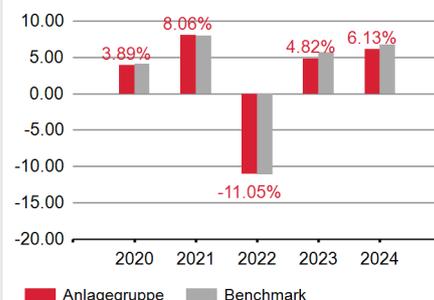


Nettovermögen (NAV) in Mio. CHF: 397.14
Nettovermögen pro Anspruch in CHF: 215.99

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%.

Performance



Wertentwicklung in Referenzwährung (Basis 100)



Produktinformationen

Valorennummer: 1245606
ISIN: CH0012456064
LEI: 254900SR5GM6HP44F130
Bloomberg-Code: SWABM35 SW
Benchmark: Customized
Währung: CHF
Domizil: Schweiz
Aufledgedatum: 30/09/2001
Erstausgabepreis: 100.00
Jahresabschluss: 30.09
Ausgabe/Rücknahme: Täglich
Annahmeschluss: 12.00 Uhr
Verwässerungsschutz: Ausgabe- / Rücknahmekommission zugunsten der Anlagegruppe gemäss Konditionenübersicht.

Asset Management: Strategische und taktische Asset Allocation durch Swiss Life Asset Management AG
Eingesetzte artreine Anlagegruppen: Diverse gemäss Swiss Life Best Select Invest Plus © Ansatz

Externe Beratung: Überwachung der Anlageresultate der eingesetzten Anlagegruppen sowie Beratung zu geeigneter Mandatsstruktur und bei der Selektion geeigneter Asset Managers durch PPCmetrics

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

Betriebsaufwandquote TER KGAST
ex ante: 0.50%
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	1.48%	0.54%	2.41%	1.72%	2.83%	2.59%	2.79%	3.28%
Benchmark	1.86%	0.55%	2.47%	2.39%	3.31%	2.93%	3.19%	3.82%

Statistische Angaben (annualisiert)

	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Aufl.
Volatilität Anlagegruppe (in %)	4.06	5.03	5.37	5.17	5.17
Volatilität Benchmark (in %)	3.87	5.26	5.58	5.33	5.16
Tracking Error ex post (in %)	0.43	0.45	0.50	0.56	0.63
Information Ratio	-1.57	-1.08	-0.67	-0.73	-0.86
Sharpe Ratio	0.28	0.36	0.41	0.58	0.58
Korrelation	1.00	1.00	1.00	0.99	0.99
Beta	1.04	0.95	0.96	0.96	1.00
Jensen-Alpha	-0.75	-0.37	-0.23	-0.29	-0.53
Maximum Drawdown (in %)	-6.55	-6.55	-13.03	-13.41	-21.36
Recovery Period (Jahre)	-	-	2.28	0.65	3.00

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	2.90%	4.00%	-
Hypotheken Schweiz	4.66%	5.00%	-
Obligationen CHF Inland	18.96%	19.00%	-
Obligationen Fremdwährungen (CHF hedged)	18.43%	20.00%	-
Aktien Schweiz	15.83%	15.00%	-
Aktien Ausland	8.61%	8.00%	-
Aktien Ausland (CHF hedged)	13.38%	12.00%	-
Immobilien Schweiz	13.47%	12.00%	30.00%
Immobilien Ausland (CHF hedged)	2.00%	2.00%	10.00%
Alternative Anlagen (CHF hedged)	1.76%	3.00%	15.00%
Infrastruktur	-	-	-
Total Aktien (In- und Ausland)	37.82%	35.00%	50.00%
Total Fremdwährungen	8.61%	17.00%	30.00%

Grösste Aktienpositionen

NOVARTIS AG-REG	1.86%
NESTLE SA-REG	1.84%
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	1.81%
NVIDIA CORP	1.02%
UBS GROUP AG-REG	0.92%
MICROSOFT CORP	0.89%
ABB LTD-REG	0.85%
ZURICH INSURANCE GROUP AG	0.82%
APPLE INC	0.74%
CIE FINANCIERE RICHEMO-A REG	0.72%

Benchmarkzusammensetzung

1M Saron	4.00%
SBI Domestic AAA-A 1-3Y Total Return	5.00%
SBI AAA-BBB Total Return	19.00%
Bloomberg Gl. Agg. Treas. ex CH (CHF hedged)	8.00%
Bloomberg Gl. Agg. Corp. (CHF hedged)	3.00%
Bloomberg Gl. Agg. Corp. Short Term (CHF hedged)	2.00%
JP Morgan CEMBI Broad Diversified IG Index (CHF hedged)	7.00%
SPI® Total Return	15.00%
MSCI World ex Switzerland Net Return	8.00%
MSCI World ex Switzerland Net Return (CHF hedged)	12.00%
KGAST Immo-Index	12.00%
SL REF (LUX) ESG German Core Real Estate (CHF hedged)	1.50%
Anlagestiftung Swiss Life Immobilien Europa Industrie und Logistik ESG (EUR), CHF hedged	0.50%
HFRX Global Hedge Funds (CHF hedged)	3.00%
Anlagestiftung Swiss Life Infrastruktur Global ESG (EUR)	-

Portfoliostruktur nach Währungen

CHF	91.39%
USD	4.75%
EUR	1.13%
JPY	0.23%
Übrige	2.50%

Eigenschaften der festverzinslichen Anlagen

Modified Duration	5.72
Durchschnittliches Rating	A+