

Anlagestiftung Swiss Life Immobilienfonds Schweiz PM

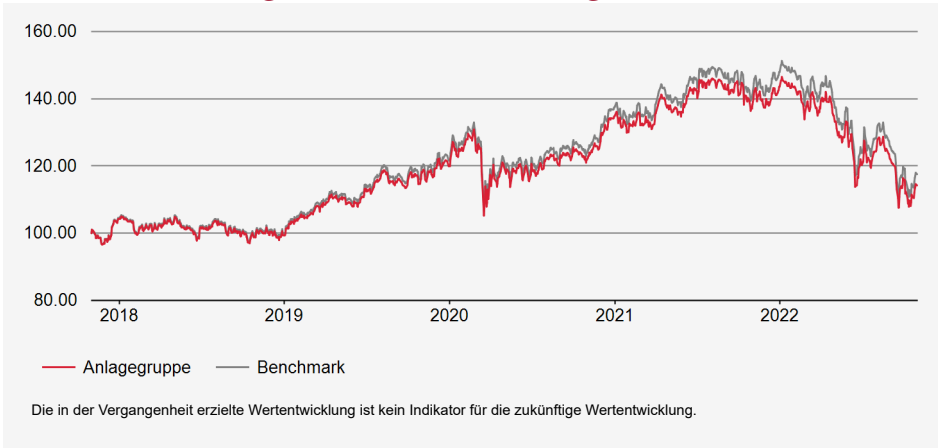


Nettovermögen (NAV) in Mio. CHF: 330.96
Nettovermögen pro Anspruch in CHF: 148.06

Anlagestrategie

Die Anlagegruppe investiert in Immobilien-Anlagefonds, die schweizerischen Rechts sind, auf CHF lauten und ausschliesslich in schweizerische Liegenschaften anlegen. Aktive Selektion der Immobilien-Anlagefonds. Umsetzung mittels Einsatz des Swiss Life Funds (CH) Real Estate Switzerland Fund of Funds.

Wertentwicklung in Referenzwährung (Basis 100)



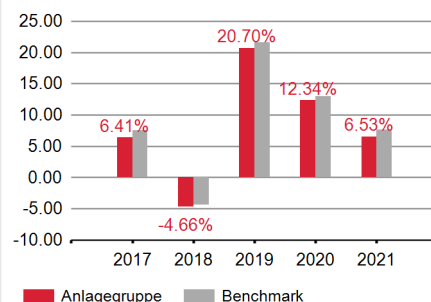
Performance in Referenzwährung

	KUMULIERTE PERFORMANCE				ANNUALISIERTE PERFORMANCE			
	YTD	1 MONAT	3 MONATE	1 JAHR	3 JAHRE	5 JAHRE	10 JAHRE	AUFL.
ANLAGEGRUPPE	-20.44%	-1.86%	-8.11%	-16.65%	-1.13%	2.70%	3.80%	3.42%
BENCHMARK	-20.54%	-1.88%	-8.31%	-16.07%	-0.62%	3.28%	4.48%	4.08%

Statistische Angaben (annualisiert)

	1 JAHR	3 JAHRE	5 JAHRE	10 JAHRE	AUFL.
Volatilität Anlagegruppe (in %)	10.88	10.72	9.72	8.67	8.29
Volatilität Benchmark (in %)	-	11.01	9.96	8.96	8.56
Tracking Error ex post (in %)	0.69	0.44	0.36	0.53	0.50
Information Ratio	-0.84	-1.16	-1.63	-1.28	-1.31
Sharpe Ratio	-1.63	-0.05	0.35	0.50	0.46
Korrelation	1.00	1.00	1.00	1.00	1.00
Beta	0.95	0.97	0.98	0.97	0.97
Jensen-Alpha	-1.35	-0.51	-0.49	-0.51	-0.51
Maximum Drawdown (in %)	-26.55	-26.55	-26.55	-26.55	-26.55
Recovery Period (Jahre)	-	-	-	-	-

Performance



Produktinformationen

Valorennummer: 12468565

ISIN: CH0124685659

LEI: 254900VB5XEQLYLQJ518

Bloomberg-Code: SWLIMPM SW

Benchmark: SXI Swiss Real Estate Funds TR Index

Währung: CHF

Domizil: Schweiz

Aufgatedatum: 28/02/2011

Ausgabepreis: 100.00

Jahresabschluss: 30.09

Ausgabe/Rücknahme: Täglich

Annahmeschluss: 14.30 Uhr

Ausgabe-/Rücknahmekommission: Keine

Ausschüttungspraxis: Thesaurierung

Asset Manager

Swiss Life Asset Management AG

Kurspublikationen: Bloomberg: ASSL
www.swisslife.ch/anlagestiftung

Betriebsaufwandquote TER KGAST

ex ante: 1.00%

ex post per: 30/09/2022 0.99%

PM-Tranche: Erwerb dieser Tranche ist nur im Rahmen einer speziellen Vereinbarung mit Swiss Life Asset Management AG möglich.

Betriebsaufwandquote TER KGAST: Die Betriebsaufwandquote TER KGAST deckt sämtliche Kosten mit Ausnahme der Transaktionskosten und der transaktionsbezogenen steuerlichen Abgaben ab.

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.

Liegenschaften nach Nutzungsart*

	Anlagegruppe	Benchmark
WOHNEN	57.50%	57.40%
KOMMERZIELL	34.00%	34.10%
GEMISCHT	8.00%	8.00%
BAULAND, PROJEKTE	0.50%	0.50%

*gemäss letzt verfügbaren Daten

Geografische Verteilung der Liegenschaften*

	Anlagegruppe	Benchmark
ZÜRICH	35.20%	35.30%
BERN	6.80%	6.80%
INNERSCHWEIZ	6.30%	6.30%
WESTSCHWEIZ	4.20%	4.20%
NORDWESTSCHWEIZ	18.20%	18.10%
OSTSCHWEIZ	5.40%	5.30%
SÜDSCHWEIZ	1.90%	1.90%
GENFERSEE	22.00%	22.10%

*gemäss letzt verfügbaren Daten

Grösste Positionen

	Anlagegruppe	Benchmark
UBS SWISS SIMA	29.40%	30.20%
CS REF SIAT	10.60%	10.80%
UBS SWISS ANFOS	9.40%	9.40%
CS REF LIVING PLUS	9.30%	9.30%
CS REF GREEN PROPERTY	8.50%	8.60%