

Anlagestiftung Swiss Life

Aktien Schweiz Small & Mid Caps PM

Nettovermögen (NAV) in Mio. CHF: 130.71
Nettovermögen pro Anspruch in CHF: 127.05

Anlagestrategie

Anlagen in Beteiligungspapiere von Gesellschaften, die im Swiss Performance Index Extra vertreten sind. Aktive Branchen- und Titelselektion. Gesellschaftsbegrenzung: 5% (Ausnahme: sofern im Benchmark; max. 5%-Punkte mehr als Benchmarkgewichtung). Umsetzung mittels Einsatz des Swiss Life iFunds (CH) Equity Switzerland Small & Mid Cap (CHF); Anlagefonds schweizerischen Rechts der Kategorie "Übrige Fonds für traditionelle Anlagen".

Wertentwicklung in Referenzwährung (Basis 100)



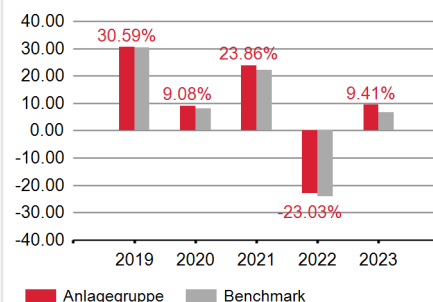
Performance in Referenzwährung

	Kumulierte Performance				Annualisierte Performance			
	YTD	1 Monat	3 Monate	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Aufl.
Anlagegruppe	4.91%	-4.76%	-3.63%	13.95%	-3.23%	4.82%	-	3.61%
Benchmark	4.94%	-3.96%	-2.85%	13.81%	-4.71%	3.61%	-	2.54%

Statistische Angaben (annualisiert)

	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Aufl.
Volatilität Anlagegruppe (in %)	10.10	14.91	15.77	-	15.40
Volatilität Benchmark (in %)	9.47	14.73	15.83	-	15.34
Tracking Error ex post (in %)	1.58	1.71	1.67	-	1.61
Information Ratio	0.09	0.87	0.72	-	0.67
Sharpe Ratio	1.15	-0.27	0.29	-	0.24
Korrelation	0.99	0.99	0.99	-	0.99
Beta	1.05	1.01	0.99	-	1.00
Jensen-Alpha	-0.54	1.51	1.23	-	1.07
Maximum Drawdown (in %)	-5.13	-31.46	-31.46	-	-31.46
Recovery Period (Jahre)	-	-	-	-	-

Performance



Produktinformationen

Valorennummer: 39561897
ISIN: CH0395618975
LEI: 254900QGENUS1GIJ4549
Bloomberg-Code: SWLSMPM SW
Benchmark: SPI EXTRA® Total Return
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®: Privatbank Von Graffenried 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

Betriebsaufwandquote TER KGAST ex ante: 0.72%
ex post per: 30/09/2024 0.72%

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.

Anlagestiftung Swiss Life

Aktien Schweiz Small & Mid Caps PM



Portfoliostruktur nach Branchen

	Anlagegruppe	Benchmark
Industrieunternehmen	36.72%	32.90%
Gesundheitswesen	19.28%	19.85%
Finanzen	15.22%	23.77%
Nichtzyklische Konsumgüter	13.61%	12.83%
Informationstechnologie	4.04%	3.13%
Zyklische Konsumgüter	2.51%	3.15%
Versorger	2.03%	1.11%
Roh- und Grundstoffe	1.94%	2.60%
Kommunikationsdienste	-	0.65%
Energie	-	-
Liquidität	4.65%	-

Grösste Positionen

	Anlagegruppe	Benchmark
LINDT & SPRÜNGLI	6.60%	6.90%
SANDOZ GROUP AG	5.73%	5.48%
SGS SA	5.50%	4.53%
STRAUMANN HOLDING AG	4.68%	4.35%
SCHINDLER HOLDING AG	4.53%	4.93%
JULIUS BAER GROUP LTD	4.26%	3.50%
VAT GROUP AG	3.64%	3.12%
BALOISE HOLDING AG	2.77%	2.33%
BELIMO HOLDING AG	2.73%	1.83%
GALENICA AG	2.51%	1.21%

Portfoliostruktur nach Unternehmensgrösse

	Anlagegruppe		Benchmark	
	Anteil	Anzahl	Anteil	Anzahl
Grosse Unternehmen	12.31%	3	9.82%	2
Mittlere Unternehmen	79.43%	45	81.85%	78
Kleine Unternehmen	3.61%	4	8.33%	104
Liquidität	4.65%	-	-	-