

Anlagestiftung Swiss Life

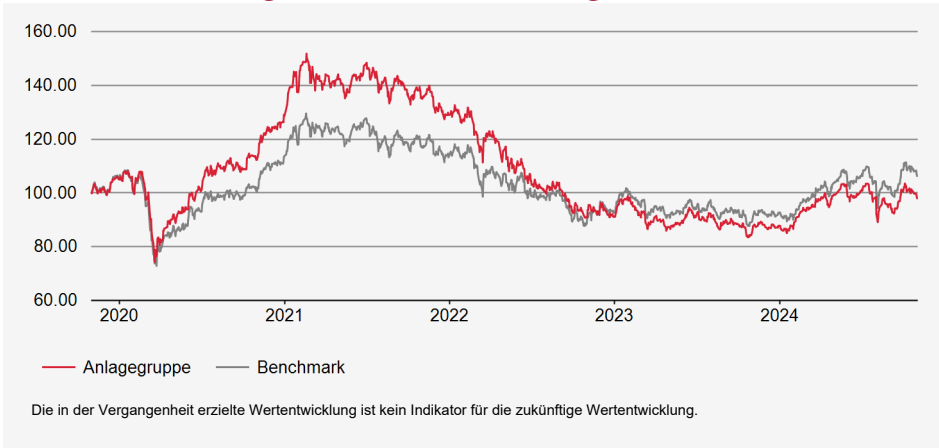
Aktien Emerging Markets ESG PM

Nettovermögen (NAV) in Mio. CHF: 195.98
Nettovermögen pro Anspruch in CHF: 86.16

Anlagestrategie

Anlagen in Beteiligungspapiere von Gesellschaften mit Domizil in Entwicklungsländern. Aktive Länder-, Branchen- und Titelselektion. Umsetzung mittels Einsatz des Fonds Amundi Emerging Markets Equity Focus und des fonds Robeco Emerging Markets Equities; SICAV nach luxemburgischem Recht gemäss UCITS.

Wertentwicklung in Referenzwährung (Basis 100)



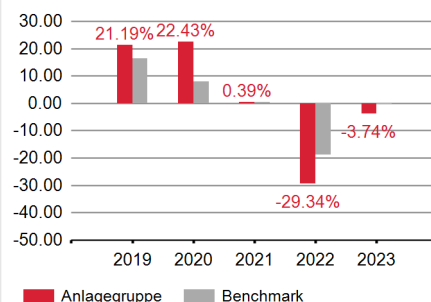
Performance in Referenzwährung

	Kumulierte Performance				Annualisierte Performance			
	YTD	1 Monat	3 Monate	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Aufl.
Anlagegruppe	11.61%	-2.47%	-0.44%	15.51%	-10.17%	-0.41%	-	-2.18%
Benchmark	14.72%	-2.05%	1.75%	19.07%	-3.22%	1.22%	-	-0.28%

Statistische Angaben (annualisiert)

	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Aufl.
Volatilität Anlagegruppe (in %)	11.44	13.91	16.59	-	16.52
Volatilität Benchmark (in %)	11.97	14.55	16.36	-	15.92
Tracking Error ex post (in %)	2.47	4.73	5.16	-	5.13
Information Ratio	-1.44	-1.47	-0.32	-	-0.37
Sharpe Ratio	1.14	-0.83	-0.04	-	-0.13
Korrelation	0.98	0.95	0.95	-	0.95
Beta	0.93	0.90	0.97	-	0.99
Jensen-Alpha	-2.40	-7.34	-1.59	-	-1.91
Maximum Drawdown (in %)	-13.84	-40.27	-44.96	-	-44.96
Recovery Period (Jahre)	0.16	-	-	-	-

Performance



Produktinformationen

Valorennummer: 39561964
ISIN: CH0395619643
LEI: 254900OLXTUB1EYJLV86
Bloomberg-Code: SWLAEPM SW
Benchmark: MSCI Emerging Markets, in CHF
Währung: CHF
Domizil: Schweiz
Aufledgedatum: 31/01/2018
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@: 50% Amundi / 50% Robeco

Externe Beratung: PPCmetrics erbringt folgende Dienstleistungen: Beratung betreffend geeigneter Mandatsstrukturen, 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: 0.46%

ex post per: 30/09/2024 0.46%

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

Aktien Emerging Markets ESG PM



Portfoliostruktur nach Branchen

	Anlagegruppe	Benchmark
Informationstechnologie	23.74%	23.68%
Finanzen	22.72%	23.20%
Zyklische Konsumgüter	16.79%	13.52%
Kommunikationsdienste	7.51%	9.04%
Industrieunternehmen	5.62%	6.65%
Immobilien	5.31%	1.58%
Nichtzyklische Konsumgüter	4.60%	4.97%
Roh- und Grundstoffe	3.76%	6.48%
Versorgungsbetriebe	3.21%	2.82%
Energie	2.57%	4.56%
Gesundheitswesen	1.92%	3.49%
Liquidität	2.25%	-

Grösste Positionen

	Anlagegruppe	Benchmark
TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFACTURING CO LT	9.56%	9.97%
SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	3.40%	2.76%
ALIBABA GROUP HOLDING LTD	3.09%	2.34%
HDFC BANK LTD	2.89%	1.11%
TENCENT HOLDINGS LTD	2.59%	2.17%
NASPERS LTD	1.80%	0.26%
INFOSYS LTD	1.80%	0.45%
ICICI BANK LTD ADR	1.71%	-
HON HAI PRECISION INDUSTRY CO LTD	1.49%	0.52%
SK HYNIX INC	1.22%	0.47%

Portfoliostruktur nach Ländern/Regionen

	Anlagegruppe	Benchmark
China	23.86%	27.38%
Indien	18.37%	18.84%
Taiwan	15.73%	18.96%
Korea	12.31%	10.12%
Brasilien	5.49%	4.79%
Südafrika	3.98%	3.06%
Übrige Länder Asien	7.20%	5.15%
Übrige Länder EMEA	7.86%	9.02%
Übrige Länder Amerika	2.94%	2.69%
Liquidität	2.26%	-

Portfoliostruktur nach Währungen

	Anlagegruppe	Benchmark
HKD	17.34%	21.25%
TWD	16.07%	18.99%
INR	15.01%	18.84%
KRW	12.36%	10.12%
USD	11.07%	3.04%
EUR	1.33%	0.44%
CHF	0.00%	-
Übrige	26.82%	27.26%

Weitere Angaben zu den Gesellschaften

Anzahl Gesellschaften	258
Anteil Nicht-Benchmark-Gesellschaften	4.08%