

Anlagestiftung Swiss Life

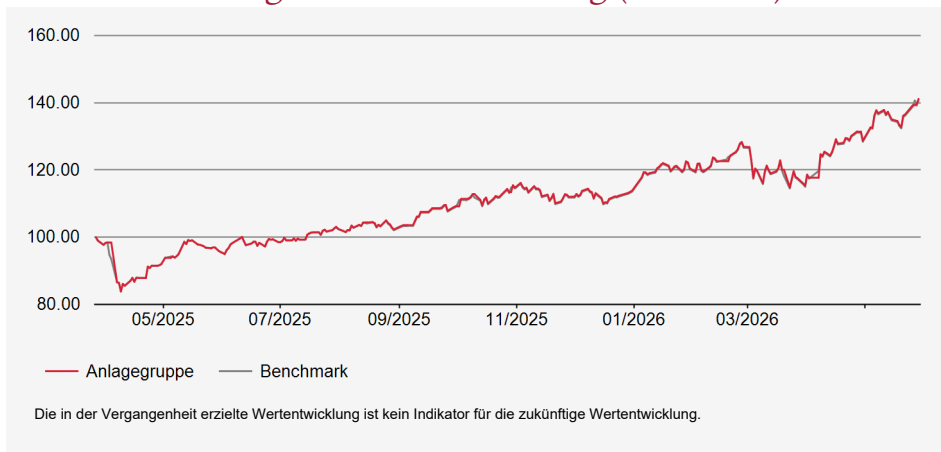
Aktien Emerging Markets Indexiert SPM

Nettovermögen (NAV) in Mio. CHF: 339.87
Nettovermögen pro Anspruch in CHF: 1'411.83

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 MSCI Emerging Markets Net Return nachzubilden. Umsetzung mittels Einsatz des Swiss Life Index Funds (CH) Equity Emerging Markets; 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	23.99%	9.70%	11.24%	47.26%	-	-	-	34.19%
Benchmark	23.89%	9.59%	11.14%	46.76%	-	-	-	33.84%

Statistische Angaben (annualisiert)

	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Aufl.
Volatilität Anlagegruppe (in %)	18.98	-	-	-	19.30
Volatilität Benchmark (in %)	19.02	-	-	-	19.33
Tracking Error ex post (in %)	0.19	-	-	-	0.19
Information Ratio	2.71	-	-	-	1.67
Sharpe Ratio	2.04	-	-	-	1.43
Korrelation	1.00	-	-	-	1.00
Beta	1.00	-	-	-	1.00
Jensen-Alpha	0.60	-	-	-	0.40
Maximum Drawdown (in %)	-10.55	-	-	-	-16.10
Recovery Period (Jahre)	0.07	-	-	-	0.17

Performance

Datenhistorie unzureichend

Produktinformationen

Valorennummer: 137660516
ISIN: CH1376605163
LEI: 254900BAE9OSOB4CB286
Bloomberg-Code: SLAIEMP SW
Benchmark: MSCI Emerging Markets Net Return
Währung: CHF
Domizil: Schweiz
Aufgagedatum: 27/03/2025
Erstausgabepreis: 1000.00
Jahresabschluss: 30.09
Ausgabe/Rücknahme: Täglich
Annaheschluss: 14:00 Uhr (T-1)
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: 0.01%
ex post per: 30/09/2025 0.01%

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 Emerging Markets Indexiert SPM

Grösste Positionen

	Anlagegruppe	Benchmark
TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC	14.74%	14.74%
SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	7.83%	7.83%
SK HYNIX INC	6.80%	6.80%
TENCENT HOLDINGS LTD	2.67%	2.67%
ALIBABA GROUP HOLDING LTD	2.05%	2.06%
MEDIATEK INC	1.58%	1.58%
DELTA ELECTRONICS INC	1.21%	1.21%
HON HAI PRECISION INDUSTRY	0.90%	0.90%
SAMSUNG ELECTRONICS-PREF	0.86%	0.86%
CHINA CONSTRUCTION BANK-H	0.72%	0.73%

Portfoliostruktur nach Ländern/Regionen

	Anlagegruppe	Benchmark
Taiwan	26.63%	26.65%
Südkorea	23.25%	23.28%
China	20.23%	20.26%
Indien	10.77%	10.74%
Brasilien	3.84%	3.84%
Südafrika	3.08%	3.08%
Saudiarabien	2.43%	2.43%
Mexiko	1.69%	1.68%
Vereinigte Arabische Emirate	1.07%	1.07%
Polen	1.04%	1.05%
Thailand	0.97%	0.96%
Malaysia	0.93%	0.93%
Andere	4.05%	4.03%
Liquidität	0.02%	-

Portfoliostruktur nach Branchen

	Anlagegruppe	Benchmark
Informationstechnologie	43.79%	43.82%
Finanzen	17.91%	17.84%
Zyklische Konsumgüter	8.32%	8.29%
Industrieunternehmen	6.67%	6.84%
Kommunikationsdienste	6.01%	6.00%
Roh- und Grundstoffe	5.95%	5.92%
Energie	3.30%	3.34%
Nichtzyklische Konsumgüter	2.73%	2.70%
Gesundheitswesen	2.38%	2.33%
Versorgungsbetriebe	1.92%	1.91%
Immobilien	1.00%	1.00%
Liquidität	0.02%	-

Portfoliostruktur nach Währungen

	Anlagegruppe	Benchmark
TWD	26.63%	26.65%
KRW	23.25%	23.28%
HKD	16.03%	15.96%
INR	10.78%	10.74%
CNY	3.56%	3.63%
BRL	3.34%	3.34%
ZAR	3.09%	3.08%
SAR	2.43%	2.43%
MXN	1.69%	1.68%
Sonstige	9.20%	9.22%