

31. Oktober 2022

Anlagestiftung Swiss Life Aktien Global ESG

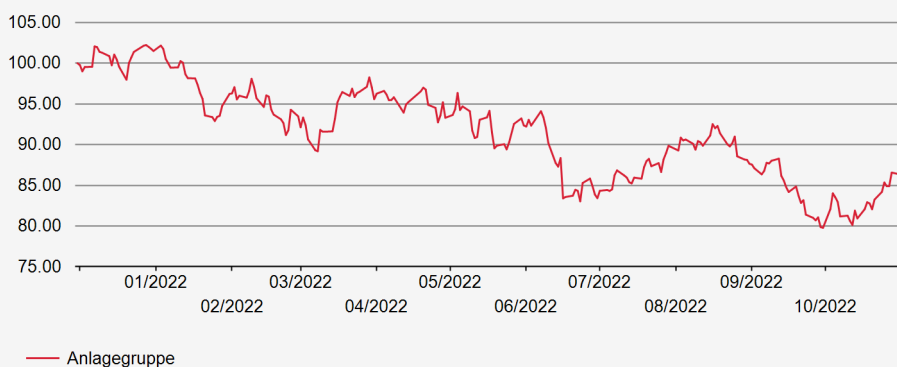


Nettovermögen (NAV) in Mio. CHF: 44.40
Nettovermögen pro Anspruch in CHF: 86.37

Anlagestrategie

Die Anlagegruppe folgt einem Core-Satellite-Ansatz. Der Core-Teil des Portfolios mit rund 70% wird aktiv verwaltet und investiert mehrheitlich in Large und Mid-Caps und zeichnet sich durch ein starkes ESG-Profil aus. Die Umsetzung erfolgt durch den Swiss Life Funds (LUX) Equity ESG Global. Der Satellite-Teil des Portfolios von rund 30% investiert mehrheitlich in Small und Mid-Caps, die einen grossen Teil ihrer Einnahmen mit Produkten und Dienstleistungen erzielen, welche die ökologische Nachhaltigkeit fördern. Die Umsetzung der Satelliten erfolgt mit jeweils rund 10% in Swiss Life Funds (LUX) Equity Climate Impact, Swiss Life Funds (LUX) Equity Green Buildings & Infrastructure Impact und Swiss Life Funds (LUX) Equity Environment & Biodiversity Impact. Die Prozentsätze können innerhalb vorgegebener Bandbreiten schwanken. Die Gesellschaftsbegrenzung beträgt 5%.

Wertentwicklung in Referenzwährung (Basis 100)



Die in der Vergangenheit erzielte Wertentwicklung ist kein Indikator für die zukünftige Wertentwicklung.

Performance in Referenzwährung

	KUMULIERTE PERFORMANCE				ANNUALISIERTE PERFORMANCE			
	YTD	1 MONAT	3 MONATE	1 JAHR	3 JAHRE	5 JAHRE	10 JAHRE	AUFL.
ANLAGEGRUPPE	-14.91%	8.26%	-3.88%	-	-	-	-	-

Statistische Angaben (annualisiert)

	1 JAHR	3 JAHRE	5 JAHRE	10 JAHRE	AUFL.
Volatilität Anlagegruppe (in %)	-	-	-	-	17.74
Sharpe Ratio	-	-	-	-	-0.86
Maximum Drawdown (in %)	-	-	-	-	-21.96
Recovery Period (Jahre)	-	-	-	-	-

Performance

Datenhistorie unzureichend

Produktinformationen

Valorenummer: 113873862

ISIN: CH1138738625

LEI: 254900RNJ8UYJ3OTB72

Bloomberg-Code: SWAGECI SW

Währung: CHF

Domizil: Schweiz

Aufgatedatum: 30/11/2021

Ausgabepreis: 100.00

Jahresabschluss: 30.9

Ausgabe/Rücknahme: Täglich

Annahmeschluss: 11 Uhr

Ausgabe-/Rücknahmekommission: Keine

Ausschüttungspraxis: Thesaurierung

Asset Manager:

Swiss Life Asset Management AG

Kurspublikationen: Bloomberg: ASSL

www.swisslife.ch/anlagestiftung

Betriebsaufwandquote TER KGAST

ex ante: 0.69%

ex post per: 30/09/2022 0.69%

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.

Portfoliostruktur nach Branchen

	Anlagegruppe
INFORMATIONSTECHNOLOGIE	22.18%
INDUSTRIEUNTERNEHMEN	19.99%
FINANZEN	10.99%
GESUNDHEITSWESEN	8.57%
ZYKLISCHE KONSUMGÜTER	7.31%
NICHTZYKLISCHE KONSUMGÜTER	7.29%
VERSORGUNGSBETRIEBE	6.72%
ROH- UND GRUNDSTOFFE	5.13%
IMMOBILIEN	3.89%
KOMMUNIKATIONSDIENSTE	2.83%
ENERGIE	2.35%
EQUITY INDEX FUTURE	1.80%
LIQUIDITÄT	0.95%

Grösste Positionen

	Anlagegruppe
APPLE INC	3.15%
MICROSOFT CORP	2.50%
ALPABET INC-CL	1.27%
AMAZON.COM INC	1.07%
UNITEDHEALTH GROUP INC	0.97%
VISA INC-CLASS A SHARES	0.71%
HOME DEPOT INC	0.66%
MERCK & CO. INC.	0.63%
TESLA INC	0.60%
FIRST SOLAR INC	0.57%

Portfoliostruktur nach Ländern/Regionen

	Anlagegruppe
USA UND KANADA	62.84%
EUROPÄISCHE REGION (EUR)	14.14%
ASIEN-PAZIFIK-RAUM	9.70%
EUROPÄISCHE REGION (EX EUR)	9.36%
FUTURE AUF AKTIENINDEX	1.80%
SCHWELLENLÄNDER ASIEN PAZIFIK	0.78%
ANDERE	0.44%
LIQUIDITÄT / DARLEHEN	0.95%