

Anlagestiftung Swiss Life

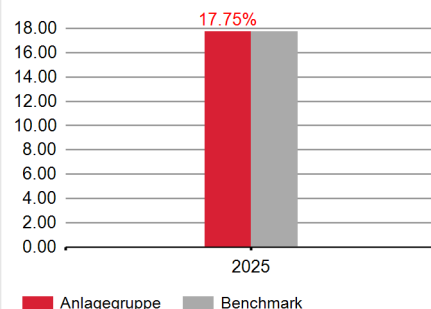
Aktien Schweiz All Caps Indexiert SPM

Nettovermögen (NAV) in Mio. CHF: 80.79
Nettovermögen pro Anspruch in CHF: 1'176.37

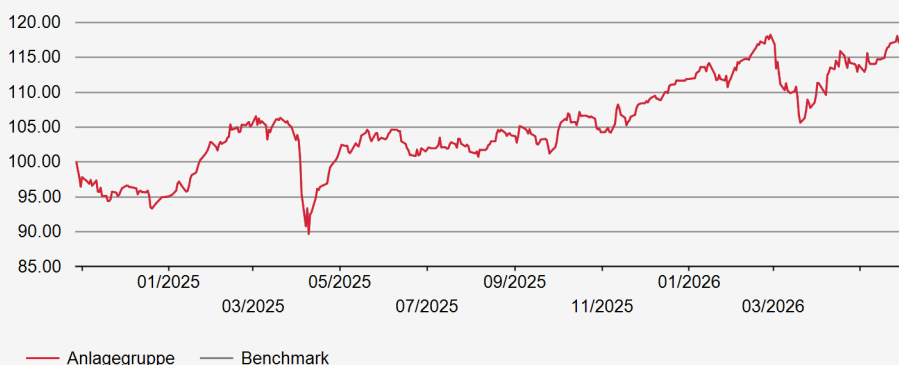
Anlagestrategie

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.

Performance



Wertentwicklung in Referenzwährung (Basis 100)



Die in der Vergangenheit erzielte Wertentwicklung ist kein Indikator für die zukünftige Wertentwicklung.

Produktinformationen

Valorennummer: 137660511
ISIN: CH1376605114
LEI: 2549008S13ES962EZ852
Bloomberg-Code: SLAIACP SW
Benchmark: SPI® Total Return
Währung: CHF
Domizil: Schweiz
Aufledgedatum: 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: 0.00%
ex post per: 30/09/2025 0.00%

Performance in Referenzwährung

	Kumulierte Performance				Annualisierte Performance			
	YTD	1 Monat	3 Monate	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Aufl.
Anlagegruppe	5.14%	3.27%	-0.52%	13.69%	-	-	-	10.80%
Benchmark	5.15%	3.27%	-0.51%	13.69%	-	-	-	10.81%

Statistische Angaben (annualisiert)

	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Aufl.
Volatilität Anlagegruppe (in %)	12.26	-	-	-	12.15
Volatilität Benchmark (in %)	12.27	-	-	-	12.15
Tracking Error ex post (in %)	0.02	-	-	-	0.01
Information Ratio	-0.44	-	-	-	-0.62
Sharpe Ratio	1.05	-	-	-	0.79
Korrelation	1.00	-	-	-	1.00
Beta	1.00	-	-	-	1.00
Jensen-Alpha	0.00	-	-	-	-0.01
Maximum Drawdown (in %)	-10.66	-	-	-	-15.82
Recovery Period (Jahre)	-	-	-	-	0.50

SPM-Tranche: Die SPM-Tranche steht sowohl Anlegern mit einer speziellen Vereinbarung mit der Swiss Life Asset Management AG (SLAM CH) sowie Vermögensverwaltungskunden und Kunden von Kooperationspartnern der SLAM CH (jeweils mit Zusatzvereinbarung) offen.

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 SPM

Grösste Positionen

	Anlagegruppe	Benchmark
NOVARTIS AG-REG	12.86%	12.85%
ROCHE HOLDING AG	12.85%	12.85%
NESTLE SA-REG	11.37%	11.37%
ABB LTD-REG	7.33%	7.33%
UBS GROUP AG-REG	6.31%	6.31%
CIE FINANCIERE RICHEMO-A REG	5.04%	5.04%
ZURICH INSURANCE GROUP AG	4.75%	4.75%
HOLCIM LTD	2.30%	2.30%
SWISS RE AG	1.95%	1.95%
LONZA GROUP AG-REG	1.95%	1.95%

Portfoliostruktur nach Ländern/Regionen

	Anlagegruppe	Benchmark
Schweiz	99.86%	99.89%
Liechtenstein	0.08%	0.08%
Italien	0.01%	0.01%
Österreich	0.01%	0.01%
Niederlande	0.00%	0.00%
Israel	0.00%	0.00%
Liquidität	0.04%	-

Portfoliostruktur nach Branchen

	Anlagegruppe	Benchmark
Gesundheitswesen	35.23%	35.24%
Finanzen	18.99%	19.00%
Industrieunternehmen	14.77%	14.77%
Nichtzyklische Konsumgüter	12.97%	12.97%
Roh- und Grundstoffe	7.45%	7.45%
Zyklische Konsumgüter	5.85%	5.85%
Informationstechnologie	1.69%	1.69%
Immobilien	1.64%	1.65%
Kommunikationsdienste	1.18%	1.18%
Versorgungsbetriebe	0.19%	0.19%
Liquidität	0.04%	-

Portfoliostruktur nach Währungen

	Anlagegruppe	Benchmark
CHF	100.00%	100.00%