

# Anlagestiftung Swiss Life

## Aktien Global ex Schweiz ESG Indexiert

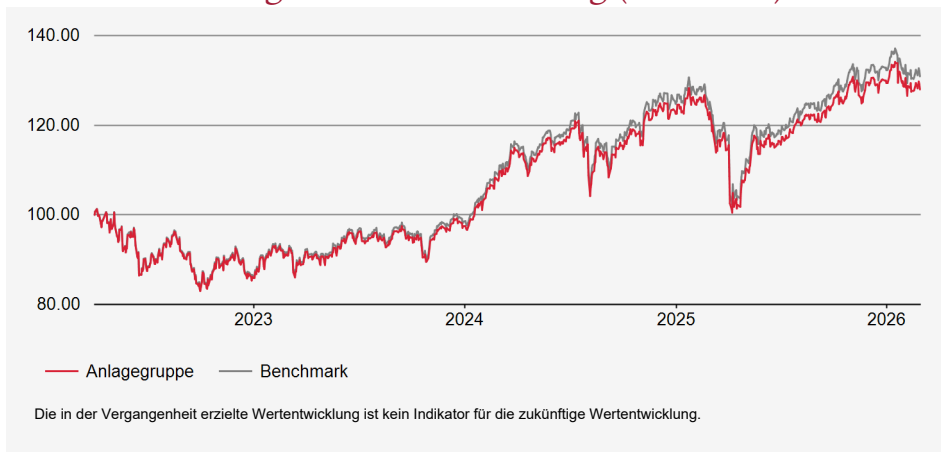


**Nettovermögen (NAV) in Mio. CHF: 545.48**  
**Nettovermögen pro Anspruch in CHF: 127.97**

### Anlagestrategie

Die Anlagegruppe wird mit einem indexierten Ansatz verwaltet und zeichnet sich durch eine breite Diversifikation und einen geringen Tracking Error aus. Das Anlageziel besteht darin, die Benchmark MSCI World ex Switzerland Selection Total Return nachzubilden. Umsetzung mittels Einsatz des Swiss Life Index Funds II (CH) Equity ESG Global ex Switzerland PF; vertraglicher Anlagefonds schweizerischen Rechts der Art "Übrige Fonds für traditionelle Anlagen". Es wird kein Securities Lending betrieben und es werden keine Investitionen in Titel getätigt, die vom Schweizer Verein für verantwortungsbewusste Kapitalanlagen ([www.svkv-asir.ch](http://www.svkv-asir.ch)) zum Ausschluss empfohlen sind.

### Wertentwicklung in Referenzwährung (Basis 100)



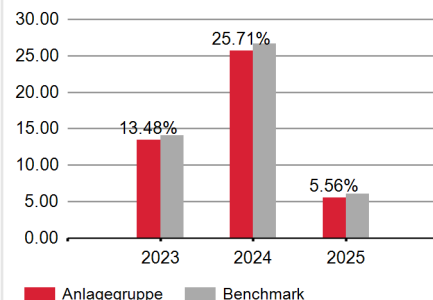
### Performance in Referenzwährung

	Kumulierte Performance				Annualisierte Performance			
	YTD	1 Monat	3 Monate	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Aufl.
Anlagegruppe	-1.10%	-0.50%	-1.20%	4.13%	12.06%	-	-	6.50%
Benchmark	-1.04%	-0.47%	-1.11%	4.53%	12.69%	-	-	7.12%

### Statistische Angaben (annualisiert)

	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Aufl.
Volatilität Anlagegruppe (in %)	13.66	11.15	-	-	14.00
Volatilität Benchmark (in %)	13.70	11.19	-	-	14.17
Tracking Error ex post (in %)	0.04	0.13	-	-	0.12
Information Ratio	-9.39	-5.00	-	-	-5.17
Sharpe Ratio	0.29	0.94	-	-	0.39
Korrelation	1.00	1.00	-	-	1.00
Beta	1.00	1.00	-	-	1.00
Jensen-Alpha	-0.39	-0.59	-	-	-0.60
Maximum Drawdown (in %)	-18.23	-21.66	-	-	-21.66
Recovery Period (Jahre)	0.44	0.55	-	-	0.55

### Performance



### Produktinformationen

**Valorennummer:** 117189932  
**ISIN:** CH1171899326  
**LEI:** 254900Q154AKVWL8UQ41  
**Bloomberg-Code:** SWAEICI SW  
**Benchmark:** MSCI World ex Switzerland Selection (TR)  
**Währung:** CHF  
**Domizil:** Schweiz  
**Aufledgedatum:** 31/03/2022  
**Erstausgabepreis:** 1000.00  
**Jahresabschluss:** 30.09  
**Ausgabe/Rücknahme:** Täglich  
**Annaheschluss:** 14:00 Uhr (T-1)  
**Verwässerungsschutz:** Ausgabe- / Rücknahmekommission zugunsten der Anlagegruppe gemäss Konditionenübersicht.  
**Asset Management:** Swiss Life Asset Management AG  
**Überwachung Asset Manager:** Überwachung der Anlageresultate des eingesetzten Vermögensverwalters durch PPCmetrics  
**Kurspublikationen:** Bloomberg: ASSL  
[www.swisslife.ch/anlagestiftung](http://www.swisslife.ch/anlagestiftung)  
**Betriebsaufwandquote TER KGAST ex ante:** 0.35%  
**ex post per:** 30/09/2025 0.38%

**Betriebsaufwandquote TER KGAST:** Die Betriebsaufwandquote TER KGAST deckt sämtliche Kosten mit Ausnahme der Transaktionskosten und der transaktionsbezogenen steuerlichen Abgaben ab.  
**Verwässerungsschutz:** Konditionenübersicht abrufbar unter: [www.swisslife.ch/anlagestiftung](http://www.swisslife.ch/anlagestiftung), «Rechtliche Dokumente» (Änderungen jederzeit ohne Vorankündigung möglich).

**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.

# Anlagestiftung Swiss Life

## Aktien Global ex Schweiz ESG Indexiert



### Grösste Positionen

	Anlagegruppe	Benchmark
NVIDIA CORP	10.03%	10.03%
MICROSOFT CORP	6.46%	6.46%
ALPHABET INC-CL A	4.22%	4.23%
ALPHABET INC-CL C	3.53%	3.53%
TESLA INC	2.65%	2.65%
ELI LILLY & CO	1.97%	1.97%
JOHNSON & JOHNSON	1.39%	1.39%
ASML HOLDING NV	1.31%	1.32%
VISA INC-CLASS A SHARES	1.26%	1.26%
MASTERCARD INC - A	1.02%	1.02%

### Portfoliostruktur nach Ländern/Regionen

	Anlagegruppe	Benchmark
Vereinigte Staaten	72.26%	72.29%
Japan	6.78%	6.79%
Vereinigtes Königreich	3.91%	3.91%
Kanada	3.69%	3.69%
Frankreich	3.41%	3.41%
Niederlande	2.19%	2.19%
Australien	1.34%	1.34%
Schweden	1.26%	1.27%
Deutschland	1.13%	1.13%
Spanien	0.81%	0.81%
Italien	0.72%	0.72%
Dänemark	0.69%	0.69%
Andere	1.77%	1.77%
Liquidität	0.05%	-

### Portfoliostruktur nach Branchen

	Anlagegruppe	Benchmark
Informationstechnologie	27.19%	27.21%
Finanzen	15.13%	15.12%
Industrieunternehmen	11.31%	11.32%
Kommunikationsdienste	10.59%	10.59%
Gesundheitswesen	9.99%	9.99%
Zyklische Konsumgüter	9.32%	9.32%
Nichtzyklische Konsumgüter	5.48%	5.48%
Roh- und Grundstoffe	4.08%	4.09%
Energie	2.63%	2.63%
Versorgungsbetriebe	2.12%	2.13%
Immobilien	2.11%	2.12%
Liquidität	0.05%	-

### Portfoliostruktur nach Währungen

	Anlagegruppe	Benchmark
USD	72.59%	72.62%
EUR	8.82%	8.83%
JPY	6.79%	6.79%
GBP	3.92%	3.91%
CAD	3.69%	3.69%
AUD	1.34%	1.34%
SEK	1.08%	1.08%
DKK	0.69%	0.69%
HKD	0.54%	0.54%
Sonstige	0.54%	0.53%