

Nettovermögen (NAV) in Mio. CHF: 633.75
Nettovermögen pro Anspruch in CHF: 220.55

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 iFunds (CH) Equity Global ex Switzerland (CHF), Invesco Global Small Cap Equity Fund, Dimensional Global Small Cap Equity Fund und des Fonds Candriam Equities L Emerging Markets.

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	21.89%	2.85%	4.00%	39.49%	13.75%	12.60%	11.64%	4.01%
BENCHMARK	22.27%	2.90%	4.33%	39.80%	14.04%	13.19%	12.41%	5.19%

Statistische Angaben (annualisiert)

	1 JAHR	3 JAHRE	5 JAHRE	10 JAHRE	AUFL.
Volatilität Anlagegruppe (in %)	12.60	18.55	15.21	13.24	15.64
Volatilität Benchmark (in %)	12.59	18.49	15.17	13.18	15.88
Tracking Error ex post (in %)	0.54	0.47	0.59	0.74	1.47
Information Ratio	-0.58	-0.62	-0.98	-1.04	-0.80
Sharpe Ratio	2.69	0.73	0.83	0.87	0.24
Korrelation	1.00	1.00	1.00	1.00	1.00
Beta	1.00	1.00	1.00	1.00	0.98
Jensen-Alpha	-0.28	-0.34	-0.61	-0.80	-1.08
Maximum Drawdown (in %)	-4.51	-34.66	-34.66	-34.66	-60.40
Recovery Period (Jahre)	0.06	0.67	0.67	0.67	7.84

Benchmark: 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.

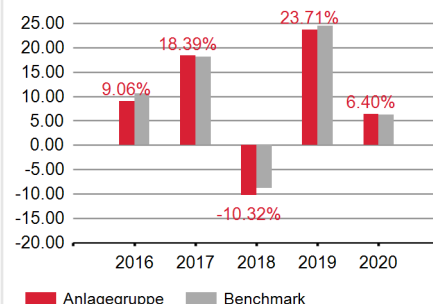
Betriebsaufwandquote TER KGAST: Die Betriebsaufwandquote TER KGAST deckt sämtliche Kosten mit Ausnahme der Transaktionskosten und der transaktionsbezogenen steuerlichen Abgaben ab.

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.

Performance



Produktinformationen

Valorennummer: 1245539

ISIN: CH0012455397

LEI: 2549000B6X3SG0K4LZ68

Bloomberg-Code: SWAAKAU SW

Benchmark: 80% MSCI World ex CH in CHF, 15% MSCI AC World Small Cap in CHF, 5% MSCI Emerging Markets in CHF

Währung: CHF

Domizil: Schweiz

Aufgagedatum: 30/09/2001

Ausgabepreis: 100.00

Jahresabschluss: 30.09

Ausgabe/Rücknahme: Täglich

Annahmeschluss: 14.30 Uhr

Ausgabe-/Rücknahmekommission: Keine

Ausschüttungspraxis: Thesaurierung

Asset Manager gemäss Swiss Life Best Select Invest Plus® Large&Mid Caps (passiv)

UBS AG

Small Caps (aktiv)

50% Invesco / 50% Dimensional

Emerging Markets (aktiv)

Candriam Investors Group

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: 0.73%

ex post per: 30/09/2021 0.73%

Portfoliostruktur nach Branchen

	Anlagegruppe	Benchmark
INFORMATIONSTECHNOLOGIE	22.21%	22.01%
FINANZEN	14.48%	14.00%
ZYKLISCHE KONSUMGÜTER	13.22%	12.95%
GESUNDHEITSWESEN	11.11%	11.39%
INDUSTRIEUNTERNEHMEN	11.06%	10.81%
TELEKOMMUNIKATIONSDIENSTLEISTUNGEN	8.08%	8.25%
NICHTZYKLISCHE KONSUMGÜTER	5.69%	5.93%
ROH- UND GRUNDSTOFFE	4.46%	4.59%
ENERGIE	3.37%	3.54%
IMMOBILIEN	3.27%	3.81%
VERSORGUNGSBETRIEBE	2.66%	2.71%
LIQUIDITÄT	0.40%	-

Grösste Positionen

	Anlagegruppe	Benchmark
APPLE INC	3.41%	3.39%
MICROSOFT CORP.	3.24%	3.22%
ALPHABET INC-CL C	2.39%	2.38%
AMAZON.COM INC	2.09%	2.07%
TESLA INC	1.24%	1.24%
FACEBOOK INC	1.06%	1.05%
NVIDIA	0.87%	0.86%
JPMORGAN CHASE & COMPANY	0.71%	0.70%
UNITEDHEALTH GROUP INC	0.59%	0.59%
JOHNSON & JOHNSON	0.59%	0.58%

Portfoliostruktur nach Ländern/Regionen

	Anlagegruppe	Benchmark
USA	64.58%	64.66%
JAPAN	6.77%	6.84%
GROSSBRITANNIEN	4.31%	4.30%
KANADA	3.03%	3.19%
FRANKREICH	3.00%	2.85%
DEUTSCHLAND	2.43%	2.37%
ÜBRIGE LÄNDER ASIEN	6.71%	7.05%
ÜBRIGES EUROPA	6.41%	6.29%
ÜBRIGE	2.35%	2.44%
LIQUIDITÄT	0.40%	-

Weitere Angaben zu den Gesellschaften

Anzahl Gesellschaften	8'383
Anteil Nicht-Benchmark-Gesellschaften	4.02%