

Anlagestiftung Swiss Life

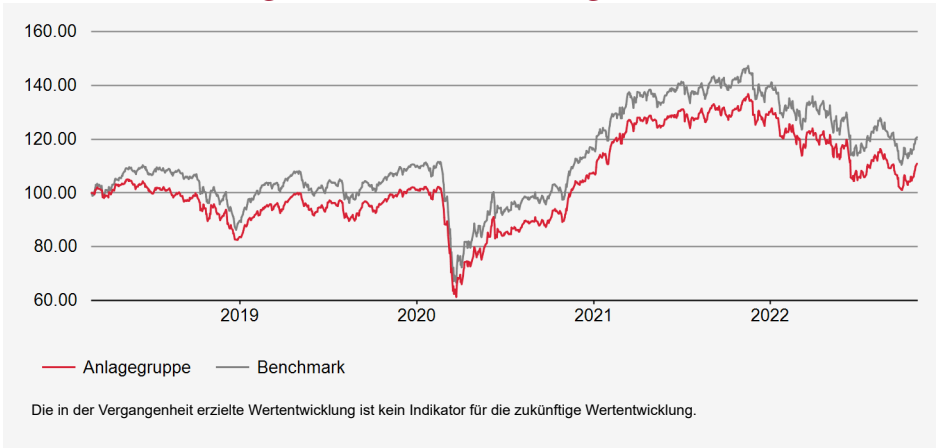
Aktien Global Small Caps PM

Nettvermögen (NAV) in Mio. CHF: 212.91
Nettvermögen pro Anspruch in CHF: 110.89

Anlagestrategie

Anlagen in kleinkapitalisierte Beteiligungspapiere weltweit. Aktive Länder-, Branchen- und Titelselektion. Gesellschaftsbegrenzung: 5%. Umsetzung mittels Invesco Global Small Cap Equity Fund und Dimensional Global Small Cap Equity Fund.

Wertentwicklung in Referenzwährung (Basis 100)



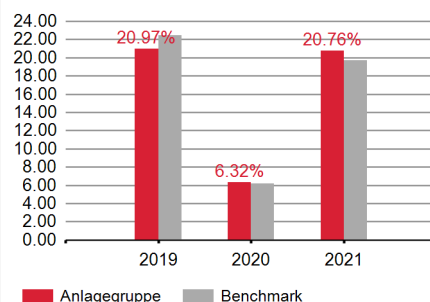
Performance in Referenzwährung

	KUMULIERTE PERFORMANCE				ANNUALISIERTE PERFORMANCE			
	YTD	1 MONAT	3 MONATE	1 JAHR	3 JAHRE	5 JAHRE	10 JAHRE	AUFL.
ANLAGEGRUPPE	-14.68%	9.72%	-1.14%	-15.22%	4.62%	-	-	2.24%
BENCHMARK	-13.44%	8.82%	-1.66%	-14.60%	4.81%	-	-	4.11%

Statistische Angaben (annualisiert)

	1 JAHR	3 JAHRE	5 JAHRE	10 JAHRE	AUFL.
Volatilität Anlagegruppe (in %)	20.51	23.94	-	-	21.35
Volatilität Benchmark (in %)	-	23.29	-	-	20.91
Tracking Error ex post (in %)	2.01	2.03	-	-	2.55
Information Ratio	-0.31	-0.09	-	-	-0.74
Sharpe Ratio	-0.78	0.21	-	-	0.14
Korrelation	1.00	1.00	-	-	0.99
Beta	1.00	1.02	-	-	1.01
Jensen-Alpha	-0.55	-0.32	-	-	-1.94
Maximum Drawdown (in %)	-26.10	-40.04	-	-	-41.60
Recovery Period (Jahre)	-	0.67	-	-	0.73

Performance



Produktinformationen

Valorennummer: 40068790

ISIN: CH0400687908

LEI: 254900XCUD9NTWJQU706

Bloomberg-Code: SLAGSPM SW

Benchmark: MSCI AC World Small Cap, in CHF

Währung: CHF

Domizil: Schweiz

Aufledgedatum: 28/02/2018

Ausgabepreis: 100.00

Jahresabschluss: 30.09

Ausgabe/Rücknahme: Täglich

Annahmeschluss: 11.00 Uhr

Ausgabe-/Rücknahmekommission: Keine

Ausschüttungspraxis: Thesaurierung

Asset Manager gemäss

Swiss Life Best Select Invest Plus®:
50% Invesco / 50% Dimensional

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: 0.78%

ex post per: 30/09/2022 0.78%

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.

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 Global Small Caps PM



Portfoliostruktur nach Branchen

	Anlagegruppe	Benchmark
INDUSTRIEUNTERNEHMEN	20.43%	18.63%
FINANZEN	16.63%	14.38%
ZYKLISCHE KONSUMGÜTER	13.64%	12.18%
INFORMATIONSTECHNOLOGIE	11.55%	11.36%
GESUNDHEITSWESEN	10.02%	10.50%
ROH- UND GRUNDSTOFFE	6.46%	7.66%
IMMOBILIEN	5.66%	8.94%
ENERGIE	5.17%	5.53%
NICHTZYKLISCHE KONSUMGÜTER	3.53%	4.96%
TELEKOMMUNIKATIONSDIENSTLEISTUNGEN	2.73%	2.76%
VERSORGUNGSBETRIEBE	2.26%	3.10%
LIQUIDITÄT	1.93%	-

Grösste Positionen

	Anlagegruppe	Benchmark
WEATHERFORD INTERNAT	0.72%	0.02%
CACTUS	0.53%	0.02%
ARISTON HLDG	0.46%	0.00%
COFACE	0.43%	0.01%
HURON CONSULTING	0.39%	0.02%
VISTEON CORP	0.38%	0.06%
PINNACLE FINL	0.38%	0.01%
WILLSCOT MOBILE MINI	0.38%	0.07%
CHART INDS	0.37%	0.05%
RGA	0.36%	0.04%

Portfoliostruktur nach Ländern/Regionen

	Anlagegruppe	Benchmark
USA	57.88%	58.78%
JAPAN	8.18%	9.84%
GROSSBRITANNIEN	5.72%	4.80%
KANADA	2.45%	3.82%
FRANKREICH	2.08%	1.14%
DEUTSCHLAND	1.97%	1.37%
ÜBRIGES EUROPA	10.98%	8.39%
ÜBRIGE LÄNDER ASIEN	5.19%	7.13%
ÜBRIGE	3.62%	4.72%
LIQUIDITÄT	1.93%	-

Weitere Angaben zu den Gesellschaften

Anzahl Gesellschaften	6'732
Anteil Nicht-Benchmark-Gesellschaften	21.18%