

Anlagestiftung Swiss Life

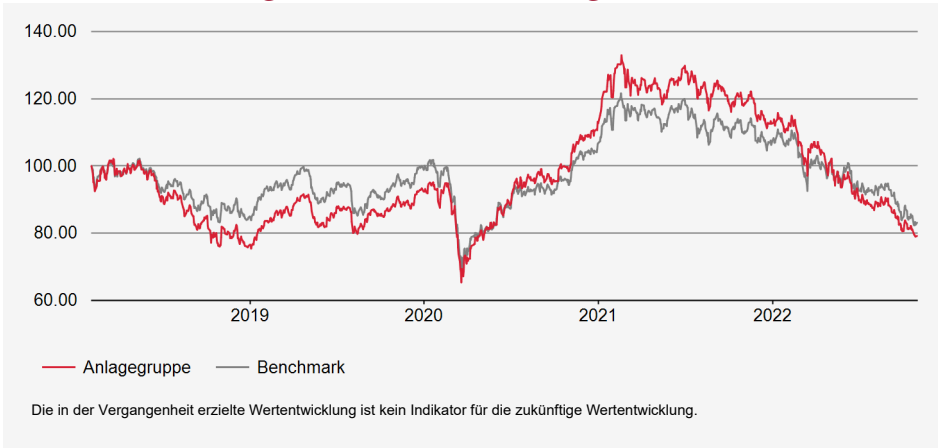
Aktien Emerging Markets ESG

Nettovermögen (NAV) in Mio. CHF: 194.53
Nettovermögen pro Anspruch in CHF: 79.21

Anlagestrategie

Anlagen in Beteiligungspapiere von Gesellschaften mit Domizil in Entwicklungsländern. Aktive Länder-, Branchen- und Titelselektion. Gesellschaftsbegrenzung: 5%. Benchmarkfremde Gesellschaften: max. 15%. Umsetzung mittels Einsatz des Fonds Candriam Sustainable Equity Emerging Markets; SICAV nach luxemburgischem Recht gemäss UCITS.

Wertentwicklung in Referenzwährung (Basis 100)



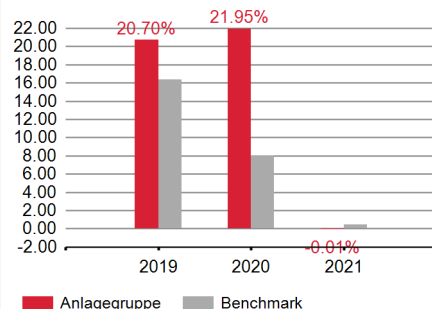
Performance in Referenzwährung

	KUMULIERTE PERFORMANCE				ANNUALISIERTE PERFORMANCE			
	YTD	1 MONAT	3 MONATE	1 JAHR	3 JAHRE	5 JAHRE	10 JAHRE	AUFL.
ANLAGEGRUPPE	-29.70%	-1.74%	-9.56%	-32.97%	-3.47%	-	-	-4.79%
BENCHMARK	-22.48%	-1.48%	-9.75%	-24.46%	-3.96%	-	-	-4.02%

Statistische Angaben (annualisiert)

	1 JAHR	3 JAHRE	5 JAHRE	10 JAHRE	AUFL.
Volatilität Anlagegruppe (in %)	12.40	18.79	-	-	17.86
Volatilität Benchmark (in %)	-	17.76	-	-	16.62
Tracking Error ex post (in %)	5.66	5.65	-	-	5.45
Information Ratio	-1.50	0.09	-	-	-0.14
Sharpe Ratio	-3.19	-0.16	-	-	-0.24
Korrelation	0.91	0.95	-	-	0.95
Beta	0.84	1.01	-	-	1.02
Jensen-Alpha	-12.30	0.53	-	-	-0.69
Maximum Drawdown (in %)	-35.30	-40.56	-	-	-40.56
Recovery Period (Jahre)	-	-	-	-	-

Performance



Produktinformationen

Valorennummer: 39561902
ISIN: CH0395619023
LEI: 254900OLXTUB1EYJLV86
Bloomberg-Code: SWLAKEM SW
Benchmark: MSCI Emerging Markets, in CHF
Währung: CHF
Domizil: Schweiz
Aufledgedatum: 01/02/2018
Ausgabepreis: 100.00
Jahresabschluss: 30.09
Ausgabe/Rücknahme: Täglich
Annahmeschluss: 11.00 Uhr
Ausgabe-/Rücknahmekommission: Keine
Ausschüttungspraxis: Thesaurierung
Asset Manager gemäss Swiss Life Best Select Invest Plus®: Candriam Investors Group
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: 0.95%
ex post per: 30/09/2022 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
FINANZEN	22.77%	23.64%
INFORMATIONSTECHNOLOGIE	16.62%	19.06%
ZYKLISCHE KONSUMGÜTER	14.67%	12.22%
INDUSTRIEUNTERNEHMEN	11.50%	6.09%
TELEKOMMUNIKATIONSDIENSTLEISTUNGEN	7.58%	8.69%
GESUNDHEITSWESEN	7.32%	4.12%
NICHTZYKLISCHE KONSUMGÜTER	5.28%	6.51%
ROH- UND GRUNDSTOFFE	4.80%	9.13%
VERSORGUNGSBETRIEBE	2.56%	3.22%
IMMOBILIEN	-	1.73%
ENERGIE	-	5.59%
LIQUIDITÄT	6.90%	-

Portfoliostruktur nach Ländern/Regionen

	Anlagegruppe	Benchmark
CHINA	24.31%	26.89%
INDIEN	19.20%	16.21%
BRASILIEN	10.36%	6.45%
TAIWAN	9.57%	13.52%
KOREA	9.52%	11.91%
SÜDAFRIKA	3.11%	3.66%
ÜBRIGE LÄNDER ASIEN	9.56%	6.91%
ÜBRIGE LÄNDER EMEA	1.82%	10.76%
ÜBRIGE LÄNDER AMERIKA	5.65%	3.70%
LIQUIDITÄT	6.90%	-

Grösste Positionen

	Anlagegruppe	Benchmark
TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFACTURING CO LTD	5.33%	5.36%
ALIBABA GROUP HOLDING LTD	3.45%	2.14%
HOUSING DEVELOPMENT FINANCE CORP LTD	2.94%	0.92%
SAMSUNG SDI CO LTD	2.37%	0.51%
BHARTI AIRTEL LTD	2.11%	0.40%
MEITUAN	2.03%	1.26%
INFOSYS LTD	2.01%	1.12%
EICHER MOTORS LTD	1.97%	0.11%
SK HYNIX INC	1.95%	0.57%
AXIS BANK LTD	1.94%	0.45%

Weitere Angaben zu den Gesellschaften

Anzahl Gesellschaften	82
Anteil Nicht-Benchmark-Gesellschaften	18.84%