

Anlagestiftung Swiss Life Aktien Global Small Caps

Nettovermögen (NAV) in Mio. CHF: 113.10
Nettovermögen pro Anspruch in CHF: 124.71

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.

Wertentwicklung in Referenzwährung (Basis 100)



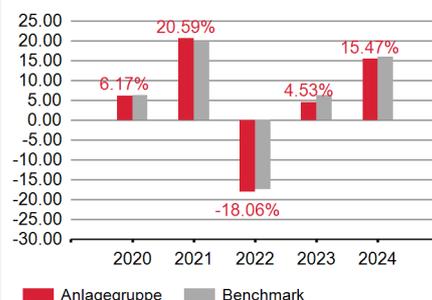
Performance in Referenzwährung

| | Kumulierte Performance | | | | Annualisierte Performance | | | |
|--------------|------------------------|---------|----------|--------|---------------------------|---------|----------|-------|
| | YTD | 1 Monat | 3 Monate | 1 Jahr | 3 Jahre | 5 Jahre | 10 Jahre | Aufl. |
| Anlagegruppe | -2.30% | 2.83% | 11.50% | -1.13% | 3.86% | 7.93% | - | 3.02% |
| Benchmark | -2.23% | 3.16% | 11.19% | 0.13% | 4.15% | 8.12% | - | 4.51% |

Statistische Angaben (annualisiert)

| | 1 Jahr | 3 Jahre | 5 Jahre | 10 Jahre | Aufl. |
|---------------------------------|--------|---------|---------|----------|--------|
| Volatilität Anlagegruppe (in %) | 16.02 | 15.85 | 16.28 | - | 19.00 |
| Volatilität Benchmark (in %) | 14.98 | 15.53 | 15.87 | - | 18.59 |
| Tracking Error ex post (in %) | 1.92 | 1.84 | 1.85 | - | 2.29 |
| Information Ratio | -0.66 | -0.16 | -0.11 | - | -0.65 |
| Sharpe Ratio | -0.11 | 0.18 | 0.45 | - | 0.16 |
| Korrelation | 0.99 | 0.99 | 0.99 | - | 0.99 |
| Beta | 1.06 | 1.01 | 1.02 | - | 1.01 |
| Jensen-Alpha | -1.23 | -0.34 | -0.35 | - | -1.55 |
| Maximum Drawdown (in %) | -21.56 | -21.56 | -27.71 | - | -41.83 |
| Recovery Period (Jahre) | - | - | - | - | 0.73 |

Performance



Produktinformationen

Valorennummer: 40068789

ISIN: CH0400687890

LEI: 254900XCUD9NTWJQU706

Bloomberg-Code: SWLAGSC SW

Benchmark: MSCI AC World Small Cap, in CHF

Währung: CHF

Domizil: Schweiz

Aufliedatum: 28/02/2018

Erstausgabepreis: 100.00

Jahresabschluss: 30.09

Ausgabe/Rücknahme: Täglich

Annaheschluss: 14.00 Uhr (T-1)

Verwässerungsschutz:
Ausgabe- / Rücknahmekommission zugunsten der Anlagegruppe gemäss Konditionenübersicht.

Asset Management gemäss Swiss Life Best Select Invest Plus @:
50% Invesco / 50% Dimensional

Überwachung Asset Manager:
Überwachung der Anlageresultate des eingesetzten Vermögensverwalters durch PPCmetrics

Kurspublikationen: Bloomberg: ASSL
www.swisslife.ch/anlagestiftung

Betriebsaufwandquote TER KGAST

ex ante: 0.82%

ex post per: 30/09/2024 0.84%

Portfoliostruktur nach Branchen

| | Anlagegruppe | Benchmark |
|----------------------------|--------------|-----------|
| Industrieunternehmen | 24.38% | 21.19% |
| Finanzen | 17.11% | 15.48% |
| Zyklische Konsumgüter | 12.99% | 12.44% |
| Informationstechnologie | 12.83% | 11.65% |
| Gesundheitswesen | 11.19% | 8.89% |
| Roh- und Grundstoffe | 6.06% | 7.26% |
| Nichtzyklische Konsumgüter | 3.82% | 4.70% |
| Kommunikationsdienste | 3.17% | 3.66% |
| Immobilien | 3.10% | 7.87% |
| Energie | 2.51% | 4.02% |
| Versorgungsbetriebe | 1.97% | 2.83% |
| Liquidität | 0.89% | - |

Grösste Positionen

| | Anlagegruppe | Benchmark |
|-----------------------|--------------|-----------|
| ASKER HEALTHCARE | 1.18% | - |
| SAMSUNG FIRE & MARINE | 0.65% | - |
| PFISTERER | 0.61% | - |
| DT MIDSTREAM | 0.59% | 0.05% |
| PIPER SANDLER | 0.57% | 0.03% |
| REV | 0.56% | 0.01% |
| BANCORP | 0.55% | 0.01% |
| SIGMAROC | 0.52% | 0.01% |
| CASTROL INDIA | 0.52% | 0.00% |
| AEROVIRONMENT | 0.50% | 0.04% |

Portfoliostruktur nach Ländern/Regionen

| | Anlagegruppe | Benchmark |
|---------------------|--------------|-----------|
| USA | 58.86% | 56.67% |
| Japan | 8.52% | 11.59% |
| Grossbritannien | 6.41% | 4.36% |
| Deutschland | 2.43% | 1.46% |
| Kanada | 1.98% | 3.41% |
| Frankreich | 1.79% | 1.14% |
| Übriges Europa | 10.00% | 8.37% |
| Übrige Länder Asien | 6.14% | 8.78% |
| Übrige | 2.99% | 4.23% |
| Liquidität | 0.89% | - |

Portfoliostruktur nach Währungen

| | Anlagegruppe | Benchmark |
|--------|--------------|-----------|
| USD | 61.94% | 57.03% |
| JPY | 8.54% | 11.59% |
| EUR | 8.34% | 6.20% |
| GBP | 5.86% | 4.36% |
| CHF | 1.40% | 1.64% |
| Übrige | 13.91% | 19.18% |

Weitere Angaben zu den Gesellschaften

| | |
|---------------------------------------|--------|
| Anzahl Gesellschaften | 6'544 |
| Anteil Nicht-Benchmark-Gesellschaften | 25.20% |