

31. Oktober 2022

Anlagestiftung Swiss Life Aktien Ausland ESG Indexiert

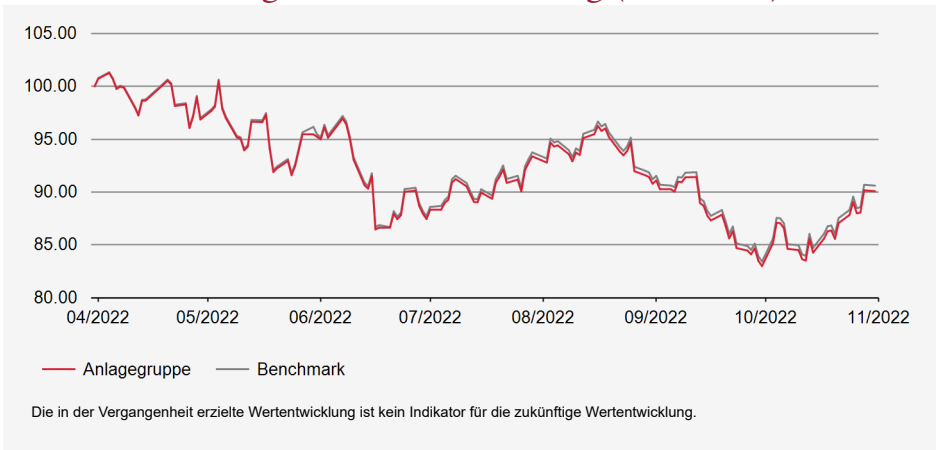


Nettovermögen (NAV) in Mio. CHF: 158.56
Nettovermögen pro Anspruch in CHF: 90.09

Anlagestrategie

Anlagen in Beteiligungspapiere von Gesellschaften, die im MSCI World ex Switzerland ESG Leaders, in CHF enthalten sind. Zugelassen sind auch Beteiligungspapiere von Gesellschaften, die aufgrund von Benchmark-Anpassungen noch nicht oder nicht mehr in der Benchmark enthalten sind (max. Abweichung +0.5 Prozentpunkte). Umsetzung mittels Swiss Life iFunds (CH) Equity ESG Global ex Switzerland (CHF).

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	-	8.54%	-3.52%	-	-	-	-	-
BENCHMARK	-	8.61%	-3.35%	-	-	-	-	-

Statistische Angaben (annualisiert)

	1 JAHR	3 JAHRE	5 JAHRE	10 JAHRE	AUFL.
Volatilität Anlagegruppe (in %)	-	-	-	-	21.54
Volatilität Benchmark (in %)	-	-	-	-	21.54
Tracking Error ex post (in %)	-	-	-	-	0.14
Information Ratio	-	-	-	-	-5.40
Sharpe Ratio	-	-	-	-	-0.71
Korrelation	-	-	-	-	1.00
Beta	-	-	-	-	1.00
Jensen-Alpha	-	-	-	-	-0.84
Maximum Drawdown (in %)	-	-	-	-	-18.04
Recovery Period (Jahre)	-	-	-	-	-

Performance

Datenhistorie unzureichend

Produktinformationen

Valorennummer: 117189932
ISIN: CH1171899326
LEI: 254900Q154AKVWL8UQ41
Bloomberg-Code: SWAEICI SW
Benchmark: MSCI World ex Switzerland ESG Leaders (CHF)
Währung: CHF
Domizil: Schweiz
Aufgatedatum: 31/03/2022
Ausgabepreis: 100.00
Jahresabschluss: 30.09
Ausgabe/Rücknahme: Täglich
Annahmeschluss: 14.30 Uhr
Ausgabe-/Rücknahmekommission: Keine
Ausschüttungspraxis: Thesaurierung
Asset Manager gemäss Swiss Life Best Select Invest Plus®: UBS 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: 0.52%
ex post per: 30/09/2022 0.52%

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
INFORMATIONSTECHNOLOGIE	21.62%	21.60%
GESUNDHEITSWESEN	14.81%	14.84%
FINANZEN	14.39%	14.34%
ZYKLISCHE KONSUMGÜTER	10.62%	10.59%
INDUSTRIEUNTERNEHMEN	10.33%	10.34%
TELEKOMMUNIKATIONSDIENSTLEISTUNGEN	8.02%	8.04%
NICHTZYKLISCHE KONSUMGÜTER	7.68%	7.68%
ROH- UND GRUNDSTOFFE	4.34%	4.34%
ENERGIE	3.70%	3.72%
IMMOBILIEN	2.69%	2.69%
VERSORGER	1.80%	1.81%
LIQUIDITÄT	-	-

Grösste Positionen

	Anlagegruppe	Benchmark
MICROSOFT CORP.	6.98%	6.98%
ALPHABET INC	4.66%	4.66%
TESLA INC	2.54%	2.54%
JOHNSON & JOHNSON	1.94%	1.94%
VISA INC	1.44%	1.44%
NVIDIA	1.43%	1.43%
PROCTER & GAMBLE	1.37%	1.37%
HOME DEPOT	1.29%	1.29%
ELI LILLY &	1.23%	1.24%
MASTERCARD INC-CLASS A	1.20%	1.21%

Portfoliostruktur nach Ländern/Regionen

	Anlagegruppe	Benchmark
USA	71.43%	71.42%
JAPAN	6.18%	6.17%
GROSSBRITANNIEN	4.31%	4.39%
KANADA	3.66%	3.64%
FRANKREICH	2.96%	3.06%
DEUTSCHLAND	1.73%	1.64%
ÜBRIGES EUROPA	6.32%	6.25%
ÜBRIGE LÄNDER ASIEN	3.34%	3.37%
ÜBRIGE	0.07%	0.06%
LIQUIDITÄT	-	-