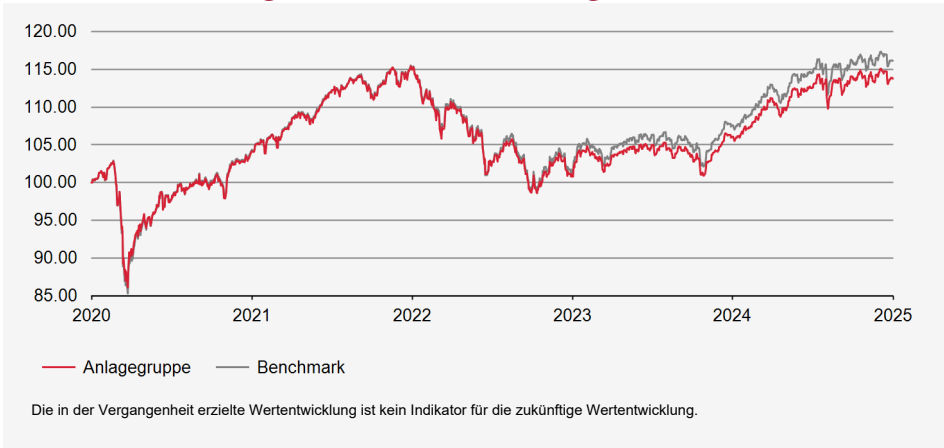


Nettvermögen (NAV) in Mio. CHF: 695.22
Nettvermögen pro Anspruch in CHF: 222.74

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)



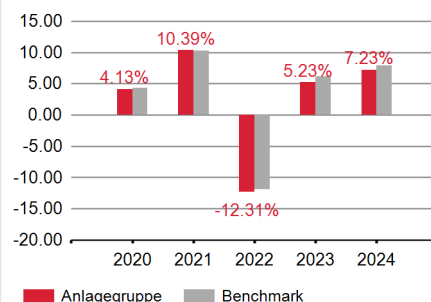
Performance in Referenzwährung

	Kumulierte Performance				Annualisierte Performance			
	YTD	1 Monat	3 Monate	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Aufl.
Anlagegruppe	7.23%	-0.72%	-0.25%	7.23%	-0.35%	2.61%	3.36%	3.50%
Benchmark	7.94%	-0.60%	0.05%	7.94%	0.30%	3.03%	3.89%	4.16%

Statistische Angaben (annualisiert)

	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Aufl.
Volatilität Anlagegruppe (in %)	4.22	6.68	7.25	6.44	6.42
Volatilität Benchmark (in %)	4.20	7.04	7.56	6.50	6.40
Tracking Error ex post (in %)	0.20	0.55	0.55	0.58	0.66
Information Ratio	-3.56	-1.20	-0.77	-0.93	-0.98
Sharpe Ratio	1.35	-0.18	0.32	0.56	0.50
Korrelation	1.00	1.00	1.00	1.00	0.99
Beta	1.01	0.95	0.96	0.99	1.00
Jensen-Alpha	-0.74	-0.68	-0.30	-0.48	-0.65
Maximum Drawdown (in %)	-3.98	-14.46	-16.22	-16.22	-28.27
Recovery Period (Jahre)	0.19	-	0.67	0.67	3.76

Performance



Produktinformationen

Valorennummer: 1245607
ISIN: CH0012456072
LEI: 2549001XL79VZWJO5Q69
Bloomberg-Code: SWABM45 SW
Benchmark: Customized
Währung: CHF
Domizil: Schweiz
Aufledgedatum: 30/09/2001
Erstausgabepreis: 100.00
Jahresabschluss: 30.09

Ausgabe/Rücknahme: Täglich
Annahmeschluss: 12.00 Uhr
Verwässerungsschutz:
Ausgabe- / Rücknahmekommission zugunsten der Anlagegruppe gemäss Konditionenübersicht.

Ausschüttungspraxis: Thesaurierung
Asset Manager:
Taktische Asset Allocation
Swiss Life Asset Management AG
Eingesetzte artreine Anlagegruppen
Diverse gemäss
Swiss Life Best Select Invest Plus®

Externe Beratung:
PPCmetrics erbringt innerhalb der artreinen Anlagegruppen folgende Dienstleistungen: Beratung betreffend geeigneter Mandatsstruktur, Unterstützung bei der Selektion geeigneter Asset Manager sowie Unterstützung bei der laufenden Überwachung des Asset Managers und Beurteilung der Anlageresultate.

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

Betriebsaufwandquote TER KGAST
ex ante: 0.56%
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.

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

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

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

Tracking Error ex ante: Der erwartete Tracking Error für die nächsten 12 Monate entspricht dem ex post 3 Jahres Tracking Error.

Portfoliostruktur nach Anlagekategorien

	Anlagegruppe	Benchmark	max. BVV2
Liquidität	2.50%	2.00%	-
Hypotheken Schweiz	0.59%	-	-
Obligationen CHF Inland	11.02%	12.00%	-
Obligationen CHF Ausland	5.01%	5.00%	-
Obligationen Fremdwährungen (CHF hedged)	19.34%	20.00%	-
Aktien Schweiz	22.94%	23.00%	-
Aktien Ausland	24.01%	22.00%	-
Aktien Ausland (CHF hedged)	-	-	-
Immobilien Schweiz	10.49%	9.00%	30.00%
Immobilien Ausland (CHF hedged)	1.70%	2.00%	10.00%
Alternative Anlagen (CHF hedged)	2.41%	5.00%	15.00%
Total Aktien (In- und Ausland)	46.96%	45.00%	50.00%
Total Fremdwährungen	24.01%	22.00%	30.00%

Grösste Aktienpositionen

NESTLE SA-REG	2.93%
NOVARTIS AG-REG	2.71%
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	2.68%
NVIDIA CORP	1.51%
MICROSOFT CORP	1.36%
UBS GROUP AG-REG	1.27%
ZURICH INSURANCE GROUP AG	1.18%
ABB LTD-REG	1.17%
CIE FINANCIERE RICHEMO-A REG	1.11%
HOLCIM LTD	0.71%

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	76.02%
USD	16.75%
JPY	1.44%
EUR	0.42%
Übrige	5.36%

Eigenschaften der festverzinslichen Anlagen

Modified Duration	5.68
Durchschnittliches Rating	A