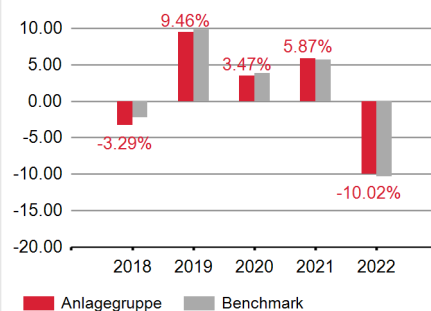


Nettovermögen (NAV) in Mio. CHF: 772.64
Nettovermögen pro Anspruch in CHF: 182.32

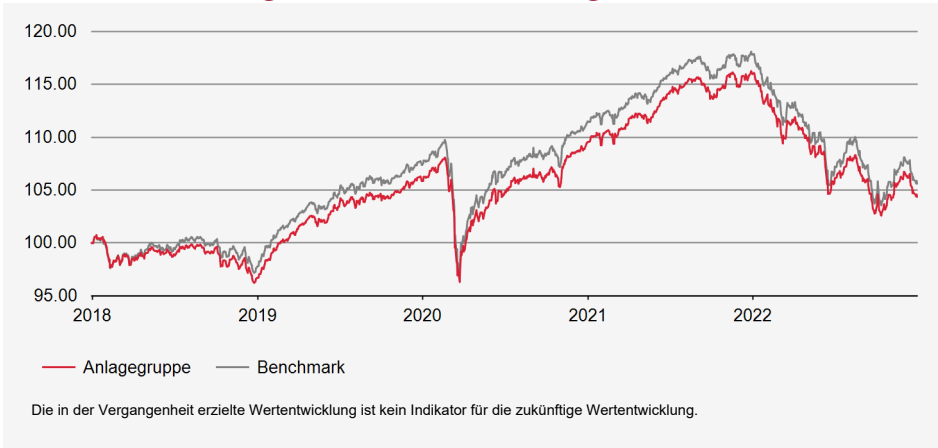
Anlagestrategie

Anlagen in alle vom BVG zugelassenen Anlagekategorien (strategischer Aktienanteil: 25%). Aktive Asset Allocation. Begrenzung für Beteiligungspapiere: 35%. Begrenzung für Fremdwährungen: 30%. Durchschnittliche Ratingqualität der Obligationen: mindestens BBB+. Umsetzung mittels Einsatz artreiner Kollektivanlagen. Empfohlene Schwankungsreserven: über 10%.

Performance



Wertentwicklung in Referenzwährung (Basis 100)



Produktinformationen

Valorennummer: 1245601
ISIN: CH0012456015
LEI: 254900JNOBNDNHDGRO53
Bloomberg-Code: SWABM25 SW
Benchmark: Customized
Währung: CHF
Domizil: Schweiz
Aufgagedatum: 30/09/2001
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	-10.02%	-1.89%	1.23%	-10.02%	-0.48%	0.86%	2.75%	2.87%
BENCHMARK	-10.36%	-1.93%	1.40%	-10.36%	-0.55%	1.10%	3.00%	3.34%

Statistische Angaben (annualisiert)

	1 JAHR	3 JAHRE	5 JAHRE	10 JAHRE	AUFL.
Volatilität Anlagegruppe (in %)	6.10	6.02	5.06	4.25	4.15
Volatilität Benchmark (in %)	-	6.41	5.33	4.31	4.12
Tracking Error ex post (in %)	0.82	0.62	0.55	0.52	0.59
Information Ratio	0.41	0.12	-0.43	-0.49	-0.80
Sharpe Ratio	-1.69	0.01	0.30	0.77	0.66
Korrelation	1.00	1.00	1.00	0.99	0.99
Beta	0.91	0.94	0.94	0.98	1.00
Jensen-Alpha	-0.61	0.07	-0.14	-0.18	-0.47
Maximum Drawdown (in %)	-11.62	-11.75	-11.75	-11.75	-14.16
Recovery Period (Jahre)	-	-	-	-	0.98

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: 0.56%
ex post per: 30/09/2022 0.60%

Portfoliostruktur nach Anlagekategorien

	Anlagegruppe	Benchmark	max. BVV2
Liquidität	5.45%	2.00%	-
Hypotheken Schweiz	0.76%	-	-
Obligationen CHF Inland	13.18%	16.00%	-
Obligationen CHF Ausland	6.76%	9.00%	-
Obligationen Fremdwährungen (CHF hedged)	28.85%	28.00%	-
Aktien Schweiz	12.30%	13.00%	-
Aktien Ausland	9.48%	12.00%	-
Aktien Ausland (CHF hedged)	1.83%	-	-
Immobilien Schweiz	15.79%	13.00%	30.00%
Immobilien Ausland (CHF hedged)	3.26%	2.00%	10.00%
Alternative Anlagen (CHF hedged)	2.34%	5.00%	15.00%
Total Aktien (In- und Ausland)	23.61%	25.00%	50.00%
Total Fremdwährungen	9.48%	12.00%	30.00%

Portfoliostruktur nach Währungen

CHF	90.52%
USD	6.54%
EUR	1.17%
JPY	0.60%
ÜBRIGE	1.17%

Benchmarkzusammensetzung

1M SARON	2.00%
SBI DOMESTIC AAA-BBB	16.00%
SBI FOREIGN AAA-BBB	9.00%
BLOOMBERG GL. AGG. TREAS. EX CH TR (CHF HEDGED)	4.00%
BLOOMBERG GL. AGG. CORP. TR (CHF HEDGED)	9.00%
BLOOMBERG GL. AGG. CORP. SHORT TERM TR (CHF HEDGED)	9.00%
JP MORGAN CEMBI BROAD DIV IG INDEX (CHF HEDGED)	6.00%
SWISS PERFORMANCE INDEX	13.00%
MSCI WORLD EX CH ESG LEADERS, IN CHF	9.60%
MSCI AC WORLD SMALL CAP, IN CHF	1.80%
MSCI EMERGING MARKETS, IN CHF	0.60%
KGAST IMMO-INDEX	13.00%
SL REF (LUX) GERMAN CORE REAL ESTATE (CHF HEDGED)	2.00%
HFRX GLOBAL HEDGE FUNDS (CHF HEDGED)	5.00%

Eigenschaften der festverzinslichen Anlagen

Modified Duration	5.14
Durchschnittliches Rating	A