

Anlagestiftung Swiss Life

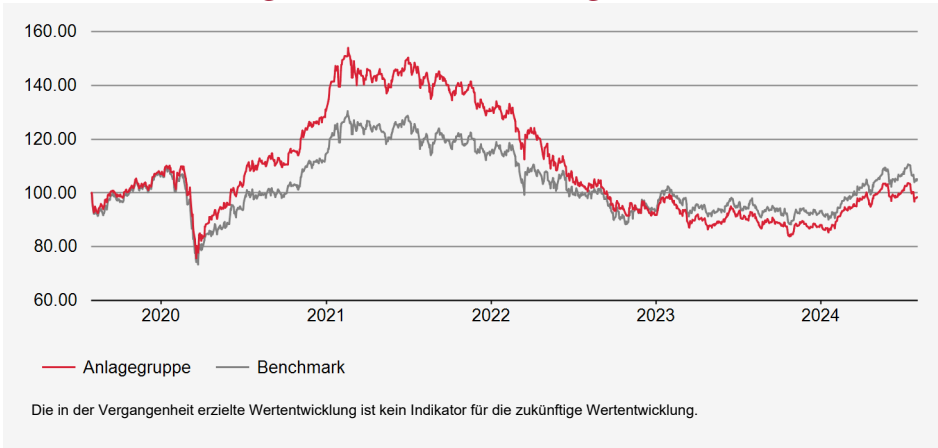
Aktien Emerging Markets ESG

Nettovermögen (NAV) in Mio. CHF: 237.85
Nettovermögen pro Anspruch in CHF: 85.04

Anlagestrategie

Anlagen in Beteiligungspapiere von Gesellschaften mit Domizil in Entwicklungsländern. Aktive Länder-, Branchen- und Titelselektion. Umsetzung mittels Einsatz des Fonds Amundi Emerging Markets Equity Focus und des fonds Robeco Emerging Markets Equities; SICAV nach luxemburgischem Recht gemäss UCITS.

Wertentwicklung in Referenzwährung (Basis 100)



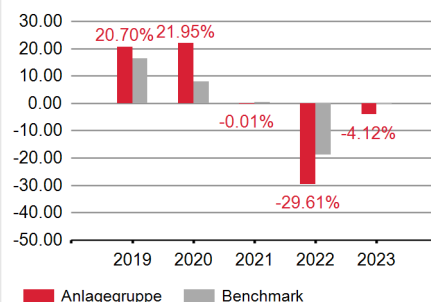
Performance in Referenzwährung

	Kumulierte Performance				Annualisierte Performance			
	YTD	1 Monat	3 Monate	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Aufl.
Anlagegruppe	11.84%	-2.35%	-1.16%	6.17%	-11.10%	-0.31%	-	-2.46%
Benchmark	12.75%	-1.75%	0.62%	7.91%	-3.67%	1.01%	-	-0.46%

Statistische Angaben (annualisiert)

	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Aufl.
Volatilität Anlagegruppe (in %)	11.88	13.59	16.48	-	16.65
Volatilität Benchmark (in %)	12.78	14.26	16.35	-	16.01
Tracking Error ex post (in %)	2.73	4.76	5.26	-	5.21
Information Ratio	-0.64	-1.56	-0.25	-	-0.38
Sharpe Ratio	0.37	-0.91	-0.02	-	-0.14
Korrelation	0.98	0.94	0.95	-	0.95
Beta	0.91	0.90	0.96	-	0.99
Jensen-Alpha	-1.17	-7.87	-1.28	-	-2.01
Maximum Drawdown (in %)	-9.61	-42.27	-45.54	-	-45.54
Recovery Period (Jahre)	0.32	-	-	-	-

Performance



Produktinformationen

Valorennummer: 39561902
ISIN: CH0395619023
LEI: 254900OLXTUB1EYJLV86
Bloomberg-Code: SWLAKEM SW
Benchmark: MSCI Emerging Markets, in CHF
Währung: CHF
Domizil: Schweiz
Auflagedatum: 01/02/2018
Erstausgabepreis: 100.00
Jahresabschluss: 30.09
Ausgabe/Rücknahme: Täglich
Annahmeschluss: 13.00 Uhr
Ausgabe- / Rücknahmekommission: Keine
Ausschüttungspraxis: Thesaurierung
Asset Manager gemäss Swiss Life Best Select Invest Plus@: 50% Amundi / 50% Robeco

Externe Beratung:
 PPCmetrics erbringt folgende Dienstleistungen: Beratung betreffend geeigneter Mandatsstrukturen, 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: 0.88%
ex post per: 30/09/2023 0.95%

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.

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	25.46%	24.38%
Finanzen	23.17%	22.33%
Zyklische Konsumgüter	14.11%	12.22%
Telekommunikationsdienstleistungen	7.17%	8.78%
Industrieunternehmen	5.39%	6.96%
Immobilien	4.84%	1.48%
Nichtzyklische Konsumgüter	4.40%	5.29%
Roh- und Grundstoffe	3.62%	6.87%
Energie	3.52%	5.14%
Versorgungsbetriebe	3.47%	3.08%
Gesundheitswesen	1.60%	3.47%
Liquidität	3.24%	-

Grösste Positionen

	Anlagegruppe	Benchmark
TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFACTURING CO LT	8.92%	9.37%
SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	5.99%	4.06%
TENCENT HOLDINGS LTD	2.44%	2.01%
HDFC BANK LTD	2.44%	0.72%
ALIBABA GROUP HOLDING LTD	2.21%	2.04%
INFOSYS LTD	2.14%	0.50%
ICICI BANK LTD ADR	1.92%	-
NASPERS LTD	1.71%	0.23%
HON HAI PRECISION INDUSTRY CO LTD	1.33%	0.50%
SK HYNIX INC	1.25%	0.51%

Portfoliostruktur nach Ländern/Regionen

	Anlagegruppe	Benchmark
China	20.27%	24.39%
Indien	18.96%	20.08%
Korea	15.04%	12.05%
Taiwan	14.73%	18.55%
Brasilien	6.02%	4.32%
Südafrika	2.98%	2.95%
Übrige Länder Asien	6.76%	5.03%
Übrige Länder EMEA	8.84%	9.63%
Übrige Länder Amerika	3.16%	3.00%
Liquidität	3.24%	-

Portfoliostruktur nach Währungen

	Anlagegruppe	Benchmark
TWD	15.86%	18.58%
INR	15.30%	20.08%
HKD	15.21%	18.49%
KRW	15.10%	12.05%
USD	10.50%	2.35%
EUR	1.71%	0.52%
CHF	0.00%	-
Übrige	26.34%	27.88%

Weitere Angaben zu den Gesellschaften

Anzahl Gesellschaften	253
Anteil Nicht-Benchmark-Gesellschaften	5.23%