

Anlagestiftung Swiss Life

Aktien Ausland ESG Indexiert

Nettovermögen (NAV) in Mio. CHF: 610.15
Nettovermögen pro Anspruch in CHF: 115.44

Anlagestrategie

Anlagen in Beteiligungspapieren von Gesellschaften, die im MSCI World ex Switzerland ESG Leaders, in CHF enthalten sind. Zugelassen sind auch Beteiligungspapieren von Gesellschaften, die aufgrund von Benchmark-Anpassungen noch nicht oder nicht mehr in der Benchmark enthalten sind (max. Abweichung +0.5 Prozentpunkte). Umsetzung mittels Swiss Life iFunds (CH) Equity ESG Global ex Switzerland (CHF).

Wertentwicklung in Referenzwährung (Basis 100)



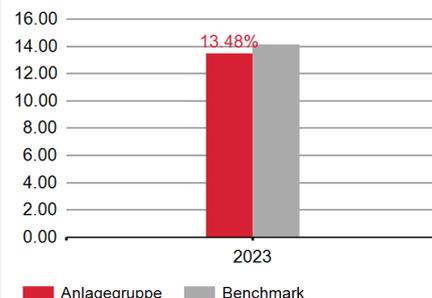
Performance in Referenzwährung

	Kumulierte Performance True				Annualisierte Performance			
	YTD	1 Monat	3 Monate	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Aufl.
Anlagegruppe	18.40%	1.29%	-1.51%	21.64%	-	-	-	5.90%
Benchmark	19.08%	1.34%	-1.32%	22.55%	-	-	-	6.58%

Statistische Angaben (annualisiert)

	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Aufl.
Volatilität Anlagegruppe (in %)	11.39	-	-	-	14.83
Volatilität Benchmark (in %)	11.42	-	-	-	14.85
Tracking Error ex post (in %)	0.07	-	-	-	0.14
Information Ratio	-13.29	-	-	-	-4.70
Sharpe Ratio	1.59	-	-	-	0.31
Korrelation	1.00	-	-	-	1.00
Beta	1.00	-	-	-	1.00
Jensen-Alpha	-0.86	-	-	-	-0.67
Maximum Drawdown (in %)	-13.92	-	-	-	-18.04
Recovery Period (Jahre)	-	-	-	-	1.30

Performance



Produktinformationen

Valorennummer: 117189932
ISIN: CH1171899326
LEI: 254900Q154AKVWL8UQ41
Bloomberg-Code: SWAEICI SW
Benchmark: MSCI World ex Switzerland ESG Leaders Net Return
Währung: CHF
Domizil: Schweiz
Auflagedatum: 31/03/2022
Erstausgabepreis: 100.00
Jahresabschluss: 30.09
Ausgabe/Rücknahme: Täglich
Annahmeschluss: 13.00 Uhr
Ausgabe- / Rücknahmekommission: Keine
Ausschüttungspraxis: Thesaurierung
Asset Manager gemäss Swiss Life Best Select Invest Plus@: UBS 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: 0.52%
ex post per: 30/09/2024 0.52%

Portfoliostruktur nach Branchen

	Anlagegruppe	Benchmark
Informationstechnologie	27.69%	27.88%
Finanzen	14.82%	14.89%
Gesundheitswesen	11.22%	11.27%
Industrieunternehmen	10.64%	10.70%
Zyklische Konsumgüter	10.61%	10.68%
Kommunikationsdienste	8.01%	8.05%
Nichtzyklische Konsumgüter	6.19%	6.24%
Roh- und Grundstoffe	3.73%	3.73%
Energie	2.45%	2.46%
Immobilien	2.29%	2.32%
Versorger	1.74%	1.78%
Liquidität	0.60%	-

Grösste Positionen

	Anlagegruppe	Benchmark
MICROSOFT CORP	8.42%	8.48%
NVIDIA CORP	8.28%	8.34%
ALPHABET INC	5.04%	5.08%
TESLA INC	2.08%	2.10%
ELI LILLY & CO	1.98%	2.00%
VISA INC	1.20%	1.21%
MASTERCARD INC	1.14%	1.14%
PROCTER & GAMBLE CO/THE	1.13%	1.14%
HOME DEPOT INC/THE	1.11%	1.12%
JOHNSON & JOHNSON	1.08%	1.09%

Portfoliostruktur nach Ländern/Regionen

	Anlagegruppe	Benchmark
USA	73.77%	74.18%
Japan	6.24%	6.24%
Grossbritannien	3.61%	3.66%
Kanada	3.19%	3.22%
Frankreich	2.92%	2.98%
Deutschland	1.04%	1.02%
Übriges Europa	6.20%	6.25%
Übrige Länder Asien	2.42%	2.44%
Übrige	-	-
Liquidität	0.60%	-

Portfoliostruktur nach Währungen

	Anlagegruppe	Benchmark
USD	74.20%	74.18%
EUR	7.42%	7.51%
JPY	6.26%	6.24%
GBP	3.74%	3.67%
Übrige	8.38%	8.39%