

Anlagestiftung Swiss Life

Aktien Schweiz Small & Mid Caps PM

Nettovermögen (NAV) in Mio. CHF: 94.08
Nettovermögen pro Anspruch in CHF: 106.28

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)



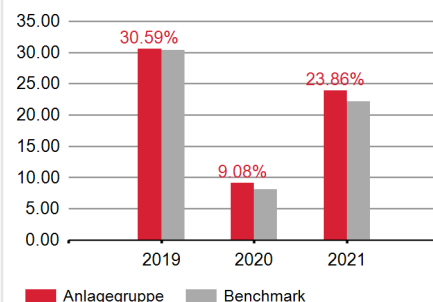
Performance in Referenzwährung

	KUMULIERTE PERFORMANCE				ANNUALISIERTE PERFORMANCE			
	YTD	1 MONAT	3 MONATE	1 JAHR	3 JAHRE	5 JAHRE	10 JAHRE	AUFL.
ANLAGEGRUPPE	-26.09%	3.84%	-10.76%	-24.21%	1.91%	-	-	1.29%
BENCHMARK	-26.32%	4.07%	-10.61%	-24.98%	1.19%	-	-	0.57%

Statistische Angaben (annualisiert)

	1 JAHR	3 JAHRE	5 JAHRE	10 JAHRE	AUFL.
Volatilität Anlagegruppe (in %)	18.90	18.25	-	-	16.87
Volatilität Benchmark (in %)	-	18.48	-	-	16.90
Tracking Error ex post (in %)	1.35	1.51	-	-	1.48
Information Ratio	0.57	0.48	-	-	0.48
Sharpe Ratio	-1.44	0.14	-	-	0.12
Korrelation	1.00	1.00	-	-	1.00
Beta	0.99	0.98	-	-	0.99
Jensen-Alpha	0.62	0.75	-	-	0.72
Maximum Drawdown (in %)	-31.46	-31.46	-	-	-31.46
Recovery Period (Jahre)	-	-	-	-	-

Performance



Produktinformationen

Valorennummer: 39561897
ISIN: CH0395618975
LEI: 254900QGENUS1GIJ4549
Bloomberg-Code: SWLSMPM SW
Benchmark: SPI Extra TR
Währung: CHF
Domizil: Schweiz
Aufledgedatum: 31/01/2018
Ausgabepreis: 100.00
Jahresabschluss: 30.09
Ausgabe/Rücknahme: Täglich
Annahmeschluss: 14.30 Uhr
Ausgabe-/Rücknahmekommission: Keine
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: 30/09/2022 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.

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	39.63%	35.18%
VERBRAUCHSGÜTER	14.39%	15.52%
FINANZEN	14.09%	23.79%
GESUNDHEITSWESEN	9.38%	13.71%
TECHNOLOGIE	5.71%	3.69%
GRUNDSTOFFE	3.30%	3.38%
VERBRAUCHERSERVICE	2.36%	3.11%
VERSORGER	2.28%	1.00%
ERDÖL UND ERDGAS	-	-
TELEKOMMUNIKATION	-	0.63%
LIQUIDITÄT	8.86%	-

Grösste Positionen

	Anlagegruppe	Benchmark
LINDT & SPRÜNGLI (PS)	5.90%	3.62%
SGS SA	4.76%	4.85%
KUEHNE + NAGEL INTERNATIONAL AG	4.74%	4.39%
JULIUS BAER GROUP LTD	4.46%	3.72%
STRAUMANN HOLDING AG	4.09%	3.91%
SCHINDLER HOLDING AG (PS)	3.57%	2.41%
BARRY CALLEBAUT AG	3.20%	2.44%
VAT GROUP AG	3.07%	2.23%
BALOISE HOLDING AG	2.93%	2.27%
SIG GROUP AG	2.68%	2.42%

Portfoliostruktur nach Unternehmensgrösse

	Anlagegruppe		Benchmark	
	Anteil	Anzahl	Anteil	Anzahl
Grosse Unternehmen	8.85%	2	8.76%	2
Mittlere Unternehmen	78.61%	46	81.24%	78
Kleine Unternehmen	3.68%	5	10.00%	117
Liquidität	8.86%	-	-	-