

Anlagestiftung Swiss Life

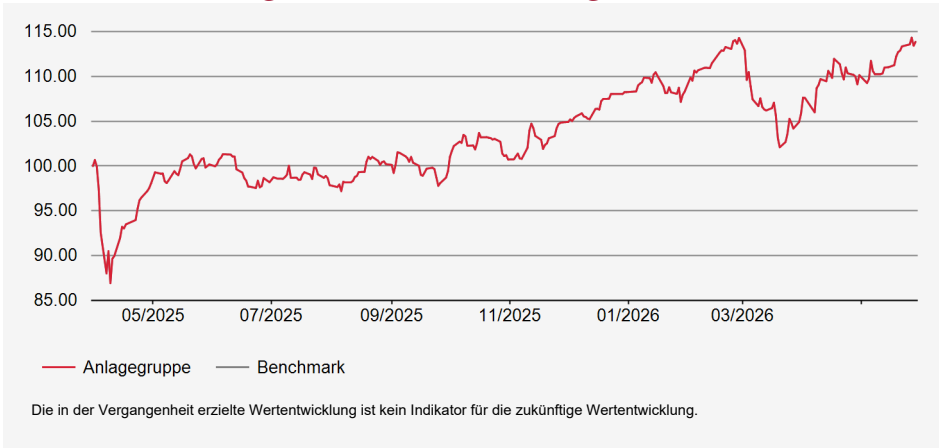
Aktien Schweiz All Caps ESG Indexiert SPM

Nettovermögen (NAV) in Mio. CHF: 48.50
Nettovermögen pro Anspruch in CHF: 1'138.52

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® ESG Total Return nachzubilden. Umsetzung mittels Einsatz des Swiss Life Index Funds (CH) Equity Responsible 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	5.18%	3.37%	-0.37%	13.65%	-	-	-	11.82%
Benchmark	5.19%	3.37%	-0.37%	13.66%	-	-	-	11.83%

Statistische Angaben (annualisiert)

	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Aufl.
Volatilität Anlagegruppe (in %)	12.29	-	-	-	11.30
Volatilität Benchmark (in %)	12.29	-	-	-	11.70
Tracking Error ex post (in %)	0.01	-	-	-	0.01
Information Ratio	-0.95	-	-	-	-1.03
Sharpe Ratio	1.04	-	-	-	0.92
Korrelation	1.00	-	-	-	1.00
Beta	1.00	-	-	-	1.00
Jensen-Alpha	-0.01	-	-	-	-0.01
Maximum Drawdown (in %)	-10.67	-	-	-	-13.64
Recovery Period (Jahre)	0.19	-	-	-	0.11

Performance

Datenhistorie unzureichend

Produktinformationen

Valorenummer: 142759728
ISIN: CH1427597286
LEI: 254900SX1QXOQG88YF19
Bloomberg-Code: SLAIARP SW
Benchmark: SPI® ESG Total Return
Währung: CHF
Domizil: Schweiz
Aufgatedatum: 31/03/2025
Erstausgabepreis: 1000.00
Jahresabschluss: 30.09
Ausgabe/Rücknahme: Täglich
Annahmeschluss: 13:00 Uhr
Verwässerungsschutz:
Ausgabe- / Rücknahmekommission zugunsten der Anlagegruppe gemäss Konditionenübersicht.

Asset management:
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%

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 ESG Indexiert SPM



Grösste Positionen

	Anlagegruppe	Benchmark
NOVARTIS AG-REG	13.32%	13.32%
ROCHE HOLDING AG	13.32%	13.32%
NESTLE SA-REG	11.79%	11.79%
ABB LTD-REG	7.60%	7.60%
UBS GROUP AG-REG	6.54%	6.54%
CIE FINANCIERE RICHEMO-A REG	5.23%	5.23%
ZURICH INSURANCE GROUP AG	4.92%	4.92%
HOLCIM LTD	2.38%	2.38%
SWISS RE AG	2.02%	2.03%
LONZA GROUP AG-REG	2.02%	2.02%

Portfoliostruktur nach Ländern/Regionen

	Anlagegruppe	Benchmark
Schweiz	99.88%	99.90%
Liechtenstein	0.08%	0.08%
Österreich	0.01%	0.01%
Niederlande	0.00%	0.00%
Liquidität	0.02%	-

Portfoliostruktur nach Branchen

	Anlagegruppe	Benchmark
Gesundheitswesen	36.46%	36.47%
Finanzen	19.68%	19.68%
Industrieunternehmen	14.38%	14.39%
Nichtzyklische Konsumgüter	13.43%	13.44%
Zyklische Konsumgüter	5.80%	5.80%
Roh- und Grundstoffe	5.71%	5.70%
Informationstechnologie	1.72%	1.73%
Immobilien	1.61%	1.61%
Kommunikationsdienste	1.19%	1.19%
Versorgungsbetriebe	0.00%	0.00%
Liquidität	0.02%	-

Portfoliostruktur nach Währungen

	Anlagegruppe	Benchmark
CHF	100.00%	100.00%