

Anlagestiftung Swiss Life

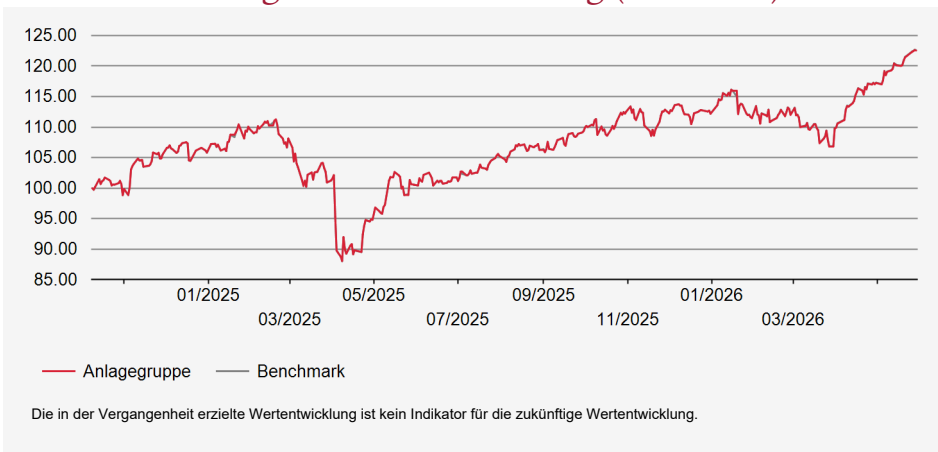
Aktien Global ex Schweiz Indexiert SPM

Nettovermögen (NAV) in Mio. CHF: 339.76
Nettovermögen pro Anspruch in CHF: 1'225.44

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 World ex Switzerland Total Return nachzubilden. Umsetzung mittels Einsatz des Swiss Life Index Funds II (CH) Equity Global ex Switzerland PF; 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)



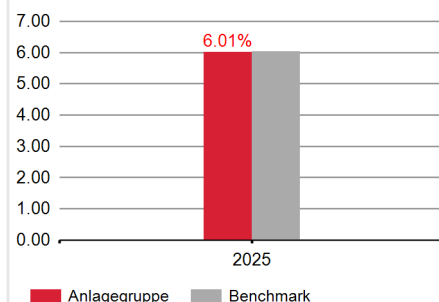
Performance in Referenzwährung

	Kumulierte Performance				Annualisierte Performance			
	YTD	1 Monat	3 Monate	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Aufl.
Anlagegruppe	9.23%	4.53%	9.40%	21.85%	-	-	-	13.24%
Benchmark	9.27%	4.54%	9.40%	21.92%	-	-	-	13.27%

Statistische Angaben (annualisiert)

	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Aufl.
Volatilität Anlagegruppe (in %)	8.46	-	-	-	12.76
Volatilität Benchmark (in %)	8.44	-	-	-	12.75
Tracking Error ex post (in %)	0.04	-	-	-	0.04
Information Ratio	-1.43	-	-	-	-0.82
Sharpe Ratio	2.34	-	-	-	0.94
Korrelation	1.00	-	-	-	1.00
Beta	1.00	-	-	-	1.00
Jensen-Alpha	-0.11	-	-	-	-0.05
Maximum Drawdown (in %)	-8.01	-	-	-	-20.85
Recovery Period (Jahre)	0.05	-	-	-	0.50

Performance



Produktinformationen

Valorennummer: 137660512
ISIN: CH1376605122
LEI: 254900L9JTOPGWYKPR82
Bloomberg-Code: SLAIAGP SW
Benchmark: MSCI World ex Switzerland Total Return
Währung: CHF
Domizil: Schweiz
Aufliedatum: 09/10/2024
Erstausgabepreis: 1000.00
Jahresabschluss: 30.09
Ausgabe/Rücknahme: Täglich
Annahmeschluss: 14:00 Uhr (T-1)
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%

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 Global ex Schweiz Indexiert SPM

Grösste Positionen

	Anlagegruppe	Benchmark
NVIDIA CORP	5.56%	5.56%
APPLE INC	5.22%	5.22%
MICROSOFT CORP	3.62%	3.62%
AMAZON.COM INC	2.99%	2.99%
ALPHABET INC-CL A	2.52%	2.52%
BROADCOM INC	2.29%	2.29%
ALPHABET INC-CL C	1.98%	1.98%
META PLATFORMS INC-CLASS A	1.58%	1.58%
TESLA INC	1.40%	1.40%
MICRON TECHNOLOGY INC	1.25%	1.25%

Portfoliostruktur nach Ländern/Regionen

	Anlagegruppe	Benchmark
Vereinigte Staaten	74.21%	74.26%
Japan	5.81%	5.81%
Vereinigtes Königreich	3.52%	3.53%
Kanada	3.46%	3.46%
Frankreich	2.42%	2.43%
Deutschland	2.21%	2.22%
Australien	1.64%	1.65%
Niederlande	1.39%	1.41%
Spanien	0.94%	0.93%
Schweden	0.87%	0.87%
Italien	0.81%	0.81%
Hongkong	0.47%	0.46%
Andere	2.20%	2.17%
Liquidität	0.05%	-

Portfoliostruktur nach Branchen

	Anlagegruppe	Benchmark
Informationstechnologie	31.32%	31.35%
Finanzen	15.14%	15.14%
Industrieunternehmen	11.19%	11.21%
Zyklische Konsumgüter	9.31%	9.29%
Kommunikationsdienste	8.79%	8.79%
Gesundheitswesen	7.90%	7.93%
Nichtzyklische Konsumgüter	4.72%	4.71%
Energie	3.89%	3.89%
Roh- und Grundstoffe	3.41%	3.41%
Versorgungsbetriebe	2.57%	2.58%
Immobilien	1.70%	1.70%
Liquidität	0.05%	-

Portfoliostruktur nach Währungen

	Anlagegruppe	Benchmark
USD	74.58%	74.67%
EUR	8.51%	8.52%
JPY	5.85%	5.81%
GBP	3.47%	3.45%
CAD	3.46%	3.46%
AUD	1.65%	1.65%
SEK	0.78%	0.77%
HKD	0.45%	0.44%
DKK	0.42%	0.41%
Sonstige	0.84%	0.82%