

Anlagestiftung Swiss Life

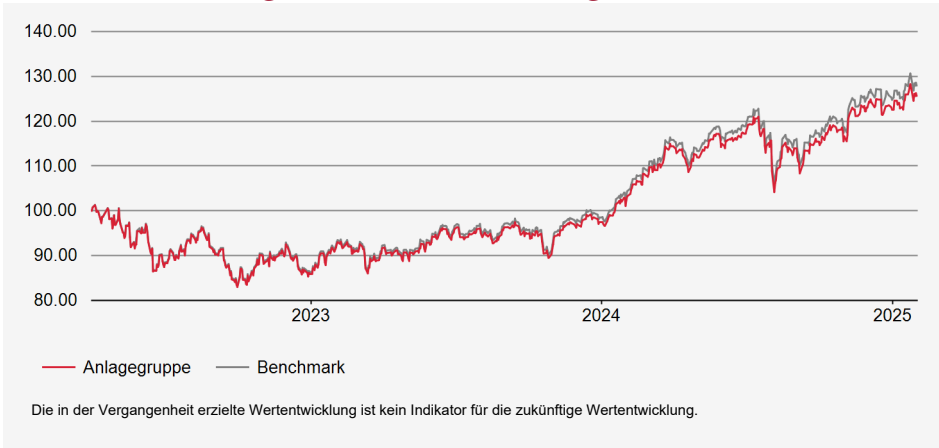
Aktien Global ex Schweiz ESG Indexiert

Nettovermögen (NAV) in Mio. CHF: 457.89
Nettovermögen pro Anspruch in CHF: 125.62

Anlagestrategie

Anlagen in Beteiligungspapiere von Gesellschaften, die im MSCI World ex Switzerland ESG Leaders Total Return enthalten sind. Zugelassen sind auch Beteiligungspapiere 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 Index Funds II (CH) Equity ESG Global ex Switzerland PF.

Wertentwicklung in Referenzwährung (Basis 100)



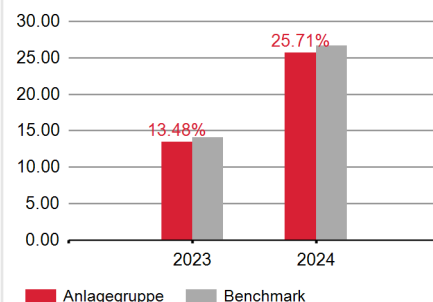
Performance in Referenzwährung

	Kumulierte Performance				Annualisierte Performance			
	YTD	1 Monat	3 Monate	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Aufl.
Anlagegruppe	2.49%	2.49%	8.77%	24.28%	-	-	-	8.36%
Benchmark	2.55%	2.55%	8.97%	25.20%	-	-	-	9.06%

Statistische Angaben (annualisiert)

	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Aufl.
Volatilität Anlagegruppe (in %)	10.74	-	-	-	14.40
Volatilität Benchmark (in %)	10.77	-	-	-	14.43
Tracking Error ex post (in %)	0.06	-	-	-	0.13
Information Ratio	-15.90	-	-	-	-5.08
Sharpe Ratio	1.91	-	-	-	0.48
Korrelation	1.00	-	-	-	1.00
Beta	1.00	-	-	-	1.00
Jensen-Alpha	-0.85	-	-	-	-0.69
Maximum Drawdown (in %)	-13.92	-	-	-	-18.04
Recovery Period (Jahre)	0.26	-	-	-	1.30

Performance



Produktinformationen

Valorennummer: 117189932
ISIN: CH1171899326
LEI: 254900Q154AKVWL8UQ41
Bloomberg-Code: SWAEICI SW
Benchmark: MSCI World ex Switzerland Selection (TR)
Währung: CHF
Domizil: Schweiz
Aufledgedatum: 31/03/2022
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

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 Anlageresultate.
Kurspublikationen: Bloomberg: ASSL
www.swisslife.ch/anlagestiftung
Betriebsaufwandquote TER KGAST ex ante: 0.36%
ex post per: 30/09/2024 0.52%

Anlagestiftung Swiss Life

Aktien Global ex Schweiz ESG Indexiert



Grösste Positionen

	Anlagegruppe	Benchmark
NVIDIA CORP	8.15%	8.15%
MICROSOFT CORP	8.11%	8.11%
ALPHABET INC-CL A	3.31%	3.31%
TESLA INC	3.22%	3.22%
ALPHABET INC-CL C	2.86%	2.86%
ELI LILLY & CO	1.81%	1.81%
VISA INC-CLASS A SHARES	1.58%	1.58%
MASTERCARD INC - A	1.27%	1.27%
HOME DEPOT INC	1.13%	1.13%
PROCTER & GAMBLE CO/THE	1.08%	1.08%

Portfoliostruktur nach Ländern/Regionen

	Anlagegruppe	Benchmark
Vereinigte Staaten	75.47%	75.49%
Japan	5.98%	5.98%
Vereinigtes Königreich	3.48%	3.48%
Kanada	3.28%	3.28%
Frankreich	2.79%	2.79%
Niederlande	1.68%	1.68%
Australien	1.53%	1.53%
Dänemark	1.16%	1.16%
Deutschland	1.15%	1.14%
Schweden	0.87%	0.87%
Italien	0.56%	0.56%
Spanien	0.50%	0.50%
Andere	1.54%	1.54%
Liquidität	0.02%	-

Portfoliostruktur nach Branchen

	Anlagegruppe	Benchmark
Informationstechnologie	27.52%	27.52%
Finanzen	16.00%	16.02%
Zyklische Konsumgüter	11.74%	11.74%
Industrieunternehmen	10.46%	10.47%
Gesundheitswesen	10.01%	10.02%
Kommunikationsdienste	9.03%	9.03%
Nichtzyklische Konsumgüter	5.64%	5.64%
Roh- und Grundstoffe	3.41%	3.39%
Energie	2.43%	2.44%
Immobilien	2.13%	2.14%
Versorgungsbetriebe	1.60%	1.60%
Liquidität	0.02%	-

Portfoliostruktur nach Währungen

	Anlagegruppe	Benchmark
USD	75.59%	75.61%
EUR	7.16%	7.16%
JPY	5.98%	5.98%
GBP	3.48%	3.48%
CAD	3.28%	3.28%
AUD	1.53%	1.53%
DKK	1.16%	1.16%
SEK	0.87%	0.87%
HKD	0.44%	0.43%
NOK	0.25%	0.25%
SGD	0.20%	0.20%
ILS	0.03%	0.03%
NZD	0.02%	0.02%