

31. Mai 2025

Anlagestiftung Swiss Life Aktien Schweiz All Caps Indexiert PM



Nettovermögen (NAV) in Mio. CHF: 37.94
Nettovermögen pro Anspruch in CHF: 1'034.74

Anlagestrategie

Die Anlagegruppe wird mit einem indexierten Ansatz verwaltet und zeichnet sich durch eine breite Diversifikation und einen geringen Tracking Error aus. Das Anlageziel besteht darin, die Benchmark SPI® Total Return nachzubilden. Umsetzung mittels Einsatz des Swiss Life Index Funds (CH) Equity Switzerland All Cap; vertraglicher Anlagefonds schweizerischen Rechts der Art "Übrige Fonds für traditionelle Anlagen". Es wird kein Securities Lending betrieben und es werden keine Investitionen in Titel getätigt, die vom Schweizer Verein für verantwortungsbewusste Kapitalanlagen (www.svvk-asir.ch) zum Ausschluss empfohlen sind.

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	8.90%	2.25%	-1.75%	-	-	-	-	-
Benchmark	8.91%	2.25%	-1.75%	-	-	-	-	-

Statistische Angaben (annualisiert)

	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Aufl.
Volatilität Anlagegruppe (in %)	-	-	-	-	12.68
Volatilität Benchmark (in %)	-	-	-	-	12.69
Tracking Error ex post (in %)	-	-	-	-	0.01
Information Ratio	-	-	-	-	-0.94
Sharpe Ratio	-	-	-	-	0.37
Korrelation	-	-	-	-	1.00
Beta	-	-	-	-	1.00
Jensen-Alpha	-	-	-	-	-0.01
Maximum Drawdown (in %)	-	-	-	-	-15.82
Recovery Period (Jahre)	-	-	-	-	-

Performance

Datenhistorie unzureichend

Produktinformationen

Valorennummer: 137660511

ISIN: CH1376605114

LEI: 2549008SI3ES962EZ852

Bloomberg-Code: SLAIACP SW

Benchmark: SPI® Total Return

Währung: CHF

Domizil: Schweiz

Aufgagedatum: 28/10/2024

Erstausgabepreis: 1000.00

Jahresabschluss: 30.09

Ausgabe/Rücknahme: Täglich

Annahmeschluss: 13.00 Uhr

Verwässerungsschutz:

Ausgabe- / Rücknahmekommission zugunsten der Anlagegruppe gemäss Konditionenübersicht.

Asset Manager gemäss

Swiss Life Best Select Invest Plus®:
Swiss Life Asset Management AG

Externe Beratung:

PPCmetrics erbringt 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: 0.01%

PM-Tranche: Der Erwerb dieser Tranche ist nur im Rahmen einer speziellen Vereinbarung mit Swiss Life Asset Management AG möglich.

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.

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

Aktien Schweiz All Caps Indexiert PM



Grösste Positionen

	Anlagegruppe	Benchmark
NESTLE SA-REG	14.20%	14.21%
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	11.53%	11.53%
NOVARTIS AG-REG	11.46%	11.46%
ZURICH INSURANCE GROUP AG	5.22%	5.22%
CIE FINANCIERE RICHEMO-A REG	5.15%	5.15%
UBS GROUP AG-REG	5.14%	5.14%
ABB LTD-REG	4.59%	4.59%
HOLCIM LTD	3.05%	3.05%
SWISS RE AG	2.64%	2.64%
LONZA GROUP AG-REG	2.54%	2.54%

Portfoliostruktur nach Ländern/Regionen

	Anlagegruppe	Benchmark
Schweiz	99.87%	99.90%
Liechtenstein	0.07%	0.07%
Österreich	0.01%	0.01%
Italien	0.01%	0.01%
Niederlande	0.00%	0.00%
Israel	0.00%	0.00%
Liquidität	0.03%	-

Portfoliostruktur nach Branchen

	Anlagegruppe	Benchmark
Gesundheitswesen	33.03%	33.03%
Finanzen	19.58%	19.58%
Nichtzyklische Konsumgüter	16.41%	16.42%
Industrieunternehmen	12.42%	12.43%
Roh- und Grundstoffe	8.09%	8.09%
Zyklische Konsumgüter	5.86%	5.87%
Immobilien	1.66%	1.66%
Informationstechnologie	1.55%	1.56%
Kommunikationsdienste	1.12%	1.12%
Versorgungsbetriebe	0.24%	0.24%
Liquidität	0.03%	-

Portfoliostruktur nach Währungen

	Anlagegruppe	Benchmark
CHF	100.00%	100.00%