

31. März 2025

# Anlagestiftung Swiss Life Aktien Global ex Schweiz ESG

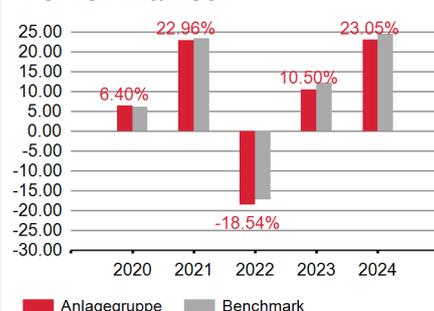


**Nettovermögen (NAV) in Mio. CHF: 474.58**  
**Nettovermögen pro Anspruch in CHF: 231.59**

## Anlagestrategie

Anlagen in Beteiligungspapiere von Gesellschaften mit Domizil im Ausland. Large & Mid Caps werden passiv abgedeckt, Small Caps sowie der Bereich Emerging Markets werden aktiv verwaltet (Core-Satellite). Gesellschaftsbegrenzung: 5% (Ausnahme: sofern Gewicht im Index mehr als 5%; dann max. 10%). Benchmarkfremde Gesellschaften: max. 10%. Umsetzung mittels Swiss Life Index Funds II (CH) Equity ESG Global ex Switzerland PF, Invesco Global Small Cap Equity Fund, Dimensional Global Small Cap Equity Fund, Amundi Emerging Markets Equity Focus Fund und Robeco Emerging Markets Equities Fund.

## Performance



## Wertentwicklung in Referenzwährung (Basis 100)



## Produktinformationen

**Valorennummer:** 1245539  
**ISIN:** CH0012455397  
**LEI:** 2549000B6X3SG0K4LZ68  
**Bloomberg-Code:** SWAAKAU SW  
**Benchmark:** 80% MSCI World ex Switzerland ESG Leaders TR, 15% MSCI AC World Small Cap NR, 5% MSCI Emerging Markets NR  
**Währung:** CHF  
**Domizil:** Schweiz  
**Aufledgedatum:** 30/09/2001  
**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®:** Swiss Life Asset Management AG

## Performance in Referenzwährung

	Kumulierte Performance				Annualisierte Performance			
	YTD	1 Monat	3 Monate	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Aufl.
Anlagegruppe	-6.02%	-6.06%	-6.02%	-0.39%	3.07%	12.05%	6.75%	3.63%
Benchmark	-6.04%	-6.24%	-6.04%	0.70%	4.34%	13.02%	7.61%	4.83%

## Statistische Angaben (annualisiert)

	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Aufl.
Volatilität Anlagegruppe (in %)	10.89	14.67	14.44	14.59	15.42
Volatilität Benchmark (in %)	10.88	14.69	14.39	14.50	15.65
Tracking Error ex post (in %)	0.64	0.51	0.52	0.61	1.37
Information Ratio	-1.69	-2.49	-1.87	-1.41	-0.87
Sharpe Ratio	-0.13	0.14	0.77	0.47	0.22
Korrelation	1.00	1.00	1.00	1.00	1.00
Beta	1.00	1.00	1.00	1.01	0.98
Jensen-Alpha	-1.09	-1.26	-1.02	-0.90	-1.11
Maximum Drawdown (in %)	-13.61	-18.21	-23.39	-34.66	-60.40
Recovery Period (Jahre)	0.26	1.36	1.47	0.67	7.84

**Externe Beratung:** PPCmetrics erbringt folgende Dienstleistungen: Beratung betreffend geeigneter Mandatsstrukturen (Core-Satellite), 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](http://www.swisslife.ch/anlagestiftung)  
**Betriebsaufwandquote TER KGAST ex ante:** 0.57%  
**ex post per:** 30/09/2024 0.74%

**Benchmark:** Bis 31.03.2022 80% MSCI World ex CH in CHF, 15% MSCI AC World Small Cap in CHF, 5% MSCI Emerging Markets in CHF - Bis 31.12.2009 100% MSCI World, ex CH, in CHF.  
**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](http://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.

### Portfoliostruktur nach Branchen

	Anlagegruppe	Benchmark
Informationstechnologie	23.27%	23.51%
Finanzen	17.83%	17.22%
Zyklische Konsumgüter	11.81%	11.27%
Industrieunternehmen	11.30%	11.59%
Gesundheitswesen	9.68%	9.89%
Kommunikationsdienste	7.63%	7.69%
Nichtzyklische Konsumgüter	5.98%	6.29%
Roh- und Grundstoffe	4.04%	4.26%
Immobilien	3.21%	3.22%
Energie	2.71%	3.00%
Versorgungsbetriebe	1.93%	2.06%
Liquidität	0.44%	-

### Grösste Positionen

	Anlagegruppe	Benchmark
NVIDIA CORP	5.83%	6.27%
MICROSOFT CORP	5.82%	6.27%
ALPHABET INC-CL A	1.99%	2.14%
ALPHABET INC-CL C	1.71%	1.84%
TESLA INC	1.65%	1.77%
ELI LILLY & CO	1.46%	1.58%
VISA INC-CLASS A SHARES	1.33%	1.43%
MASTERCARD INC - A	0.99%	1.06%
PROCTER & GAMBLE CO/THE	0.88%	0.95%
JOHNSON & JOHNSON	0.88%	0.94%

### Portfoliostruktur nach Ländern/Regionen

	Anlagegruppe	Benchmark
USA	64.03%	67.75%
Übrige Länder Asien	6.95%	4.33%
Japan	5.73%	6.70%
Übriges Europa	5.46%	5.45%
Kanada	2.88%	3.26%
Vereinigtes Königreich	2.78%	3.00%
Frankreich	2.47%	2.51%
Deutschland	1.26%	1.28%
Grossbritannien	1.03%	0.67%
Übrige	6.80%	5.06%
Liquidität	0.44%	-

### Portfoliostruktur nach Währungen

	Anlagegruppe	Benchmark
USD	65.65%	68.25%
JPY	5.78%	6.70%
GBP	3.77%	3.67%
EUR	1.43%	0.95%
CHF	0.27%	0.22%
Übrige	22.94%	20.19%