

Anlagestiftung Swiss Life

Aktien Schweiz Small & Mid Caps

Nettovermögen (NAV) in Mio. CHF: 164.32
Nettovermögen pro Anspruch in CHF: 126.62

Anlagestrategie

Anlagen in Beteiligungspapiere von Gesellschaften, die im Swiss Performance Index Extra vertreten sind. Aktive Branchen- und Titelselektion. Gesellschaftsbegrenzung: 5% (Ausnahme: sofern im Benchmark; max. 5%-Punkte mehr als Benchmarkgewichtung). Umsetzung mittels Einsatz des Swiss Life iFunds (CH) Equity Switzerland Small & Mid Cap (CHF); Anlagefonds schweizerischen Rechts der Kategorie "Übrige Fonds für traditionelle Anlagen".

Wertentwicklung in Referenzwährung (Basis 100)



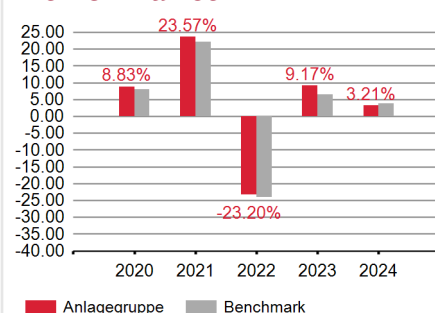
Performance in Referenzwährung

	Kumulierte Performance				Annualisierte Performance			
	YTD	1 Monat	3 Monate	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Aufl.
Anlagegruppe	2.78%	-3.08%	2.78%	0.85%	-0.32%	7.80%	-	3.35%
Benchmark	3.10%	-2.63%	3.10%	2.34%	-1.20%	7.02%	-	2.68%

Statistische Angaben (annualisiert)

	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Aufl.
Volatilität Anlagegruppe (in %)	10.99	14.35	14.68	-	15.22
Volatilität Benchmark (in %)	10.12	14.00	14.45	-	15.12
Tracking Error ex post (in %)	1.13	1.64	1.59	-	1.58
Information Ratio	-1.31	0.53	0.49	-	0.42
Sharpe Ratio	-0.01	-0.09	0.49	-	0.22
Korrelation	1.00	0.99	0.99	-	0.99
Beta	1.08	1.02	1.01	-	1.00
Jensen-Alpha	-1.60	0.92	0.70	-	0.67
Maximum Drawdown (in %)	-7.73	-23.01	-31.60	-	-31.60
Recovery Period (Jahre)	0.11	1.65	-	-	-

Performance



Produktinformationen

Valorennummer: 39561890
ISIN: CH0395618900
LEI: 254900QGENUS1GIJ4549
Bloomberg-Code: SWLASM SW
Benchmark: SPI EXTRA® Total Return
Währung: CHF
Domizil: Schweiz
Aufgatedatum: 01/02/2018
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®:
Privatbank Von Graffenried 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: 0.93%
ex post per: 30/09/2024 0.94%

Portfoliostruktur nach Branchen

	Anlagegruppe	Benchmark
Industrieunternehmen	31.23%	28.52%
Gesundheitswesen	22.28%	21.07%
Finanzen	13.82%	17.74%
Nichtzyklische Konsumgüter	12.11%	10.58%
Informationstechnologie	5.25%	4.22%
Roh- und Grundstoffe	3.87%	3.91%
Immobilien	3.17%	7.96%
Utilities	2.03%	1.13%
Zyklische Konsumgüter	1.64%	3.63%
Kommunikationsdienste	-	1.22%
Energie	-	-
Liquidität	4.58%	-

Grösste Positionen

	Anlagegruppe	Benchmark
LINDT & SPRÜNGLI	7.94%	7.78%
SGS SA	5.56%	4.44%
SANDOZ GROUP AG	5.50%	5.09%
SCHINDLER HOLDING AG	4.93%	5.21%
JULIUS BAER GROUP LTD	4.43%	3.90%
STRAUMANN HOLDING AG	4.06%	3.90%
BALOISE HOLDING AG	3.38%	2.40%
VAT GROUP AG	3.20%	2.64%
GALDERMA GROUP AG	2.58%	3.16%
GALENICA AG	2.44%	1.24%

Portfoliostruktur nach Unternehmensgrösse

	Anlagegruppe		Benchmark	
	Anteil	Anzahl	Anteil	Anzahl
Grosse Unternehmen	11.76%	3	8.99%	2
Mittlere Unternehmen	80.40%	45	82.78%	78
Kleine Unternehmen	3.26%	3	8.23%	104
Liquidität	4.58%	-	-	-