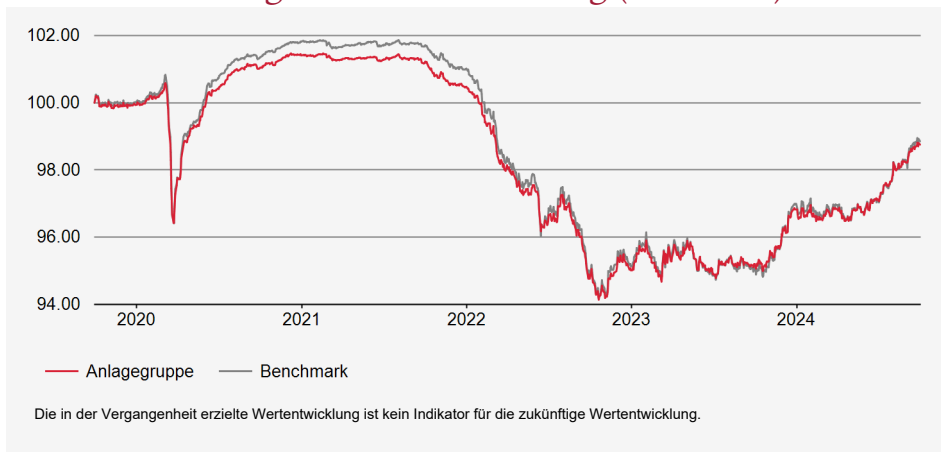
Anlagestrategie

Anlagen in Forderungspapiere von Unternehmen inklusive Agencies und Supranationals mit einer kurzen Restlaufzeit (mehrheitlich unter 3 Jahren). Aktive Titelselektion, Durationsteuerung und Zinskurvenpositionierung. Schuldnerbegrenzung: 10%. Forderungspapiere benchmarkfremder Schuldner: max. 10%. Durchschnittliche Ratingqualität: mindestens BBB. Fremdwährungsrisiken werden zu mindestens 90% gegen Schweizerfranken abgesichert. Umsetzung mittels Einsatz des Swiss Life iFunds (CH) Bond Global Corporates Short Term (CHF hedged); Anlagefonds schweizerischen Rechts der Kategorie "Übrige Fonds für traditionelle Anlagen".

Performance



Wertentwicklung in Referenzwährung (Basis 100)



Produktinformationen

Valorennummer: 22073695

ISIN: CH0220736950

LEI: 2549003DSGO0RN37K507

Bloomberg-Code: SWLOGPM SW

Benchmark: BLOOMBERG GLO AGG
CORP 1-3 YR IND HEDGED CHF

Währung: CHF

Domizil: Schweiz

Aufliedatum: 11/10/2013

Erstausgabepreis: 100.00

Jahresabschluss: 30.09

Ausgabe/Rücknahme: Täglich

Annahmeschluss: 13.00 Uhr

Ausgabe- / Rücknahmekommission:
Keine

Ausschüttungspraxis: Thesaurierung

Asset Manager gemäss

Swiss Life Best Select Invest Plus@:
Swiss Life Asset Management AG

Überwachung Asset Manager:
PPCmetrics unterstützt die laufende Überwachung des Asset Managers sowie die Beurteilung der Anlageresultate.

Kurspublikationen: Bloomberg: ASSL
www.swisslife.ch/anlagestiftung

Betriebsaufwandquote TER KGAST

ex ante: 0.15%

ex post per: 30/09/2024 0.15%

Performance in Referenzwährung

| | Kumulierte Performance | | | | Annualisierte Performance | | | |
|--------------|------------------------|---------|----------|--------|---------------------------|---------|----------|-------|
| | YTD | 1 Monat | 3 Monate | 1 Jahr | 3 Jahre | 5 Jahre | 10 Jahre | Aufl. |
| Anlagegruppe | 1.99% | 0.54% | 1.68% | 3.73% | -0.80% | -0.25% | -0.04% | 0.14% |
| Benchmark | 1.92% | 0.58% | 1.83% | 3.97% | -0.93% | -0.23% | -0.09% | 0.07% |

Statistische Angaben (annualisiert)

| | 1 Jahr | 3 Jahre | 5 Jahre | 10 Jahre | Aufl. |
|---------------------------------|--------|---------|---------|----------|-------|
| Volatilität Anlagegruppe (in %) | 1.36 | 2.14 | 2.22 | 1.67 | 1.61 |
| Volatilität Benchmark (in %) | 1.68 | 2.35 | 2.39 | 1.76 | 1.69 |
| Tracking Error ex post (in %) | 0.37 | 0.31 | 0.27 | 0.32 | 0.32 |
| Information Ratio | -0.65 | 0.41 | -0.07 | 0.16 | 0.23 |
| Sharpe Ratio | 1.59 | -0.70 | -0.18 | 0.15 | 0.26 |
| Korrelation | 0.99 | 0.99 | 1.00 | 0.98 | 0.98 |
| Beta | 0.81 | 0.90 | 0.92 | 0.93 | 0.94 |
| Jensen-Alpha | 0.23 | -0.04 | -0.05 | 0.06 | 0.09 |
| Maximum Drawdown (in %) | -0.49 | -6.99 | -7.22 | -7.22 | -7.22 |
| Recovery Period (Jahre) | 0.25 | - | - | - | - |

PM-Tranche: Der Erwerb dieser Tranche ist nur im Rahmen einer speziellen Vereinbarung mit Swiss Life Asset Management AG möglich.

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.

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 Obligationen Global Unternehmen Short Term PM (CHF hedged)

Portfoliostruktur nach Branchen

| | Anlagegruppe | Benchmark |
|------------------------|--------------|-----------|
| Finanzwesen | 53.44% | 50.99% |
| Basiskonsumgüter | 11.59% | 12.11% |
| Nicht-Basiskonsumgüter | 8.52% | 9.88% |
| Kommunikation | 4.67% | 5.39% |
| Energie | 4.08% | 4.13% |
| Technologie | 3.75% | 4.08% |
| Industrie | 3.36% | 5.91% |
| Versorgungsbetriebe | 2.52% | 5.24% |
| Andere | 2.88% | 2.28% |
| Liquidität | 3.58% | - |
| Währungsabsicherung | 1.60% | - |

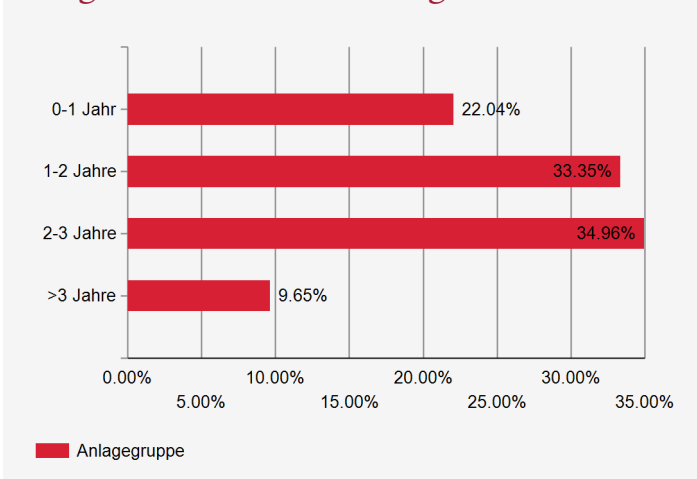
Grösste Schuldner und Rating

| | | Anlagegruppe |
|------------------------------|------|--------------|
| Banco Santander SA, Madrid | A- | 3.06% |
| Credit Agricole Group | BBB+ | 2.65% |
| Citigroup Inc | BBB+ | 2.33% |
| Barclays Capital PLC, London | BBB | 2.14% |
| Morgan Stanley NE US | A | 2.03% |

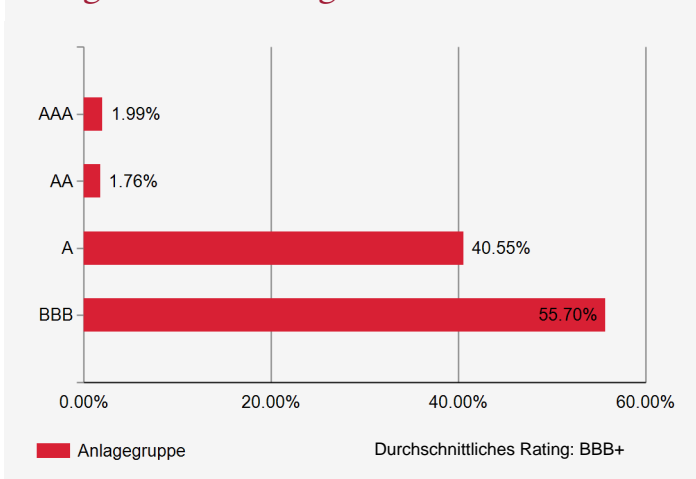
Weitere Angaben zu den Schuldnern

| | |
|----------------------------------|-------|
| Anzahl Schuldner | 149 |
| Anteil Benchmarkfremde Schuldner | 6.63% |

Fälligkeitstruktur der Anlagen



Anlagen nach Rating



Duration und Rendite auf Verfall

| | Anlagegruppe | Benchmark |
|-----------------------------------|--------------|-----------|
| Modified Duration* | 1.9 | 1.8 |
| Theoretische Rendite auf Verfall* | 3.76% | 3.89% |

* Vor Währungsabsicherung, unter Berücksichtigung der Derivate

Portfolio nach Währungen und Duration

| | Anlagegruppe | | Benchmark | |
|--------|--------------|----------|------------|----------|
| | Gewichtung | Duration | Gewichtung | Duration |
| USD | 58.79% | 1.89 | 60.04% | 1.88 |
| EUR | 25.44% | 1.97 | 29.79% | 1.96 |
| CHF | 11.25% | 1.31 | 0.47% | 1.91 |
| GBP | 3.47% | 1.47 | 3.86% | 1.89 |
| Andere | 1.05% | 2.00 | 5.84% | 1.97 |

Portfoliostruktur nach Ländern/Regionen

| | Anlagegruppe | Benchmark |
|-------------------------------|--------------|-----------|
| Vereinigte Staaten | 34.19% | 45.94% |
| Frankreich | 8.95% | 7.59% |
| Vereinigtes Königreich | 7.84% | 6.85% |
| Kanada | 7.56% | 5.77% |
| Deutschland | 6.45% | 6.20% |
| Schweiz | 6.14% | 2.05% |
| Spanien | 5.60% | 3.33% |
| Europäische Region (EUR) | 6.14% | 6.62% |
| Schwellenländer Asien Pazifik | 4.69% | 2.36% |
| Asien-Pazifik-Raum | 3.55% | 4.63% |
| Andere | 3.70% | 8.67% |
| Liquidität, Absicherung | 5.19% | - |

Anlagestiftung Swiss Life

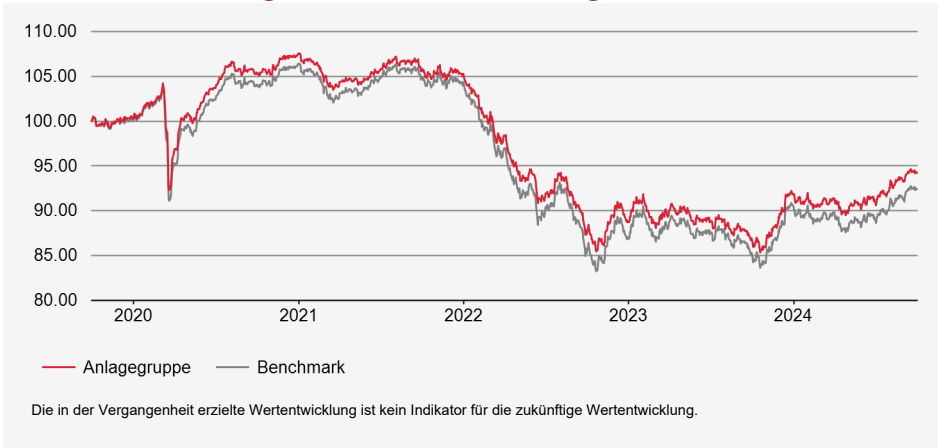
Obligationen Global Unternehmen PM (CHF hedged)

Nettovermögen (NAV) in Mio. CHF: 811.36
Nettovermögen pro Anspruch in CHF: 129.03

Anlagestrategie

Anlagen in Forderungspapiere von Unternehmen inklusive Agencies und Supranationals. Aktive Titelselektion, Durationsteuerung und Zinskurvenpositionierung. Schuldnerbegrenzung: 10%. Forderungspapiere benchmarkfremder Schuldner: max.10%. Durchschnittliche Ratingqualität: mindestens BBB. Fremdwährungsrisiken werden zu mindestens 90% gegen Schweizerfranken abgesichert. Umsetzung mittels Einsatz des Swiss Life iFunds (CH) Bond Global Corporates (CHF hedged); Anlagefonds schweizerischen Rechts der Kategorie "Übrige Fonds für traditionelle Anlagen".

Wertentwicklung in Referenzwährung (Basis 100)



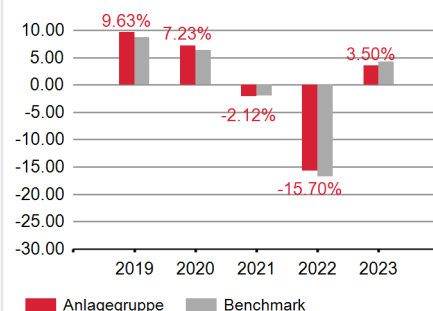
Performance in Referenzwährung

| | Kumulierte Performance | | | | Annualisierte Performance | | | |
|--------------|------------------------|---------|----------|--------|---------------------------|---------|----------|-------|
| | YTD | 1 Monat | 3 Monate | 1 Jahr | 3 Jahre | 5 Jahre | 10 Jahre | Aufl. |
| Anlagegruppe | 2.58% | 1.02% | 3.56% | 8.41% | -3.71% | -1.18% | 0.55% | 1.86% |
| Benchmark | 2.01% | 1.22% | 3.81% | 8.31% | -4.05% | -1.56% | 0.30% | 1.44% |

Statistische Angaben (annualisiert)

| | 1 Jahr | 3 Jahre | 5 Jahre | 10 Jahre | Aufl. |
|---------------------------------|--------|---------|---------|----------|--------|
| Volatilität Anlagegruppe (in %) | 5.72 | 6.99 | 6.81 | 5.40 | 5.18 |
| Volatilität Benchmark (in %) | 6.50 | 7.83 | 7.56 | 5.83 | 5.37 |
| Tracking Error ex post (in %) | 0.84 | 1.00 | 0.95 | 0.86 | 0.96 |
| Information Ratio | 0.11 | 0.34 | 0.41 | 0.29 | 0.43 |
| Sharpe Ratio | 1.15 | -0.64 | -0.20 | 0.16 | 0.40 |
| Korrelation | 1.00 | 1.00 | 1.00 | 0.99 | 0.98 |
| Beta | 0.88 | 0.89 | 0.90 | 0.92 | 0.95 |
| Jensen-Alpha | 0.92 | -0.19 | 0.21 | 0.30 | 0.50 |
| Maximum Drawdown (in %) | -2.93 | -19.66 | -20.63 | -20.63 | -20.63 |
| Recovery Period (Jahre) | 0.22 | - | - | - | - |

Performance



Produktinformationen

Valorennummer: 11956108

ISIN: CH0119561089

LEI: 254900C3B00LU0UJ428

Bloomberg-Code: SWLGUPM SW

Benchmark: BLOOMBERG GLO AGG CORP IND HEDGED CHF

Währung: CHF

Domizil: Schweiz

Aufledgedatum: 14/12/2010

Erstausgabepreis: 100.00

Jahresabschluss: 30.09

Ausgabe/Rücknahme: Täglich

Annahmeschluss: 13.00 Uhr

Ausgabe- / Rücknahmekommission: Keine

Ausschüttungspraxis: Thesaurierung

Asset Manager gemäss

Swiss Life Best Select Invest Plus@:
Swiss Life Asset Management AG

Überwachung Asset Manager:

PPCmetrics unterstützt die laufende Überwachung des Asset Managers sowie die Beurteilung der Anlageresultate.

Kurspublikationen: Bloomberg: ASSL
www.swisslife.ch/anlagestiftung

Betriebsaufwandquote TER KGAST

ex ante: 0.15%

ex post per: 30/09/2024 0.15%

PM-Tranche: Der Erwerb dieser Tranche ist nur im Rahmen einer speziellen Vereinbarung mit Swiss Life Asset Management AG möglich.

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.

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

Obligationen Global Unternehmen PM (CHF hedged)

Portfoliostruktur nach Branchen

| | Anlagegruppe | Benchmark |
|------------------------|--------------|-----------|
| Finanzwesen | 46.83% | 38.35% |
| Basiskonsumgüter | 13.75% | 16.36% |
| Energie | 7.44% | 6.00% |
| Versorgungsbetriebe | 6.41% | 8.99% |
| Industrie | 5.32% | 7.20% |
| Nicht-Basiskonsumgüter | 5.09% | 7.61% |
| Kommunikation | 5.08% | 7.90% |
| Technologie | 4.98% | 4.64% |
| Andere | 2.00% | 2.95% |
| Liquidität | 2.54% | - |
| Währungsabsicherung | 0.57% | - |

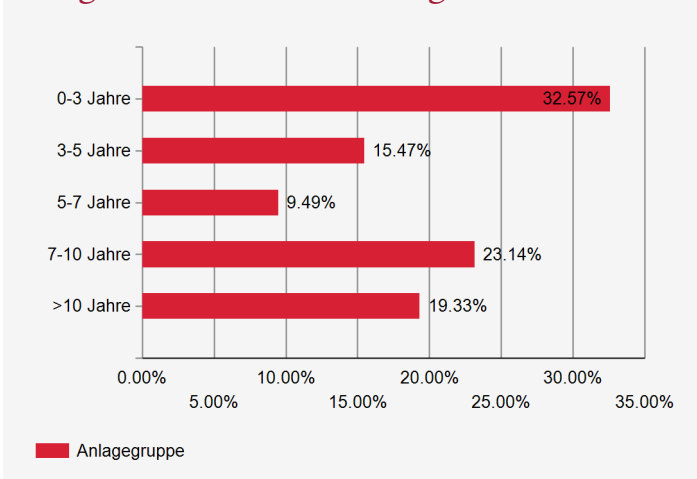
Grösste Schuldner und Rating

| | | Anlagegruppe |
|------------------------------|------|--------------|
| Porsche Automobil Holding SE | BBB | 2.26% |
| Banco Santander SA, Madrid | BBB+ | 2.26% |
| Groupe BPCE | BBB+ | 1.74% |
| Credit Agricole Group | BBB+ | 1.73% |
| Société Générale, Paris | BBB | 1.66% |

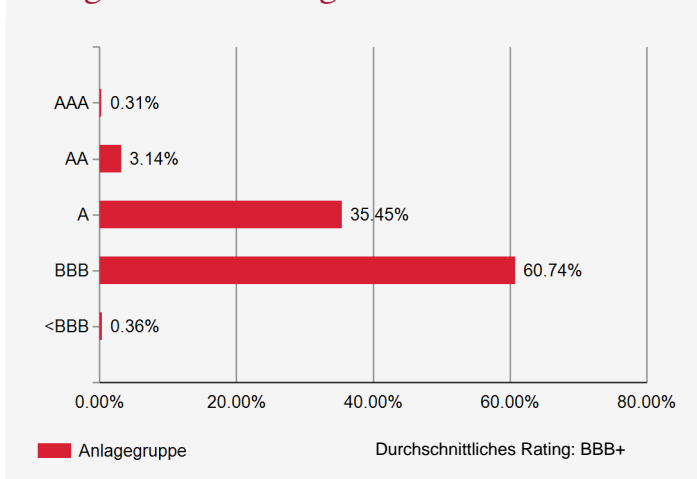
Weitere Angaben zu den Schuldnern

| | |
|----------------------------------|-------|
| Anzahl Schuldner | 231 |
| Anteil Benchmarkfremde Schuldner | 3.11% |

Fälligkeitstruktur der Anlagen



Anlagen nach Rating



Duration und Rendite auf Verfall

| | Anlagegruppe | Benchmark |
|-----------------------------------|--------------|-----------|
| Modified Duration* | 6.1 | 6.1 |
| Theoretische Rendite auf Verfall* | 4.71% | 4.65% |

* Vor Währungsabsicherung, unter Berücksichtigung der Derivate

Portfolio nach Währungen und Duration

| | Anlagegruppe | | Benchmark | |
|--------|--------------|----------|------------|----------|
| | Gewichtung | Duration | Gewichtung | Duration |
| USD | 56.90% | 7.88 | 67.08% | 6.74 |
| EUR | 28.77% | 3.60 | 23.88% | 4.44 |
| CHF | 5.81% | 2.18 | 0.37% | 4.39 |
| JPY | 2.48% | 2.04 | 0.70% | 4.16 |
| Andere | 6.03% | 4.29 | 7.97% | 5.64 |

Portfoliostruktur nach Ländern/Regionen

| | Anlagegruppe | Benchmark |
|-----------------------------|--------------|-----------|
| Vereinigte Staaten | 37.40% | 56.23% |
| Vereinigtes Königreich | 10.24% | 6.85% |
| Frankreich | 9.17% | 6.19% |
| Deutschland | 5.33% | 5.04% |
| Spanien | 4.30% | 2.20% |
| Japan | 4.15% | 3.37% |
| Schweiz | 3.99% | 1.45% |
| Europäische Region (EUR) | 9.45% | 5.87% |
| Asien-Pazifik-Raum | 3.23% | 2.21% |
| Europäische Region (Ex EUR) | 3.20% | 1.61% |
| Andere | 6.43% | 8.98% |
| Liquidität, Absicherung | 3.11% | - |

Anlagestiftung Swiss Life Obligationen Emerging Markets Short Term PM (CHF hedged)



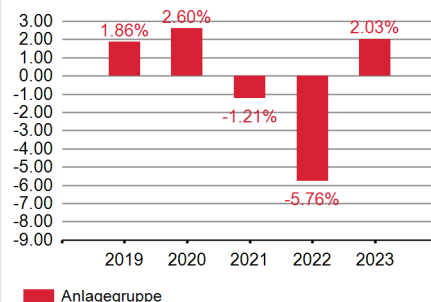
SwissLife

Nettovermögen (NAV) in Mio. CHF: 128.57
Nettovermögen pro Anspruch in CHF: 98.62

Anlagestrategie

Anlagen in auf US Dollar oder auf andere Hartwährungen lautende Forderungspapiere von Unternehmen und Staaten aus Schwellenländern (Emerging Markets) inklusive Agencies und Supranationals mit einer kurzen Restlaufzeit (mehrheitlich unter 3 Jahren). Aktive Titelselektion, Durationsteuerung und Zinskurvenpositionierung. Schuldnerbegrenzung: 10%. Durchschnittliche Ratingqualität: mindestens BBB-. Fremdwährungsrisiken werden zu mindestens 90% gegen Schweizerfranken abgesichert. Umsetzung mittels Einsatz des Swiss Life Funds (LUX) Bond Emerging Markets Short Term CHF AM Cap; Anlagefonds nach luxemburgischem Recht.

Performance



Wertentwicklung in Referenzwährung (Basis 100)



Produktinformationen

Valorennummer: 38013685

ISIN: CH0380136850

LEI: 254900EGYJLGZXIT6O90

Bloomberg-Code: SLOSTPM SW

Währung: CHF

Domizil: Schweiz

Aufledgedatum: 29/09/2017

Erstausgabepreis: 100.00

Jahresabschluss: 30.09

Ausgabe/Rücknahme: Täglich

Annahmeschluss: 13.00 Uhr

Ausgabe- / Rücknahmekommission:
Keine

Ausschüttungspraxis: Thesaurierung

Asset Manager gemäss

Swiss Life Best Select Invest Plus®:
Swiss Life Asset Management AG

Überwachung Asset Manager:

PPCmetrics unterstützt die laufende Überwachung des Asset Managers sowie die Beurteilung der Anlageresultate.

Kurspublikationen: Bloomberg: ASSL
www.swisslife.ch/anlagestiftung

Betriebsaufwandquote TER KGAST

ex ante: 0.30%

ex post per: 30/09/2024 0.30%

Performance in Referenzwährung

| | Kumulierte Performance | | | | Annualisierte Performance | | | |
|--------------|------------------------|---------|----------|--------|---------------------------|---------|----------|--------|
| | YTD | 1 Monat | 3 Monate | 1 Jahr | 3 Jahre | 5 Jahre | 10 Jahre | Aufl. |
| Anlagegruppe | 2.49% | 0.65% | 2.03% | 4.44% | -0.63% | -0.06% | - | -0.20% |

Statistische Angaben (annualisiert)

| | 1 Jahr | 3 Jahre | 5 Jahre | 10 Jahre | Aufl. |
|---------------------------------|--------|---------|---------|----------|-------|
| Volatilität Anlagegruppe (in %) | 1.93 | 2.66 | 2.65 | - | 2.30 |
| Sharpe Ratio | 1.48 | -0.50 | -0.08 | - | -0.03 |
| Maximum Drawdown (in %) | -0.65 | -7.52 | -8.39 | - | -8.39 |
| Recovery Period (Jahre) | 0.05 | - | - | - | - |

PM-Tranche: Der Erwerb dieser Tranche ist nur im Rahmen einer speziellen Vereinbarung mit Swiss Life Asset Management AG möglich.

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.

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 Branchen

| | Anlagegruppe |
|-------------------------|--------------|
| Finanzwesen | 33.86% |
| Staatlich und staatsnah | 18.51% |
| Energie | 8.84% |
| Kommunikation | 8.25% |
| Basiskonsumgüter | 6.38% |
| Nicht-Basiskonsumgüter | 6.29% |
| Grundstoffe | 5.79% |
| Versorgungsbetriebe | 4.23% |
| Andere | 6.03% |
| Liquidität | 1.75% |
| Währungsabsicherung | 0.08% |

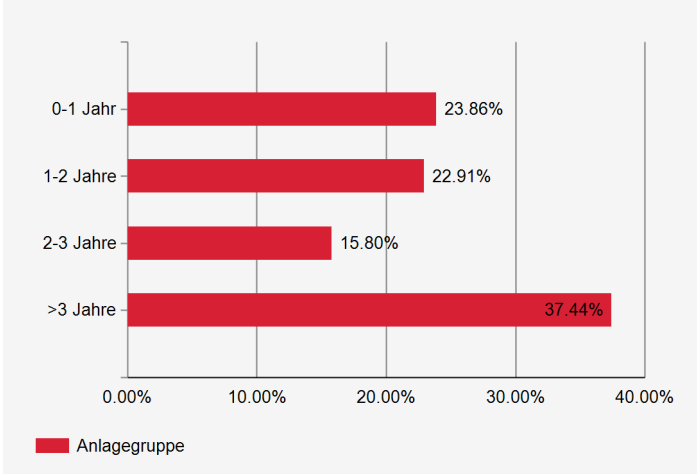
Grösste Schuldner und Rating

| | | Anlagegruppe |
|---------------------------|------|--------------|
| HDFC Bank Ltd | BBB- | 3.07% |
| First Abu Dhabi Bank PJSC | AA- | 3.05% |
| United Mexican States | BBB | 3.05% |
| OTP Bank Nyrt | BBB- | 2.73% |
| Reliance Industries Ltd | BBB | 2.39% |

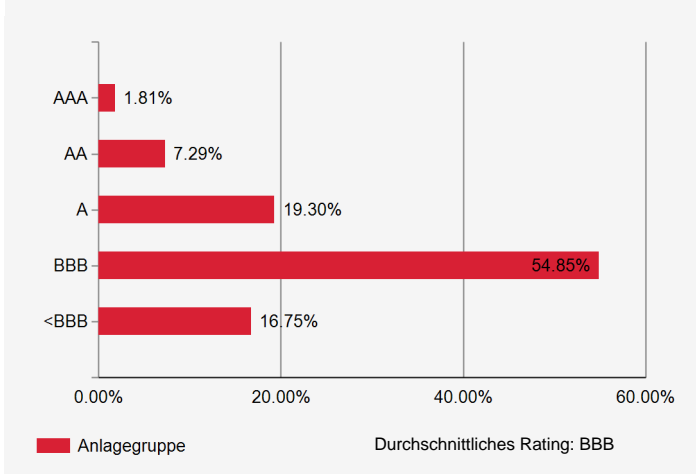
Weitere Angaben zu den Schuldnern

| | |
|------------------|----|
| Anzahl Schuldner | 94 |
|------------------|----|

Fälligkeitstruktur der Anlagen



Anlagen nach Rating



Duration und Rendite auf Verfall

| | Anlagegruppe |
|-----------------------------------|--------------|
| Modified Duration* | 2.1 |
| Theoretische Rendite auf Verfall* | 4.97% |

* Vor Währungsabsicherung, unter Berücksichtigung der Derivate

Portfolio nach Währungen und Duration

| | Anlagegruppe | |
|-----|--------------|----------|
| | Gewichtung | Duration |
| CHF | 99.70% | 0.07 |
| USD | 0.30% | 673.87 |
| EUR | 0.01% | 1040.17 |

Portfoliostruktur nach Ländern/Regionen

| | Anlagegruppe |
|-------------------------------|--------------|
| China | 10.93% |
| Indien | 9.69% |
| Vereinigte Arabische Emirate | 7.75% |
| Mexiko | 6.17% |
| Indonesien | 6.12% |
| Ungarn | 4.65% |
| Katar | 3.60% |
| Schwellenländer Asien Pazifik | 15.60% |
| Schwellenländer Lateinamerika | 13.57% |
| Schwellenländer Europa | 4.12% |
| Andere | 15.99% |
| Liquidität, Absicherung | 1.82% |



Anlagestiftung Swiss Life Obligationen Emerging Markets Unternehmen PM (CHF hedged)

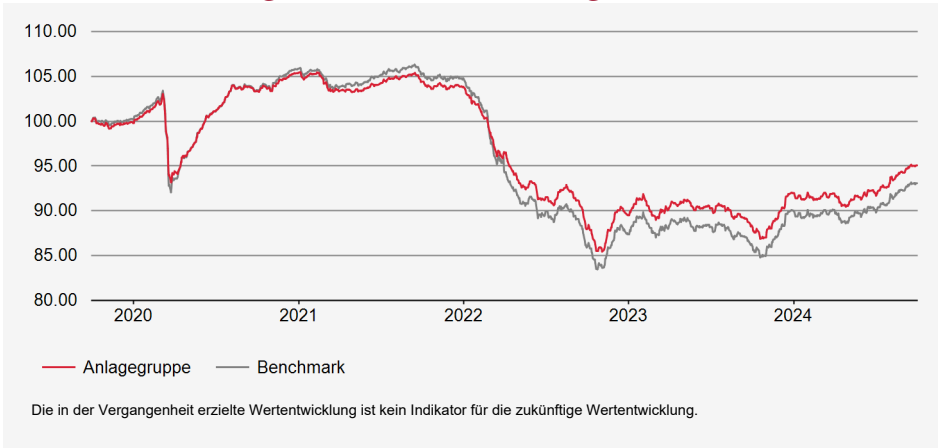
SwissLife

Nettovermögen (NAV) in Mio. CHF: 352.54
Nettovermögen pro Anspruch in CHF: 98.23

Anlagestrategie

Anlagen in auf US Dollar oder auf andere Hartwährungen lautende Forderungspapiere von Unternehmen und Staaten, inklusive Agencies und Supranationals aus Schwellenländern (Emerging Markets). Aktive Titelselektion, Durationsteuerung und Zinskurvenpositionierung. Schuldnerbegrenzung: 10%. Forderungspapiere benchmarkfremder Schuldner: max.35%. Durchschnittliche Ratingqualität: mindestens BBB-. Fremdwährungsrisiken werden zu mindestens 90% gegen Schweizerfranken abgesichert. Umsetzung mittels Einsatz des Swiss Life Funds (LUX) Bond Emerging Markets Corporates CHF-hedged AM Cap; Anlagefonds nach luxemburgischem Recht.

Wertentwicklung in Referenzwährung (Basis 100)



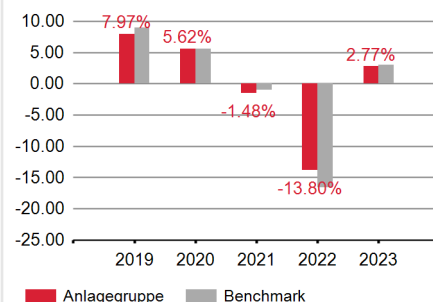
Performance in Referenzwährung

| | Kumulierte Performance | | | | Annualisierte Performance | | | |
|--------------|------------------------|---------|----------|--------|---------------------------|---------|----------|--------|
| | YTD | 1 Monat | 3 Monate | 1 Jahr | 3 Jahre | 5 Jahre | 10 Jahre | Aufl. |
| Anlagegruppe | 3.37% | 0.88% | 3.36% | 7.59% | -3.06% | -1.00% | - | -0.25% |
| Benchmark | 3.38% | 0.89% | 3.30% | 7.89% | -4.00% | -1.42% | - | -0.43% |

Statistische Angaben (annualisiert)

| | 1 Jahr | 3 Jahre | 5 Jahre | 10 Jahre | Aufl. |
|---------------------------------|--------|---------|---------|----------|--------|
| Volatilität Anlagegruppe (in %) | 4.85 | 6.12 | 6.39 | - | 5.59 |
| Volatilität Benchmark (in %) | 4.98 | 6.62 | 7.06 | - | 6.14 |
| Tracking Error ex post (in %) | 0.42 | 1.28 | 1.22 | - | 1.07 |
| Information Ratio | -0.70 | 0.73 | 0.34 | - | 0.16 |
| Sharpe Ratio | 1.20 | -0.62 | -0.18 | - | -0.02 |
| Korrelation | 1.00 | 0.98 | 0.99 | - | 0.99 |
| Beta | 0.97 | 0.91 | 0.89 | - | 0.90 |
| Jensen-Alpha | -0.12 | 0.50 | 0.25 | - | 0.14 |
| Maximum Drawdown (in %) | -1.70 | -18.17 | -18.98 | - | -18.98 |
| Recovery Period (Jahre) | 0.11 | - | - | - | - |

Performance



Produktinformationen

Valorennummer: 36974878

ISIN: CH0369748782

LEI: 254900R4DORKK6JJUG51

Bloomberg-Code: SLOEMPM SW

Benchmark: JP Morgan CEMBI Broad Diversified IG Index (CHF Hedged)

Währung: CHF

Domizil: Schweiz

Aufliedatum: 29/09/2017

Erstausgabepreis: 100.00

Jahresabschluss: 30.09

Ausgabe/Rücknahme: Täglich

Annahmeschluss: 13.00 Uhr

Ausgabe- / Rücknahmekommission: Keine

Ausschüttungspraxis: Thesaurierung

Asset Manager gemäss

Swiss Life Best Select Invest Plus@:
Swiss Life Asset Management AG

Überwachung Asset Manager:

PPCmetrics unterstützt die laufende Überwachung des Asset Managers sowie die Beurteilung der Anlageresultate.

Kurspublikationen: Bloomberg: ASSL
www.swisslife.ch/anlagestiftung

Betriebsaufwandquote TER KGAST

ex ante: 0.28%

ex post per: 30/09/2024 0.28%

PM-Tranche: Der Erwerb dieser Tranche ist nur im Rahmen einer speziellen Vereinbarung mit Swiss Life Asset Management AG möglich.

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.

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 Obligationen Emerging Markets Unternehmen PM (CHF hedged)

Portfoliostruktur nach Branchen

| | Anlagegruppe | Benchmark |
|---------------------|--------------|-----------|
| Finanzwesen | 31.93% | 36.41% |
| Kommunikation | 12.02% | 9.03% |
| Versorgungsbetriebe | 10.70% | 10.48% |
| Energie | 9.55% | 11.44% |
| Basiskonsumgüter | 8.86% | 4.84% |
| Industrie | 6.65% | 4.08% |
| Technologie | 5.47% | 5.27% |
| Grundstoffe | 4.50% | 11.22% |
| Supranational | 1.66% | - |
| Andere | 8.01% | 7.24% |
| Liquidität | 0.57% | - |
| Währungsabsicherung | 0.07% | - |

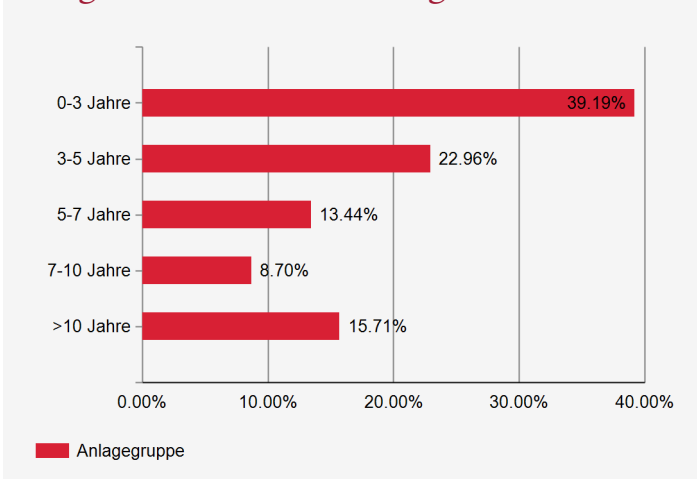
Grösste Schuldner und Rating

| | Rating | Anlagegruppe |
|---|--------|--------------|
| Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd | AA- | 3.53% |
| US Treasury N/B | AAA | 3.31% |
| Prosus NV | BBB | 2.32% |
| OTP Bank Nyrt | BBB- | 1.81% |
| HDFC Bank Ltd | BBB- | 1.77% |

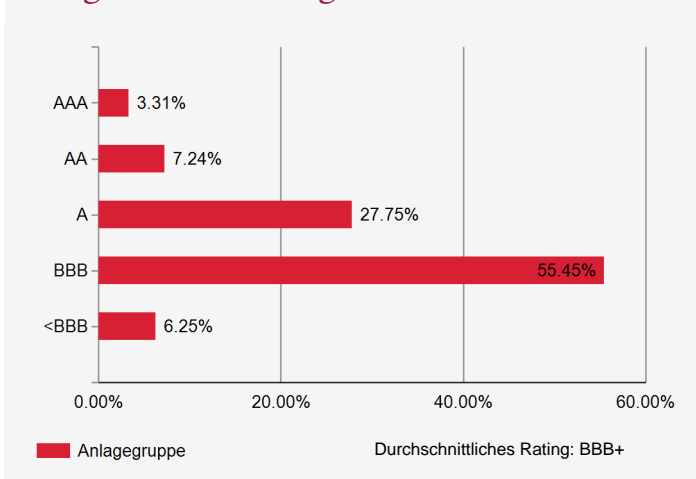
Weitere Angaben zu den Schuldnern

| | |
|----------------------------------|--------|
| Anzahl Schuldner | 149 |
| Anteil Benchmarkfremde Schuldner | 23.05% |

Fälligkeitstruktur der Anlagen



Anlagen nach Rating



Duration und Rendite auf Verfall

| | Anlagegruppe | Benchmark |
|-----------------------------------|--------------|-----------|
| Modified Duration* | 5.2 | 4.8 |
| Theoretische Rendite auf Verfall* | 5.78% | 5.19% |

* Vor Währungsabsicherung, unter Berücksichtigung der Derivate

Portfoliostruktur nach Ländern/Regionen

| | Anlagegruppe | Benchmark |
|------------------------------------|--------------|-----------|
| China | 9.52% | 13.52% |
| Südkorea | 6.91% | 7.63% |
| Vereinigte Arabische Emirate | 6.66% | 5.72% |
| Indien | 5.92% | 4.03% |
| Mexiko | 5.03% | 4.85% |
| Katar | 4.64% | 5.56% |
| Singapur | 4.59% | 3.93% |
| Schwellenländer Asien Pazifik | 18.84% | 19.75% |
| Schwellenländer Lateinamerika | 12.30% | 8.20% |
| Schwellenländer im mittleren Osten | 5.80% | 10.07% |
| Andere | 19.14% | 16.75% |
| Liquidität, Absicherung | 0.64% | - |

Nettovermögen (NAV) in Mio. CHF: 518.72
Nettovermögen pro Anspruch in CHF: 203.58

Anlagestrategie

Anlagen in Beteiligungspapiere von Gesellschaften, die im Swiss Performance Index (SPI) vertreten sind. Large Caps werden passiv abgedeckt, Small & Mid Caps werden aktiv verwaltet (Core-Satellite). Gesellschaftsbegrenzung: 5% (Ausnahme: sofern im Benchmark; max. 5%-Punkte mehr als Benchmarkgewichtung). Umsetzung mittels Einsatz der Swiss Life Index Funds (CH) Equity Switzerland Large Cap und SL iFunds Equity Switzerland Small & Mid Cap (CHF); Anlagenfonds schweizerischen Rechts der Kategorie "Übrige Fonds für traditionelle Anlagen".

Wertentwicklung in Referenzwährung (Basis 100)



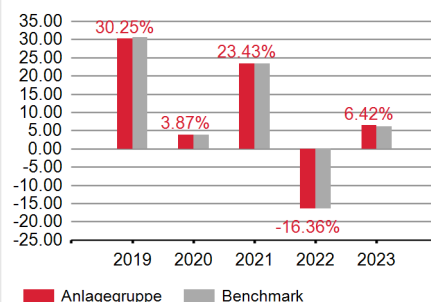
Performance in Referenzwährung

| | Kumulierte Performance | | | | Annualisierte Performance | | | |
|--------------|------------------------|---------|----------|--------|---------------------------|---------|----------|-------|
| | YTD | 1 Monat | 3 Monate | 1 Jahr | 3 Jahre | 5 Jahre | 10 Jahre | Aufl. |
| Anlagegruppe | 11.37% | -1.57% | 1.96% | 12.91% | 2.82% | 5.91% | 6.41% | 4.18% |
| Benchmark | 11.47% | -1.59% | 2.03% | 13.04% | 2.58% | 5.83% | 6.44% | 4.41% |

Statistische Angaben (annualisiert)

| | 1 Jahr | 3 Jahre | 5 Jahre | 10 Jahre | Aufl. |
|---------------------------------|--------|---------|---------|----------|--------|
| Volatilität Anlagegruppe (in %) | 10.95 | 12.46 | 12.74 | 12.14 | 12.81 |
| Volatilität Benchmark (in %) | 11.02 | 12.50 | 12.80 | 12.18 | 12.81 |
| Tracking Error ex post (in %) | 0.27 | 0.35 | 0.34 | 0.31 | 0.67 |
| Information Ratio | -0.49 | 0.67 | 0.25 | -0.10 | -0.34 |
| Sharpe Ratio | 0.97 | 0.17 | 0.44 | 0.54 | 0.32 |
| Korrelation | 1.00 | 1.00 | 1.00 | 1.00 | 1.00 |
| Beta | 0.99 | 1.00 | 0.99 | 1.00 | 1.00 |
| Jensen-Alpha | -0.05 | 0.24 | 0.11 | 0.00 | -0.22 |
| Maximum Drawdown (in %) | -6.50 | -21.74 | -25.86 | -25.86 | -54.13 |
| Recovery Period (Jahre) | 0.06 | 1.93 | 0.83 | 0.83 | 4.84 |

Performance



Produktinformationen

Valorennummer: 3026057
ISIN: CH0030260571
LEI: 254900UNZU5YPIKQTQ23
Bloomberg-Code: SLACHPM SW
Benchmark: SPI® Total Return
Währung: CHF
Domizil: Schweiz
Aufledgedatum: 31/05/2007
Erstausgabepreis: 100.00
Jahresabschluss: 30.09
Ausgabe/Rücknahme: Täglich
Annahmeschluss: 13.00 Uhr
Ausgabe- / Rücknahmekommission: Keine
Ausschüttungspraxis: Thesaurierung
Asset Manager gemäss Swiss Life Best Select Invest Plus® Large Caps (passiv)
Swiss Life Asset Management AG
Small&Mid Caps (aktiv)
Privatbank Von Graffenried AG

Externe Beratung:
PPCmetrics erbringt folgende Dienstleistungen: Beratung betreffend geeigneter Mandatsstrukturen (Core-Satellite), Unterstützung bei der Selektion geeigneter Asset Manager sowie Unterstützung bei der laufenden Überwachung der Asset Manager und Beurteilung der Anlageresultate.
Kurspublikationen: Bloomberg: ASSL
www.swisslife.ch/anlagestiftung
Betriebsaufwandsquote TER KGAST ex ante: 0.26%
ex post per: 30/09/2024 0.28%

PM-Tranche: Der Erwerb dieser Tranche ist nur im Rahmen einer speziellen Vereinbarung mit Swiss Life Asset Management AG möglich.

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.

Betriebsaufwandsquote TER KGAST: Die Betriebsaufwandsquote TER KGAST deckt sämtliche Kosten mit Ausnahme der Transaktionskosten und der transaktionsbezogenen steuerlichen Abgaben ab.

Performance: Gesamtertrag über einen bestimmten Betrachtungszeitraum auf der Basis von zeitgewichteten Renditen.

Statistische Angaben: Die Risikokennzahlen basieren auf logarithmierten, monatlichen zeitgewichteten Renditen.

Portfoliostruktur nach Branchen

| | Anlagegruppe | Benchmark |
|----------------------------|--------------|-----------|
| Gesundheitswesen | 33.76% | 34.11% |
| Finanzen | 17.90% | 19.68% |
| Nichtzyklische Konsumgüter | 16.48% | 16.48% |
| Industrieunternehmen | 14.17% | 13.48% |
| Roh- und Grundstoffe | 8.22% | 8.42% |
| Zyklische Konsumgüter | 4.92% | 5.14% |
| Informationstechnologie | 1.67% | 1.49% |
| Kommunikationsdienste | 0.87% | 0.97% |
| Versorgungsbetriebe | 0.39% | 0.22% |
| Energie | - | - |
| Liquidität | 1.63% | - |

Grösste Positionen

| | Anlagegruppe | Benchmark |
|------------------------------|--------------|-----------|
| NESTLE SA-REG | 13.78% | 13.86% |
| NOVARTIS AG-REG | 12.30% | 12.37% |
| ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN | 11.77% | 11.84% |
| UBS GROUP AG-REG | 5.21% | 5.24% |
| ABB LTD-REG | 4.84% | 4.87% |
| ZURICH INSURANCE GROUP AG | 4.62% | 4.65% |
| CIE FINANCIERE RICHEMO-A REG | 4.45% | 4.48% |
| SIKA AG-REG | 2.78% | 2.80% |
| HOLCIM LTD | 2.77% | 2.79% |
| ALCON INC | 2.61% | 2.62% |

Portfoliostruktur nach Unternehmensgrösse

| | Anlagegruppe | | Benchmark | |
|----------------------|--------------|--------|-----------|--------|
| | Anteil | Anzahl | Anteil | Anzahl |
| Grosse Unternehmen | 80.14% | 20 | 80.20% | 20 |
| Mittlere Unternehmen | 17.50% | 47 | 18.15% | 80 |
| Kleine Unternehmen | 0.74% | 4 | 1.65% | 106 |
| Liquidität | 1.63% | - | - | - |

Anlagestiftung Swiss Life

Aktien Schweiz Large Caps Indexiert PM

Nettovermögen (NAV) in Mio. CHF: 517.66
Nettovermögen pro Anspruch in CHF: 156.32

Anlagestrategie

Die Anlagegruppe wird mit einem indexierten Ansatz verwaltet und zeichnet sich durch eine breite Diversifikation und einen geringen Tracking Error aus. Das Anlageziel besteht darin, die Benchmark SPI® 20 Total Return nachzubilden. Umsetzung mittels Einsatz des Swiss Life Index Funds (CH) Equity Switzerland Large Cap; Anlagefonds schweizerischen Rechts der Kategorie "Übrige Fonds für traditionelle Anlagen.

Wertentwicklung in Referenzwährung (Basis 100)



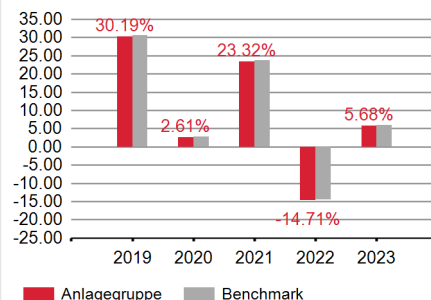
Performance in Referenzwährung

| | Kumulierte Performance | | | | Annualisierte Performance | | | |
|--------------|------------------------|---------|----------|--------|---------------------------|---------|----------|-------|
| | YTD | 1 Monat | 3 Monate | 1 Jahr | 3 Jahre | 5 Jahre | 10 Jahre | Aufl. |
| Anlagegruppe | 11.71% | -2.10% | 1.37% | 12.83% | 3.67% | 5.83% | - | 6.93% |
| Benchmark | 12.02% | -2.12% | 1.42% | 13.22% | 3.95% | 6.10% | - | 7.20% |

Statistische Angaben (annualisiert)

| | 1 Jahr | 3 Jahre | 5 Jahre | 10 Jahre | Aufl. |
|---------------------------------|--------|---------|---------|----------|--------|
| Volatilität Anlagegruppe (in %) | 11.37 | 12.33 | 12.48 | - | 12.35 |
| Volatilität Benchmark (in %) | 11.47 | 12.39 | 12.54 | - | 12.40 |
| Tracking Error ex post (in %) | 0.12 | 0.08 | 0.08 | - | 0.08 |
| Information Ratio | -3.09 | -3.28 | -3.39 | - | -3.46 |
| Sharpe Ratio | 0.93 | 0.24 | 0.44 | - | 0.55 |
| Korrelation | 1.00 | 1.00 | 1.00 | - | 1.00 |
| Beta | 0.99 | 1.00 | 1.00 | - | 1.00 |
| Jensen-Alpha | -0.28 | -0.26 | -0.24 | - | -0.24 |
| Maximum Drawdown (in %) | -6.91 | -19.80 | -25.03 | - | -25.03 |
| Recovery Period (Jahre) | 0.06 | 1.69 | 1.00 | - | 1.00 |

Performance



Produktinformationen

Valorennummer: 39561886

ISIN: CH0395618868

LEI: 254900P0FZIREAGSUQ60

Bloomberg-Code: SLASLPM SW

Benchmark: SPI® 20 Total Return

Währung: CHF

Domizil: Schweiz

Aufgatedatum: 31/01/2018

Erstausgabepreis: 100.00

Jahresabschluss: 30.09

Ausgabe/Rücknahme: Täglich

Annahmeschluss: 13.00 Uhr

Ausgabe- / Rücknahmekommission:
Keine

Ausschüttungspraxis: Thesaurierung

Asset Manager gemäss

Swiss Life Best Select Invest Plus®:
Swiss Life Asset Management AG

Externe Beratung:

PPCmetrics erbringt 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: 0.15%

ex post per: 30/09/2024 0.14%

PM-Tranche: Der Erwerb dieser Tranche ist nur im Rahmen einer speziellen Vereinbarung mit Swiss Life Asset Management AG möglich.

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.

Performance: Gesamtertrag über einen bestimmten Betrachtungszeitraum auf der Basis von zeitgewichteten Renditen.

Statistische Angaben: Die Risikokennzahlen basieren auf logarithmierten, monatlichen zeitgewichteten Renditen.

Anlagestiftung Swiss Life

Aktien Schweiz Large Caps Indexiert PM



Portfoliostruktur nach Branchen

| | Anlagegruppe | Benchmark |
|----------------------------|--------------|-----------|
| Gesundheitswesen | 37.73% | 37.74% |
| Finanzen | 18.86% | 18.87% |
| Nichtzyklische Konsumgüter | 17.34% | 17.34% |
| Roh- und Grundstoffe | 9.86% | 9.86% |
| Industrieunternehmen | 8.52% | 8.52% |
| Zyklische Konsumgüter | 5.60% | 5.60% |
| Kommunikationsdienste | 1.09% | 1.09% |
| Informationstechnologie | 0.97% | 0.97% |
| Liquidität / Darlehen | 0.04% | - |

Grösste Positionen

| | Anlagegruppe | Benchmark |
|------------------------------|--------------|-----------|
| NESTLE SA-REG | 17.34% | 17.34% |
| NOVARTIS AG-REG | 15.47% | 15.48% |
| ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN | 14.81% | 14.81% |
| UBS GROUP AG-REG | 6.56% | 6.56% |
| ABB LTD-REG | 6.09% | 6.09% |
| ZURICH INSURANCE GROUP AG | 5.81% | 5.81% |
| CIE FINANCIERE RICHEMO-A REG | 5.60% | 5.60% |
| SIKA AG-REG | 3.50% | 3.50% |
| HOLCIM LTD | 3.48% | 3.49% |
| ALCON INC | 3.28% | 3.28% |

Haftungsausschluss: 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, c/o Swiss Life AG, Postfach, 8022 Zürich, Tel. 043 547 71 11 und unter www.swisslife.ch/anlagestiftung 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 Vorsorge dienen und Personen, die kollektive Anlagen für diese Einrichtungen verwalten, von der Eidgenössischen Finanzmarktaufsicht FINMA beaufsichtigt werden und bei der Stiftung ausschliesslich Gelder für diese Einrichtungen anlegen. Zusätzlich müssen die erwähnten Anleger eine spezielle Vereinbarung mit der Swiss Life Asset Management AG abgeschlossen haben. Die vergangene Performance stellt keinen Indikator für die laufende und zukünftige Entwicklung dar. Sämtliche Produkt- und Firmennamen sind Marken™ oder eingetragene® Warenzeichen ihrer jeweiligen Inhaber. Ihre Verwendung stellt keine Zugehörigkeit zu ihnen und keine Zustimmung durch sie dar. **Quelle:** Swiss Life Asset Managers. Alle Rechte vorbehalten.

Anlagestiftung Swiss Life

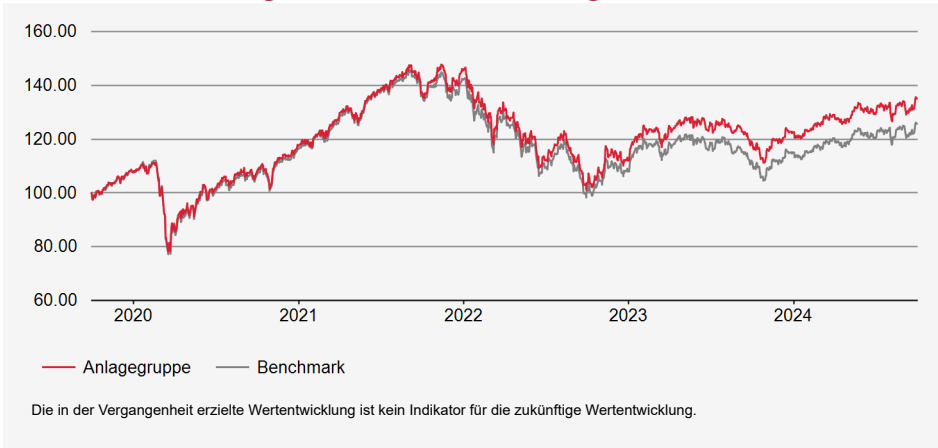
Aktien Schweiz Small & Mid Caps PM

Nettovermögen (NAV) in Mio. CHF: 137.24
Nettovermögen pro Anspruch in CHF: 133.40

Anlagestrategie

Anlagen in Beteiligungspapiere von Gesellschaften, die im Swiss Performance Index Extra vertreten sind. Aktive Branchen- und Titelselektion. Gesellschaftsbegrenzung: 5% (Ausnahme: sofern im Benchmark; max. 5%-Punkte mehr als Benchmarkgewichtung). Umsetzung mittels Einsatz des Swiss Life iFunds (CH) Equity Switzerland Small & Mid Cap (CHF); Anlagefonds schweizerischen Rechts der Kategorie "Übrige Fonds für traditionelle Anlagen".

Wertentwicklung in Referenzwährung (Basis 100)



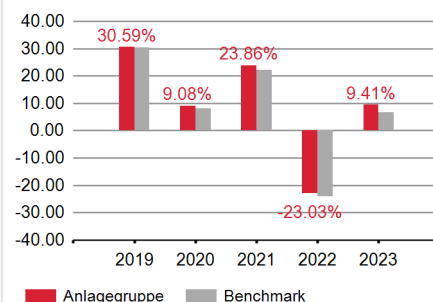
Performance in Referenzwährung

| | Kumulierte Performance | | | | Annualisierte Performance | | | |
|--------------|------------------------|---------|----------|--------|---------------------------|---------|----------|-------|
| | YTD | 1 Monat | 3 Monate | 1 Jahr | 3 Jahre | 5 Jahre | 10 Jahre | Aufl. |
| Anlagegruppe | 10.16% | 0.72% | 4.46% | 13.40% | -0.60% | 6.19% | - | 4.42% |
| Benchmark | 9.26% | 0.58% | 4.53% | 12.27% | -2.75% | 4.67% | - | 3.20% |

Statistische Angaben (annualisiert)

| | 1 Jahr | 3 Jahre | 5 Jahre | 10 Jahre | Aufl. |
|---------------------------------|--------|---------|---------|----------|--------|
| Volatilität Anlagegruppe (in %) | 10.42 | 14.78 | 15.60 | - | 15.37 |
| Volatilität Benchmark (in %) | 10.33 | 14.64 | 15.71 | - | 15.35 |
| Tracking Error ex post (in %) | 1.28 | 1.70 | 1.63 | - | 1.57 |
| Information Ratio | 0.88 | 1.27 | 0.93 | - | 0.78 |
| Sharpe Ratio | 1.06 | -0.09 | 0.38 | - | 0.29 |
| Korrelation | 0.99 | 0.99 | 0.99 | - | 0.99 |
| Beta | 1.00 | 1.00 | 0.99 | - | 1.00 |
| Jensen-Alpha | 1.12 | 2.17 | 1.57 | - | 1.23 |
| Maximum Drawdown (in %) | -6.61 | -31.46 | -31.46 | - | -31.46 |
| Recovery Period (Jahre) | 0.05 | - | - | - | - |

Performance



Produktinformationen

Valorennummer: 39561897
ISIN: CH0395618975
LEI: 254900QGENUS1GIJ4549
Bloomberg-Code: SWLSMPM SW
Benchmark: SPI EXTRA® Total Return
Währung: CHF
Domizil: Schweiz
Aufledgedatum: 31/01/2018
Erstausgabepreis: 100.00
Jahresabschluss: 30.09
Ausgabe/Rücknahme: Täglich
Annahmeschluss: 13.00 Uhr
Ausgabe- / Rücknahmekommission: Keine
Ausschüttungspraxis: Thesaurierung
Asset Manager gemäss Swiss Life Best Select Invest Plus®: Privatbank Von Graffenried AG

Externe Beratung: PPCmetrics erbringt 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: 0.72%
ex post per: 30/09/2024 0.72%

PM-Tranche: Der Erwerb dieser Tranche ist nur im Rahmen einer speziellen Vereinbarung mit Swiss Life Asset Management AG möglich.

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.

Performance: Gesamtertrag über einen bestimmten Betrachtungszeitraum auf der Basis von zeitgewichteten Renditen.

Statistische Angaben: Die Risikokennzahlen basieren auf logarithmierten, monatlichen zeitgewichteten Renditen.

Anlagestiftung Swiss Life

Aktien Schweiz Small & Mid Caps PM



Portfoliostruktur nach Branchen

| | Anlagegruppe | Benchmark |
|----------------------------|--------------|-----------|
| Industrieunternehmen | 37.46% | 33.25% |
| Gesundheitswesen | 19.12% | 19.67% |
| Finanzen | 14.73% | 22.90% |
| Nichtzyklische Konsumgüter | 13.71% | 13.07% |
| Informationstechnologie | 4.56% | 3.58% |
| Zyklische Konsumgüter | 2.38% | 3.27% |
| Roh- und Grundstoffe | 1.99% | 2.68% |
| Versorger | 1.97% | 1.09% |
| Kommunikationsdienste | - | 0.50% |
| Energie | - | - |
| Liquidität | 4.08% | - |

Grösste Positionen

| | Anlagegruppe | Benchmark |
|-----------------------|--------------|-----------|
| LINDT & SPRÜNGLI | 6.77% | 7.12% |
| STRAUMANN HOLDING AG | 5.43% | 5.07% |
| SGS SA | 5.42% | 4.49% |
| SANDOZ GROUP AG | 4.91% | 4.72% |
| SCHINDLER HOLDING AG | 4.27% | 4.66% |
| VAT GROUP AG | 4.17% | 3.60% |
| JULIUS BAER GROUP LTD | 3.94% | 3.25% |
| BALOISE HOLDING AG | 2.87% | 2.33% |
| BELIMO HOLDING AG | 2.76% | 1.85% |
| SIEGFRIED HOLDING AG | 2.41% | 1.51% |

Portfoliostruktur nach Unternehmensgrösse

| | Anlagegruppe | | Benchmark | |
|----------------------|--------------|--------|-----------|--------|
| | Anteil | Anzahl | Anteil | Anzahl |
| Grosse Unternehmen | 12.18% | 3 | 9.78% | 2 |
| Mittlere Unternehmen | 80.04% | 45 | 82.01% | 78 |
| Kleine Unternehmen | 3.69% | 4 | 8.21% | 106 |
| Liquidität | 4.08% | - | - | - |

Anlagestiftung Swiss Life

Aktien Schweiz Protect Flex PM

Nettovermögen (NAV) in Mio. CHF: 175.59
Nettovermögen pro Anspruch in CHF: 118.19

Anlagestrategie

SMI-indexierte Anlagestrategie mit aktiv verwalteter Optionsabsicherungsstrategie. Anlageuniversum besteht aus Gesellschaften des SMI; die Gewichtung erfolgt nach der Marktkapitalisierung. Investitionen können in Form von Beteiligungspapieren, kollektiven Anlagen oder derivativen Instrumenten erfolgen. Der ergänzende Einsatz einer Absicherungsstrategie, bestehend aus Optionen, bewirkt bei stark sinkenden Märkten eine Verminderung der Kursverluste und bei stark steigenden Märkten eine Limitierung des Aufwärtspotentials. Je nach Markteinschätzung kann auf den Verkauf der Put-Option und/oder der Call-Option verzichtet werden. Umsetzung mittels Einsatz des SLF (CH) Equity Switzerland Protect Enhanced.

Wertentwicklung in Referenzwährung (Basis 100)



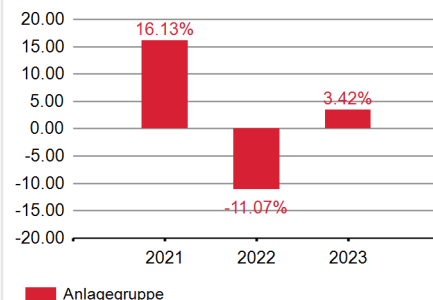
Performance in Referenzwährung

| | Kumulierte Performance | | | | Annualisierte Performance | | | |
|--------------|------------------------|---------|----------|--------|---------------------------|---------|----------|-------|
| | YTD | 1 Monat | 3 Monate | 1 Jahr | 3 Jahre | 5 Jahre | 10 Jahre | Aufl. |
| Anlagegruppe | 9.39% | -1.75% | 0.92% | 10.53% | 2.69% | - | - | 4.51% |

Statistische Angaben (annualisiert)

| | 1 Jahr | 3 Jahre | 5 Jahre | 10 Jahre | Aufl. |
|---------------------------------|--------|---------|---------|----------|--------|
| Volatilität Anlagegruppe (in %) | 8.56 | 8.91 | - | - | 8.97 |
| Sharpe Ratio | 1.00 | 0.22 | - | - | 0.44 |
| Maximum Drawdown (in %) | -4.81 | -15.16 | - | - | -15.16 |
| Recovery Period (Jahre) | 0.06 | 1.69 | - | - | 1.69 |

Performance



Produktinformationen

Valorennummer: 58002364

ISIN: CH0580023643

LEI: 254900ZUTROYHLYQ4E86

Bloomberg-Code: SLSPFPM SW

Währung: CHF

Domizil: Schweiz

Aufledgedatum: 18/12/2020

Erstausgabepreis: 100.00

Jahresabschluss: 30.09

Ausgabe/Rücknahme: Täglich

Annahmeschluss: 13.00 Uhr

Ausgabe- / Rücknahmekommission: Keine

Ausschüttungspraxis: Thesaurierung

Asset Manager

Swisslife Asset Management AG

Kurspublikationen: Bloomberg: ASSL
www.swisslife.ch/anlagestiftung

Betriebsaufwandquote TERK GAST

ex ante: 0.15%

ex post per: 30/09/2024 0.15%

PM-Tranche: Erwerb dieser Tranche ist nur im Rahmen einer speziellen Vereinbarung mit Swiss Life Asset Management AG möglich.

Betriebsaufwandquote TER KGAST: Die Betriebsaufwandquote TER KGAST deckt sämtliche Kosten mit Ausnahme der Transaktionskosten und der transaktionsbezogenen steuerlichen Abgaben ab.

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

Aktien Schweiz Protect Flex PM



Portfoliostruktur nach Branchen

| | Anlagegruppe |
|----------------------------|--------------|
| Gesundheitswesen | 35.66% |
| Finanzen | 17.78% |
| Nichtzyklische Konsumgüter | 14.38% |
| Roh- und Grundstoffe | 9.28% |
| Industrieunternehmen | 8.10% |
| Zyklische Konsumgüter | 5.27% |
| Kommunikationsdienste | 1.03% |
| Informationstechnologie | 0.91% |
| Future auf Aktienindex | 0.07% |
| Liquidität / Darlehen | 7.51% |

Grösste Positionen

| | Anlagegruppe |
|------------------------------|--------------|
| NOVARTIS AG-REG | 14.61% |
| NESTLE SA-REG | 14.38% |
| ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN | 13.94% |
| UBS GROUP AG-REG | 6.18% |
| ABB LTD-REG | 5.81% |
| ZURICH INSURANCE GROUP AG | 5.47% |
| CIE FINANCIERE RICHEMO-A REG | 5.27% |
| SIKA AG-REG | 3.29% |
| HOLCIM LTD | 3.28% |
| ALCON INC | 3.09% |

Anlagestiftung Swiss Life

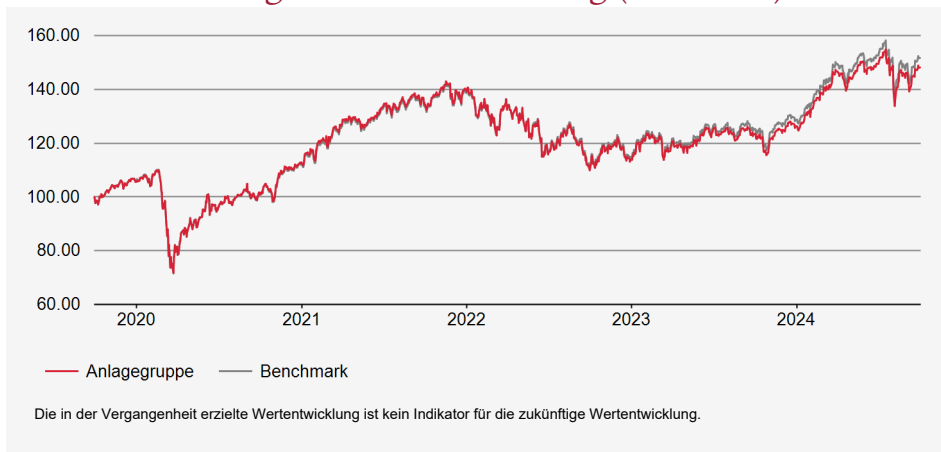
Aktien Ausland ESG PM

Nettovermögen (NAV) in Mio. CHF: 473.76
Nettovermögen pro Anspruch in CHF: 193.07

Anlagestrategie

Anlagen in Beteiligungspapiere von Gesellschaften mit Domizil im Ausland. Large & Mid Caps werden passiv abgedeckt, Small Caps sowie der Bereich Emerging Markets werden aktiv verwaltet (Core-Satellite). Gesellschaftsbegrenzung: 5% (Ausnahme: sofern Gewicht im Index mehr als 5%; dann max. 10%). Benchmarkfremde Gesellschaften: max. 10%. Umsetzung mittels Swiss Life iFunds (CH) Equity ESG Global ex Switzerland (CHF), Invesco Global Small Cap Equity Fund, Dimensional Global Small Cap Equity Fund, Amundi Emerging Markets Equity Focus Fund und Robeco Emerging Markets Equities Fund.

Wertentwicklung in Referenzwährung (Basis 100)



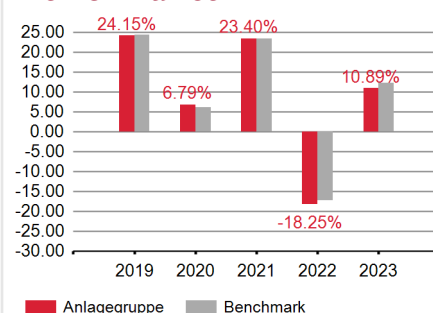
Performance in Referenzwährung

| | Kumulierte Performance | | | | Annualisierte Performance | | | |
|--------------|------------------------|---------|----------|--------|---------------------------|---------|----------|-------|
| | YTD | 1 Monat | 3 Monate | 1 Jahr | 3 Jahre | 5 Jahre | 10 Jahre | Aufl. |
| Anlagegruppe | 17.35% | 1.33% | -0.90% | 20.04% | 3.37% | 8.17% | 7.73% | 3.87% |
| Benchmark | 17.89% | 1.61% | -0.62% | 21.15% | 4.35% | 8.68% | 8.26% | 4.41% |

Statistische Angaben (annualisiert)

| | 1 Jahr | 3 Jahre | 5 Jahre | 10 Jahre | Aufl. |
|---------------------------------|--------|---------|---------|----------|--------|
| Volatilität Anlagegruppe (in %) | 11.33 | 14.16 | 16.33 | 14.81 | 15.77 |
| Volatilität Benchmark (in %) | 11.17 | 14.17 | 16.30 | 14.77 | 15.78 |
| Tracking Error ex post (in %) | 0.48 | 0.41 | 0.46 | 0.61 | 0.91 |
| Information Ratio | -2.33 | -2.39 | -1.10 | -0.87 | -0.59 |
| Sharpe Ratio | 1.48 | 0.19 | 0.47 | 0.52 | 0.24 |
| Korrelation | 1.00 | 1.00 | 1.00 | 1.00 | 1.00 |
| Beta | 1.01 | 1.00 | 1.00 | 1.00 | 1.00 |
| Jensen-Alpha | -1.38 | -0.97 | -0.52 | -0.54 | -0.53 |
| Maximum Drawdown (in %) | -13.59 | -23.15 | -34.64 | -34.64 | -59.96 |
| Recovery Period (Jahre) | - | 1.47 | 0.67 | 0.67 | 7.75 |

Performance



Produktinformationen

Valorennummer: 3026051

ISIN: CH0030260514

LEI: 2549000B6X3SG0K4LZ68

Bloomberg-Code: SLAAUPM SW

Benchmark: 80% MSCI World ex CH ESG Leaders, 15% MSCI AC World Small Cap in CHF, 5% MSCI Emerging Markets in CHF

Währung: CHF

Domizil: Schweiz

Auflegedatum: 31/05/2007

Erstausgabepreis: 100.00

Jahresabschluss: 30.09

Ausgabe/Rücknahme: Täglich

Annahmeschluss: 13.00 Uhr

Ausgabe- / Rücknahmekommission: Keine

Ausschüttungspraxis: Thesaurierung

Asset Manager gemäss Swiss Life Best Select Invest Plus® Large&Mid Caps (passiv)
UBS AG

Small Caps (aktiv)
50% Invesco / 50% Dimensional

Emerging Markets (aktiv)
50% Amundi / 50% Robeco

Externe Beratung:
PPCmetrics erbringt folgende Dienstleistungen: Beratung betreffend geeigneter Mandatsstrukturen (Core-Satellite), Unterstützung bei der Selektion geeigneter Asset Manager sowie Unterstützung bei der laufenden Überwachung der Asset Manager und Beurteilung der Anlagesresultate.

Kurspublikationen: Bloomberg: ASSL
www.swisslife.ch/anlagestiftung

Betriebsaufwandquote TER KGAST

ex ante: 0.38%

ex post per: 30/09/2024 0.38%

PM-Tranche: Der Erwerb dieser Tranche ist nur im Rahmen einer speziellen Vereinbarung mit Swiss Life Asset Management AG möglich.

Benchmark: Bis 31.03.2022 80% MSCI World ex CH in CHF, 15% MSCI AC World Small Cap in CHF, 5% MSCI Emerging Markets in CHF - Bis 31.12.2009 100% MSCI World, ex CH, in CHF.

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.

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 Branchen

| | Anlagegruppe | Benchmark |
|----------------------------|--------------|-----------|
| Informationstechnologie | 23.59% | 25.11% |
| Finanzen | 15.70% | 15.28% |
| Industrieunternehmen | 13.28% | 11.86% |
| Zyklische Konsumgüter | 11.46% | 11.25% |
| Gesundheitswesen | 10.45% | 10.64% |
| Kommunikationsdienste | 6.79% | 7.38% |
| Nichtzyklische Konsumgüter | 5.68% | 5.99% |
| Roh- und Grundstoffe | 4.53% | 4.50% |
| Immobilien | 3.44% | 3.22% |
| Energie | 2.82% | 2.80% |
| Versorgungsbetriebe | 1.82% | 1.97% |
| Liquidität | 0.40% | - |

Grösste Positionen

| | Anlagegruppe | Benchmark |
|-------------------------|--------------|-----------|
| MICROSOFT CORP | 5.88% | 6.78% |
| NVIDIA CORP | 5.78% | 6.67% |
| ALPHABET INC | 3.52% | 4.06% |
| TESLA INC | 1.45% | 1.68% |
| ELI LILLY & CO | 1.38% | 1.60% |
| VISA INC | 0.84% | 0.97% |
| MASTERCARD INC | 0.80% | 0.91% |
| PROCTER & GAMBLE CO/THE | 0.79% | 0.91% |
| HOME DEPOT INC/THE | 0.78% | 0.90% |
| JOHNSON & JOHNSON | 0.75% | 0.87% |

Portfoliostruktur nach Ländern/Regionen

| | Anlagegruppe | Benchmark |
|---------------------|--------------|-----------|
| USA | 66.65% | 67.84% |
| Japan | 6.30% | 6.73% |
| Grossbritannien | 4.19% | 3.67% |
| Kanada | 2.79% | 3.11% |
| Frankreich | 2.55% | 2.55% |
| Deutschland | 1.16% | 1.00% |
| Übriges Europa | 6.95% | 6.23% |
| Übrige Länder Asien | 6.16% | 6.29% |
| Übrige | 2.84% | 2.56% |
| Liquidität | 0.40% | - |

Portfoliostruktur nach Währungen

| | Anlagegruppe | Benchmark |
|--------|--------------|-----------|
| USD | 67.87% | 68.03% |
| EUR | 7.41% | 6.90% |
| JPY | 6.32% | 6.73% |
| GBP | 4.29% | 3.68% |
| CHF | 0.47% | 0.21% |
| Übrige | 13.63% | 14.43% |

Weitere Angaben zu den Gesellschaften

| | |
|---------------------------------------|-------|
| Anzahl Gesellschaften | 7'778 |
| Anteil Nicht-Benchmark-Gesellschaften | 6.07% |

Anlagestiftung Swiss Life

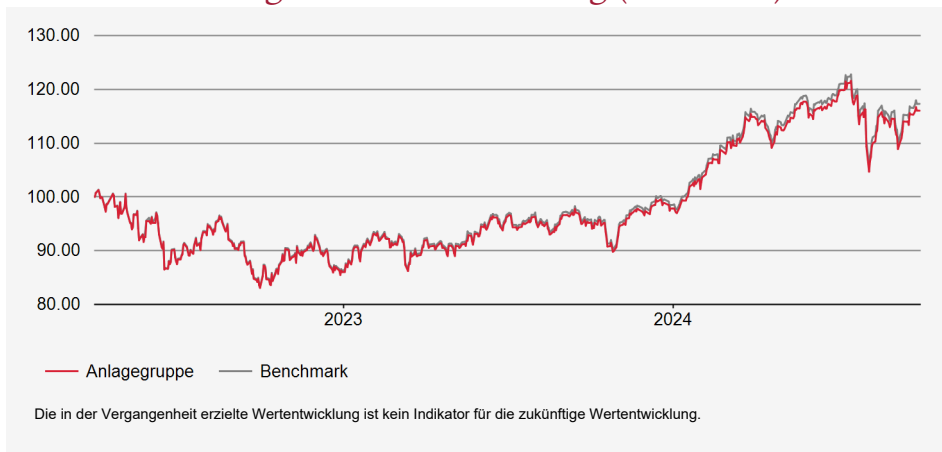
Aktien Ausland ESG Indexiert PM

Nettovermögen (NAV) in Mio. CHF: 610.15
Nettovermögen pro Anspruch in CHF: 116.03

Anlagestrategie

Anlagen in Beteiligungspapieren von Gesellschaften, die im MSCI World ex Switzerland ESG Leaders, in CHF enthalten sind. Zugelassen sind auch Beteiligungspapieren von Gesellschaften, die aufgrund von Benchmark-Anpassungen noch nicht oder nicht mehr in der Benchmark enthalten sind (max. Abweichung +0.5 Prozentpunkte). Umsetzung mittels Swiss Life iFunds (CH) Equity ESG Global ex Switzerland (CHF).

Wertentwicklung in Referenzwährung (Basis 100)



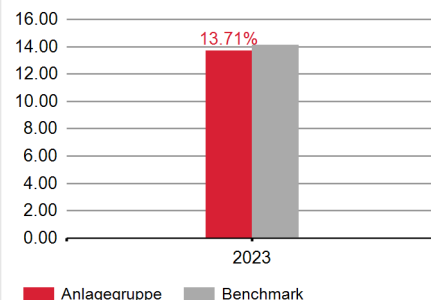
Performance in Referenzwährung

| | Kumulierte Performance | | | | Annualisierte Performance | | | |
|--------------|------------------------|---------|----------|--------|---------------------------|---------|----------|-------|
| | YTD | 1 Monat | 3 Monate | 1 Jahr | 3 Jahre | 5 Jahre | 10 Jahre | Aufl. |
| Anlagegruppe | 18.58% | 1.30% | -1.46% | 21.89% | - | - | - | 6.12% |
| Benchmark | 19.08% | 1.34% | -1.32% | 22.55% | - | - | - | 6.58% |

Statistische Angaben (annualisiert)

| | 1 Jahr | 3 Jahre | 5 Jahre | 10 Jahre | Aufl. |
|---------------------------------|--------|---------|---------|----------|--------|
| Volatilität Anlagegruppe (in %) | 11.39 | - | - | - | 14.83 |
| Volatilität Benchmark (in %) | 11.42 | - | - | - | 14.85 |
| Tracking Error ex post (in %) | 0.07 | - | - | - | 0.14 |
| Information Ratio | -9.10 | - | - | - | -3.24 |
| Sharpe Ratio | 1.61 | - | - | - | 0.32 |
| Korrelation | 1.00 | - | - | - | 1.00 |
| Beta | 1.00 | - | - | - | 1.00 |
| Jensen-Alpha | -0.59 | - | - | - | -0.46 |
| Maximum Drawdown (in %) | -13.90 | - | - | - | -17.96 |
| Recovery Period (Jahre) | - | - | - | - | 1.30 |

Performance



Produktinformationen

Valorennummer: 117189938
ISIN: CH1171899383
LEI: 254900Q154AKVWL8UQ41
Bloomberg-Code: SWAEIPC SW
Benchmark: MSCI World ex Switzerland ESG Leaders Net Return
Währung: CHF
Domizil: Schweiz
Auflagedatum: 31/03/2022
Erstausgabepreis: 100.00
Jahresabschluss: 30.09
Ausgabe/Rücknahme: Täglich
Annahmeschluss: 13.00 Uhr
Ausgabe- / Rücknahmekommission: Keine
Ausschüttungspraxis: Thesaurierung
Asset Manager gemäss Swiss Life Best Select Invest Plus@: UBS AG

Externe Beratung:
 PPCmetrics erbringt 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: 0.32%
ex post per: 30/09/2024 0.32%

Portfoliostruktur nach Branchen

| | Anlagegruppe | Benchmark |
|----------------------------|--------------|-----------|
| Informationstechnologie | 27.69% | 27.88% |
| Finanzen | 14.82% | 14.89% |
| Gesundheitswesen | 11.22% | 11.27% |
| Industrieunternehmen | 10.64% | 10.70% |
| Zyklische Konsumgüter | 10.61% | 10.68% |
| Kommunikationsdienste | 8.01% | 8.05% |
| Nichtzyklische Konsumgüter | 6.19% | 6.24% |
| Roh- und Grundstoffe | 3.73% | 3.73% |
| Energie | 2.45% | 2.46% |
| Immobilien | 2.29% | 2.32% |
| Versorger | 1.74% | 1.78% |
| Liquidität | 0.60% | - |

Grösste Positionen

| | Anlagegruppe | Benchmark |
|-------------------------|--------------|-----------|
| MICROSOFT CORP | 8.42% | 8.48% |
| NVIDIA CORP | 8.28% | 8.34% |
| ALPHABET INC | 5.04% | 5.08% |
| TESLA INC | 2.08% | 2.10% |
| ELI LILLY & CO | 1.98% | 2.00% |
| VISA INC | 1.20% | 1.21% |
| MASTERCARD INC | 1.14% | 1.14% |
| PROCTER & GAMBLE CO/THE | 1.13% | 1.14% |
| HOME DEPOT INC/THE | 1.11% | 1.12% |
| JOHNSON & JOHNSON | 1.08% | 1.09% |

Portfoliostruktur nach Ländern/Regionen

| | Anlagegruppe | Benchmark |
|---------------------|--------------|-----------|
| USA | 73.77% | 74.18% |
| Japan | 6.24% | 6.24% |
| Grossbritannien | 3.61% | 3.66% |
| Kanada | 3.19% | 3.22% |
| Frankreich | 2.92% | 2.98% |
| Deutschland | 1.04% | 1.02% |
| Übriges Europa | 6.20% | 6.25% |
| Übrige Länder Asien | 2.42% | 2.44% |
| Übrige | - | - |
| Liquidität | 0.60% | - |

Portfoliostruktur nach Währungen

| | Anlagegruppe | Benchmark |
|--------|--------------|-----------|
| USD | 74.20% | 74.18% |
| EUR | 7.42% | 7.51% |
| JPY | 6.26% | 6.24% |
| GBP | 3.74% | 3.67% |
| Übrige | 8.38% | 8.39% |

Anlagestiftung Swiss Life

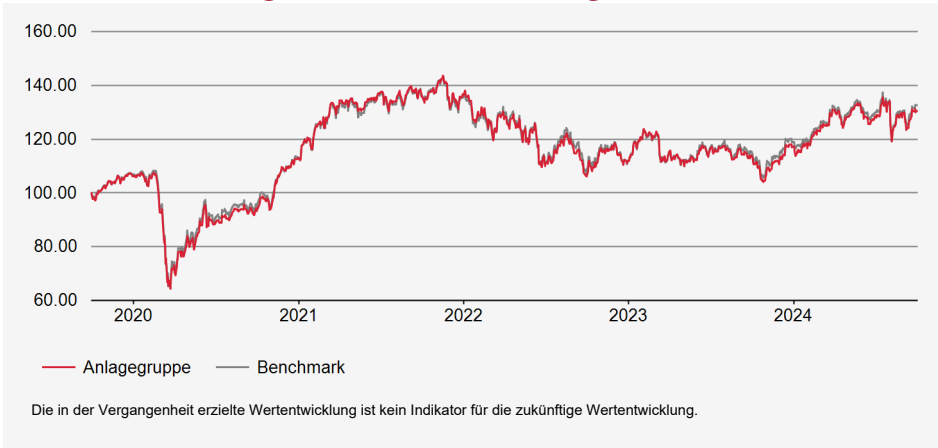
Aktien Global Small Caps PM

Nettovermögen (NAV) in Mio. CHF: 468.19
Nettovermögen pro Anspruch in CHF: 124.27

Anlagestrategie

Anlagen in kleinkapitalisierte Beteiligungspapiere weltweit. Aktive Länder-, Branchen- und Titelselektion. Gesellschaftsbegrenzung: 5%. Umsetzung mittels Invesco Global Small Cap Equity Fund und Dimensional Global Small Cap Equity Fund.

Wertentwicklung in Referenzwährung (Basis 100)



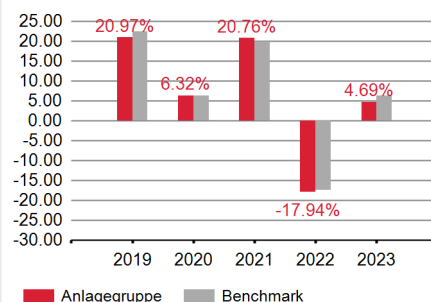
Performance in Referenzwährung

| | Kumulierte Performance | | | | Annualisierte Performance | | | |
|--------------|------------------------|---------|----------|--------|---------------------------|---------|----------|-------|
| | YTD | 1 Monat | 3 Monate | 1 Jahr | 3 Jahre | 5 Jahre | 10 Jahre | Aufl. |
| Anlagegruppe | 11.30% | 0.62% | 1.85% | 14.60% | -1.34% | 5.46% | - | 3.35% |
| Benchmark | 11.54% | 1.54% | 2.13% | 14.91% | -0.79% | 5.80% | - | 4.84% |

Statistische Angaben (annualisiert)

| | 1 Jahr | 3 Jahre | 5 Jahre | 10 Jahre | Aufl. |
|---------------------------------|--------|---------|---------|----------|--------|
| Volatilität Anlagegruppe (in %) | 14.43 | 15.99 | 20.19 | - | 19.30 |
| Volatilität Benchmark (in %) | 13.85 | 15.96 | 19.77 | - | 18.98 |
| Tracking Error ex post (in %) | 1.78 | 1.80 | 1.90 | - | 2.35 |
| Information Ratio | -0.18 | -0.31 | -0.18 | - | -0.63 |
| Sharpe Ratio | 0.84 | -0.13 | 0.26 | - | 0.18 |
| Korrelation | 0.99 | 0.99 | 1.00 | - | 0.99 |
| Beta | 1.03 | 1.00 | 1.02 | - | 1.01 |
| Jensen-Alpha | -0.77 | -0.56 | -0.43 | - | -1.53 |
| Maximum Drawdown (in %) | -12.06 | -27.52 | -40.04 | - | -41.60 |
| Recovery Period (Jahre) | - | - | 0.67 | - | 0.73 |

Performance



Produktinformationen

Valorennummer: 40068790
ISIN: CH0400687908
LEI: 254900XCUD9NTWJQU706
Bloomberg-Code: SLAGSPM SW
Benchmark: MSCI AC World Small Cap, in CHF
Währung: CHF
Domizil: Schweiz
Aufledgedatum: 28/02/2018
Erstausgabepreis: 100.00
Jahresabschluss: 30.09
Ausgabe/Rücknahme: Täglich
Annahmeschluss: 13.00 Uhr
Ausgabe- / Rücknahmekommission: Keine
Ausschüttungspraxis: Thesaurierung
Asset Manager gemäss Swiss Life Best Select Invest Plus@: 50% Invesco / 50% Dimensional

Externe Beratung:
 PPCmetrics erbringt folgende Dienstleistungen: Beratung betreffend geeigneter Mandatsstrukturen, Unterstützung bei der Selektion geeigneter Asset Manager sowie Unterstützung bei der laufenden Überwachung der Asset Manager und Beurteilung der Anlageresultate.
Kurspublikationen: Bloomberg: ASSL
www.swisslife.ch/anlagestiftung
Betriebsaufwandquote TER KGAST ex ante: 0.59%
ex post per: 30/09/2024 0.59%

PM-Tranche: Der Erwerb dieser Tranche ist nur im Rahmen einer speziellen Vereinbarung mit Swiss Life Asset Management AG möglich.

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.

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

Aktien Global Small Caps PM



Portfoliostruktur nach Branchen

| | Anlagegruppe | Benchmark |
|----------------------------|--------------|-----------|
| Industrieunternehmen | 22.01% | 19.72% |
| Finanzen | 16.42% | 14.82% |
| Zyklische Konsumgüter | 12.64% | 13.48% |
| Informationstechnologie | 12.11% | 11.22% |
| Gesundheitswesen | 10.03% | 9.64% |
| Roh- und Grundstoffe | 6.80% | 7.91% |
| Immobilien | 6.29% | 8.59% |
| Nichtzyklische Konsumgüter | 4.46% | 4.89% |
| Energie | 3.87% | 3.96% |
| Kommunikationsdienste | 3.22% | 3.13% |
| Versorgungsbetriebe | 1.78% | 2.64% |
| Liquidität | 0.37% | - |

Grösste Positionen

| | Anlagegruppe | Benchmark |
|-----------------------------|--------------|-----------|
| TAYLOR MORRISON | 0.66% | 0.04% |
| CACTUS | 0.63% | 0.02% |
| PLANISWARE | 0.59% | 0.00% |
| WEATHERFORD INTERNAT | 0.56% | 0.03% |
| SPROUTS FARMERS MARKET | 0.54% | 0.06% |
| PIPER SANDLER | 0.49% | 0.03% |
| SIGMAROC | 0.46% | - |
| TMX | 0.44% | - |
| PINNACLE FINANCIAL PARTNERS | 0.44% | 0.04% |
| HELIOS TOWERS | 0.41% | 0.01% |

Portfoliostruktur nach Ländern/Regionen

| | Anlagegruppe | Benchmark |
|---------------------|--------------|-----------|
| USA | 60.31% | 56.65% |
| Japan | 7.69% | 11.61% |
| Grossbritannien | 6.55% | 4.95% |
| Kanada | 2.26% | 3.57% |
| Frankreich | 2.00% | 1.10% |
| Deutschland | 1.72% | 1.24% |
| Übriges Europa | 10.36% | 8.20% |
| Übrige Länder Asien | 5.56% | 8.66% |
| Übrige | 3.17% | 4.03% |
| Liquidität | 0.37% | - |

Portfoliostruktur nach Währungen

| | Anlagegruppe | Benchmark |
|--------|--------------|-----------|
| USD | 62.28% | 56.90% |
| EUR | 8.52% | 5.80% |
| JPY | 7.73% | 11.60% |
| GBP | 6.62% | 4.97% |
| CHF | 1.86% | 1.42% |
| Übrige | 12.99% | 19.31% |

Weitere Angaben zu den Gesellschaften

| | |
|---------------------------------------|--------|
| Anzahl Gesellschaften | 6'835 |
| Anteil Nicht-Benchmark-Gesellschaften | 23.05% |

Anlagestiftung Swiss Life

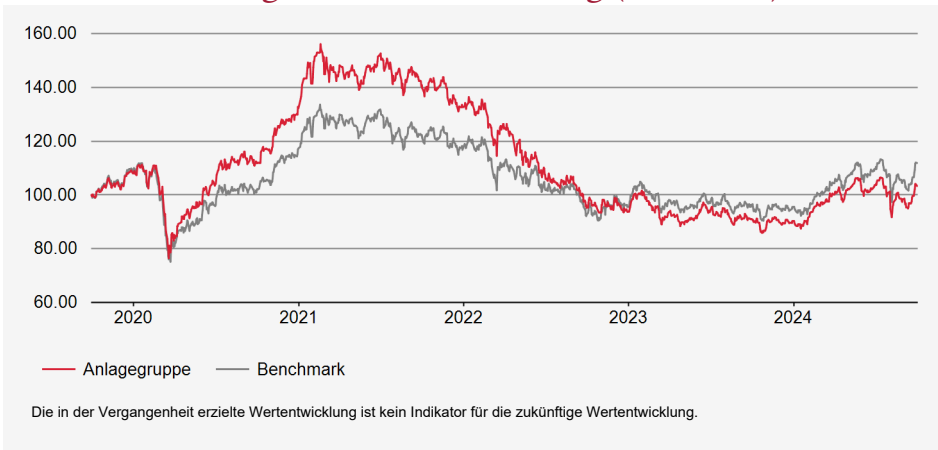
Aktien Emerging Markets ESG PM

Nettovermögen (NAV) in Mio. CHF: 261.74
Nettovermögen pro Anspruch in CHF: 88.34

Anlagestrategie

Anlagen in Beteiligungspapiere von Gesellschaften mit Domizil in Entwicklungsländern. Aktive Länder-, Branchen- und Titelselektion. Umsetzung mittels Einsatz des Fonds Amundi Emerging Markets Equity Focus und des fonds Robeco Emerging Markets Equities; SICAV nach luxemburgischem Recht gemäss UCITS.

Wertentwicklung in Referenzwährung (Basis 100)



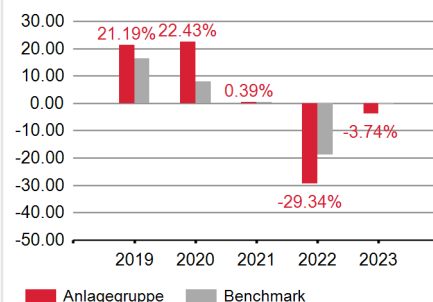
Performance in Referenzwährung

| | Kumulierte Performance | | | | Annualisierte Performance | | | |
|--------------|------------------------|---------|----------|--------|---------------------------|---------|----------|--------|
| | YTD | 1 Monat | 3 Monate | 1 Jahr | 3 Jahre | 5 Jahre | 10 Jahre | Aufl. |
| Anlagegruppe | 14.43% | 4.94% | -0.28% | 13.47% | -9.81% | 0.65% | - | -1.84% |
| Benchmark | 17.13% | 6.06% | 2.06% | 16.23% | -2.91% | 2.27% | - | 0.03% |

Statistische Angaben (annualisiert)

| | 1 Jahr | 3 Jahre | 5 Jahre | 10 Jahre | Aufl. |
|---------------------------------|--------|---------|---------|----------|--------|
| Volatilität Anlagegruppe (in %) | 12.18 | 13.88 | 16.60 | - | 16.60 |
| Volatilität Benchmark (in %) | 12.95 | 14.52 | 16.38 | - | 16.01 |
| Tracking Error ex post (in %) | 2.50 | 4.73 | 5.16 | - | 5.16 |
| Information Ratio | -1.10 | -1.46 | -0.31 | - | -0.36 |
| Sharpe Ratio | 0.92 | -0.79 | 0.03 | - | -0.11 |
| Korrelation | 0.98 | 0.94 | 0.95 | - | 0.95 |
| Beta | 0.92 | 0.90 | 0.96 | - | 0.99 |
| Jensen-Alpha | -1.63 | -7.26 | -1.54 | - | -1.87 |
| Maximum Drawdown (in %) | -13.84 | -40.27 | -44.96 | - | -44.96 |
| Recovery Period (Jahre) | - | - | - | - | - |

Performance



Produktinformationen

Valorennummer: 39561964
ISIN: CH0395619643
LEI: 254900OLXTUB1EYJLV86
Bloomberg-Code: SWLAEPM SW
Benchmark: MSCI Emerging Markets, in CHF
Währung: CHF
Domizil: Schweiz
Aufledgedatum: 31/01/2018
Erstausgabepreis: 100.00
Jahresabschluss: 30.09
Ausgabe/Rücknahme: Täglich
Annahmeschluss: 13.00 Uhr
Ausgabe- / Rücknahmekommission: Keine
Ausschüttungspraxis: Thesaurierung
Asset Manager gemäss Swiss Life Best Select Invest Plus@: 50% Amundi / 50% Robeco

Externe Beratung: PPCmetrics erbringt folgende Dienstleistungen: Beratung betreffend geeigneter Mandatsstrukturen, Unterstützung bei der Selektion geeigneter Asset Manager sowie Unterstützung bei der laufenden Überwachung der Asset Manager und Beurteilung der Anlageresultate.
Kurspublikationen: Bloomberg: ASSL
www.swisslife.ch/anlagestiftung
Betriebsaufwandquote TER KGAST ex ante: 0.46%
ex post per: 30/09/2024 0.46%

PM-Tranche: Der Erwerb dieser Tranche ist nur im Rahmen einer speziellen Vereinbarung mit Swiss Life Asset Management AG möglich.

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.

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 Branchen

| | Anlagegruppe | Benchmark |
|----------------------------|--------------|-----------|
| Finanzen | 18.23% | 22.92% |
| Informationstechnologie | 18.00% | 22.50% |
| Zyklische Konsumgüter | 13.17% | 13.79% |
| Kommunikationsdienste | 5.90% | 9.36% |
| Industrieunternehmen | 4.51% | 6.76% |
| Immobilien | 4.13% | 1.58% |
| Nichtzyklische Konsumgüter | 3.66% | 5.20% |
| Roh- und Grundstoffe | 3.28% | 6.63% |
| Versorgungsbetriebe | 2.54% | 2.92% |
| Energie | 2.17% | 4.77% |
| Gesundheitswesen | 1.36% | 3.57% |
| Liquidität | 22.99% | - |

Grösste Positionen

| | Anlagegruppe | Benchmark |
|--|--------------|-----------|
| TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFACTURING CO LT | 7.29% | 9.18% |
| SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD | 3.11% | 2.96% |
| ALIBABA GROUP HOLDING LTD | 2.44% | 2.51% |
| TENCENT HOLDINGS LTD | 2.08% | 2.22% |
| HDFC BANK LTD | 2.05% | 1.07% |
| NASPERS LTD | 1.55% | 0.26% |
| INFOSYS LTD | 1.48% | 0.46% |
| ICICI BANK LTD ADR | 1.32% | - |
| HON HAI PRECISION INDUSTRY CO LTD | 0.97% | 0.45% |
| SK HYNIX INC | 0.88% | 0.44% |

Portfoliostruktur nach Ländern/Regionen

| | Anlagegruppe | Benchmark |
|-----------------------|--------------|-----------|
| China | 18.60% | 27.24% |
| Indien | 14.90% | 19.63% |
| Taiwan | 11.59% | 17.79% |
| Korea | 10.07% | 10.53% |
| Brasilien | 4.51% | 4.85% |
| Südafrika | 2.84% | 3.03% |
| Übrige Länder Asien | 5.85% | 5.26% |
| Übrige Länder EMEA | 6.45% | 8.97% |
| Übrige Länder Amerika | 2.22% | 2.71% |
| Liquidität | 22.99% | - |

Portfoliostruktur nach Währungen

| | Anlagegruppe | Benchmark |
|--------|--------------|-----------|
| HKD | 13.74% | 21.19% |
| TWD | 12.26% | 17.82% |
| INR | 12.20% | 19.63% |
| KRW | 10.11% | 10.53% |
| USD | 6.25% | 3.00% |
| EUR | 1.19% | 0.46% |
| CHF | 0.00% | - |
| Übrige | 44.29% | 27.32% |

Weitere Angaben zu den Gesellschaften

| | |
|---------------------------------------|-------|
| Anzahl Gesellschaften | 265 |
| Anteil Nicht-Benchmark-Gesellschaften | 3.39% |

Anlagestiftung Swiss Life

Aktien Global Protect Flex PM (CHF hedged)

Nettovermögen (NAV) in Mio. CHF: 787.44
Nettovermögen pro Anspruch in CHF: 160.49

Anlagestrategie

Regelbasierte aktive Anlagestrategie mit ergänzender Absicherungsstrategie. Anlageuniversum besteht aus Gesellschaften der wichtigsten ausländischen Börsenindizes (S&P 500, Euro Stoxx 50, FTSE 100 und Nikkei 225) sowie dem SMI; die Gewichtung erfolgt nach der Marktkapitalisierung. Die Fremdwährungsrisiken werden zu mindestens 90% gegen CHF abgesichert. Investitionen können in Form von Beteiligungspapieren, kollektiven Anlagen oder derivativen Instrumenten erfolgen. Der ergänzende Einsatz einer Absicherungsstrategie, bestehend aus Optionen, bewirkt bei stark sinkenden Märkten eine Verminderung der Kursverluste und bei stark steigenden Märkten eine Limitierung des Aufwärtspotentials („Put Spread Collar“). Je nach Markteinschätzung kann auf den Verkauf der Put-Option und/oder der Call-Option verzichtet werden. Umsetzung mittels Einsatz des SLF (CH) Equity Global Protect (CHF hedged).

Wertentwicklung in Referenzwährung (Basis 100)



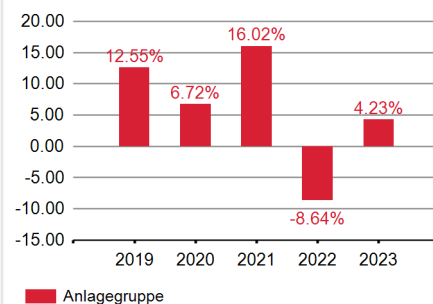
Performance in Referenzwährung

| | Kumulierte Performance | | | | Annualisierte Performance | | | |
|--------------|------------------------|---------|----------|--------|---------------------------|---------|----------|-------|
| | YTD | 1 Monat | 3 Monate | 1 Jahr | 3 Jahre | 5 Jahre | 10 Jahre | Aufl. |
| Anlagegruppe | 13.01% | 0.82% | 2.83% | 18.50% | 4.42% | 6.54% | - | 5.77% |

Statistische Angaben (annualisiert)

| | 1 Jahr | 3 Jahre | 5 Jahre | 10 Jahre | Aufl. |
|---------------------------------|--------|---------|---------|----------|--------|
| Volatilität Anlagegruppe (in %) | 7.68 | 10.30 | 9.88 | - | 8.44 |
| Sharpe Ratio | 2.02 | 0.35 | 0.63 | - | 0.69 |
| Maximum Drawdown (in %) | -6.60 | -14.29 | -15.96 | - | -15.96 |
| Recovery Period (Jahre) | 0.14 | 1.42 | 0.63 | - | 0.63 |

Performance



Produktinformationen

Valorennummer: 31954200
ISIN: CH0319542004
LEI: 254900LUAQC3MC0MWL48
Bloomberg-Code: SLAGCPM SW
Währung: CHF
Domizil: Schweiz
Aufgagedatum: 29/04/2016
Erstausgabepreis: 100.00
Jahresabschluss: 30.09
Ausgabe/Rücknahme: Täglich
Annahmeschluss: 13.00 Uhr
Ausgabe- / Rücknahmekommission: Keine
Ausschüttungspraxis: Thesaurierung
Asset Manager: Swiss Life Asset Management AG
Kurspublikationen: Bloomberg: ASSL
www.swisslife.ch/anlagestiftung
Betriebsaufwandquote TER KGAST
ex ante: 0.15%
ex post per: 30/09/2024 0.15%

PM-Tranche: Der Erwerb dieser Tranche ist nur im Rahmen einer speziellen Vereinbarung mit Swiss Life Asset Management AG möglich.

Betriebsaufwandquote TER KGAST: Die Betriebsaufwandquote TER KGAST deckt sämtliche Kosten mit Ausnahme der Transaktionskosten und der transaktionsbezogenen steuerlichen Abgaben ab.

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

Aktien Global Protect Flex PM (CHF hedged)

Portfoliostruktur nach Branchen

| | Anlagegruppe |
|----------------------------|--------------|
| Informationstechnologie | 16.09% |
| Finanzen | 15.02% |
| Gesundheitswesen | 12.68% |
| Industrieunternehmen | 12.46% |
| Nichtzyklische Konsumgüter | 7.75% |
| Zyklische Konsumgüter | 7.44% |
| Versorgungsbetriebe | 5.41% |
| Kommunikationsdienste | 5.05% |
| Roh- und Grundstoffe | 3.95% |
| Energie | 2.95% |
| Immobilien | 2.84% |
| Future auf Aktienindex | 0.78% |
| Liquidität / Darlehen | 7.57% |

Grösste Positionen

| | Anlagegruppe |
|-----------------------------|--------------|
| INTL BUSINESS MACHINES CORP | 0.79% |
| T-MOBILE US INC | 0.77% |
| WALMART INC | 0.74% |
| CHUBB LTD | 0.69% |
| CISCO SYSTEMS INC | 0.68% |
| JOHNSON & JOHNSON | 0.68% |
| PEPSICO INC | 0.66% |
| MOTOROLA SOLUTIONS INC | 0.61% |
| ACCENTURE PLC-CL A | 0.61% |
| ELI LILLY & CO | 0.61% |

Portfoliostruktur nach Ländern/Regionen

| | Anlagegruppe |
|-------------------------------|--------------|
| USA und Kanada | 67.57% |
| Europäische Region (EUR) | 10.15% |
| Asien-Pazifik-Raum | 7.88% |
| Europäische Region (Ex EUR) | 5.67% |
| Future auf Aktienindex | 0.78% |
| Schwellenländer Lateinamerika | 0.35% |
| Schwellenländer Europa | 0.03% |
| Liquidität / Darlehen | 7.57% |

Haftungsausschluss: 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, c/o Swiss Life AG, Postfach, 8022 Zürich, Tel. 043 547 71 11 und unter www.swisslife.ch/anlagestiftung 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 Vorsorge dienen und Personen, die kollektive Anlagen für diese Einrichtungen verwalten, von der Eidgenössischen Finanzmarktaufsicht FINMA beaufsichtigt werden und bei der Stiftung ausschliesslich Gelder für diese Einrichtungen anlegen. Zusätzlich müssen die erwähnten Anleger eine spezielle Vereinbarung mit der Swiss Life Asset Management AG abgeschlossen haben. Die vergangene Performance stellt keinen Indikator für die laufende und zukünftige Entwicklung dar. Sämtliche Produkt- und Firmennamen sind Marken™ oder eingetragene® Warenzeichen ihrer jeweiligen Inhaber. Ihre Verwendung stellt keine Zugehörigkeit zu ihnen und keine Zustimmung durch sie dar. **Quelle:** Swiss Life Asset Managers. Alle Rechte vorbehalten.

Anlagestiftung Swiss Life

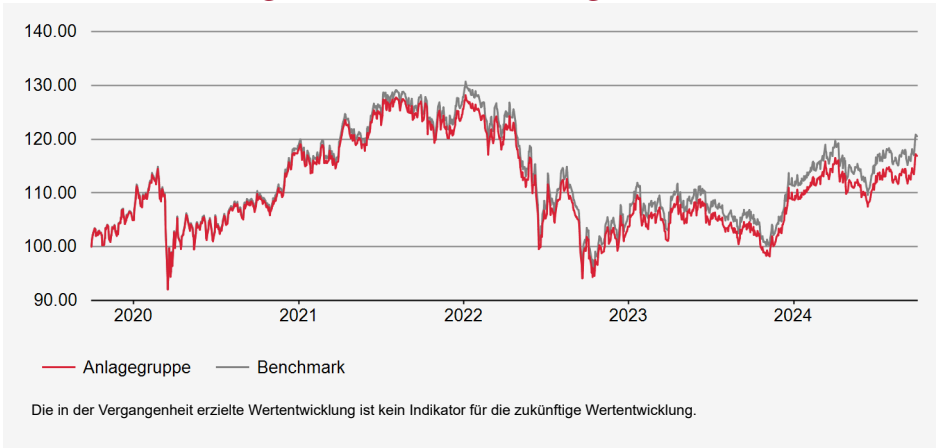
Immobilienfonds Schweiz Indexiert PM

Nettovermögen (NAV) in Mio. CHF: 416.61
Nettovermögen pro Anspruch in CHF: 173.19

Anlagestrategie

Die Anlagegruppe investiert in Immobilien-Anlagefonds, die schweizerischen Rechts sind, auf CHF lauten und ausschliesslich in schweizerische Liegenschaften anlegen. Die Anlagegruppe wird mit einem indexierten Ansatz verwaltet. Das Anlageziel besteht darin, die Benchmark SXI Real Estate® Funds Broad Total Return nachzubilden. Umsetzung mittels Einsatz des Swiss Life Index Funds III (CH) Real Estate Switzerland.

Wertentwicklung in Referenzwährung (Basis 100)



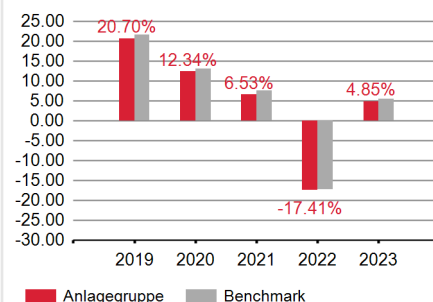
Performance in Referenzwährung

| | Kumulierte Performance | | | | Annualisierte Performance | | | |
|--------------|------------------------|---------|----------|--------|---------------------------|---------|----------|-------|
| | YTD | 1 Monat | 3 Monate | 1 Jahr | 3 Jahre | 5 Jahre | 10 Jahre | Aufl. |
| Anlagegruppe | 7.47% | 2.58% | 4.60% | 13.23% | -2.17% | 3.17% | 4.50% | 4.12% |
| Benchmark | 8.24% | 2.62% | 4.67% | 14.33% | -1.46% | 3.80% | 5.25% | 4.80% |

Statistische Angaben (annualisiert)

| | 1 Jahr | 3 Jahre | 5 Jahre | 10 Jahre | Aufl. |
|---------------------------------|--------|---------|---------|----------|--------|
| Volatilität Anlagegruppe (in %) | 10.52 | 10.05 | 9.94 | 9.00 | 8.31 |
| Volatilität Benchmark (in %) | 10.95 | 10.42 | 10.24 | 9.28 | 8.58 |
| Tracking Error ex post (in %) | 0.60 | 0.53 | 0.44 | 0.48 | 0.50 |
| Information Ratio | -1.82 | -1.33 | -1.44 | -1.58 | -1.37 |
| Sharpe Ratio | 1.04 | -0.29 | 0.30 | 0.52 | 0.51 |
| Korrelation | 1.00 | 1.00 | 1.00 | 1.00 | 1.00 |
| Beta | 0.96 | 0.96 | 0.97 | 0.97 | 0.97 |
| Jensen-Alpha | -0.59 | -0.79 | -0.53 | -0.58 | -0.51 |
| Maximum Drawdown (in %) | -7.76 | -26.55 | -26.55 | -26.55 | -26.55 |
| Recovery Period (Jahre) | 0.29 | - | - | - | - |

Performance



Produktinformationen

Valorennummer: 12468565

ISIN: CH0124685659

LEI: 254900VB5XEQLYLQJ518

Bloomberg-Code: SWLIMPM SW

Benchmark: SXI Real Estate® Funds Broad Total Return

Währung: CHF

Domizil: Schweiz

Aufliedatum: 28/02/2011

Erstausgabepreis: 100.00

Jahresabschluss: 30.09

Ausgabe/Rücknahme: Täglich

Annahmeschluss: 13.00 Uhr

Ausgabe- / Rücknahmekommission: Keine

Ausschüttungspraxis: Thesaurierung

Asset Manager

Swiss Life Asset Management AG

Kurspublikationen: Bloomberg: ASSL
www.swisslife.ch/anlagestiftung

Betriebsaufwandquote TER KGAST

ex ante: 0.94%

ex post per: 30/09/2024 0.98%

PM-Tranche: Erwerb dieser Tranche ist nur im Rahmen einer speziellen Vereinbarung mit Swiss Life Asset Management AG möglich.

Betriebsaufwandquote TER KGAST: Die Betriebsaufwandquote TER KGAST deckt sämtliche Kosten mit Ausnahme der Transaktionskosten und der transaktionsbezogenen steuerlichen Abgaben ab.

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

Immobilienfonds Schweiz Indexiert PM



Grösste Positionen

| | |
|------------------------------|--------|
| UBS PRPRTY FD SW MIXD SIMA | 16.48% |
| CREDIT SUISSE REAL EST SIAT | 6.00% |
| UBS PRPRTY FD SW RESIDTL ANF | 4.98% |
| CS REAL ESTATE LIVINGPLUS | 4.86% |
| SWISS L REF CH ESG SWISS PRO | 3.93% |
| ED DE ROTHSCHILD REAL ESTATE | 3.80% |
| CS REAL ESTATE FD GREEN PROP | 3.68% |
| LA FONCIERE | 3.19% |
| IMMOFONDS | 3.18% |
| UBS PRPRTY FD LEMAN RESD FON | 3.00% |

30. September 2024

Anlagestiftung Swiss Life Infrastruktur Global ESG PM (CHF hedged)



Nettovermögen (NAV) in Mio. CHF: 201.23
Nettovermögen pro Anspruch in CHF: 112.53

Management Kommentar und Ausblick

Während des Berichtszeitraums Q3 2024 kam es zu keinen weiteren Kapitalabrufen der Anleger. Über die Anlagegruppe Infrastruktur Global ESG (EUR) wurde jedoch weiter in Zielinvestments investiert. Dabei handelte es sich um Investitionen in Zielfonds und Kapitalabrufe zweier Direktanlagen. Das Anlagegruppenvermögen hat sich im dritten Quartal 2024 positiv entwickelt. Einen leicht negativen Effekt auf die Gesamtbewertung hatten die Fremdwährungen im Anlagegruppenvermögen. Im vierten Quartal 2024 wird es voraussichtlich zu einem weiteren Kapitalabruf der Anleger kommen.

Anlagestrategie

Erwerb von Ansprüchen der Anlagegruppe Infrastruktur Global ESG (EUR) und Durchführung von Währungsabsicherungen zur Minderung der daraus entstehenden Fremdwährungsrisiken. Die Anlagegruppe hält zur Sicherstellung die für die Währungsabsicherung notwendige Liquidität. Der Anlageertrag der Anlageklasse EUR wird mittels Kapitalanlagenlagen in Infrastrukturinvestments erreicht. Dabei soll ein konservatives bis ausgewogenes Rendite-Risiko-Spektrum abgedeckt werden. (Vgl. Prospekt Anlagegruppe Infrastruktur Global ESG (CHF hedged) Punkt 2.3).

Performance in Referenzwährung

| | Kumulierte Performance | | | Annualisierte Performance | | | |
|--------------|------------------------|----------|--------|---------------------------|---------|----------|-------|
| | YTD | 3 Monate | 1 Jahr | 3 Jahre | 5 Jahre | 10 Jahre | Aufl. |
| Anlagegruppe | -0.15% | 0.06% | 0.39% | 3.34% | - | - | 3.59% |

Indikative Kennzahlen

| | |
|---|-------|
| Kapitalzusagen Anleger* | 259.1 |
| Abgerufenes Kapital* | 191.3 |
| Nettovermögen (NAV)* | 201.2 |
| Kapitalzusagen Portfolio Investments* | 234.8 |
| Anzahl Portfolio Investments (Durchsicht) | 15 |
| Anzahl Beteiligungen (Durchsicht) | 30 |

*in Mio. CHF

Produktinformationen

Valorennummer: 59605226

ISIN: CH0596052263

Bloomberg-Code: SWGCHPC SW

Währung: CHF

Domizil: Schweiz

Aufledgedatum: 26/05/2021

Erstausgabepreis: 100.00

Jahresabschluss: 30.09

Ausschüttungspraxis: Thesaurierend

Asset Manager:

Swiss Life Asset Management AG

Administrator:

Northern Trust Global Services SE
Leudelange Luxembourg
Zweigniederlassung Basel

Revisionsstelle:

PricewaterhouseCoopers AG

Depotbank:

UBS Switzerland AG

Kurspublikationen: Bloomberg: ASSL

www.swisslife.ch/anlagestiftung

Betriebsaufwandquote TER KGAST

ex ante: 1.22%

ex post per: 30/09/2024 1.22%

Rücknahme von Ansprüchen: Die Rücknahme von Ansprüchen erfolgt jeweils jährlich per 30. September (Rücknahmeterrin), unter Einhaltung einer neunmonatigen Kündigungsfrist, erstmals per 30. September 2025, wobei die Rücknahmebegrenzungen der Anlagegruppe Infrastruktur Global (EUR) zu berücksichtigen sind.

Portfolio Investments*

| | Kapitalzusagen | Nettovermögen |
|--|----------------|---------------|
| Swiss Life Funds (LUX) ESG Global Infrastructure Opportunities III | 30.86% | 34.36% |
| Swiss Life Funds (LUX) ESG GIO III Co-Invest | 11.70% | 12.57% |
| FONTAVIS ESG Renewable Infrastructure Fund II («FORTE II») | 9.58% | 7.58% |
| Swiss Life Funds (LUX) ESG Global Infrastructure Opportunities Growth II | 8.51% | 3.39% |
| FONTAVIS ESG Renewable Infrastructure Fund Europe («FORTE») | 5.32% | 7.21% |
| Co-Investment Transition Network Operator Ampriom | 5.32% | 3.46% |
| Co-Investment District Heating UK | 4.99% | 5.43% |
| Co-Investment Saffir (offshore Norway) | 4.69% | 5.03% |
| Co-Investment TTT via Bazalgette (Investments) Ltd | 3.72% | 4.54% |
| Co-Investment JFK via JLC Terminal One Co-Invest L.P. | 3.40% | 2.21% |
| Andere | 11.91% | 14.22% |

*Ohne Liquidität

Assets nach Sektoren*

| | |
|-------------------------------|--------|
| Erneuerbare Energie / Energie | 32.49% |
| Kommunikation | 31.10% |
| Transport | 12.82% |
| Soziale Infrastruktur | 12.42% |
| Versorger | 11.17% |
| Andere | - |

*Ohne Liquidität

Assets nach Region*

| | |
|--------------------------------|--------|
| Europa (inkl. Grossbritannien) | 79.96% |
| Nord Amerika | 18.49% |
| Schweiz | 1.55% |
| Sonstige Regionen | - |

*Ohne Liquidität

Assets nach Stadium*

| | |
|------------|--------|
| Brownfield | 91.33% |
| Greenfield | 8.67% |

*Ohne Liquidität

Assets nach Währung*

| | |
|-----|--------|
| EUR | 60.76% |
| USD | 19.53% |
| GBP | 18.16% |
| CHF | 1.55% |

*Ohne Liquidität

30. September 2024

Anlagestiftung Swiss Life Infrastruktur Global ESG PM (EUR)



Nettovermögen (NAV) in Mio. EUR: 430.97
Nettovermögen pro Anspruch in EUR: 119.12

Management Kommentar und Ausblick

Während des Berichtszeitraums Q3 2024 konnte die Anlagegruppe Infrastruktur Global ESG (EUR) ca. EUR 10 Mio. in ihre Zielinvestments investieren. Dabei handelte es sich um Kapitalabrufe der Zielfonds (ca. EUR 7 Mio.) und zweier Direktanlagen (ca. EUR 3 Mio.). Weiterhin hat sich das Anlagegruppenvermögen im Berichtszeitraum stabil positiv entwickelt. Im vierten Quartal 2024 wird es voraussichtlich zu einem weiteren Kapitalabruf der Anleger kommen. Das Portfoliomanagement prüft neue Kapitalallokationen im Fonds- und Direktanlagenbereich.

Anlagestrategie

Partizipation an mehreren diversifizierten Infrastrukturfonds und Direktanlagen in OECD-Ländern, die von Swiss Life verwaltet werden. Fokus auf Core/Core+ Strategien und regelmässige Ausschüttungen aus dem operativen Geschäft. Diversifikation nach Ländern, Regionen, Standorten, Sektoren, Technologien, Anlagenalter und Cashflow-Profilen. Investmentprozess berücksichtigt Risiko- und Finanzfaktoren sowie ESG Kriterien. (Vgl. Prospekt Anlagegruppe Infrastruktur Global ESG (EUR) Punkt 2.3).

Performance in Referenzwährung

| | Kumulierte Performance | | | Annualisierte Performance | | | |
|--------------|------------------------|----------|--------|---------------------------|---------|----------|-------|
| | YTD | 3 Monate | 1 Jahr | 3 Jahre | 5 Jahre | 10 Jahre | Aufl. |
| Anlagegruppe | 1.92% | 0.82% | 3.13% | 5.40% | - | - | 5.59% |

Indikative Kennzahlen

| | |
|---|-------|
| Kapitalzusagen Anleger* | 502.3 |
| Abgerufenes Kapital* | 395.8 |
| Nettovermögen (NAV)* | 431.0 |
| Kapitalzusagen Portfolio Investments* | 470.0 |
| Anzahl Portfolio Investments (Durchsicht) | 15 |
| Anzahl Beteiligungen (Durchsicht) | 30 |

*in Mio. EUR

Produktinformationen

Valorennummer: 59600218

ISIN: CH0596002185

Bloomberg-Code: SWIGEP SW

Währung: EUR

Domizil: Schweiz

Aufledgedatum: 26/05/2021

Erstausgabepreis: 100.00

Jahresabschluss: 30.09

Ausschüttungspraxis: Ausschüttend

Letzte Ausschüttung per:

21/02/2024 EUR 0.85

Asset Manager:

Swiss Life Asset Management AG

Administrator:

Northern Trust Global Services SE

Leudelange Luxembourg

Zweigniederlassung Basel

Revisionsstelle:

PricewaterhouseCoopers AG

Depotbank:

UBS Switzerland AG

Kurspublikationen: Bloomberg: ASSL

www.swisslife.ch/anlagestiftung

Betriebsaufwandquote TER KGAST

ex ante: 1.32%

ex post per: 30/09/2024 1.32%

Rücknahme von Ansprüchen: Die Rücknahme von Ansprüchen erfolgt jeweils jährlich per 30. September (Rücknahmetermine), unter Einhaltung einer sechsmonatigen Kündigungsfrist, erstmals per 30. September 2025; jährliche Rücknahmen sind begrenzt auf 20% (resp. maximal EUR 50 Mio.) des investierten Kapitals.

Portfolio Investments*

| | Kapitalzusagen | Nettovermögen |
|--|----------------|---------------|
| Swiss Life Funds (LUX) ESG Global Infrastructure Opportunities III | 30.86% | 34.36% |
| Swiss Life Funds (LUX) ESG GIO III Co-Invest | 11.70% | 12.57% |
| FONTAVIS ESG Renewable Infrastructure Fund II («FORTE II») | 9.58% | 7.58% |
| Swiss Life Funds (LUX) ESG Global Infrastructure Opportunities Growth II | 8.51% | 3.39% |
| FONTAVIS ESG Renewable Infrastructure Fund Europe («FORTE») | 5.32% | 7.21% |
| Co-Investment Transition Network Operator Ampriom | 5.32% | 3.46% |
| Co-Investment District Heating UK | 4.99% | 5.43% |
| Co-Investment Saffir (offshore Norway) | 4.69% | 5.03% |
| Co-Investment TTT via Bazalgette (Investments) Ltd | 3.72% | 4.54% |
| Co-Investment JFK via JLC Terminal One Co-Invest L.P. | 3.40% | 2.21% |
| Andere | 11.91% | 14.22% |

*Ohne Liquidität

Assets nach Sektoren*

| | |
|-------------------------------|--------|
| Erneuerbare Energie / Energie | 32.49% |
| Kommunikation | 31.10% |
| Transport | 12.82% |
| Soziale Infrastruktur | 12.42% |
| Versorger | 11.17% |
| Andere | - |

*Ohne Liquidität

Assets nach Region*

| | |
|--------------------------------|--------|
| Europa (inkl. Grossbritannien) | 79.96% |
| Nord Amerika | 18.49% |
| Schweiz | 1.55% |
| Sonstige Regionen | - |

*Ohne Liquidität

Assets nach Stadium*

| | |
|------------|--------|
| Brownfield | 91.33% |
| Greenfield | 8.67% |

*Ohne Liquidität

Assets nach Währung*

| | |
|-----|--------|
| EUR | 60.76% |
| USD | 19.53% |
| GBP | 18.16% |
| CHF | 1.55% |

*Ohne Liquidität

Anlagestiftung Swiss Life

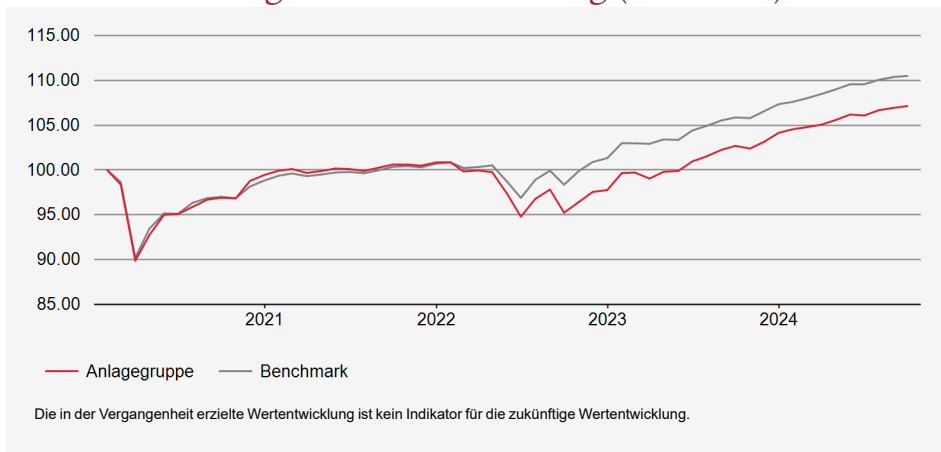
Senior Secured Loans PM (CHF hedged)

Nettovermögen (NAV) in Mio. CHF: 143.61
Nettovermögen pro Anspruch in CHF: 107.13

Anlagestrategie

Die Anlagegruppe strebt stabile hohe Erträge bei einer minimalen Preisvolatilität und einer geringen Zinsduration an. Die Anlagegruppe investiert vorwiegend in erstrangige Senior Secured Loans von Unternehmen aus entwickelten Ländern. Mindestens 85% werden in erstrangigen Senior Secured Loans angelegt. Höchstens 5% werden beim selben Schuldner angelegt. Höchstens 25% werden in derselben Industriegruppe angelegt. Fremdwährungsrisiken werden zu mindestens 90% gegen Schweizerfranken abgesichert. Umsetzung mittels Einsatz des Swiss Life Loan Fund (LUX) S.A., SICAV-SIF Senior Secured Loans V AM-Shares (CHF hedged); Anlagfonds nach luxemburgischem Recht.

Wertentwicklung in Referenzwährung (Basis 100)



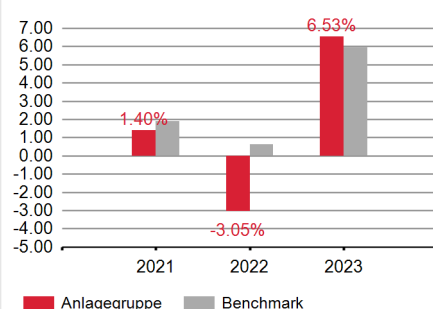
Performance in Referenzwährung

| | Kumulierte Performance | | | | Annualisierte Performance | | | |
|--------------|------------------------|---------|----------|--------|---------------------------|---------|----------|-------|
| | YTD | 1 Monat | 3 Monate | 1 Jahr | 3 Jahre | 5 Jahre | 10 Jahre | Aufl. |
| Anlagegruppe | 2.86% | 0.19% | 0.99% | 4.32% | 2.11% | - | - | 1.49% |
| Benchmark | 2.94% | 0.11% | 0.85% | 4.37% | 3.26% | - | - | 2.16% |

Statistische Angaben (annualisiert)

| | 1 Jahr | 3 Jahre | 5 Jahre | 10 Jahre | Aufl. |
|---------------------------------|--------|---------|---------|----------|--------|
| Volatilität Anlagegruppe (in %) | 1.20 | 3.63 | - | - | 5.62 |
| Volatilität Benchmark (in %) | 0.89 | 2.81 | - | - | 5.24 |
| Tracking Error ex post (in %) | 0.47 | 1.06 | - | - | 1.02 |
| Information Ratio | -0.10 | -1.08 | - | - | -0.66 |
| Sharpe Ratio | 2.30 | 0.38 | - | - | 0.22 |
| Korrelation | 0.94 | 0.98 | - | - | 0.98 |
| Beta | 1.28 | 1.26 | - | - | 1.06 |
| Jensen-Alpha | -0.84 | -1.81 | - | - | -0.78 |
| Maximum Drawdown (in %) | -0.28 | -6.02 | - | - | -10.11 |
| Recovery Period (Jahre) | 0.08 | 1.00 | - | - | 0.91 |

Performance



Produktinformationen

Valorennummer: 51215723
ISIN: CH0512157238
LEI: 254900TFN2RL5B1QJ986
Bloomberg-Code: SWSSLPM SW
Benchmark: JPM Lev Loans Upper Tier (80% US + 20% EU) CHFh
Währung: CHF
Domizil: Schweiz
Aufgagedatum: 31/01/2020
Erstausgabepreis: 100.00
Jahresabschluss: 30.09
Ausgabe/Rücknahme: Monatlich
Annahmeschluss: 14.30 Uhr
 Zeichnungen: Ultimo - 2
 Rücknahmen: Ultimo - 5
Ausgabe- / Rücknahmekommission: Keine

Ausschüttungspraxis: Thesaurierung

Asset Manager gemäss Swiss Life Best Select Invest Plus®:
 Swiss Life Asset Management AG

Überwachung Asset Manager:
 PPCmetrics unterstützt die laufende Überwachung des Asset Managers sowie die Beurteilung der Anlageresultate.

Kurspublikationen: Bloomberg: ASSL
www.swisslife.ch/anlagestiftung

Betriebsaufwandquote TER KGAST

ex ante: 0.48%

ex post per: 30/09/2024 0.48%

PM-Tranche: Der Erwerb dieser Tranche ist nur im Rahmen einer speziellen Vereinbarung mit Swiss Life Asset Management AG möglich.

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.

Annahmeschluss: Ultimo = letzter Bankwerktag des Monats

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 Branchen

| | Anlagegruppe | Benchmark |
|---------------------------|--------------|-----------|
| Dienstleistungen | 16.71% | 9.93% |
| Technologie | 9.32% | 7.68% |
| Gesundheitswesen | 8.16% | 8.58% |
| Finanzwesen | 7.67% | 5.41% |
| Glücksspiel/Freizeit | 7.31% | 10.54% |
| Chemikalien | 6.94% | 6.06% |
| Baugewerbe | 5.48% | 4.05% |
| Kabel und Satellit | 5.04% | 4.18% |
| Automobile | 3.96% | 4.02% |
| Lebensmittel und Getränke | 3.73% | 4.87% |
| Andere | 21.99% | 34.70% |
| Liquidität | 3.68% | - |

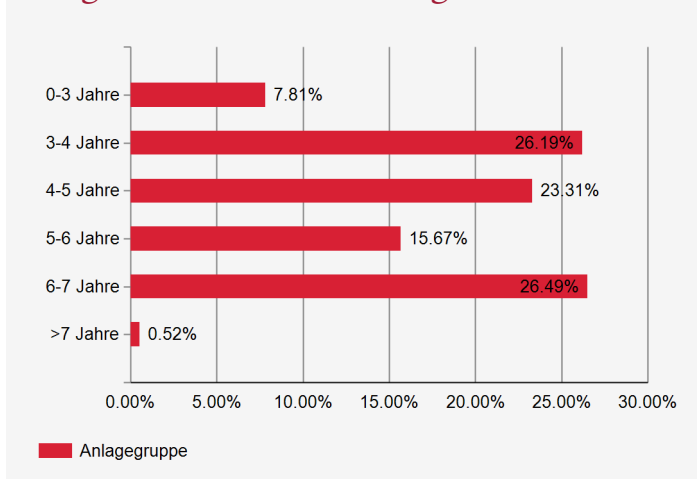
Grösste Schuldner und Rating

| | | Anlagegruppe |
|------------------|-----|--------------|
| Action Nederland | BB | 1.50% |
| INEOS Quattro | BB | 1.47% |
| Entain | BB- | 1.42% |
| Belron | BB- | 1.41% |
| Asurion | B+ | 1.39% |

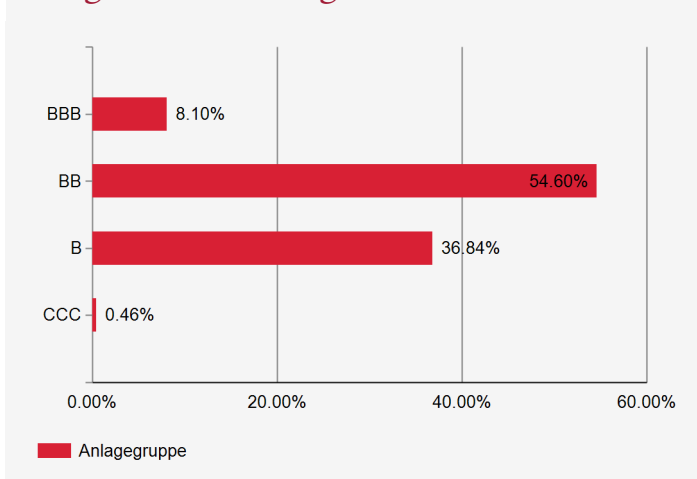
Weitere Angaben zu den Schuldnern

| | |
|------------------|-----|
| Anzahl Schuldner | 223 |
|------------------|-----|

Fälligkeitstruktur der Anlagen



Anlagen nach Rating



Portfeuillestruktur nach Währungen / Rendite (ohne Liquidität)

| | Anlagegruppe | | Benchmark | |
|--------------|--------------|---------|------------|---------|
| | Gewichtung | Rendite | Gewichtung | Rendite |
| USD | 69.03% | 7.85% | 80.00% | 7.19% |
| EUR | 30.97% | 7.02% | 20.00% | 6.52% |
| Durchschnitt | - | 7.59% | - | 7.06% |

Portfoliostruktur nach Ländern/Regionen

| | Anlagegruppe | Benchmark |
|------------------------|--------------|-----------|
| Vereinigte Staaten | 57.71% | 83.34% |
| Vereinigtes Königreich | 8.92% | 5.66% |
| Niederlande | 6.14% | 2.11% |
| Deutschland | 3.90% | 0.40% |
| Luxemburg | 3.89% | 0.29% |
| Belgien | 2.76% | 1.09% |
| Frankreich | 1.84% | - |
| Schweiz | 1.82% | 0.17% |
| Spanien | 1.62% | 0.81% |
| Kanada | 1.41% | 2.39% |
| Andere | 6.32% | 3.75% |
| Liquidität | 3.68% | - |

Anlagestiftung Swiss Life Hypotheke Schweiz ESG PM

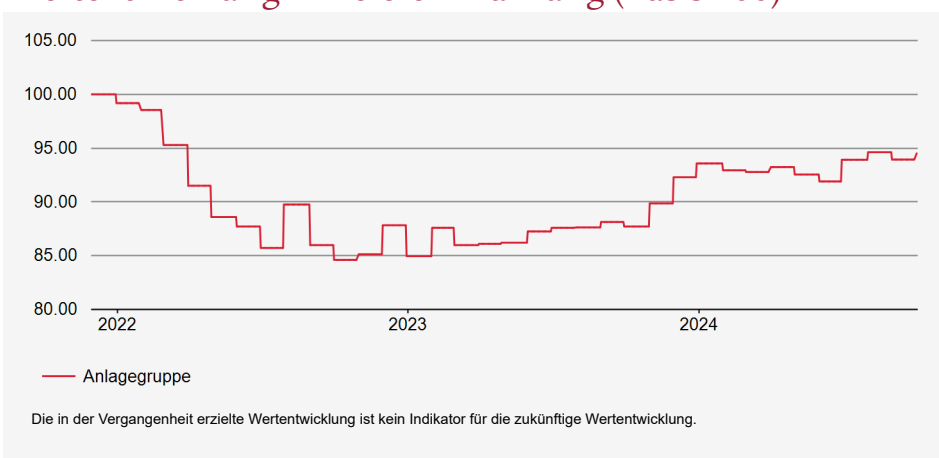


Nettovermögen (NAV) in Mio. CHF: 219.34
Nettovermögen pro Anspruch in CHF: 94.52

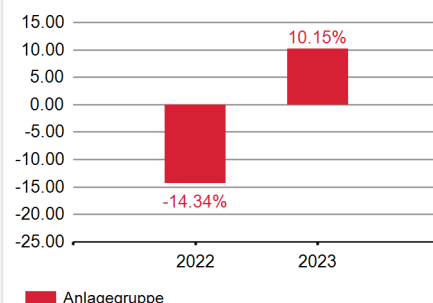
Anlagestrategie

Investitionen in nachhaltige Schweizer Hypotheken: mindestens 85% nach Abzug der flüssigen Mittel. Zielduration von 8. Umsetzung mittels Einsatz des «Swiss Life ESG Mortgage Fund» Teilvermögen des Swiss Life Mortgage Funds, ein vertraglicher Umbrella-Fonds schweizerischen Rechts.

Wertentwicklung in Referenzwährung (Basis 100)



Performance



Produktinformationen

Valorennummer: 112778775

ISIN: CH1127787757

LEI: 254900V4K2D79T13EF45

Bloomberg-Code: SLHSEPM SW

Währung: CHF

Domizil: Schweiz

Aufledgedatum: 30/11/2021

Erstausgabepreis: 100.00

Jahresabschluss: 30.9

Ausgabe/Rücknahme: Monatlich

Ausgabe- / Rücknahmekommission:
Keine

Ausschüttungspraxis: Thesaurierung

Asset Manager:

Swiss Life Asset Management AG

Kurspublikationen: Bloomberg: ASSL
www.swisslife.ch/anlagestiftung

Betriebsaufwandquote TER KGAST

ex ante: 0.35%

ex post per: 30/09/2023 0.35%

Performance in Referenzwährung

| | Kumulierte Performance | | | | Annualisierte Performance | | | |
|--------------|------------------------|---------|----------|--------|---------------------------|---------|----------|--------|
| | YTD | 1 Monat | 3 Monate | 1 Jahr | 3 Jahre | 5 Jahre | 10 Jahre | Auf. |
| Anlagegruppe | 1.00% | 0.62% | 0.64% | 7.75% | - | - | - | -1.97% |

Statistische Angaben

| | |
|---|-------|
| Durchschnittliche Restlaufzeit (Jahre) | 8.41 |
| Modified Duration (exkl. Forward Hypotheken)* | 7.13 |
| Modified Duration (inkl. Forward Hypotheken)* | 7.61 |
| Bruttorendite auf Verfall | 1.60% |
| Durchschnittliche Belehnung | 59% |
| Anzahl Hypotheken | 699 |
| Rendite-Differenz zu Schweizer Staatsanleihen | 1.20% |

*inkl. Liquidität

PM-Tranche: Der Erwerb dieser Tranche ist nur im Rahmen einer speziellen Vereinbarung mit Swiss Life Asset Management AG möglich.

Ausgabe: Monatlich, unter Einhaltung einer 1-monatigen Zeichnungsfrist.

Rückgabe: Monatlich, unter Einhaltung einer 6-monatigen Kündigungsfrist. Erstmalige Rückgabe 30. Januar 2024

Performance: Gesamtertrag über einen bestimmten Betrachtungszeitraum auf der Basis von zeitgewichteten Renditen.

Statistische Angaben: Die Risikokennzahlen basieren auf logarithmierten, monatlichen zeitgewichteten Renditen.

Vermögensstruktur

| | |
|----------------|--------|
| Hypotheken | 94.00% |
| Geldmarktfonds | 3.14% |
| Liquidität | 2.86% |
| Derivate | 0.00% |

Verteilung nach Belehnungshöhe

| | |
|----------|--------|
| <40% | 8.89% |
| 40 - 50% | 14.10% |
| 50 - 60% | 13.86% |
| 60 - 70% | 51.47% |
| >70% | 11.68% |

Art der Pfandobjekte

| | |
|-------------------------------------|--------|
| EINFAMILIENHÄUSER | 35.00% |
| EIGENTUMSWOHNUNGEN | 52.94% |
| MEHRFAMILIENHÄUSER | 7.43% |
| KOMMERZIELL GENUTZTE LIEGENSCHAFTEN | 4.62% |

Hypothekenarten

| | |
|---------------------|--------|
| Festhypotheken | 98.39% |
| Saron Hypotheken | 1.38% |
| Variable Hypotheken | 0.23% |

Hypotheken mit Zahlungsausständen grösser 90 Tage

| | |
|--|---|
| Durchschnittliche Belehnung | - |
| Anzahl Hypothekarschuldner | - |
| Relativer Gesamtwert der Hypotheken mit Zahlungsausständen | - |

Geografische Verteilung der Liegenschaften

| | |
|-------------------|--------|
| Zürich | 27.18% |
| Espace Mittelland | 15.86% |
| Innerschweiz | 8.00% |
| Nordwestschweiz | 6.89% |
| Ostschweiz | 1.92% |
| Tessin | 1.08% |
| Genferseeregion | 39.07% |

Verfallstruktur der Hypotheken

| | |
|-------------|--------|
| 1-3 JAHRE | 7.80% |
| 3-5 JAHRE | 17.88% |
| 5-7 JAHRE | 5.09% |
| 7-10 JAHRE | 49.62% |
| 10-15 JAHRE | 12.46% |
| >15 JAHRE | 7.16% |

ESG Verteilung

| | |
|-----------------------|--------|
| Minergie | 51.89% |
| GEAK | 45.41% |
| THPE | 2.61% |
| Kein Label/Zertifikat | 0.09% |



Anlagestiftung Swiss Life

Obligationen Global Unternehmen Short Term SPM (CHF hedged)

SwissLife

Nettovermögen (NAV) in Mio. CHF: 1'376.35
Nettovermögen pro Anspruch in CHF: 103.91

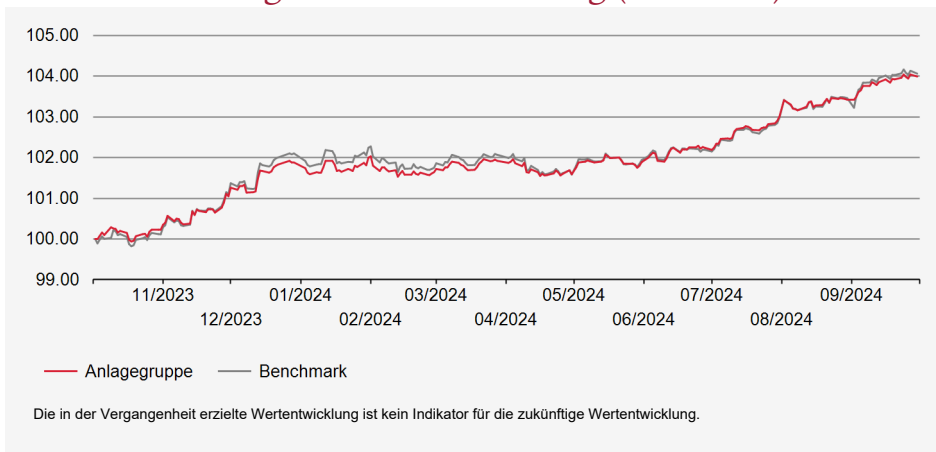
Anlagestrategie

Anlagen in Forderungspapiere von Unternehmen inklusive Agencies und Supranationals mit einer kurzen Restlaufzeit (mehrheitlich unter 3 Jahren). Aktive Titelselektion, Durationsteuerung und Zinskurvenpositionierung. Schuldnerbegrenzung: 10%. Forderungspapiere benchmarkfremder Schuldner: max. 10%. Durchschnittliche Ratingqualität: mindestens BBB. Fremdwährungsrisiken werden zu mindestens 90% gegen Schweizerfranken abgesichert. Umsetzung mittels Einsatz des Swiss Life iFunds (CH) Bond Global Corporates Short Term (CHF hedged); Anlagefonds schweizerischen Rechts der Kategorie "Übrige Fonds für traditionelle Anlagen".

Performance

Datenhistorie unzureichend

Wertentwicklung in Referenzwährung (Basis 100)



Produktinformationen

Valorennummer: 129127773
ISIN: CH1291277734
LEI: 2549003DSGO0RN37K507
Bloomberg-Code: SWLOSPM SW
Benchmark: BLOOMBERG GLO AGG CORP 1-3 YR IND HEDGED CHF
Währung: CHF
Domizil: Schweiz
Aufgatedatum: 02/10/2023
Erstausgabepreis: 100.00
Jahresabschluss: 30.09
Ausgabe/Rücknahme: Täglich
Annahmeschluss: 13.00 Uhr
Ausgabe- / Rücknahmekommission: Keine

Ausschüttungspraxis: Thesaurierung

Asset Manager gemäss Swiss Life Best Select Invest Plus@: Swiss Life Asset Management AG

Überwachung Asset Manager: PPCmetrics unterstützt die laufende Überwachung des Asset Managers sowie die Beurteilung der Anlageresultate.

Kurspublikationen: Bloomberg: ASSL
www.swisslife.ch/anlagestiftung

Betriebsaufwandquote TER KGAST

ex ante: 0.04%

ex post per: 30/09/2024 0.04%

Performance in Referenzwährung

| | Kumulierte Performance | | | | Annualisierte Performance | | | |
|--------------|------------------------|---------|----------|--------|---------------------------|---------|----------|-------|
| | YTD | 1 Monat | 3 Monate | 1 Jahr | 3 Jahre | 5 Jahre | 10 Jahre | Aufl. |
| Anlagegruppe | 2.07% | 0.55% | 1.71% | - | - | - | - | - |
| Benchmark | 1.92% | 0.58% | 1.83% | - | - | - | - | - |

Statistische Angaben (annualisiert)

| | 1 Jahr | 3 Jahre | 5 Jahre | 10 Jahre | Aufl. |
|---------------------------------|--------|---------|---------|----------|-------|
| Volatilität Anlagegruppe (in %) | - | - | - | - | 1.35 |
| Volatilität Benchmark (in %) | - | - | - | - | 1.66 |
| Tracking Error ex post (in %) | - | - | - | - | 0.38 |
| Information Ratio | - | - | - | - | -0.19 |
| Sharpe Ratio | - | - | - | - | 1.81 |
| Korrelation | - | - | - | - | 0.99 |
| Beta | - | - | - | - | 0.80 |
| Jensen-Alpha | - | - | - | - | 0.43 |
| Maximum Drawdown (in %) | - | - | - | - | -0.49 |
| Recovery Period (Jahre) | - | - | - | - | 0.25 |

Der Kreis der Anleger ist auf die Anlagestiftung Swiss Life beschränkt.

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

Obligationen Global Unternehmen Short Term SPM (CHF hedged)

Portfoliostruktur nach Branchen

| | Anlagegruppe | Benchmark |
|------------------------|--------------|-----------|
| Finanzwesen | 53.44% | 50.99% |
| Basiskonsumgüter | 11.59% | 12.11% |
| Nicht-Basiskonsumgüter | 8.52% | 9.88% |
| Kommunikation | 4.67% | 5.39% |
| Energie | 4.08% | 4.13% |
| Technologie | 3.75% | 4.08% |
| Industrie | 3.36% | 5.91% |
| Versorgungsbetriebe | 2.52% | 5.24% |
| Andere | 2.88% | 2.28% |
| Liquidität | 3.58% | - |
| Währungsabsicherung | 1.60% | - |

Grösste Schuldner und Rating

| | Rating | Anlagegruppe |
|------------------------------|--------|--------------|
| Banco Santander SA, Madrid | A- | 3.06% |
| Credit Agricole Group | BBB+ | 2.65% |
| Citigroup Inc | BBB+ | 2.33% |
| Barclays Capital PLC, London | BBB | 2.14% |
| Morgan Stanley NE US | A | 2.03% |

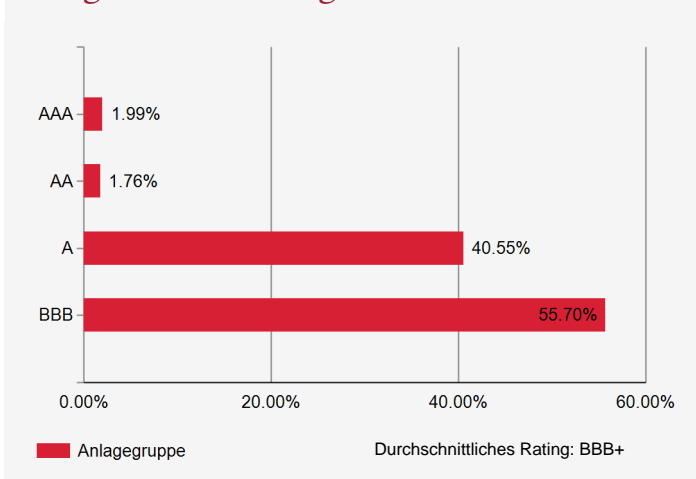
Weitere Angaben zu den Schuldnern

| | |
|----------------------------------|-------|
| Anzahl Schuldner | 149 |
| Anteil Benchmarkfremde Schuldner | 6.63% |

Fälligkeitstruktur der Anlagen



Anlagen nach Rating



Duration und Rendite auf Verfall

| | Anlagegruppe | Benchmark |
|-----------------------------------|--------------|-----------|
| Modified Duration* | 1.9 | 1.8 |
| Theoretische Rendite auf Verfall* | 3.76% | 3.89% |

* Vor Währungsabsicherung, unter Berücksichtigung der Derivate

Portfolio nach Währungen und Duration

| | Anlagegruppe | | Benchmark | |
|--------|--------------|----------|------------|----------|
| | Gewichtung | Duration | Gewichtung | Duration |
| USD | 58.79% | 1.89 | 60.04% | 1.88 |
| EUR | 25.44% | 1.97 | 29.79% | 1.96 |
| CHF | 11.25% | 1.31 | 0.47% | 1.91 |
| GBP | 3.47% | 1.47 | 3.86% | 1.89 |
| Andere | 1.05% | 2.00 | 5.84% | 1.97 |

Portfoliostruktur nach Ländern/Regionen

| | Anlagegruppe | Benchmark |
|-------------------------------|--------------|-----------|
| Vereinigte Staaten | 34.19% | 45.94% |
| Frankreich | 8.95% | 7.59% |
| Vereinigtes Königreich | 7.84% | 6.85% |
| Kanada | 7.56% | 5.77% |
| Deutschland | 6.45% | 6.20% |
| Schweiz | 6.14% | 2.05% |
| Spanien | 5.60% | 3.33% |
| Europäische Region (EUR) | 6.14% | 6.62% |
| Schwellenländer Asien Pazifik | 4.69% | 2.36% |
| Asien-Pazifik-Raum | 3.55% | 4.63% |
| Andere | 3.70% | 8.67% |
| Liquidität, Absicherung | 5.19% | - |