

Anlagestiftung Swiss Life

Immobilienfonds Schweiz Indexiert

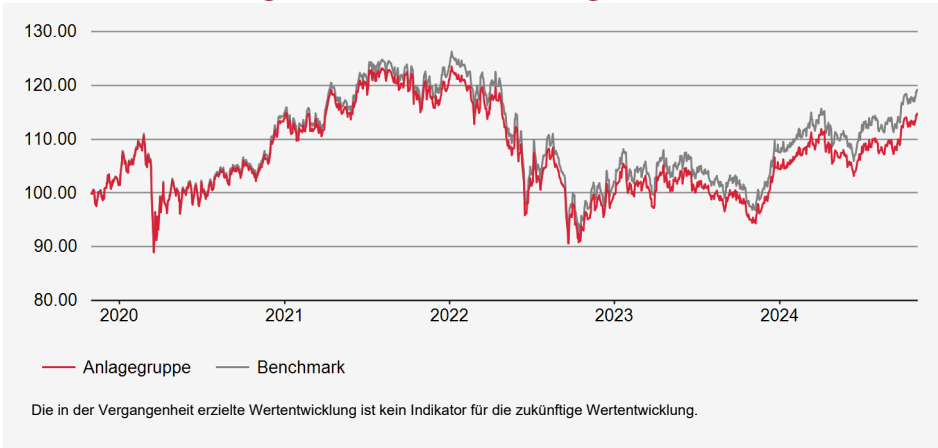


Nettovermögen (NAV) in Mio. CHF: 429.70
Nettovermögen pro Anspruch in CHF: 173.37

Anlagestrategie

Die Anlagegruppe investiert in Immobilien-Anlagefonds, die schweizerischen Rechts sind, auf CHF lauten und ausschliesslich in schweizerische Liegenschaften anlegen. Die Anlagegruppe wird mit einem indexierten Ansatz verwaltet. Das Anlageziel besteht darin, die Benchmark SXI Real Estate® Funds Broad Total Return nachzubilden. Umsetzung mittels Einsatz des Swiss Life Index Funds III (CH) Real Estate Switzerland.

Wertentwicklung in Referenzwährung (Basis 100)



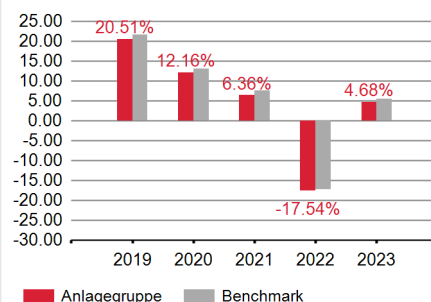
Performance in Referenzwährung

	Kumulierte Performance				Annualisierte Performance			
	YTD	1 Monat	3 Monate	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Aufl.
Anlagegruppe	9.85%	2.31%	4.85%	20.79%	-0.23%	2.79%	4.43%	4.10%
Benchmark	10.76%	2.33%	4.92%	22.29%	0.64%	3.57%	5.36%	4.95%

Statistische Angaben (annualisiert)

	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Aufl.
Volatilität Anlagegruppe (in %)	8.81	9.89	9.89	9.01	8.30
Volatilität Benchmark (in %)	9.15	10.25	10.18	9.30	8.57
Tracking Error ex post (in %)	0.57	0.53	0.44	0.48	0.49
Information Ratio	-2.61	-1.64	-1.77	-1.93	-1.71
Sharpe Ratio	1.98	-0.10	0.26	0.51	0.51
Korrelation	1.00	1.00	1.00	1.00	1.00
Beta	0.96	0.96	0.97	0.97	0.97
Jensen-Alpha	-0.68	-0.87	-0.68	-0.74	-0.68
Maximum Drawdown (in %)	-7.79	-26.64	-26.64	-26.64	-26.64
Recovery Period (Jahre)	0.29	-	-	-	-

Performance



Produktinformationen

Valorennummer: 12468379
ISIN: CH0124683795
LEI: 254900VB5XEQLYLQJ518
Bloomberg-Code: SWLIMSC SW
Benchmark: SXI Real Estate® Funds Broad Total Return
Währung: CHF
Domizil: Schweiz
Aufledgedatum: 28/02/2011
Erstausgabepreis: 100.00
Jahresabschluss: 30.09
Ausgabe/Rücknahme: Täglich
Annahmeschluss: 13.00 Uhr
Verwässerungsschutz: Ausgabe- / Rücknahmekommission zugunsten der Anlagegruppe gemäss Konditionenübersicht.
Ausschüttungspraxis: Thesaurierung
Asset Manager: Swiss Life Asset Management AG
Kurspublikationen: Bloomberg: ASSL
www.swisslife.ch/anlagestiftung
Betriebsaufwandquote TER KGAST
ex ante: 1.00%
ex post per: 30/09/2024 1.00%

Betriebsaufwandquote TER KGAST: Die Betriebsaufwandquote TER KGAST deckt sämtliche Kosten mit Ausnahme der Transaktionskosten und der transaktionsbezogenen steuerlichen Abgaben ab.

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.

Anlagestiftung Swiss Life

Immobilienfonds Schweiz Indexiert



Grösste Positionen

UBS PRPRTY FD SW MIXD SIMA	16.77%
CREDIT SUISSE REAL EST SIAT	5.84%
UBS PRPRTY FD SW RESIDTL ANF	5.02%
CS REAL ESTATE LIVINGPLUS	4.86%
SWISS L REF CH ESG SWISS PRO	3.94%
ED DE ROTHSCHILD REAL ESTATE	3.70%
CS REAL ESTATE FD GREEN PROP	3.67%
IMMOFONDS	3.25%
LA FONCIERE	3.24%
UBS PRPRTY FD LEMAN RESD FON	3.05%