

Anlagestiftung Swiss Life

Equities Global Small Caps ex Switzerland Indexed PM



Nettovermögen (NAV) in Mio. CHF: 117.73
Nettovermögen pro Anspruch in CHF: 955.97

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 Small Cap Total Return nachzubilden. Umsetzung mittels Einsatz des Swiss Life Index Funds II (CH) Equity Global Small Cap 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.svvk-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	-7.10%	5.81%	-6.67%	-	-	-	-	-
Benchmark	-7.08%	5.83%	-6.67%	-	-	-	-	-

Statistische Angaben (annualisiert)

	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Aufl.
Volatilität Anlagegruppe (in %)	-	-	-	-	19.45
Volatilität Benchmark (in %)	-	-	-	-	19.50
Tracking Error ex post (in %)	-	-	-	-	0.07
Information Ratio	-	-	-	-	0.19
Sharpe Ratio	-	-	-	-	-0.37
Korrelation	-	-	-	-	1.00
Beta	-	-	-	-	1.00
Jensen-Alpha	-	-	-	-	0.00
Maximum Drawdown (in %)	-	-	-	-	-21.83
Recovery Period (Jahre)	-	-	-	-	-

Performance

Datenhistorie unzureichend

Produktinformationen

Valorennummer: 137660515
ISIN: CH1376605155
LEI: 254900CCBGYEX2MIC497
Bloomberg-Code: SLAISCP SW
Benchmark: MSCI World ex Switzerland Small Cap Total Return
Währung: CHF
Domizil: Schweiz
Auflagedatum: 15/10/2024
Erstausgabepreis: 1000.00
Jahresabschluss: 30.09
Ausgabe/Rücknahme: Täglich
Annahmeschluss: 14.00 Uhr (T-1)
Verwässerungsschutz: Ausgabe- / Rücknahmekommission zugunsten der Anlagegruppe gemäss Konditionenübersicht.

Asset Manager gemäss Swiss Life Best Select Invest Plus@:
 Swiss Life Asset Management 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

Betriebsaufwandquote TER KGAST ex ante: 0.02%

PM-Tranche: Der Erwerb dieser Tranche ist nur im Rahmen einer speziellen Vereinbarung mit Swiss Life Asset Management AG möglich.

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.

Anlagestiftung Swiss Life

Equities Global Small Caps ex Switzerland Indexed PM



Grösste Positionen

	Anlagegruppe	Benchmark
DUOLINGO	0.22%	0.22%
US FOODS HOLDING CORP	0.22%	0.22%
GUIDEWIRE SOFTWARE INC	0.21%	0.21%
SPROUTS FARMERS MARKET INC	0.20%	0.20%
COMFORT SYSTEMS USA INC	0.20%	0.20%
CURTISS-WRIGHT CORP	0.20%	0.20%
TAPESTRY INC	0.20%	0.20%
CASEY'S GENERAL STORES INC	0.20%	0.20%
FLEX LTD	0.19%	0.20%
TENET HEALTHCARE CORP	0.19%	0.19%

Portfoliostruktur nach Ländern/Regionen

	Anlagegruppe	Benchmark
Vereinigte Staaten	61.39%	61.45%
Japan	12.97%	13.00%
Vereinigtes Königreich	5.09%	5.09%
Kanada	3.68%	3.69%
Australien	3.68%	3.68%
Schweden	2.02%	2.03%
Deutschland	1.64%	1.65%
Israel	1.28%	1.30%
Frankreich	1.25%	1.25%
Italien	1.24%	1.24%
Norwegen	0.79%	0.78%
Dänemark	0.69%	0.68%
Andere	4.17%	4.15%
Liquidität	0.11%	-

Portfoliostruktur nach Branchen

	Anlagegruppe	Benchmark
Industrieunternehmen	20.13%	20.19%
Finanzen	16.06%	16.03%
Zyklische Konsumgüter	12.92%	13.02%
Informationstechnologie	10.97%	10.99%
Gesundheitswesen	8.97%	8.96%
Immobilien	8.05%	8.02%
Roh- und Grundstoffe	7.32%	7.31%
Nichtzyklische Konsumgüter	4.89%	4.90%
Energie	4.15%	4.17%
Kommunikationsdienste	3.57%	3.56%
Versorgungsbetriebe	2.88%	2.86%
Liquidität	0.11%	-

Portfoliostruktur nach Währungen

	Anlagegruppe	Benchmark
USD	61.53%	61.75%
JPY	13.07%	13.00%
EUR	6.95%	6.88%
GBP	5.12%	5.09%
CAD	3.69%	3.69%
AUD	3.69%	3.68%
SEK	1.98%	1.98%
ILS	1.10%	1.11%
NOK	0.80%	0.78%
Sonstige	2.07%	2.05%