

31. März 2025

Anlagestiftung Swiss Life Aktien Global Small Caps PM

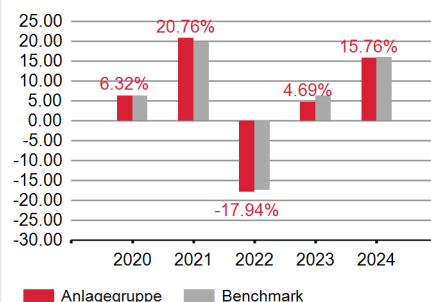


Nettovermögen (NAV) in Mio. CHF: 208.69
Nettovermögen pro Anspruch in CHF: 120.59

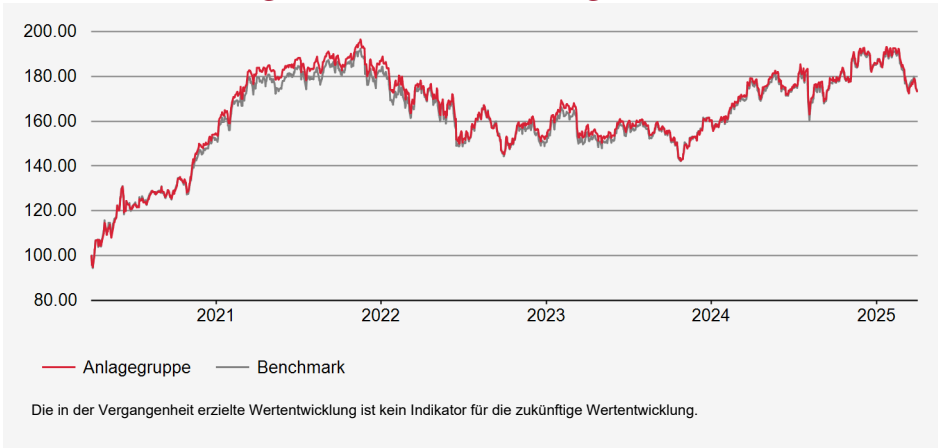
Anlagestrategie

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.

Performance



Wertentwicklung in Referenzwährung (Basis 100)



Produktinformationen

Valorennummer: 40068790
ISIN: CH0400687908
LEI: 254900XCUD9NTWJQU706
Bloomberg-Code: SLAGSPM 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

Performance in Referenzwährung

	Kumulierte Performance				Annualisierte Performance			
	YTD	1 Monat	3 Monate	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Aufl.
Anlagegruppe	-6.70%	-5.99%	-6.70%	-3.24%	-0.21%	11.61%	-	2.68%
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 %)	13.85	16.86	16.85	-	19.12
Volatilität Benchmark (in %)	12.49	16.55	16.37	-	18.71
Tracking Error ex post (in %)	2.16	1.91	1.93	-	2.33
Information Ratio	-0.51	-0.24	-0.04	-	-0.62
Sharpe Ratio	-0.31	-0.07	0.64	-	0.14
Korrelation	0.99	0.99	0.99	-	0.99
Beta	1.10	1.01	1.02	-	1.01
Jensen-Alpha	-0.79	-0.44	-0.33	-	-1.49
Maximum Drawdown (in %)	-12.06	-19.38	-27.52	-	-41.60
Recovery Period (Jahre)	0.25	0.40	-	-	0.73

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: 0.59%
ex post per: 30/09/2024 0.59%

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