

Anlagestiftung Swiss Life

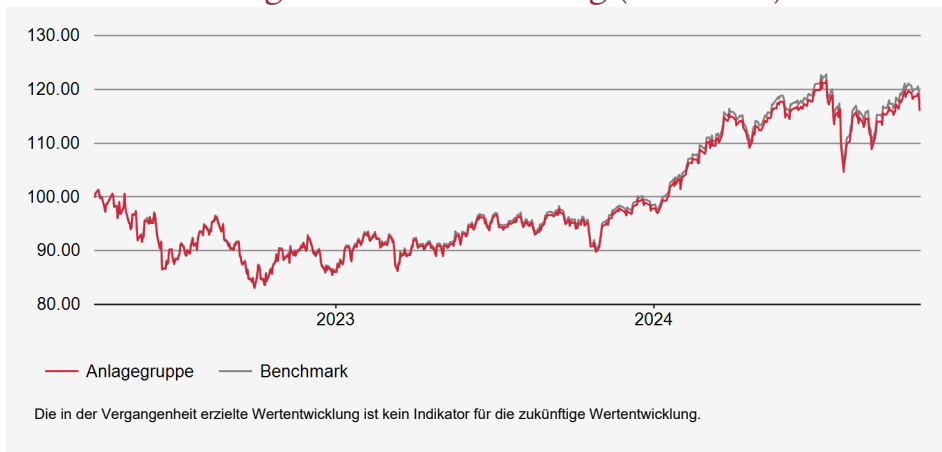
Aktien Ausland ESG Indexiert PM

Nettovermögen (NAV) in Mio. CHF: 609.82
Nettovermögen pro Anspruch in CHF: 116.10

Anlagestrategie

Anlagen in Beteiligungspapieren von Gesellschaften, die im MSCI World ex Switzerland ESG Leaders, in CHF enthalten sind. Zugelassen sind auch Beteiligungspapieren von Gesellschaften, die aufgrund von Benchmark-Anpassungen noch nicht oder nicht mehr in der Benchmark enthalten sind (max. Abweichung +0.5 Prozentpunkte). Umsetzung mittels Swiss Life iFunds (CH) Equity ESG Global ex Switzerland (CHF).

Wertentwicklung in Referenzwährung (Basis 100)



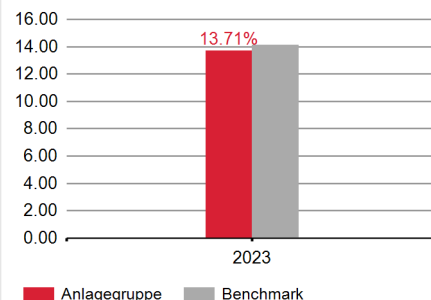
Performance in Referenzwährung

	Kumulierte Performance				Annualisierte Performance			
	YTD	1 Monat	3 Monate	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Aufl.
Anlagegruppe	18.65%	0.06%	-0.13%	26.39%	-	-	-	5.94%
Benchmark	19.19%	0.09%	0.01%	27.06%	-	-	-	6.40%

Statistische Angaben (annualisiert)

	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Aufl.
Volatilität Anlagegruppe (in %)	10.08	-	-	-	14.59
Volatilität Benchmark (in %)	10.12	-	-	-	14.61
Tracking Error ex post (in %)	0.07	-	-	-	0.14
Information Ratio	-9.13	-	-	-	-3.28
Sharpe Ratio	2.18	-	-	-	0.32
Korrelation	1.00	-	-	-	1.00
Beta	1.00	-	-	-	1.00
Jensen-Alpha	-0.57	-	-	-	-0.45
Maximum Drawdown (in %)	-13.90	-	-	-	-17.96
Recovery Period (Jahre)	-	-	-	-	1.30

Performance



Produktinformationen

Valorennummer: 117189938
ISIN: CH1171899383
LEI: 254900Q154AKVWL8UQ41
Bloomberg-Code: SWAEIPC SW
Benchmark: MSCI World ex Switzerland ESG Leaders Net Return
Währung: CHF
Domizil: Schweiz
Aufledgedatum: 31/03/2022
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@: UBS 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: 0.32%
ex post per: 30/09/2024 0.32%

Portfoliostruktur nach Branchen

	Anlagegruppe	Benchmark
Informationstechnologie	28.51%	28.37%
Finanzen	15.80%	15.23%
Industrieunternehmen	11.00%	10.60%
Gesundheitswesen	10.99%	10.84%
Zyklische Konsumgüter	10.75%	10.44%
Kommunikationsdienste	8.44%	8.37%
Nichtzyklische Konsumgüter	6.00%	5.99%
Roh- und Grundstoffe	3.79%	3.63%
Energie	2.50%	2.49%
Immobilien	2.34%	2.29%
Versorger	1.77%	1.75%
Liquidität	-1.89%	-

Grösste Positionen

	Anlagegruppe	Benchmark
NVIDIA CORP	9.29%	9.34%
MICROSOFT CORP	8.16%	8.20%
ALPHABET INC	5.34%	5.37%
TESLA INC	2.04%	2.05%
ELI LILLY & CO	1.91%	1.92%
VISA INC	1.29%	1.30%
MASTERCARD INC	1.17%	1.19%
HOME DEPOT INC/THE	1.11%	1.12%
PROCTER & GAMBLE CO/THE	1.11%	1.11%
JOHNSON & JOHNSON	1.09%	1.10%

Portfoliostruktur nach Ländern/Regionen

	Anlagegruppe	Benchmark
USA	74.91%	75.18%
Japan	7.73%	6.10%
Grossbritannien	3.49%	3.50%
Kanada	3.20%	3.21%
Frankreich	2.78%	2.80%
Deutschland	0.99%	0.99%
Übriges Europa	5.87%	5.91%
Übrige Länder Asien	2.91%	2.32%
Übrige	-	-
Liquidität	-1.89%	-

Portfoliostruktur nach Währungen

	Anlagegruppe	Benchmark
USD	75.16%	75.18%
EUR	7.02%	7.06%
JPY	6.13%	6.10%
GBP	3.58%	3.51%
Übrige	8.12%	8.15%