

# Anlagestiftung Swiss Life

## Aktien Schweiz Small & Mid Caps

**Nettovermögen (NAV) in Mio. CHF: 130.71**  
**Nettovermögen pro Anspruch in CHF: 125.00**

### Anlagestrategie

Anlagen in Beteiligungspapiere von Gesellschaften, die im Swiss Performance Index Extra vertreten sind. Aktive Branchen- und Titelselektion. Gesellschaftsbegrenzung: 5% (Ausnahme: sofern im Benchmark; max. 5%-Punkte mehr als Benchmarkgewichtung). Umsetzung mittels Einsatz des Swiss Life iFunds (CH) Equity Switzerland Small & Mid Cap (CHF); Anlagefonds schweizerischen Rechts der Kategorie "Übrige Fonds für traditionelle Anlagen".

### Wertentwicklung in Referenzwährung (Basis 100)



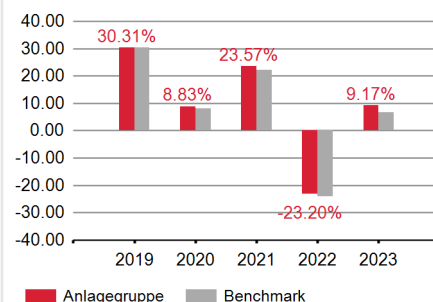
### Performance in Referenzwährung

	Kumulierte Performance				Annualisierte Performance			
	YTD	1 Monat	3 Monate	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Aufl.
Anlagegruppe	4.72%	-4.78%	-3.68%	13.69%	-3.45%	4.58%	-	3.36%
Benchmark	4.94%	-3.96%	-2.85%	13.81%	-4.71%	3.61%	-	2.54%

### Statistische Angaben (annualisiert)

	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Aufl.
Volatilität Anlagegruppe (in %)	10.09	14.90	15.77	-	15.41
Volatilität Benchmark (in %)	9.47	14.73	15.83	-	15.34
Tracking Error ex post (in %)	1.58	1.71	1.66	-	1.60
Information Ratio	-0.07	0.74	0.58	-	0.51
Sharpe Ratio	1.13	-0.29	0.27	-	0.22
Korrelation	0.99	0.99	0.99	-	0.99
Beta	1.05	1.01	0.99	-	1.00
Jensen-Alpha	-0.79	1.29	1.00	-	0.82
Maximum Drawdown (in %)	-5.14	-31.60	-31.60	-	-31.60
Recovery Period (Jahre)	-	-	-	-	-

### Performance



### Produktinformationen

**Valorennummer:** 39561890  
**ISIN:** CH0395618900  
**LEI:** 254900QGENUS1GIJ4549  
**Bloomberg-Code:** SWLASM SW  
**Benchmark:** SPI EXTRA® Total Return  
**Währung:** CHF  
**Domizil:** Schweiz  
**Aufgedatum:** 01/02/2018  
**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®:** Privatbank Von Graffenried AG

**Externe Beratung:** PPCmetrics erbringt folgende Dienstleistungen: Beratung betreffend geeigneter Mandatsstruktur, Unterstützung bei der Selektion geeigneter Asset Manager sowie Unterstützung bei der laufenden Überwachung des Asset Managers und Beurteilung der Anlageresultate.

**Kurspublikationen:** Bloomberg: ASSL  
[www.swisslife.ch/anlagestiftung](http://www.swisslife.ch/anlagestiftung)

**Betriebsaufwandquote TER KGAST ex ante:** 0.95%  
**ex post per:** 30/09/2024 0.94%

# Anlagestiftung Swiss Life

## Aktien Schweiz Small & Mid Caps



### Portfoliostruktur nach Branchen

	Anlagegruppe	Benchmark
Industrieunternehmen	36.72%	32.90%
Gesundheitswesen	19.28%	19.85%
Finanzen	15.22%	23.77%
Nichtzyklische Konsumgüter	13.61%	12.83%
Informationstechnologie	4.04%	3.13%
Zyklische Konsumgüter	2.51%	3.15%
Versorger	2.03%	1.11%
Roh- und Grundstoffe	1.94%	2.60%
Kommunikationsdienste	-	0.65%
Energie	-	-
Liquidität	4.65%	-

### Grösste Positionen

	Anlagegruppe	Benchmark
LINDT & SPRÜNGLI	6.60%	6.90%
SANDOZ GROUP AG	5.73%	5.48%
SGS SA	5.50%	4.53%
STRAUMANN HOLDING AG	4.68%	4.35%
SCHINDLER HOLDING AG	4.53%	4.93%
JULIUS BAER GROUP LTD	4.26%	3.50%
VAT GROUP AG	3.64%	3.12%
BALOISE HOLDING AG	2.77%	2.33%
BELIMO HOLDING AG	2.73%	1.83%
GALENICA AG	2.51%	1.21%

### Portfoliostruktur nach Unternehmensgrösse

	Anlagegruppe		Benchmark	
	Anteil	Anzahl	Anteil	Anzahl
Grosse Unternehmen	12.31%	3	9.82%	2
Mittlere Unternehmen	79.43%	45	81.85%	78
Kleine Unternehmen	3.61%	4	8.33%	104
Liquidität	4.65%	-	-	-