



Anlagestiftung Swiss Life

Aktien Global ex Schweiz ESG Indexiert SPM (CHF hedged) SwissLife

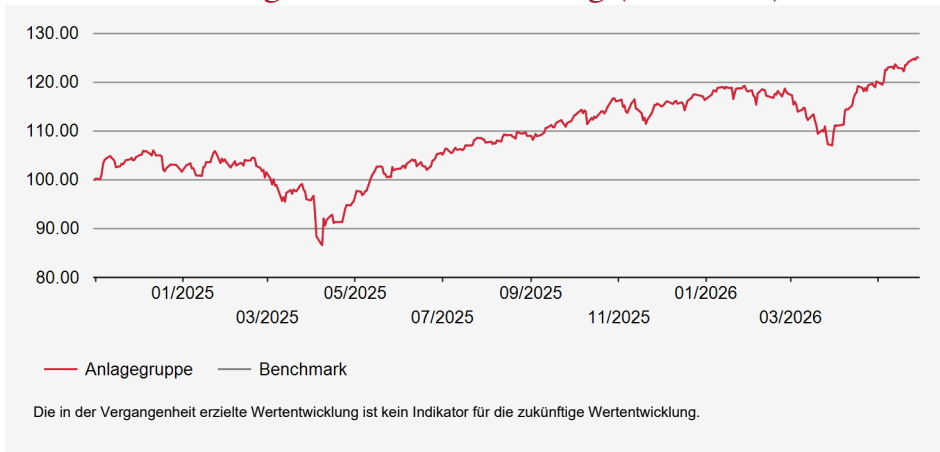
Nettovermögen (NAV) in Mio. CHF: 610.53

Nettovermögen pro Anspruch in CHF: 1'251.09

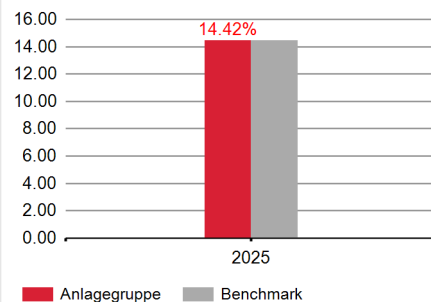
Anlagestrategie

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 Selection Total Return (CHF hedged) nachzubilden. Umsetzung mittels Einsatz des Swiss Life Index Funds II (CH) Equity ESG Global ex Switzerland PF (CHF hedged); 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.svkv-asir.ch) zum Ausschluss empfohlen sind.

Wertentwicklung in Referenzwährung (Basis 100)



Performance



Produktinformationen

Valorennummer: 137660514

ISIN: CH1376605148

LEI: 25490086E6SZEPD5IJ48

Bloomberg-Code: SLAIAEP SW

Benchmark: MSCI World ex Switzerland Selection (TR) (CHF hdg)

Währung: CHF

Domizil: Schweiz

Aufledgedatum: 31/10/2024

Erstausgabepreis: 1000.00

Jahresabschluss: 30.09

Ausgabe/Rücknahme: Täglich

Annaheschluss: 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%

Performance in Referenzwährung

| | Kumulierte Performance | | | | Annualisierte Performance | | | |
|--------------|------------------------|---------|----------|--------|---------------------------|---------|----------|--------|
| | YTD | 1 Monat | 3 Monate | 1 Jahr | 3 Jahre | 5 Jahre | 10 Jahre | Aufl. |
| Anlagegruppe | 7.50% | 4.09% | 6.30% | 22.33% | - | - | - | 15.28% |
| Benchmark | 7.46% | 4.09% | 6.25% | 22.30% | - | - | - | 15.28% |

Statistische Angaben (annualisiert)

| | 1 Jahr | 3 Jahre | 5 Jahre | 10 Jahre | Aufl. |
|---------------------------------|--------|---------|---------|----------|--------|
| Volatilität Anlagegruppe (in %) | 12.89 | - | - | - | 13.24 |
| Volatilität Benchmark (in %) | 12.95 | - | - | - | 13.60 |
| Tracking Error ex post (in %) | 0.09 | - | - | - | 0.08 |
| Information Ratio | 0.40 | - | - | - | -0.01 |
| Sharpe Ratio | 1.57 | - | - | - | 1.00 |
| Korrelation | 1.00 | - | - | - | 1.00 |
| Beta | 1.00 | - | - | - | 1.00 |
| Jensen-Alpha | 0.13 | - | - | - | 0.03 |
| Maximum Drawdown (in %) | -10.22 | - | - | - | -18.29 |
| Recovery Period (Jahre) | 0.07 | - | - | - | 0.24 |

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 ESG Indexiert SPM (CHF hedged)



Grösste Positionen

| | Anlagegruppe | Benchmark |
|-------------------------|--------------|-----------|
| NVIDIA CORP | 10.66% | 10.65% |
| MICROSOFT CORP | 6.94% | 6.94% |
| ALPHABET INC-CL A | 4.84% | 4.84% |
| ALPHABET INC-CL C | 3.81% | 3.80% |
| TESLA INC | 2.68% | 2.68% |
| ELI LILLY & CO | 1.94% | 1.94% |
| ADVANCED MICRO DEVICES | 1.84% | 1.84% |
| ASML HOLDING NV | 1.37% | 1.37% |
| VISA INC-CLASS A SHARES | 1.20% | 1.20% |
| JOHNSON & JOHNSON | 1.19% | 1.19% |

Portfoliostruktur nach Ländern/Regionen

| | Anlagegruppe | Benchmark |
|------------------------|--------------|-----------|
| Vereinigte Staaten | 74.25% | 74.24% |
| Japan | 6.11% | 6.11% |
| Kanada | 3.55% | 3.55% |
| Vereinigtes Königreich | 3.48% | 3.48% |
| Frankreich | 2.89% | 2.89% |
| Niederlande | 2.15% | 2.15% |
| Australien | 1.45% | 1.44% |
| Schweden | 1.05% | 1.05% |
| Deutschland | 1.14% | 1.12% |
| Spanien | 0.86% | 0.86% |
| Dänemark | 0.66% | 0.67% |
| Hongkong | 0.56% | 0.56% |
| Andere | 1.85% | 1.85% |
| Liquidität | - | - |

Portfoliostruktur nach Branchen

| | Anlagegruppe | Benchmark |
|----------------------------|--------------|-----------|
| Informationstechnologie | 29.81% | 29.80% |
| Finanzen | 14.77% | 14.77% |
| Kommunikationsdienste | 11.41% | 11.41% |
| Industrieunternehmen | 10.76% | 10.76% |
| Zyklische Konsumgüter | 9.05% | 9.06% |
| Gesundheitswesen | 8.92% | 8.92% |
| Nichtzyklische Konsumgüter | 5.43% | 5.44% |
| Roh- und Grundstoffe | 3.58% | 3.58% |
| Energie | 2.67% | 2.67% |
| Immobilien | 1.89% | 1.89% |
| Versorgungsbetriebe | 1.71% | 1.71% |
| Liquidität | - | - |