

31. Oktober 2022

# Anlagestiftung Swiss Life Aktien Ausland ESG Indexiert PM

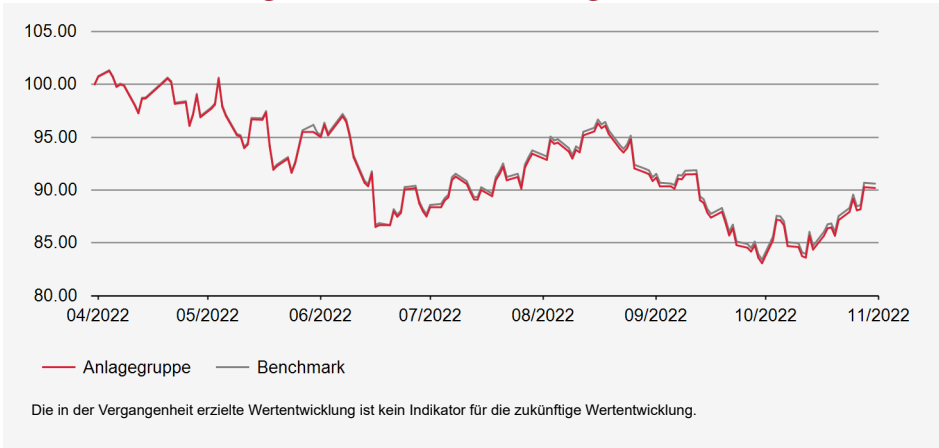


**Nettovermögen (NAV) in Mio. CHF: 158.56**  
**Nettovermögen pro Anspruch in CHF: 90.20**

## Anlagestrategie

Anlagen in Beteiligungspapiere von Gesellschaften, die im MSCI World ex Switzerland ESG Leaders, in CHF enthalten sind. Zugelassen sind auch Beteiligungspapiere 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	-	8.57%	-3.47%	-	-	-	-	-
BENCHMARK	-	8.61%	-3.35%	-	-	-	-	-

## Statistische Angaben (annualisiert)

	1 JAHR	3 JAHRE	5 JAHRE	10 JAHRE	AUFL.
Volatilität Anlagegruppe (in %)	-	-	-	-	21.53
Volatilität Benchmark (in %)	-	-	-	-	21.54
Tracking Error ex post (in %)	-	-	-	-	0.13
Information Ratio	-	-	-	-	-4.63
Sharpe Ratio	-	-	-	-	-0.71
Korrelation	-	-	-	-	1.00
Beta	-	-	-	-	1.00
Jensen-Alpha	-	-	-	-	-0.67
Maximum Drawdown (in %)	-	-	-	-	-17.96
Recovery Period (Jahre)	-	-	-	-	-

## Performance

Datenhistorie unzureichend

## Produktinformationen

**Valorennummer:** 117189938  
**ISIN:** CH1171899383  
**LEI:** 254900Q154AKVWL8UQ41  
**Bloomberg-Code:** SWAEIPC SW  
**Benchmark:** MSCI World ex Switzerland ESG Leaders (CHF)  
**Währung:** CHF  
**Domizil:** Schweiz  
**Aufgatedatum:** 31/03/2022  
**Ausgabepreis:** 100.00  
**Jahresabschluss:** 30.09  
**Ausgabe/Rücknahme:** Täglich  
**Annahmeschluss:** 14.30 Uhr  
**Ausgabe-/Rücknahmekommission:** Keine  
**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](http://www.swisslife.ch/anlagestiftung)  
**Betriebsaufwandquote TER KGAST ex ante:** 0.32%  
**ex post per:** 30/09/2022 0.32%

**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
INFORMATIONSTECHNOLOGIE	21.62%	21.60%
GESUNDHEITSWESEN	14.81%	14.84%
FINANZEN	14.39%	14.34%
ZYKLISCHE KONSUMGÜTER	10.62%	10.59%
INDUSTRIEUNTERNEHMEN	10.33%	10.34%
TELEKOMMUNIKATIONSDIENSTLEISTUNGEN	8.02%	8.04%
NICHTZYKLISCHE KONSUMGÜTER	7.68%	7.68%
ROH- UND GRUNDSTOFFE	4.34%	4.34%
ENERGIE	3.70%	3.72%
IMMOBILIEN	2.69%	2.69%
VERSORGER	1.80%	1.81%
LIQUIDITÄT	-	-

### Grösste Positionen

	Anlagegruppe	Benchmark
MICROSOFT CORP.	6.98%	6.98%
ALPHABET INC	4.66%	4.66%
TESLA INC	2.54%	2.54%
JOHNSON & JOHNSON	1.94%	1.94%
VISA INC	1.44%	1.44%
NVIDIA	1.43%	1.43%
PROCTER & GAMBLE	1.37%	1.37%
HOME DEPOT	1.29%	1.29%
ELI LILLY &	1.23%	1.24%
MASTERCARD INC-CLASS A	1.20%	1.21%

### Portfoliostruktur nach Ländern/Regionen

	Anlagegruppe	Benchmark
USA	71.43%	71.42%
JAPAN	6.18%	6.17%
GROSSBRITANNIEN	4.31%	4.39%
KANADA	3.66%	3.64%
FRANKREICH	2.96%	3.06%
DEUTSCHLAND	1.73%	1.64%
ÜBRIGES EUROPA	6.32%	6.25%
ÜBRIGE LÄNDER ASIEN	3.34%	3.37%
ÜBRIGE	0.07%	0.06%
LIQUIDITÄT	-	-