

31. März 2025

Anlagestiftung Swiss Life Aktien Global ex Schweiz ESG PM



Nettovermögen (NAV) in Mio. CHF: 474.58
Nettovermögen pro Anspruch in CHF: 191.06

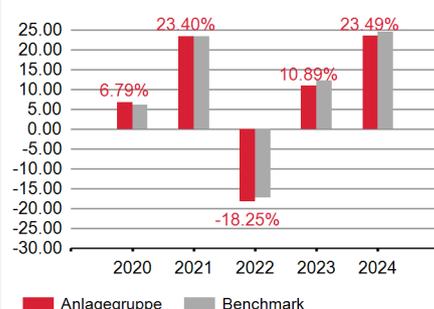
Anlagestrategie

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.

Wertentwicklung in Referenzwährung (Basis 100)



Performance



Produktinformationen

Valorennummer: 3026051
ISIN: CH0030260514
LEI: 2549000B6X3SG0K4LZ68
Bloomberg-Code: SLAAUPM 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: 31/05/2007
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 | -5.96% | -6.05% | -5.96% | -0.06% | 3.43% | 12.44% | 7.13% | 3.69% |
| Benchmark | -6.04% | -6.24% | -6.04% | 0.70% | 4.34% | 13.02% | 7.61% | 4.24% |

Statistische Angaben (annualisiert)

| | 1 Jahr | 3 Jahre | 5 Jahre | 10 Jahre | Aufl. |
|---------------------------------|--------|---------|---------|----------|--------|
| Volatilität Anlagegruppe (in %) | 10.89 | 14.67 | 14.44 | 14.59 | 15.72 |
| Volatilität Benchmark (in %) | 10.88 | 14.69 | 14.39 | 14.50 | 15.72 |
| Tracking Error ex post (in %) | 0.64 | 0.50 | 0.52 | 0.61 | 0.91 |
| Information Ratio | -1.20 | -1.80 | -1.12 | -0.79 | -0.60 |
| Sharpe Ratio | -0.10 | 0.17 | 0.79 | 0.49 | 0.23 |
| Korrelation | 1.00 | 1.00 | 1.00 | 1.00 | 1.00 |
| Beta | 1.00 | 1.00 | 1.00 | 1.01 | 1.00 |
| Jensen-Alpha | -0.77 | -0.90 | -0.63 | -0.52 | -0.54 |
| Maximum Drawdown (in %) | -13.59 | -18.07 | -23.15 | -34.64 | -59.96 |
| Recovery Period (Jahre) | 0.26 | 1.36 | 1.47 | 0.67 | 7.75 |

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
Betriebsaufwandquote TER KGAST ex ante: 0.28%
ex post per: 30/09/2024 0.38%

PM-Tranche: Der Erwerb dieser Tranche ist nur im Rahmen einer speziellen Vereinbarung mit Swiss Life Asset Management AG möglich.
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, «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% |