

# Anlagestiftung Swiss Life

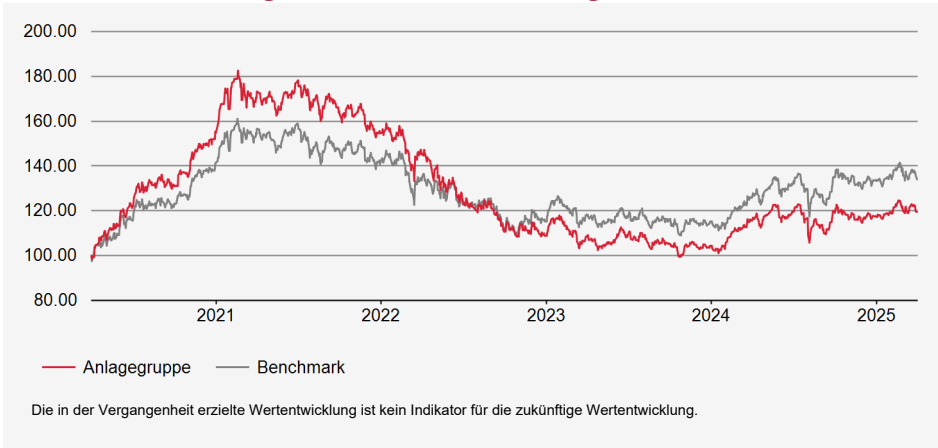
## Aktien Emerging Markets ESG

**Nettovermögen (NAV) in Mio. CHF: 218.25**  
**Nettovermögen pro Anspruch in CHF: 87.04**

### Anlagestrategie

Anlagen in Beteiligungspapiere von Gesellschaften mit Domizil in Entwicklungsländern. Aktive Länder-, Branchen- und Titelselektion. Umsetzung mittels Einsatz des Fonds Amundi Emerging Markets Equity Focus und des fonds Robeco Emerging Markets Equities; SICAV nach luxemburgischem Recht gemäss UCITS.

### Wertentwicklung in Referenzwährung (Basis 100)



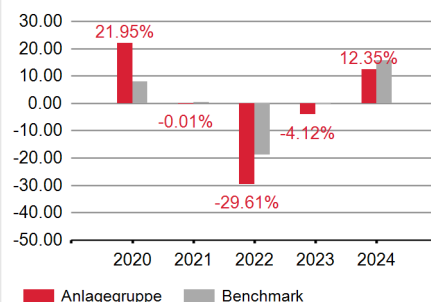
### Performance in Referenzwährung

	Kumulierte Performance				Annualisierte Performance			
	YTD	1 Monat	3 Monate	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Aufl.
Anlagegruppe	1.88%	-0.42%	1.88%	3.34%	-6.26%	3.63%	-	-1.92%
Benchmark	0.49%	-1.32%	0.49%	6.47%	0.12%	6.03%	-	0.02%

### Statistische Angaben (annualisiert)

	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Aufl.
Volatilität Anlagegruppe (in %)	8.18	13.85	14.58	-	16.06
Volatilität Benchmark (in %)	9.27	14.39	14.02	-	15.51
Tracking Error ex post (in %)	2.58	4.77	5.11	-	5.02
Information Ratio	-1.21	-1.34	-0.47	-	-0.39
Sharpe Ratio	0.28	-0.53	0.22	-	-0.12
Korrelation	0.96	0.94	0.94	-	0.95
Beta	0.85	0.91	0.97	-	0.98
Jensen-Alpha	-2.32	-6.46	-2.25	-	-1.94
Maximum Drawdown (in %)	-13.87	-32.46	-45.54	-	-45.54
Recovery Period (Jahre)	0.52	-	-	-	-

### Performance



### Produktinformationen

**Valorenummer:** 39561902  
**ISIN:** CH0395619023  
**LEI:** 254900OLXTUB1EYJLV86  
**Bloomberg-Code:** SWLAKEM SW  
**Benchmark:** MSCI Emerging Markets, in CHF  
**Währung:** CHF  
**Domizil:** Schweiz  
**Aufledgedatum:** 01/02/2018  
**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% Amundi / 50% Robeco

**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](http://www.swisslife.ch/anlagestiftung)

**Betriebsaufwandquote TER KGAST ex ante:** 0.83%

**ex post per:** 30/09/2024 0.86%

### Portfoliostruktur nach Branchen

	Anlagegruppe	Benchmark
Finanzen	25.01%	24.21%
Informationstechnologie	21.01%	21.95%
Zyklische Konsumgüter	17.75%	14.58%
Kommunikationsdienste	9.27%	10.27%
Immobilien	5.55%	1.66%
Industrieunternehmen	5.15%	6.30%
Nichtzyklische Konsumgüter	4.20%	4.72%
Roh- und Grundstoffe	3.84%	5.91%
Versorgungsbetriebe	3.00%	2.62%
Energie	2.68%	4.45%
Gesundheitswesen	1.66%	3.33%
Liquidität	0.89%	-

### Grösste Positionen

	Anlagegruppe	Benchmark
TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFACTURING CO LT	8.14%	8.73%
TENCENT HOLDINGS LTD	5.16%	5.27%
ALIBABA GROUP HOLDING LTD	3.73%	3.40%
SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	3.60%	2.59%
HDFC BANK LTD	2.92%	1.53%
NASPERS LTD	1.79%	0.27%
ICICI BANK LTD ADR	1.53%	-
HCL TECHNOLOGIES LTD	0.91%	0.11%
PICC PROPERTY & CASUALTY CO LTD	0.90%	0.08%
INFOSYS LTD	0.89%	-

### Portfoliostruktur nach Ländern/Regionen

	Anlagegruppe	Benchmark
China	29.75%	31.24%
Indien	17.47%	18.36%
Taiwan	13.66%	17.06%
Korea	11.03%	9.09%
Brasilien	4.56%	4.35%
Südafrika	4.51%	3.00%
Übrige Länder Asien	5.37%	4.25%
Übrige Länder EMEA	9.85%	9.85%
Übrige Länder Amerika	2.91%	2.80%
Liquidität	0.89%	-

### Portfoliostruktur nach Währungen

	Anlagegruppe	Benchmark
HKD	22.28%	25.17%
INR	14.41%	18.36%
TWD	13.87%	17.09%
KRW	11.18%	9.09%
USD	9.32%	2.85%
EUR	1.75%	0.57%
Übrige	27.19%	26.88%

### Weitere Angaben zu den Gesellschaften

Anzahl Gesellschaften	260
Anteil Nicht-Benchmark-Gesellschaften	4.42%