

Anlagestiftung Swiss Life Aktien Global Small Caps

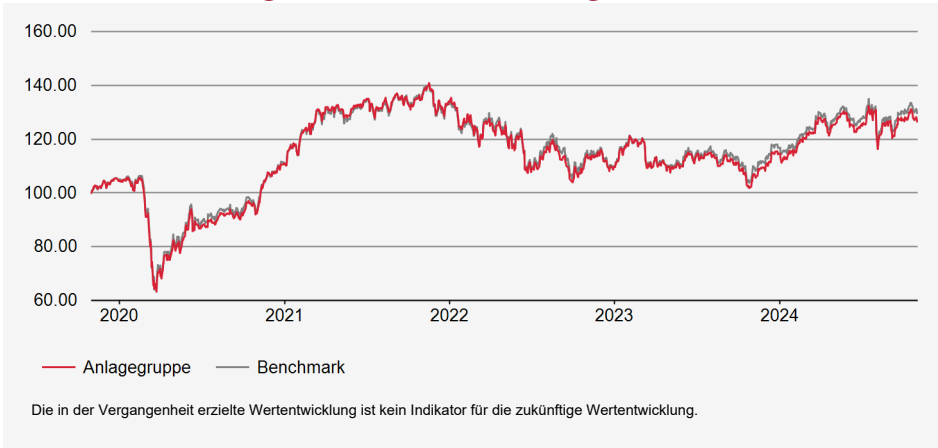


Nettovermögen (NAV) in Mio. CHF: 367.70
Nettovermögen pro Anspruch in CHF: 122.00

Anlagestrategie

Anlagen in kleinkapitalisierte Beteiligungspapiere weltweit. Aktive Länder-, Branchen- und Titelselektion. Gesellschaftsbegrenzung: 5%. Umsetzung mittels Invesco Global Small Cap Equity Fund und Dimensional Global Small Cap Equity Fund.

Wertentwicklung in Referenzwährung (Basis 100)



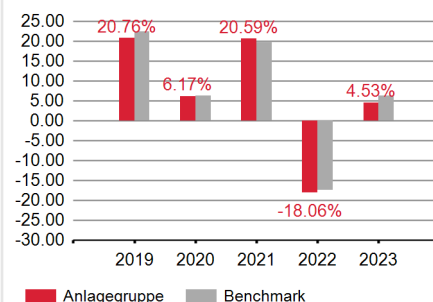
Performance in Referenzwährung

	Kumulierte Performance				Annualisierte Performance			
	YTD	1 Monat	3 Monate	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Aufl.
Anlagegruppe	10.37%	-0.65%	-3.28%	21.71%	-2.06%	4.81%	-	3.02%
Benchmark	11.02%	-0.46%	-1.92%	22.25%	-1.30%	5.32%	-	4.70%

Statistische Angaben (annualisiert)

	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Aufl.
Volatilität Anlagegruppe (in %)	11.74	15.97	20.18	-	19.19
Volatilität Benchmark (in %)	11.17	15.95	19.76	-	18.86
Tracking Error ex post (in %)	1.77	1.80	1.90	-	2.34
Information Ratio	-0.31	-0.43	-0.27	-	-0.72
Sharpe Ratio	1.55	-0.18	0.22	-	0.16
Korrelation	0.99	0.99	1.00	-	0.99
Beta	1.04	0.99	1.02	-	1.01
Jensen-Alpha	-1.37	-0.78	-0.60	-	-1.73
Maximum Drawdown (in %)	-12.07	-27.71	-40.05	-	-41.83
Recovery Period (Jahre)	-	-	0.67	-	0.73

Performance



Produktinformationen

Valorennummer: 40068789

ISIN: CH0400687890

LEI: 254900XCUD9NTWJQU706

Bloomberg-Code: SWLAGSC SW

Benchmark: MSCI AC World Small Cap, in CHF

Währung: CHF

Domizil: Schweiz

Aufgatedatum: 28/02/2018

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@:
50% Invesco / 50% Dimensional

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: 0.84%

ex post per: 30/09/2024 0.84%

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.

Verwässerungsschutz: Konditionenübersicht abrufbar unter: 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.

Portfoliostruktur nach Branchen

	Anlagegruppe	Benchmark
Industrieunternehmen	22.40%	19.87%
Finanzen	16.72%	15.39%
Zyklische Konsumgüter	12.79%	13.16%
Informationstechnologie	12.27%	11.17%
Gesundheitswesen	10.22%	9.59%
Roh- und Grundstoffe	7.09%	7.92%
Immobilien	5.87%	8.28%
Nichtzyklische Konsumgüter	3.98%	4.83%
Energie	3.60%	4.01%
Kommunikationsdienste	3.22%	3.18%
Versorgungsbetriebe	1.74%	2.60%
Liquidität	0.10%	-

Grösste Positionen

	Anlagegruppe	Benchmark
TAYLOR MORRISON	0.66%	0.04%
CACTUS	0.62%	0.02%
WEATHERFORD INTERNAT	0.53%	0.03%
SIGMAROC	0.51%	-
PIPER SANDLER	0.50%	0.03%
PINNACLE FINANCIAL PARTNERS	0.49%	0.04%
PLANISWARE	0.48%	0.00%
XPO	0.42%	0.08%
ENCOMPASS HEALTH	0.41%	-
Q2	0.41%	0.03%

Portfoliostruktur nach Ländern/Regionen

	Anlagegruppe	Benchmark
USA	61.66%	57.76%
Japan	7.22%	11.30%
Grossbritannien	6.56%	4.66%
Kanada	2.19%	3.67%
Frankreich	1.91%	1.07%
Deutschland	1.65%	1.20%
Übriges Europa	10.16%	7.81%
Übrige Länder Asien	5.51%	8.64%
Übrige	3.04%	3.89%
Liquidität	0.10%	-

Portfoliostruktur nach Währungen

	Anlagegruppe	Benchmark
USD	63.34%	58.00%
EUR	8.33%	5.66%
JPY	7.26%	11.30%
GBP	6.63%	4.66%
CHF	1.82%	1.34%
Übrige	12.63%	19.04%

Weitere Angaben zu den Gesellschaften

Anzahl Gesellschaften	6'775
Anteil Nicht-Benchmark-Gesellschaften	22.53%