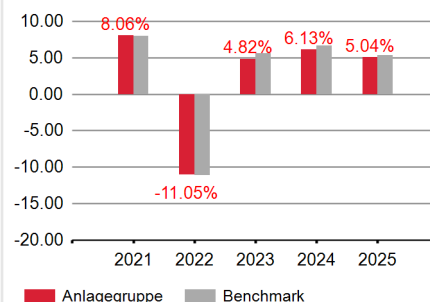


**Nettovermögen (NAV) in Mio. CHF: 399.50**  
**Nettovermögen pro Anspruch in CHF: 221.17**

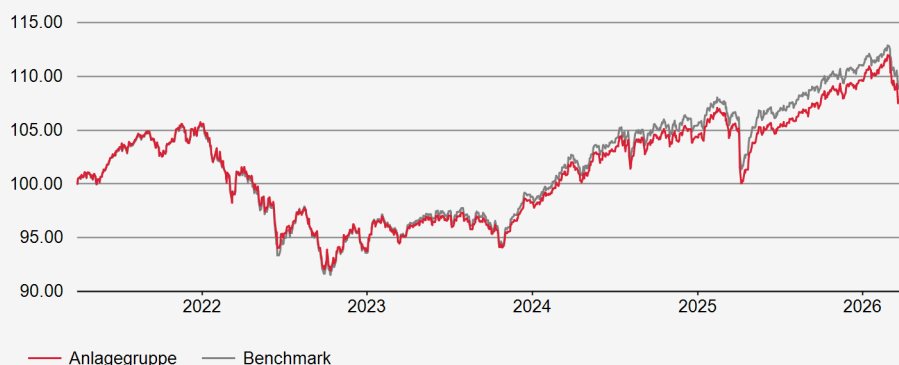
### Anlagestrategie

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)



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

### Produktinformationen

**Valorennummer:** 1245606  
**ISIN:** CH0012456064  
**LEI:** 254900SR5GM6HP44F130  
**Bloomberg-Code:** SWABM35 SW  
**Benchmark:** Customized  
**Währung:** CHF  
**Domizil:** Schweiz  
**Aufgatedatum:** 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](http://www.swisslife.ch/anlagestiftung)

**Betriebsaufwandquote TER KGAST**  
**ex ante:** 0.50%  
**ex post per:** 30/09/2025 0.53%

### Performance in Referenzwährung

	Kumulierte Performance				Annualisierte Performance			
	YTD	1 Monat	3 Monate	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Aufl.
Anlagegruppe	-1.06%	-3.15%	-1.06%	3.36%	4.16%	1.63%	3.28%	3.29%
Benchmark	-1.15%	-2.74%	-1.15%	3.59%	4.49%	1.87%	3.58%	3.81%

### Statistische Angaben (annualisiert)

	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Aufl.
Volatilität Anlagegruppe (in %)	4.68	4.16	5.22	5.08	5.16
Volatilität Benchmark (in %)	4.06	4.04	5.37	5.25	5.13
Tracking Error ex post (in %)	0.74	0.48	0.56	0.56	0.63
Information Ratio	-0.31	-0.69	-0.44	-0.53	-0.81
Sharpe Ratio	0.70	0.77	0.23	0.67	0.59
Korrelation	1.00	0.99	0.99	0.99	0.99
Beta	1.15	1.02	0.97	0.96	1.00
Jensen-Alpha	-0.75	-0.42	-0.20	-0.16	-0.51
Maximum Drawdown (in %)	-4.84	-6.55	-13.03	-13.41	-21.36
Recovery Period (Jahre)	0.11	0.42	2.28	0.65	3.00

**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](http://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	2.65%	4.00%	-
Hypotheken Schweiz	4.65%	5.00%	-
Obligationen CHF Inland	16.97%	19.00%	-
Obligationen Fremdwährungen (CHF hedged)	18.78%	20.00%	-
Aktien Schweiz	16.40%	15.00%	-
Aktien Ausland	9.77%	8.00%	-
Aktien Ausland (CHF hedged)	11.66%	12.00%	-
Immobilien Schweiz	14.66%	12.00%	30.00%
Immobilien Ausland (CHF hedged)	1.97%	2.00%	10.00%
Alternative Anlagen (CHF hedged)	2.55%	3.00%	15.00%
Infrastruktur	-	-	-
Total Aktien (In- und Ausland)	37.82%	35.00%	50.00%
Total Fremdwährungen	9.77%	17.00%	30.00%

## Grösste Aktienpositionen

NVIDIA CORP	0.80%
APPLE INC	0.70%
MICROSOFT CORP	0.49%
AMAZON.COM INC	0.38%
ALPHABET INC-CL A	0.32%
TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	0.29%
ALPHABET INC-CL C	0.26%
BROADCOM INC	0.26%
META PLATFORMS INC-CLASS A	0.24%
TESLA INC	0.20%

## 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	90.23%
USD	5.22%
JPY	1.36%
EUR	0.65%
Übrige	2.54%

## Eigenschaften der festverzinslichen Anlagen

Modified Duration	5.72
Durchschnittliches Rating	A+