

Anlagestiftung Swiss Life

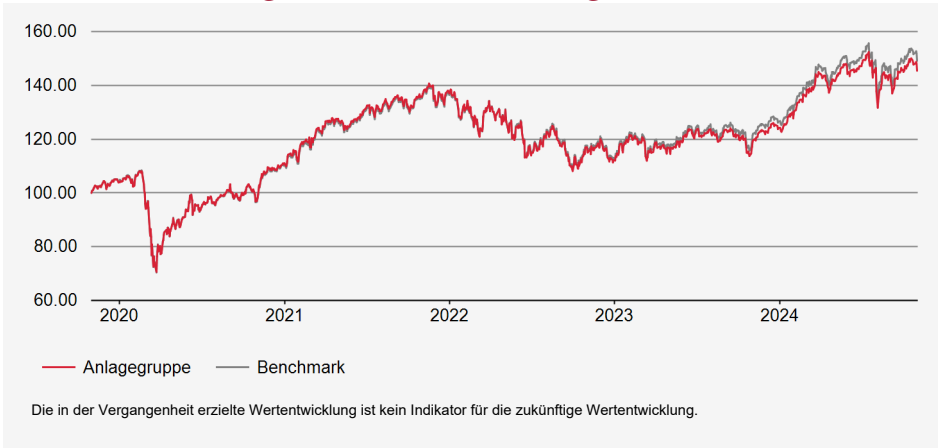
Aktien Ausland ESG PM

Nettovermögen (NAV) in Mio. CHF: 409.69
Nettovermögen pro Anspruch in CHF: 192.58

Anlagestrategie

Anlagen in Beteiligungspapiere von Gesellschaften mit Domizil im Ausland. Large & Mid Caps werden passiv abgedeckt, Small Caps sowie der Bereich Emerging Markets werden aktiv verwaltet (Core-Satellite). Gesellschaftsbegrenzung: 5% (Ausnahme: sofern Gewicht im Index mehr als 5%; dann max. 10%). Benchmarkfremde Gesellschaften: max. 10%. Umsetzung mittels Swiss Life iFunds (CH) Equity ESG Global ex Switzerland (CHF), Invesco Global Small Cap Equity Fund, Dimensional Global Small Cap Equity Fund, Amundi Emerging Markets Equity Focus Fund und Robeco Emerging Markets Equities Fund.

Wertentwicklung in Referenzwährung (Basis 100)



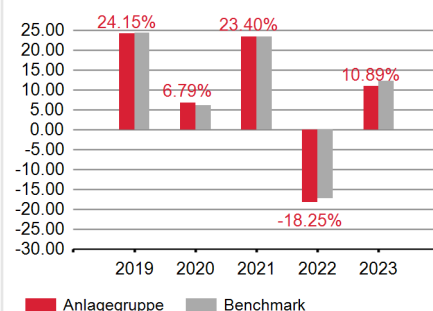
Performance in Referenzwährung

	Kumulierte Performance				Annualisierte Performance			
	YTD	1 Monat	3 Monate	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Aufl.
Anlagegruppe	17.05%	-0.25%	-0.68%	25.14%	2.31%	7.76%	7.56%	3.83%
Benchmark	17.77%	-0.10%	-0.19%	26.01%	3.32%	8.31%	8.08%	4.38%

Statistische Angaben (annualisiert)

	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Aufl.
Volatilität Anlagegruppe (in %)	9.58	14.08	16.32	14.81	15.73
Volatilität Benchmark (in %)	9.59	14.09	16.30	14.77	15.74
Tracking Error ex post (in %)	0.35	0.41	0.47	0.61	0.91
Information Ratio	-2.46	-2.49	-1.16	-0.86	-0.60
Sharpe Ratio	2.19	0.11	0.45	0.51	0.24
Korrelation	1.00	1.00	1.00	1.00	1.00
Beta	1.00	1.00	1.00	1.00	1.00
Jensen-Alpha	-0.83	-1.01	-0.55	-0.54	-0.54
Maximum Drawdown (in %)	-13.59	-23.15	-34.64	-34.64	-59.96
Recovery Period (Jahre)	-	1.47	0.67	0.67	7.75

Performance



Produktinformationen

Valorennummer: 3026051

ISIN: CH0030260514

LEI: 2549000B6X3SG0K4LZ68

Bloomberg-Code: SLAAUPM SW

Benchmark: 80% MSCI World ex CH ESG Leaders, 15% MSCI AC World Small Cap in CHF, 5% MSCI Emerging Markets in CHF

Währung: CHF

Domizil: Schweiz

Aufliedatum: 31/05/2007

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® Large&Mid Caps (passiv)
UBS AG

Small Caps (aktiv)

50% Invesco / 50% Dimensional

Emerging Markets (aktiv)

50% Amundi / 50% Robeco

Externe Beratung:

PPCmetrics erbringt folgende Dienstleistungen: Beratung betreffend geeigneter Mandatsstrukturen (Core-Satellite), 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: 0.38%

ex post per: 30/09/2024 0.38%

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

Benchmark: Bis 31.03.2022 80% MSCI World ex CH in CHF, 15% MSCI AC World Small Cap in CHF, 5% MSCI Emerging Markets in CHF - Bis 31.12.2009 100% MSCI World, ex CH, in CHF.

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.

Portfoliostruktur nach Branchen

	Anlagegruppe	Benchmark
Informationstechnologie	24.11%	25.56%
Finanzen	16.31%	15.65%
Industrieunternehmen	13.56%	11.79%
Zyklische Konsumgüter	11.51%	11.00%
Gesundheitswesen	10.32%	10.29%
Kommunikationsdienste	7.06%	7.63%
Nichtzyklische Konsumgüter	5.40%	5.76%
Roh- und Grundstoffe	4.60%	4.42%
Immobilien	3.35%	3.15%
Energie	2.77%	2.82%
Versorgungsbetriebe	1.82%	1.93%
Liquidität	-0.81%	-

Grösste Positionen

	Anlagegruppe	Benchmark
NVIDIA CORP	6.48%	7.47%
MICROSOFT CORP	5.69%	6.56%
ALPHABET INC	3.72%	4.30%
TESLA INC	1.42%	1.64%
ELI LILLY & CO	1.33%	1.54%
VISA INC	0.90%	1.04%
MASTERCARD INC	0.82%	0.95%
PROCTER & GAMBLE CO/THE	0.77%	0.89%
HOME DEPOT INC/THE	0.77%	0.90%
JOHNSON & JOHNSON	0.76%	0.88%

Portfoliostruktur nach Ländern/Regionen

	Anlagegruppe	Benchmark
USA	67.63%	68.81%
Japan	7.20%	6.58%
Grossbritannien	4.09%	3.50%
Kanada	2.78%	3.12%
Frankreich	2.42%	2.40%
Deutschland	1.10%	0.97%
Übriges Europa	6.64%	5.90%
Übrige Länder Asien	6.30%	6.23%
Übrige	2.65%	2.50%
Liquidität	-0.81%	-

Portfoliostruktur nach Währungen

	Anlagegruppe	Benchmark
USD	68.77%	69.00%
EUR	7.05%	6.52%
JPY	6.09%	6.58%
GBP	4.16%	3.51%
CHF	0.45%	0.20%
Übrige	13.48%	14.20%

Weitere Angaben zu den Gesellschaften

Anzahl Gesellschaften	7'711
Anteil Nicht-Benchmark-Gesellschaften	5.88%