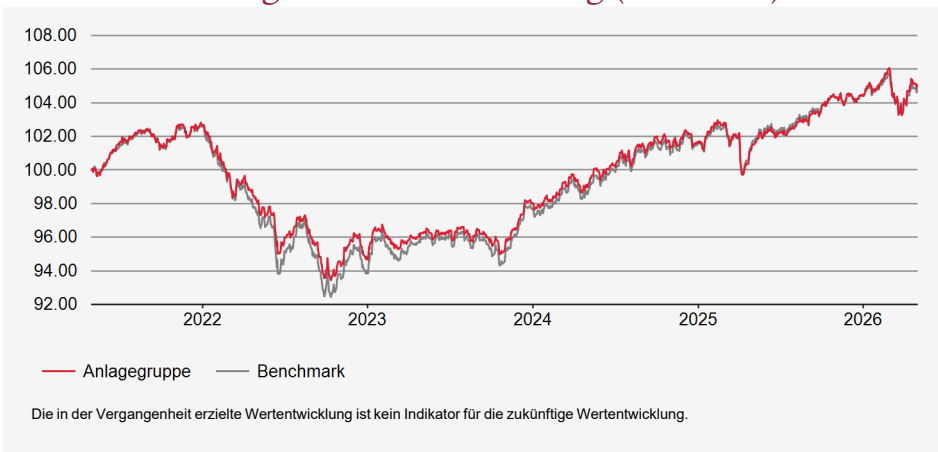


Nettovermögen (NAV) in Mio. CHF: 192.69
Nettovermögen pro Anspruch in CHF: 181.44

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)



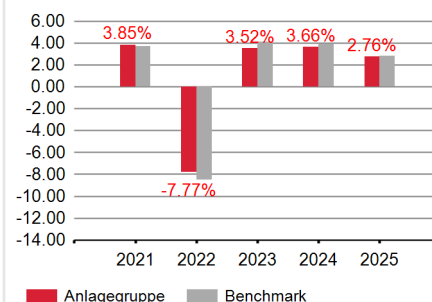
Performance in Referenzwährung

	Kumulierte Performance				Annualisierte Performance			
	YTD	1 Monat	3 Monate	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Aufl.
Anlagegruppe	0.62%	1.13%	0.22%	3.57%	2.95%	0.99%	2.02%	2.64%
Benchmark	0.35%	0.93%	0.01%	3.10%	2.99%	0.94%	2.07%	2.92%

Statistische Angaben (annualisiert)

	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Aufl.
Volatilität Anlagegruppe (in %)	2.92	2.57	3.24	3.09	2.82
Volatilität Benchmark (in %)	2.55	2.55	3.50	0.00	0.00
Tracking Error ex post (in %)	0.44	0.47	0.59	0.00	0.00
Information Ratio	1.07	-0.07	0.09	0.00	0.00
Sharpe Ratio	1.21	0.81	0.17	0.71	0.87
Korrelation	1.00	0.98	0.99	0.00	0.00
Beta	1.14	0.99	0.92	0.00	0.00
Jensen-Alpha	0.02	-0.01	0.09	2.20	2.49
Maximum Drawdown (in %)	-2.63	-3.17	-9.12	-9.12	-9.12
Recovery Period (Jahre)	-	0.34	2.34	2.34	2.34

Performance



Produktinformationen

Valorennummer: 1564965
ISIN: CH0015649657
LEI: 254900RW4KJYAQTH6Y97
Bloomberg-Code: SWABM15 SW
Benchmark: Customized
Währung: CHF
Domizil: Schweiz
Aufgatedatum: 30/06/2003
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: 30/09/2025 0.54%

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	3.31%	4.00%	-
Hypotheken Schweiz	7.46%	7.00%	-
Obligationen CHF Inland	25.00%	28.00%	-
Obligationen Fremdwährungen (CHF hedged)	24.48%	27.00%	-
Aktien Schweiz	8.00%	7.00%	-
Aktien Ausland	6.23%	4.00%	-
Aktien Ausland (CHF hedged)	4.28%	4.00%	-
Immobilien Schweiz	17.81%	15.00%	30.00%
Immobilien Ausland (CHF hedged)	1.14%	1.00%	10.00%
Alternative Anlagen (CHF hedged)	2.29%	3.00%	15.00%
Infrastruktur	-	-	-
Total Aktien (In- und Ausland)	18.50%	15.00%	50.00%
Total Fremdwährungen	6.23%	7.00%	30.00%

Grösste Aktienpositionen

NOVARTIS AG-REG	1.07%
ROCHE HOLDING AG	1.06%
NESTLE SA-REG	0.96%
ABB LTD-REG	0.58%
UBS GROUP AG-REG	0.50%
NVIDIA CORP	0.43%
ZURICH INSURANCE GROUP AG	0.39%
CIE FINANCIERE RICHEMO-A REG	0.38%
APPLE INC	0.35%
MICROSOFT CORP	0.25%

Benchmarkzusammensetzung

1M Saron	4.00%
SBI Domestic AAA-A 1-3Y Total Return	7.00%
SBI AAA-BBB Total Return	28.00%
Bloomberg Gl. Agg. Treas. ex CH (CHF hedged)	17.00%
Bloomberg Gl. Agg. Corp. (CHF hedged)	4.00%
Bloomberg Gl. Agg. Corp. Short Term (CHF hedged)	4.00%
JP Morgan CEMBI Broad Diversified IG Index (CHF hedged)	2.00%
SPI® Total Return	7.00%
MSCI World ex Switzerland Net Return	4.00%
MSCI World ex Switzerland Net Return (CHF hedged)	4.00%
KGAST Immo-Index	15.00%
SL REF (LUX) ESG German Core Real Estate (CHF hedged)	0.75%
Anlagestiftung Swiss Life Immobilien Europa Industrie und Logistik ESG (EUR), CHF hedged	0.25%
HFRX Global Hedge Funds (CHF hedged)	3.00%
Anlagestiftung Swiss Life Infrastruktur Global ESG (EUR)	-

Portfoliostruktur nach Währungen

CHF	93.77%
USD	3.55%
JPY	0.78%
EUR	0.73%
Übrige	1.17%

Eigenschaften der festverzinslichen Anlagen

Modified Duration	5.78
Durchschnittliches Rating	AA-