

# Anlagestiftung Swiss Life

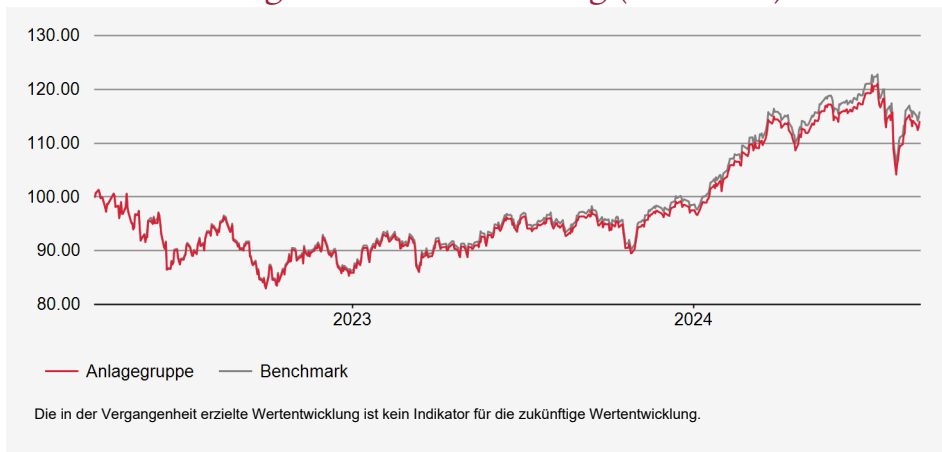
## Aktien Ausland ESG Indexiert

**Nettovermögen (NAV) in Mio. CHF: 353.47**  
**Nettovermögen pro Anspruch in CHF: 113.97**

### Anlagestrategie

Anlagen in Beteiligungspapieren von Gesellschaften, die im MSCI World ex Switzerland ESG Leaders, in CHF enthalten sind. Zugelassen sind auch Beteiligungspapieren von Gesellschaften, die aufgrund von Benchmark-Anpassungen noch nicht oder nicht mehr in der Benchmark enthalten sind (max. Abweichung +0.5 Prozentpunkte). Umsetzung mittels Swiss Life iFunds (CH) Equity ESG Global ex Switzerland (CHF).

### Wertentwicklung in Referenzwährung (Basis 100)



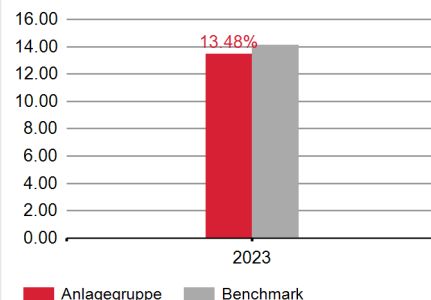
### Performance in Referenzwährung

	Kumulierte Performance				Annualisierte Performance			
	YTD	1 Monat	3 Monate	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Aufl.
Anlagegruppe	16.89%	-1.49%	-0.85%	18.50%	-	-	-	5.55%
Benchmark	17.50%	-1.40%	-0.65%	19.35%	-	-	-	6.23%

### Statistische Angaben (annualisiert)

	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Aufl.
Volatilität Anlagegruppe (in %)	11.77	-	-	-	15.07
Volatilität Benchmark (in %)	11.81	-	-	-	15.09
Tracking Error ex post (in %)	0.08	-	-	-	0.14
Information Ratio	-11.05	-	-	-	-4.61
Sharpe Ratio	1.31	-	-	-	0.28
Korrelation	1.00	-	-	-	1.00
Beta	1.00	-	-	-	1.00
Jensen-Alpha	-0.80	-	-	-	-0.67
Maximum Drawdown (in %)	-13.92	-	-	-	-18.04
Recovery Period (Jahre)	-	-	-	-	1.30

### Performance



### Produktinformationen

**Valorennummer:** 117189932  
**ISIN:** CH1171899326  
**LEI:** 254900Q154AKVWL8UQ41  
**Bloomberg-Code:** SWAEICI SW  
**Benchmark:** MSCI World ex Switzerland ESG Leaders Net Return  
**Währung:** CHF  
**Domizil:** Schweiz  
**Aufgagedatum:** 31/03/2022  
**Erstausgabepreis:** 100.00  
**Jahresabschluss:** 30.09  
**Ausgabe/Rücknahme:** Täglich  
**Annahmeschluss:** 13.00 Uhr  
**Ausgabe- / Rücknahmekommission:** Keine  
**Ausschüttungspraxis:** Thesaurierung  
**Asset Manager gemäss Swiss Life Best Select Invest Plus@:** UBS AG

**Externe Beratung:** PPCmetrics erbringt folgende Dienstleistungen: Beratung betreffend geeigneter Mandatsstruktur, Unterstützung bei der Selektion geeigneter Asset Manager sowie Unterstützung bei der laufenden Überwachung des Asset Managers und Beurteilung der Anlagesresultate.  
**Kurspublikationen:** Bloomberg: ASSL  
[www.swisslife.ch/anlagestiftung](http://www.swisslife.ch/anlagestiftung)  
**Betriebsaufwandquote TER KGAST ex ante:** 0.52%  
**ex post per:** 30/09/2023 0.52%

### Portfoliostruktur nach Branchen

	Anlagegruppe	Benchmark
Informationstechnologie	27.49%	27.91%
Finanzen	14.30%	14.80%
Gesundheitswesen	11.79%	12.08%
Industrieunternehmen	9.99%	10.48%
Zyklische Konsumgüter	9.76%	10.09%
Kommunikationsdienste	7.86%	8.03%
Nichtzyklische Konsumgüter	6.17%	6.26%
Roh- und Grundstoffe	3.54%	3.71%
Energie	2.54%	2.72%
Immobilien	2.17%	2.25%
Versorger	1.68%	1.67%
Liquidität	2.72%	-

### Grösste Positionen

	Anlagegruppe	Benchmark
MICROSOFT CORP	8.33%	8.32%
NVIDIA CORP	8.30%	8.43%
ALPHABET INC	5.07%	5.10%
ELI LILLY & CO	2.19%	2.19%
TESLA INC	1.74%	1.73%
NOVO NORDISK A/S	1.26%	1.28%
VISA INC	1.23%	1.23%
PROCTER & GAMBLE CO/THE	1.14%	1.14%
JOHNSON & JOHNSON	1.13%	1.13%
MASTERCARD INC	1.13%	1.14%

### Portfoliostruktur nach Ländern/Regionen

	Anlagegruppe	Benchmark
USA	73.56%	73.92%
Japan	4.73%	6.39%
Grossbritannien	3.68%	3.74%
Kanada	3.17%	3.15%
Frankreich	2.93%	2.98%
Deutschland	1.04%	1.00%
Übriges Europa	6.45%	6.50%
Übrige Länder Asien	1.71%	2.32%
Übrige	-	-
Liquidität	2.72%	-

### Portfoliostruktur nach Währungen

	Anlagegruppe	Benchmark
USD	73.77%	73.92%
EUR	7.48%	7.54%
JPY	6.39%	6.39%
GBP	3.80%	3.72%
Übrige	8.49%	9.01%