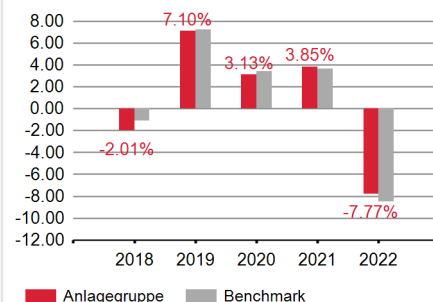


Nettovermögen (NAV) in Mio. CHF: 226.79
Nettovermögen pro Anspruch in CHF: 163.52

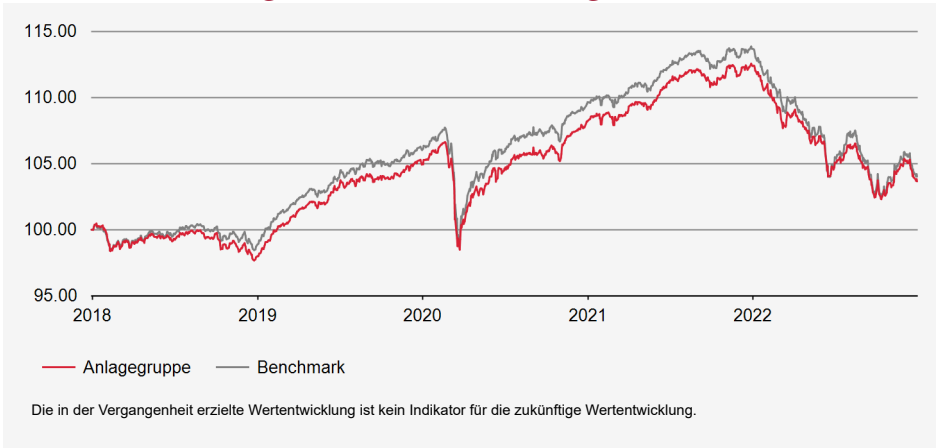
Anlagestrategie

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%.

Performance



Wertentwicklung in Referenzwährung (Basis 100)



Produktinformationen

Valorennummer: 1564965
ISIN: CH0015649657
LEI: 254900RW4KJYAQTH6Y97
Bloomberg-Code: SWABM15 SW
Benchmark: Customized
Währung: CHF
Domizil: Schweiz
Aufledgedatum: 30/06/2003
Ausgabepreis: 100.00
Jahresabschluss: 30.09
Ausgabe/Rücknahme: Täglich
Annahmeschluss: 14.00 Uhr
Ausgabe-/Rücknahmekommission: Keine
Ausschüttungspraxis: Thesaurierung
Asset Manager:
Taktische Asset Allocation
 Swiss Life Asset Management AG
Eingesetzte artreine Anlagegruppen
 Diverse gemäss
 Swiss Life Best Select Invest Plus®

Performance in Referenzwährung

	KUMULIERTE PERFORMANCE				ANNUALISIERTE PERFORMANCE			
	YTD	1 MONAT	3 MONATE	1 JAHR	3 JAHRE	5 JAHRE	10 JAHRE	AUFL.
ANLAGEGRUPPE	-7.77%	-1.30%	0.93%	-7.77%	-0.41%	0.72%	2.19%	2.55%
BENCHMARK	-8.51%	-1.38%	1.03%	-8.51%	-0.64%	0.79%	2.26%	2.84%

Statistische Angaben (annualisiert)

	1 JAHR	3 JAHRE	5 JAHRE	10 JAHRE	AUFL.
Volatilität Anlagegruppe (in %)	4.41	4.40	3.66	3.02	2.85
Volatilität Benchmark (in %)	-	4.74	3.89	3.08	2.87
Tracking Error ex post (in %)	0.89	0.61	0.55	0.51	0.58
Information Ratio	0.82	0.37	-0.13	-0.14	-0.48
Sharpe Ratio	-1.78	0.02	0.37	0.90	0.87
Korrelation	0.99	0.99	0.99	0.99	0.98
Beta	0.85	0.92	0.93	0.97	0.98
Jensen-Alpha	-0.47	0.22	0.03	0.02	-0.22
Maximum Drawdown (in %)	-8.99	-9.12	-9.12	-9.12	-9.12
Recovery Period (Jahre)	-	-	-	-	-

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: 0.57%
ex post per: 30/09/2022 0.60%

Portfoliostruktur nach Anlagekategorien

	Anlagegruppe	Benchmark	max. BVV2
Liquidität	5.81%	2.00%	-
Hypotheken Schweiz	11.65%	13.00%	-
Obligationen CHF Inland	10.07%	13.00%	-
Obligationen CHF Ausland	3.95%	6.00%	-
Obligationen Fremdwährungen (CHF hedged)	30.54%	28.00%	-
Aktien Schweiz	7.48%	8.00%	-
Aktien Ausland	4.83%	7.00%	-
Aktien Ausland (CHF hedged)	1.54%	-	-
Immobilien Schweiz	18.01%	15.00%	30.00%
Immobilien Ausland (CHF hedged)	3.80%	3.00%	10.00%
Alternative Anlagen (CHF hedged)	2.33%	5.00%	15.00%
Total Aktien (In- und Ausland)	13.85%	15.00%	50.00%
Total Fremdwährungen	4.83%	7.00%	30.00%

Portfoliostruktur nach Währungen

CHF	95.17%
USD	3.39%
EUR	0.58%
JPY	0.30%
ÜBRIGE	0.57%

Benchmarkzusammensetzung

1M SARON	2.00%
SBI DOMESTIC AAA-A 1-3Y	13.00%
SBI DOMESTIC AAA-BBB	13.00%
SBI FOREIGN AAA-BBB	6.00%
BLOOMBERG GL. AGG. TREAS. EX CH TR (CHF HEDGED)	5.00%
BLOOMBERG GL. AGG. CORP. TR (CHF HEDGED)	12.00%
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	8.00%
MSCI WORLD EX CH ESG LEADERS, IN CHF	5.60%
MSCI AC WORLD SMALL CAP, IN CHF	1.05%
MSCI EMERGING MARKETS, IN CHF	0.35%
KGAST IMMO-INDEX	15.00%
SL REF (LUX) GERMAN CORE REAL ESTATE (CHF HEDGED)	3.00%
HFRX GLOBAL HEDGE FUNDS (CHF HEDGED)	5.00%

Eigenschaften der festverzinslichen Anlagen

Modified Duration	3.95
Durchschnittliches Rating	A+