

Anlagestiftung Swiss Life

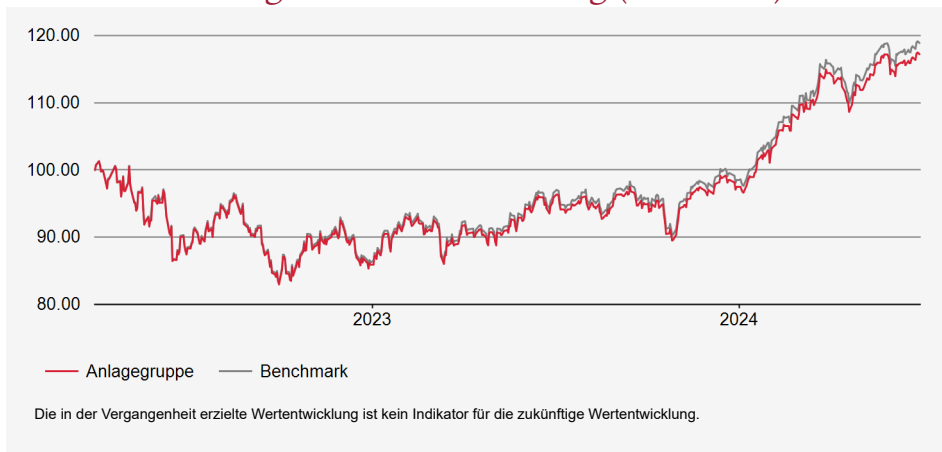
Aktien Ausland ESG Indexiert

Nettovermögen (NAV) in Mio. CHF: 445.63
Nettovermögen pro Anspruch in CHF: 117.21

Anlagestrategie

Anlagen in Beteiligungspapieren von Gesellschaften, die im MSCI World ex Switzerland ESG Leaders, in CHF enthalten sind. Zugelassen sind auch Beteiligungspapieren 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)



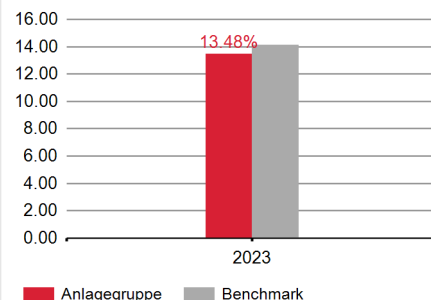
Performance in Referenzwährung

| | Kumulierte Performance | | | | Annualisierte Performance | | | |
|--------------|------------------------|---------|----------|--------|---------------------------|---------|----------|-------|
| | YTD | 1 Monat | 3 Monate | 1 Jahr | 3 Jahre | 5 Jahre | 10 Jahre | Aufl. |
| Anlagegruppe | 20.22% | 1.97% | 2.45% | 22.18% | - | - | - | 7.32% |
| Benchmark | 20.67% | 2.03% | 2.62% | 23.03% | - | - | - | 8.00% |

Statistische Angaben (annualisiert)

| | 1 Jahr | 3 Jahre | 5 Jahre | 10 Jahre | Aufl. |
|---------------------------------|--------|---------|---------|----------|--------|
| Volatilität Anlagegruppe (in %) | 11.14 | - | - | - | 15.52 |
| Volatilität Benchmark (in %) | 11.19 | - | - | - | 15.54 |
| Tracking Error ex post (in %) | 0.20 | - | - | - | 0.15 |
| Information Ratio | -4.28 | - | - | - | -4.45 |
| Sharpe Ratio | 1.65 | - | - | - | 0.38 |
| Korrelation | 1.00 | - | - | - | 1.00 |
| Beta | 1.00 | - | - | - | 1.00 |
| Jensen-Alpha | -0.75 | - | - | - | -0.66 |
| Maximum Drawdown (in %) | -8.15 | - | - | - | -18.04 |
| Recovery Period (Jahre) | 0.12 | - | - | - | 1.30 |

Performance



Produktinformationen

Valorennummer: 117189932
ISIN: CH1171899326
LEI: 254900Q154AKVWL8UQ41
Bloomberg-Code: SWAEICI SW
Benchmark: MSCI World ex Switzerland ESG Leaders Net Return
Währung: CHF
Domizil: Schweiz
Auflagedatum: 31/03/2022
Erstausgabepreis: 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: 30/09/2023 0.52%

Portfoliostruktur nach Branchen

| | Anlagegruppe | Benchmark |
|------------------------------------|--------------|-----------|
| Informationstechnologie | 29.68% | 29.88% |
| Finanzen | 14.26% | 14.29% |
| Gesundheitswesen | 11.66% | 11.74% |
| Industrieunternehmen | 9.94% | 10.07% |
| Zyklische Konsumgüter | 9.32% | 9.36% |
| Telekommunikationsdienstleistungen | 8.72% | 8.79% |
| Nichtzyklische Konsumgüter | 5.94% | 5.97% |
| Roh- und Grundstoffe | 3.59% | 3.58% |
| Energie | 2.71% | 2.74% |
| Immobilien | 2.03% | 2.06% |
| Versorger | 1.50% | 1.53% |
| Liquidität | 0.65% | - |

Grösste Positionen

| | Anlagegruppe | Benchmark |
|-------------------------|--------------|-----------|
| MICROSOFT CORP | 9.12% | 9.17% |
| NVIDIA CORP | 8.92% | 8.98% |
| ALPHABET INC | 5.80% | 5.84% |
| ELI LILLY & CO | 2.11% | 2.13% |
| TESLA INC | 1.64% | 1.65% |
| NOVO NORDISK A/S | 1.36% | 1.37% |
| ASML HOLDING NV | 1.20% | 1.20% |
| VISA INC | 1.20% | 1.21% |
| PROCTER & GAMBLE CO/THE | 1.12% | 1.13% |
| MASTERCARD INC | 1.07% | 1.07% |

Portfoliostruktur nach Ländern/Regionen

| | Anlagegruppe | Benchmark |
|---------------------|--------------|-----------|
| USA | 73.99% | 74.45% |
| Japan | 6.07% | 6.10% |
| Grossbritannien | 3.51% | 3.59% |
| Kanada | 2.97% | 2.98% |
| Frankreich | 2.87% | 2.98% |
| Deutschland | 0.99% | 0.96% |
| Übriges Europa | 6.69% | 6.65% |
| Übrige Länder Asien | 2.26% | 2.27% |
| Übrige | - | - |
| Liquidität | 0.65% | - |

Portfoliostruktur nach Währungen

| | Anlagegruppe | Benchmark |
|--------|--------------|-----------|
| USD | 74.43% | 74.47% |
| EUR | 7.51% | 7.61% |
| JPY | 6.08% | 6.10% |
| GBP | 3.65% | 3.57% |
| Übrige | 8.34% | 8.26% |