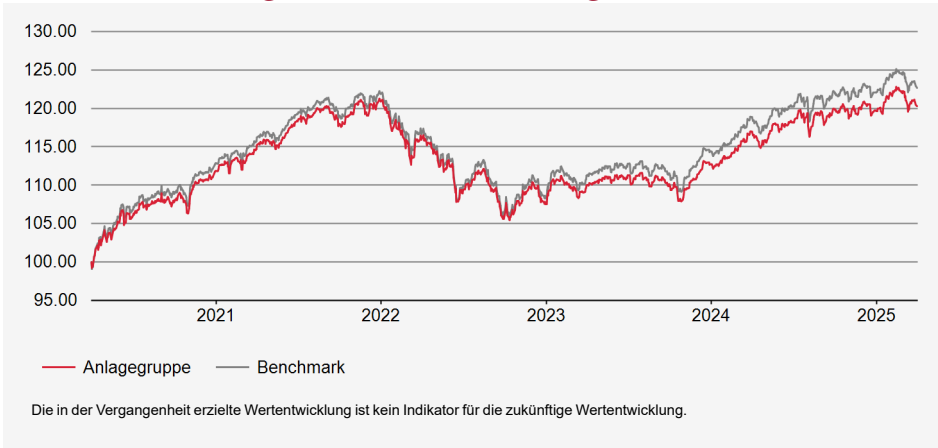


Nettovermögen (NAV) in Mio. CHF: 397.19
Nettovermögen pro Anspruch in CHF: 213.98

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)



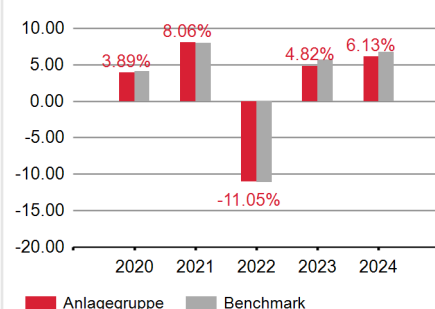
Performance in Referenzwährung

	Kumulierte Performance				Annualisierte Performance			
	YTD	1 Monat	3 Monate	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Aufl.
Anlagegruppe	0.54%	-1.60%	0.54%	2.82%	1.24%	3.76%	2.73%	3.29%
Benchmark	0.48%	-1.64%	0.48%	3.19%	1.69%	4.17%	3.13%	3.82%

Statistische Angaben (annualisiert)

	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Aufl.
Volatilität Anlagegruppe (in %)	3.99	5.62	5.52	5.23	5.19
Volatilität Benchmark (in %)	3.97	6.02	5.80	5.39	5.18
Tracking Error ex post (in %)	0.24	0.55	0.52	0.56	0.63
Information Ratio	-1.55	-0.82	-0.79	-0.72	-0.84
Sharpe Ratio	0.45	0.05	0.62	0.56	0.58
Korrelation	1.00	1.00	1.00	0.99	0.99
Beta	1.00	0.93	0.95	0.97	0.99
Jensen-Alpha	-0.38	-0.40	-0.21	-0.29	-0.52
Maximum Drawdown (in %)	-2.93	-9.47	-13.03	-13.41	-21.36
Recovery Period (Jahre)	0.14	1.44	2.28	0.65	3.00

Performance



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.

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: 0.55%
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.

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	3.79%	2.00%	-
Hypotheken Schweiz	0.62%	-	-
Obligationen CHF Inland	13.09%	14.00%	-
Obligationen CHF Ausland	6.92%	7.00%	-
Obligationen Fremdwährungen (CHF hedged)	21.58%	24.00%	-
Aktien Schweiz	18.83%	18.00%	-
Aktien Ausland	17.90%	17.00%	-
Aktien Ausland (CHF hedged)	0.75%	-	-
Immobilien Schweiz	11.84%	11.00%	30.00%
Immobilien Ausland (CHF hedged)	2.00%	2.00%	10.00%
Alternative Anlagen (CHF hedged)	2.69%	5.00%	15.00%
Total Aktien (In- und Ausland)	37.48%	35.00%	50.00%
Total Fremdwährungen	17.90%	17.00%	30.00%

Grösste Aktienpositionen

NESTLE SA-REG	2.68%
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	2.34%
NOVARTIS AG-REG	2.21%
ZURICH INSURANCE GROUP AG	1.03%
NVIDIA CORP	0.98%
MICROSOFT CORP	0.98%
UBS GROUP AG-REG	0.98%
CIE FINANCIERE RICHEMO-A REG	0.94%
ABB LTD-REG	0.83%
HOLCIM LTD	0.59%

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%
SPI® Total Return	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	81.38%
USD	12.06%
JPY	1.03%
EUR	0.21%
Übrige	4.60%

Eigenschaften der festverzinslichen Anlagen

Modified Duration	5.50
Durchschnittliches Rating	A