

Nettovermögen (NAV) in Mio. CHF: 578.23
Nettovermögen pro Anspruch in CHF: 209.81

Anlagestrategie

Anlagen in Beteiligungspapiere von Gesellschaften, die im Swiss Performance Index (SPI) vertreten sind. Large Caps werden passiv abgedeckt, Small & Mid Caps werden aktiv verwaltet (Core-Satellite). Gesellschaftsbegrenzung: 5% (Ausnahme: sofern im Benchmark; max. 5%-Punkte mehr als Benchmarkgewichtung). Umsetzung mittels Einsatz der Swiss Life Index Funds (CH) Equity Switzerland Large Cap und SL iFunds Equity Switzerland Small & Mid Cap (CHF); Anlagenfonds schweizerischen Rechts der Kategorie "Übrige Fonds für traditionelle Anlagen".

Wertentwicklung in Referenzwährung (Basis 100)



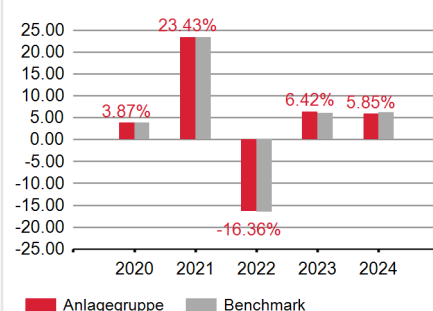
Performance in Referenzwährung

	Kumulierte Performance				Annualisierte Performance			
	YTD	1 Monat	3 Monate	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Aufl.
Anlagegruppe	8.43%	-2.12%	8.43%	8.29%	2.64%	8.19%	6.21%	4.24%
Benchmark	8.58%	-2.04%	8.58%	8.79%	2.63%	8.21%	6.27%	4.48%

Statistische Angaben (annualisiert)

	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Aufl.
Volatilität Anlagegruppe (in %)	12.03	12.39	12.59	11.98	12.82
Volatilität Benchmark (in %)	11.98	12.41	12.60	12.02	12.81
Tracking Error ex post (in %)	0.18	0.32	0.32	0.31	0.66
Information Ratio	-2.82	0.03	-0.08	-0.21	-0.36
Sharpe Ratio	0.58	0.14	0.60	0.52	0.32
Korrelation	1.00	1.00	1.00	1.00	1.00
Beta	1.00	1.00	1.00	1.00	1.00
Jensen-Alpha	-0.53	0.01	-0.02	-0.04	-0.24
Maximum Drawdown (in %)	-8.07	-18.85	-21.74	-25.86	-54.13
Recovery Period (Jahre)	0.11	1.64	1.93	0.83	4.84

Performance



Produktinformationen

Valorennummer: 3026057
ISIN: CH0030260571
LEI: 254900UNZU5YPIKQTQ23
Bloomberg-Code: SLACHPM SW
Benchmark: SPI® Total Return
Währung: CHF
Domizil: Schweiz
Aufledgedatum: 31/05/2007
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 gemäss Swiss Life Best Select Invest Plus® Large Caps (passiv)
 Swiss Life Asset Management AG
Small&Mid Caps (aktiv)
 Privatbank Von Graffenried AG

Externe Beratung: PPCmetrics erbringt folgende Dienstleistungen: Beratung betreffend geeigneter Mandatsstrukturen (Core-Satellite), Unterstützung bei der Selektion geeigneter Asset Manager sowie Unterstützung bei der laufenden Überwachung der Asset Manager und Beurteilung der Anlageresultate.
Kurspublikationen: Bloomberg: ASSL
www.swisslife.ch/anlagestiftung
Betriebsaufwandquote TER KGAST ex ante: 0.25%
ex post per: 30/09/2024 0.28%

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

Asset Manager: Die Auswahl der Manager, deren permanente Überwachung und die gesamte Prozessbegleitung erfolgen nach objektiven Kriterien und bester institutioneller Praxis durch Swiss Life Asset Management AG.

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.

Portfoliostruktur nach Branchen

	Anlagegruppe	Benchmark
Gesundheitswesen	34.04%	33.99%
Finanzen	19.07%	19.96%
Nichtzyklische Konsumgüter	16.53%	16.33%
Industrieunternehmen	12.08%	11.77%
Roh- und Grundstoffe	7.80%	7.85%
Zyklische Konsumgüter	5.31%	5.72%
Informationstechnologie	1.75%	1.59%
Kommunikationsdienste	0.79%	1.03%
Immobilien	0.60%	1.55%
Versorgungsbetriebe	0.38%	0.22%
Energie	-	-
Liquidität	1.65%	-

Grösste Positionen

	Anlagegruppe	Benchmark
NESTLE SA-REG	14.25%	14.26%
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	12.42%	12.44%
NOVARTIS AG-REG	11.74%	11.75%
ZURICH INSURANCE GROUP AG	5.48%	5.48%
UBS GROUP AG-REG	5.19%	5.20%
CIE FINANCIERE RICHEMO-A REG	5.00%	5.01%
ABB LTD-REG	4.39%	4.40%
HOLCIM LTD	3.12%	3.12%
SWISS RE AG	2.68%	2.69%
ALCON INC	2.53%	2.53%

Haftungsausschluss: Die vorliegende Publikation begründet weder eine Aufforderung noch eine Empfehlung zum Erwerb oder Verkauf von Anlageinstrumenten, sondern dient lediglich zu Informationszwecken. Sämtliche Dokumente, welche die rechtliche Grundlage für eine allfällige Investition bilden, können kostenlos bei der Anlagestiftung Swiss Life, c/o Swiss Life AG, Postfach, 8022 Zürich, Tel. 043 547 71 11 und unter www.swisslife.ch/anlagestiftung bezogen werden. Der Kreis der Anleger ist beschränkt auf Einrichtungen der 2. Säule und der Säule 3a sowie sonstige steuerbefreite Einrichtungen mit Sitz in der Schweiz, die ihrem Zweck nach der beruflichen Vorsorge dienen und Personen, die kollektive Anlagen für diese Einrichtungen verwalten, von der Eidgenössischen Finanzmarktaufsicht FINMA beaufsichtigt werden und bei der Stiftung ausschliesslich Gelder für diese Einrichtungen anlegen. Zusätzlich müssen die erwähnten Anleger eine spezielle Vereinbarung mit der Swiss Life Asset Management AG abgeschlossen haben. Die vergangene Performance stellt keinen Indikator für die laufende und zukünftige Entwicklung dar. Sämtliche Produkt- und Firmennamen sind Marken™ oder eingetragene® Warenzeichen ihrer jeweiligen Inhaber. Ihre Verwendung stellt keine Zugehörigkeit zu ihnen und keine Zustimmung durch sie dar. **Quelle:** Swiss Life Asset Managers. Alle Rechte vorbehalten