

# Anlagestiftung Swiss Life

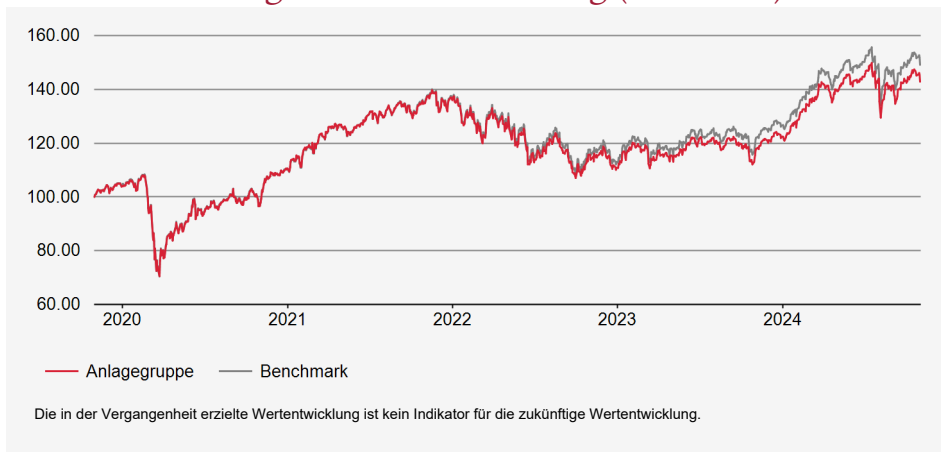
## Aktien Ausland ESG

**Nettovermögen (NAV) in Mio. CHF: 409.69**  
**Nettovermögen pro Anspruch in CHF: 233.69**

### Anlagestrategie

Anlagen in Beteiligungspapiere von Gesellschaften mit Domizil im Ausland. Large & Mid Caps werden passiv abgedeckt, Small Caps sowie der Bereich Emerging Markets werden aktiv verwaltet (Core-Satellite). Gesellschaftsbegrenzung: 5% (Ausnahme: sofern Gewicht im Index mehr als 5%; dann max. 10%). Benchmarkfremde Gesellschaften: max. 10%. Umsetzung mittels Swiss Life iFunds (CH) Equity ESG Global ex Switzerland (CHF), Invesco Global Small Cap Equity Fund, Dimensional Global Small Cap Equity Fund, Amundi Emerging Markets Equity Focus Fund und Robeco Emerging Markets Equities Fund.

### Wertentwicklung in Referenzwährung (Basis 100)



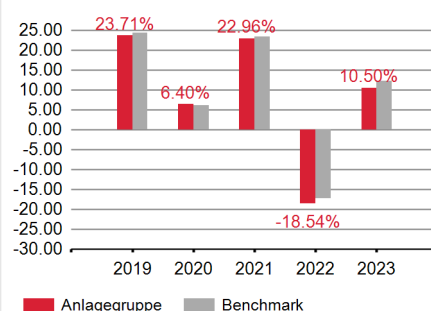
### Performance in Referenzwährung

	Kumulierte Performance				Annualisierte Performance			
	YTD	1 Monat	3 Monate	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Aufl.
Anlagegruppe	16.69%	-0.29%	-0.77%	24.69%	1.94%	7.38%	7.17%	3.74%
Benchmark	17.77%	-0.10%	-0.19%	26.01%	3.32%	8.31%	8.08%	4.95%

### Statistische Angaben (annualisiert)

	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Aufl.
Volatilität Anlagegruppe (in %)	9.58	14.08	16.33	14.81	15.43
Volatilität Benchmark (in %)	9.59	14.09	16.30	14.77	15.67
Tracking Error ex post (in %)	0.35	0.41	0.47	0.61	1.38
Information Ratio	-3.71	-3.38	-1.99	-1.49	-0.88
Sharpe Ratio	2.15	0.08	0.43	0.49	0.22
Korrelation	1.00	1.00	1.00	1.00	1.00
Beta	1.00	1.00	1.00	1.00	0.98
Jensen-Alpha	-1.28	-1.37	-0.93	-0.92	-1.12
Maximum Drawdown (in %)	-13.61	-23.39	-34.66	-34.66	-60.40
Recovery Period (Jahre)	-	1.47	0.67	0.67	7.84

### Performance



### Produktinformationen

**Valorennummer:** 1245539

**ISIN:** CH0012455397

**LEI:** 2549000B6X3SG0K4LZ68

**Bloomberg-Code:** SWAAKAU SW

**Benchmark:** 80% MSCI World ex CH ESG Leaders, 15% MSCI AC World Small Cap in CHF, 5% MSCI Emerging Markets in CHF

**Währung:** CHF

**Domizil:** Schweiz

**Aufliedatum:** 30/09/2001

**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&Mid Caps (passiv)**  
UBS AG

**Small Caps (aktiv)**

50% Invesco / 50% Dimensional

**Emerging Markets (aktiv)**

50% Amundi / 50% Robeco

**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:** 0.73%

**ex post per:** 30/09/2024 0.74%

## Portfoliostruktur nach Branchen

	Anlagegruppe	Benchmark
Informationstechnologie	24.11%	25.56%
Finanzen	16.31%	15.65%
Industrieunternehmen	13.56%	11.79%
Zyklische Konsumgüter	11.51%	11.00%
Gesundheitswesen	10.32%	10.29%
Kommunikationsdienste	7.06%	7.63%
Nichtzyklische Konsumgüter	5.40%	5.76%
Roh- und Grundstoffe	4.60%	4.42%
Immobilien	3.35%	3.15%
Energie	2.77%	2.82%
Versorgungsbetriebe	1.82%	1.93%
Liquidität	-0.81%	-

## Grösste Positionen

	Anlagegruppe	Benchmark
NVIDIA CORP	6.48%	7.47%
MICROSOFT CORP	5.69%	6.56%
ALPHABET INC	3.72%	4.30%
TESLA INC	1.42%	1.64%
ELI LILLY & CO	1.33%	1.54%
VISA INC	0.90%	1.04%
MASTERCARD INC	0.82%	0.95%
PROCTER & GAMBLE CO/THE	0.77%	0.89%
HOME DEPOT INC/THE	0.77%	0.90%
JOHNSON & JOHNSON	0.76%	0.88%

## Portfoliostruktur nach Ländern/Regionen

	Anlagegruppe	Benchmark
USA	67.63%	68.81%
Japan	7.20%	6.58%
Grossbritannien	4.09%	3.50%
Kanada	2.78%	3.12%
Frankreich	2.42%	2.40%
Deutschland	1.10%	0.97%
Übriges Europa	6.64%	5.90%
Übrige Länder Asien	6.30%	6.23%
Übrige	2.65%	2.50%
Liquidität	-0.81%	-

## Portfoliostruktur nach Währungen

	Anlagegruppe	Benchmark
USD	68.77%	69.00%
EUR	7.05%	6.52%
JPY	6.09%	6.58%
GBP	4.16%	3.51%
CHF	0.45%	0.20%
Übrige	13.48%	14.20%

## Weitere Angaben zu den Gesellschaften

Anzahl Gesellschaften	7'711
Anteil Nicht-Benchmark-Gesellschaften	5.88%