

Anlagestiftung Swiss Life

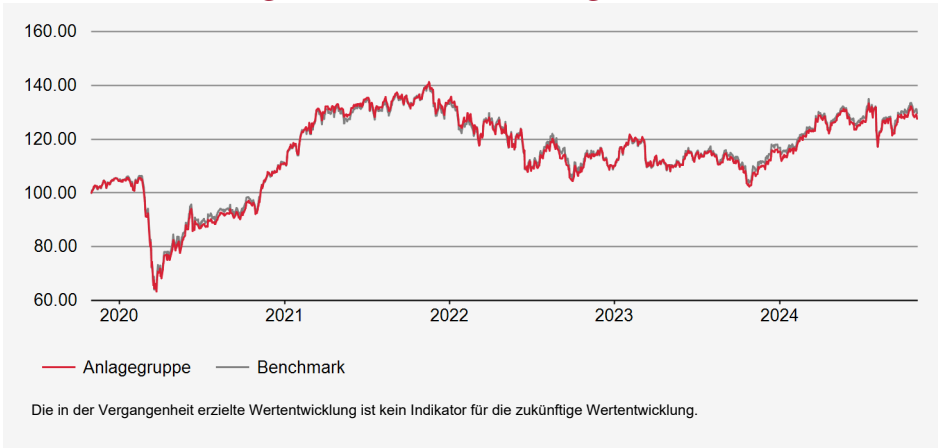
Aktien Global Small Caps PM

Nettvermögen (NAV) in Mio. CHF: 367.70
Nettvermögen pro Anspruch in CHF: 123.49

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)



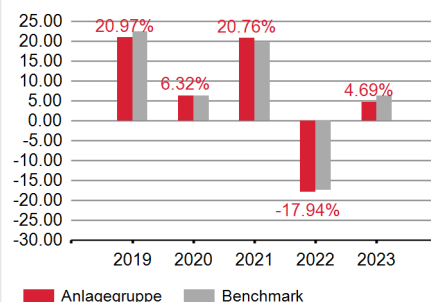
Performance in Referenzwährung

	Kumulierte Performance				Annualisierte Performance			
	YTD	1 Monat	3 Monate	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Aufl.
Anlagegruppe	10.60%	-0.63%	-3.21%	22.01%	-1.89%	4.98%	-	3.21%
Benchmark	11.02%	-0.46%	-1.92%	22.25%	-1.30%	5.32%	-	4.70%

Statistische Angaben (annualisiert)

	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Aufl.
Volatilität Anlagegruppe (in %)	11.73	15.97	20.18	-	19.18
Volatilität Benchmark (in %)	11.17	15.95	19.76	-	18.86
Tracking Error ex post (in %)	1.77	1.81	1.90	-	2.33
Information Ratio	-0.13	-0.33	-0.18	-	-0.64
Sharpe Ratio	1.58	-0.17	0.23	-	0.17
Korrelation	0.99	0.99	1.00	-	0.99
Beta	1.04	1.00	1.02	-	1.01
Jensen-Alpha	-1.04	-0.61	-0.43	-	-1.54
Maximum Drawdown (in %)	-12.06	-27.52	-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
Aufgatedatum: 28/02/2018
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% 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: 0.59%
ex post per: 30/09/2024 0.59%

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 Global Small Caps PM

Portfoliostruktur nach Branchen

	Anlagegruppe	Benchmark
Industrieunternehmen	22.40%	19.87%
Finanzen	16.72%	15.39%
Zyklische Konsumgüter	12.79%	13.16%
Informationstechnologie	12.27%	11.17%
Gesundheitswesen	10.22%	9.59%
Roh- und Grundstoffe	7.09%	7.92%
Immobilien	5.87%	8.28%
Nichtzyklische Konsumgüter	3.98%	4.83%
Energie	3.60%	4.01%
Kommunikationsdienste	3.22%	3.18%
Versorgungsbetriebe	1.74%	2.60%
Liquidität	0.10%	-

Grösste Positionen

	Anlagegruppe	Benchmark
TAYLOR MORRISON	0.66%	0.04%
CACTUS	0.62%	0.02%
WEATHERFORD INTERNAT	0.53%	0.03%
SIGMAROC	0.51%	-
PIPER SANDLER	0.50%	0.03%
PINNACLE FINANCIAL PARTNERS	0.49%	0.04%
PLANISWARE	0.48%	0.00%
XPO	0.42%	0.08%
ENCOMPASS HEALTH	0.41%	-
Q2	0.41%	0.03%

Portfoliostruktur nach Ländern/Regionen

	Anlagegruppe	Benchmark
USA	61.66%	57.76%
Japan	7.22%	11.30%
Grossbritannien	6.56%	4.66%
Kanada	2.19%	3.67%
Frankreich	1.91%	1.07%
Deutschland	1.65%	1.20%
Übriges Europa	10.16%	7.81%
Übrige Länder Asien	5.51%	8.64%
Übrige	3.04%	3.89%
Liquidität	0.10%	-

Portfoliostruktur nach Währungen

	Anlagegruppe	Benchmark
USD	63.34%	58.00%
EUR	8.33%	5.66%
JPY	7.26%	11.30%
GBP	6.63%	4.66%
CHF	1.82%	1.34%
Übrige	12.63%	19.04%

Weitere Angaben zu den Gesellschaften

Anzahl Gesellschaften	6'775
Anteil Nicht-Benchmark-Gesellschaften	22.53%