

Anlagestiftung Swiss Life Aktien Global Small Caps

Nettovermögen (NAV) in Mio. CHF: 208.69
Nettovermögen pro Anspruch in CHF: 119.02

Anlagestrategie

Anlagen in kleinkapitalisierte Beteiligungspapiere weltweit. Aktive Länder-, Branchen- und Titelselektion. Gesellschaftsbegrenzung: 5%. Umsetzung mittels Invesco Global Small Cap Equity Fund und Dimensional Global Small Cap Equity Fund.

Wertentwicklung in Referenzwährung (Basis 100)



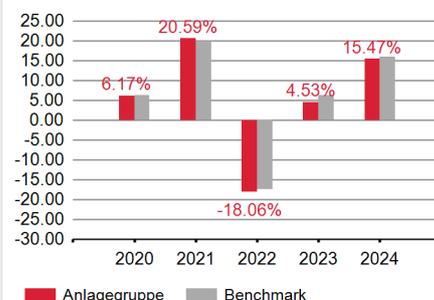
Performance in Referenzwährung

	Kumulierte Performance				Annualisierte Performance			
	YTD	1 Monat	3 Monate	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Aufl.
Anlagegruppe	-6.75%	-6.01%	-6.75%	-3.48%	-0.40%	11.42%	-	2.49%
Benchmark	-6.25%	-5.15%	-6.25%	-2.14%	0.25%	11.68%	-	4.11%

Statistische Angaben (annualisiert)

	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Aufl.
Volatilität Anlagegruppe (in %)	13.86	16.86	16.85	-	19.12
Volatilität Benchmark (in %)	12.49	16.55	16.37	-	18.71
Tracking Error ex post (in %)	2.17	1.90	1.93	-	2.33
Information Ratio	-0.62	-0.34	-0.14	-	-0.70
Sharpe Ratio	-0.33	-0.08	0.62	-	0.13
Korrelation	0.99	0.99	0.99	-	0.99
Beta	1.10	1.01	1.02	-	1.01
Jensen-Alpha	-1.03	-0.64	-0.53	-	-1.68
Maximum Drawdown (in %)	-12.07	-19.54	-27.71	-	-41.83
Recovery Period (Jahre)	0.25	0.40	-	-	0.73

Performance



Produktinformationen

Valorennummer: 40068789

ISIN: CH0400687890

LEI: 254900XCUD9NTWJQU706

Bloomberg-Code: SWLAGSC SW

Benchmark: MSCI AC World Small Cap, in CHF

Währung: CHF

Domizil: Schweiz

Aufledgedatum: 28/02/2018

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% Invesco / 50% Dimensional

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

Betriebsaufwandquote TER KGAST

ex ante: 0.82%

ex post per: 30/09/2024 0.84%

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.

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
Industrieunternehmen	20.35%	19.66%
Finanzen	17.19%	15.77%
Zyklische Konsumgüter	13.04%	12.54%
Gesundheitswesen	11.93%	9.38%
Informationstechnologie	11.78%	10.48%
Roh- und Grundstoffe	6.94%	7.95%
Immobilien	6.04%	8.46%
Nichtzyklische Konsumgüter	4.11%	4.92%
Kommunikationsdienste	3.34%	3.48%
Energie	3.04%	4.39%
Versorgungsbetriebe	1.69%	2.97%
Liquidität	0.55%	-

Grösste Positionen

	Anlagegruppe	Benchmark
ASKER HEALTHCARE	1.11%	-
SIGMAROC	0.55%	0.01%
CACTUS	0.53%	0.02%
PINNACLE FINANCIAL PARTNERS	0.51%	0.05%
OLLIES BARGAIN OUTLET	0.50%	0.04%
CASTROL INDIA	0.49%	0.01%
MR COOPER	0.47%	0.04%
PIPER SANDLER	0.46%	0.02%
PLANISWARE	0.45%	0.00%
BANCORP	0.44%	0.01%

Portfoliostruktur nach Ländern/Regionen

	Anlagegruppe	Benchmark
USA	59.17%	56.45%
Japan	8.09%	12.08%
Grossbritannien	6.91%	4.49%
Kanada	2.28%	3.48%
Frankreich	2.02%	1.11%
Deutschland	1.80%	1.38%
Übriges Europa	10.58%	8.48%
Übrige Länder Asien	5.52%	8.29%
Übrige	3.09%	4.23%
Liquidität	0.55%	-

Portfoliostruktur nach Währungen

	Anlagegruppe	Benchmark
USD	61.73%	56.78%
EUR	8.34%	6.15%
JPY	8.13%	12.08%
GBP	6.51%	4.49%
CHF	1.78%	1.50%
Übrige	13.50%	19.00%

Weitere Angaben zu den Gesellschaften

Anzahl Gesellschaften	6'667
Anteil Nicht-Benchmark-Gesellschaften	22.96%