

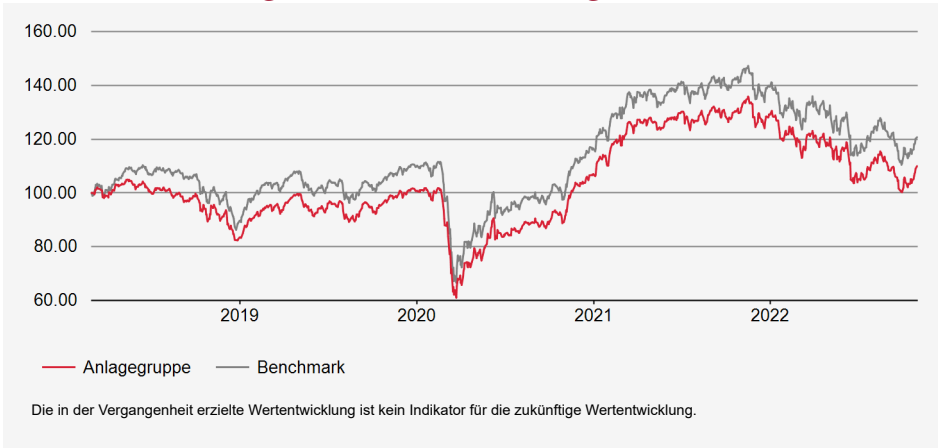
Anlagestiftung Swiss Life Aktien Global Small Caps

Nettovermögen (NAV) in Mio. CHF: 212.91
Nettovermögen pro Anspruch in CHF: 109.97

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)



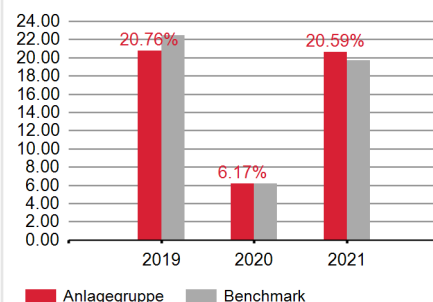
Performance in Referenzwährung

| | KUMULIERTE PERFORMANCE | | | | ANNUALISIERTE PERFORMANCE | | | |
|--------------|------------------------|---------|----------|---------|---------------------------|---------|----------|-------|
| | YTD | 1 MONAT | 3 MONATE | 1 JAHR | 3 JAHRE | 5 JAHRE | 10 JAHRE | AUFL. |
| ANLAGEGRUPPE | -14.79% | 9.70% | -1.19% | -15.34% | 4.47% | - | - | 2.05% |
| BENCHMARK | -13.44% | 8.82% | -1.66% | -14.60% | 4.81% | - | - | 4.11% |

Statistische Angaben (annualisiert)

| | 1 JAHR | 3 JAHRE | 5 JAHRE | 10 JAHRE | AUFL. |
|---------------------------------|--------|---------|---------|----------|--------|
| Volatilität Anlagegruppe (in %) | 20.51 | 23.94 | - | - | 21.36 |
| Volatilität Benchmark (in %) | - | 23.29 | - | - | 20.91 |
| Tracking Error ex post (in %) | 2.00 | 2.02 | - | - | 2.56 |
| Information Ratio | -0.37 | -0.17 | - | - | -0.81 |
| Sharpe Ratio | -0.79 | 0.21 | - | - | 0.13 |
| Korrelation | 1.00 | 1.00 | - | - | 0.99 |
| Beta | 1.00 | 1.02 | - | - | 1.01 |
| Jensen-Alpha | -0.68 | -0.47 | - | - | -2.12 |
| Maximum Drawdown (in %) | -26.19 | -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

Aufledgedatum: 28/02/2018

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®:
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: 0.92%

ex post per: 30/09/2022 0.92%

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 |
|------------------------------------|--------------|-----------|
| INDUSTRIEUNTERNEHMEN | 20.43% | 18.63% |
| FINANZEN | 16.63% | 14.38% |
| ZYKLISCHE KONSUMGÜTER | 13.64% | 12.18% |
| INFORMATIONSTECHNOLOGIE | 11.55% | 11.36% |
| GESUNDHEITSWESEN | 10.02% | 10.50% |
| ROH- UND GRUNDSTOFFE | 6.46% | 7.66% |
| IMMOBILIEN | 5.66% | 8.94% |
| ENERGIE | 5.17% | 5.53% |
| NICHTZYKLISCHE KONSUMGÜTER | 3.53% | 4.96% |
| TELEKOMMUNIKATIONSDIENSTLEISTUNGEN | 2.73% | 2.76% |
| VERSORGUNGSBETRIEBE | 2.26% | 3.10% |
| LIQUIDITÄT | 1.93% | - |

Grösste Positionen

| | Anlagegruppe | Benchmark |
|----------------------|--------------|-----------|
| WEATHERFORD INTERNAT | 0.72% | 0.02% |
| CACTUS | 0.53% | 0.02% |
| ARISTON HLDG | 0.46% | 0.00% |
| COFACE | 0.43% | 0.01% |
| HURON CONSULTING | 0.39% | 0.02% |
| VISTEON CORP | 0.38% | 0.06% |
| PINNACLE FINL | 0.38% | 0.01% |
| WILLSCOT MOBILE MINI | 0.38% | 0.07% |
| CHART INDS | 0.37% | 0.05% |
| RGA | 0.36% | 0.04% |

Portfoliostruktur nach Ländern/Regionen

| | Anlagegruppe | Benchmark |
|---------------------|--------------|-----------|
| USA | 57.88% | 58.78% |
| JAPAN | 8.18% | 9.84% |
| GROSSBRITANNIEN | 5.72% | 4.80% |
| KANADA | 2.45% | 3.82% |
| FRANKREICH | 2.08% | 1.14% |
| DEUTSCHLAND | 1.97% | 1.37% |
| ÜBRIGES EUROPA | 10.98% | 8.39% |
| ÜBRIGE LÄNDER ASIEN | 5.19% | 7.13% |
| ÜBRIGE | 3.62% | 4.72% |
| LIQUIDITÄT | 1.93% | - |

Weitere Angaben zu den Gesellschaften

| | |
|---------------------------------------|--------|
| Anzahl Gesellschaften | 6'732 |
| Anteil Nicht-Benchmark-Gesellschaften | 21.18% |