

Anlagestiftung Swiss Life

Immobilienfonds Schweiz Indexiert PM

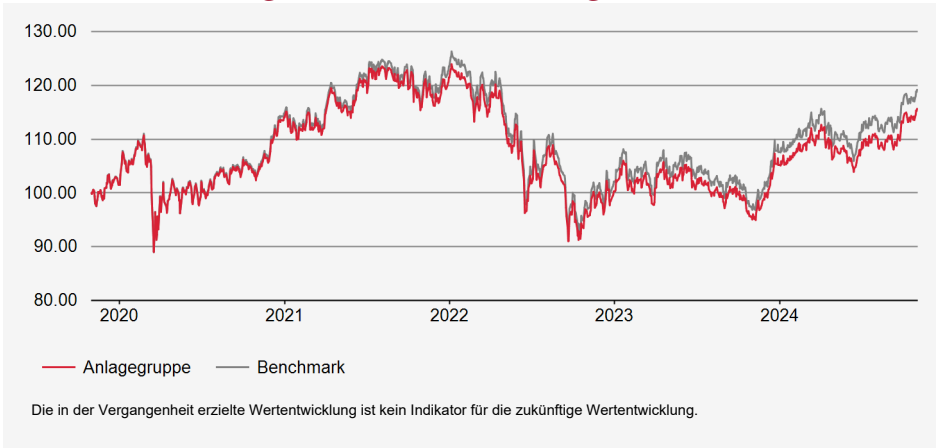


Nettovermögen (NAV) in Mio. CHF: 429.70
Nettovermögen pro Anspruch in CHF: 177.20

Anlagestrategie

Die Anlagegruppe investiert in Immobilien-Anlagefonds, die schweizerischen Rechts sind, auf CHF lauten und ausschliesslich in schweizerische Liegenschaften anlegen. Die Anlagegruppe wird mit einem indexierten Ansatz verwaltet. Das Anlageziel besteht darin, die Benchmark SXI Real Estate® Funds Broad Total Return nachzubilden. Umsetzung mittels Einsatz des Swiss Life Index Funds III (CH) Real Estate Switzerland.

Wertentwicklung in Referenzwährung (Basis 100)



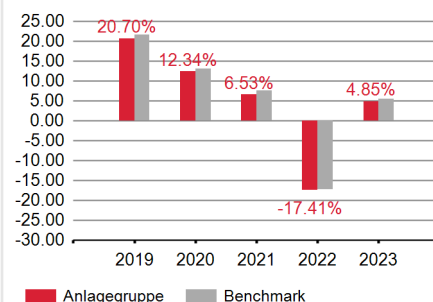
Performance in Referenzwährung

	Kumulierte Performance				Annualisierte Performance			
	YTD	1 Monat	3 Monate	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Aufl.
Anlagegruppe	9.96%	2.32%	4.86%	20.94%	-0.08%	2.95%	4.60%	4.27%
Benchmark	10.76%	2.33%	4.92%	22.29%	0.64%	3.57%	5.36%	4.95%

Statistische Angaben (annualisiert)

	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Aufl.
Volatilität Anlagegruppe (in %)	8.80	9.88	9.89	9.01	8.30
Volatilität Benchmark (in %)	9.15	10.25	10.18	9.30	8.57
Tracking Error ex post (in %)	0.57	0.53	0.44	0.48	0.50
Information Ratio	-2.37	-1.35	-1.41	-1.57	-1.37
Sharpe Ratio	2.00	-0.08	0.28	0.53	0.53
Korrelation	1.00	1.00	1.00	1.00	1.00
Beta	0.96	0.96	0.97	0.97	0.97
Jensen-Alpha	-0.52	-0.72	-0.52	-0.58	-0.51
Maximum Drawdown (in %)	-7.76	-26.55	-26.55	-26.55	-26.55
Recovery Period (Jahre)	0.29	-	-	-	-

Performance



Produktinformationen

Valorennummer: 12468565
ISIN: CH0124685659
LEI: 254900VB5XEQLYLQJ518
Bloomberg-Code: SWLIMPM SW
Benchmark: SXI Real Estate® Funds Broad Total Return

Währung: CHF

Domizil: Schweiz

Aufledgedatum: 28/02/2011

Erstausgabepreis: 100.00

Jahresabschluss: 30.09

Ausgabe/Rücknahme: Täglich

Annahmeschluss: 13.00 Uhr

Verwässerungsschutz:
Ausgabe- / Rücknahmekommission zugunsten der Anlagegruppe gemäss Konditionenübersicht.

Ausschüttungspraxis: Thesaurierung

Asset Manager

Swiss Life Asset Management AG

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

Betriebsaufwandquote TER KGAST

ex ante: 0.94%

ex post per: 30/09/2024 0.94%

Anlagestiftung Swiss Life

Immobilienfonds Schweiz Indexiert PM



Grösste Positionen

UBS PRPRTY FD SW MIXD SIMA	16.77%
CREDIT SUISSE REAL EST SIAT	5.84%
UBS PRPRTY FD SW RESIDTL ANF	5.02%
CS REAL ESTATE LIVINGPLUS	4.86%
SWISS L REF CH ESG SWISS PRO	3.94%
ED DE ROTHSCHILD REAL ESTATE	3.70%
CS REAL ESTATE FD GREEN PROP	3.67%
IMMOFONDS	3.25%
LA FONCIERE	3.24%
UBS PRPRTY FD LEMAN RESD FON	3.05%