

Anlagestiftung Swiss Life

Aktien Emerging Markets ESG PM

Nettovermögen (NAV) in Mio. CHF: 218.25
Nettovermögen pro Anspruch in CHF: 88.79

Anlagestrategie

Anlagen in Beteiligungspapiere von Gesellschaften mit Domizil in Entwicklungsländern. Aktive Länder-, Branchen- und Titelselektion. Umsetzung mittels Einsatz des Fonds Amundi Emerging Markets Equity Focus und des fonds Robeco Emerging Markets Equities; SICAV nach luxemburgischem Recht gemäss UCITS.

Wertentwicklung in Referenzwährung (Basis 100)



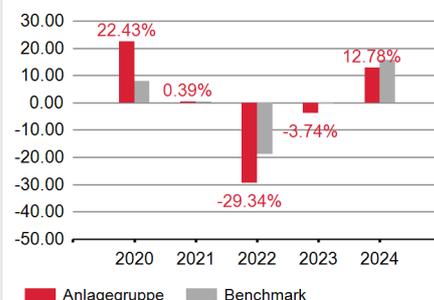
Performance in Referenzwährung

	Kumulierte Performance				Annualisierte Performance			
	YTD	1 Monat	3 Monate	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Aufl.
Anlagegruppe	1.98%	-0.38%	1.98%	3.74%	-5.90%	4.04%	-	-1.65%
Benchmark	0.49%	-1.32%	0.49%	6.47%	0.12%	6.03%	-	-0.07%

Statistische Angaben (annualisiert)

	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Aufl.
Volatilität Anlagegruppe (in %)	8.19	13.84	14.58	-	16.08
Volatilität Benchmark (in %)	9.27	14.39	14.02	-	15.52
Tracking Error ex post (in %)	2.57	4.77	5.11	-	5.02
Information Ratio	-1.06	-1.26	-0.39	-	-0.31
Sharpe Ratio	0.33	-0.51	0.25	-	-0.10
Korrelation	0.96	0.94	0.94	-	0.95
Beta	0.85	0.91	0.97	-	0.98
Jensen-Alpha	-1.92	-6.10	-1.84	-	-1.58
Maximum Drawdown (in %)	-13.84	-32.05	-44.96	-	-44.96
Recovery Period (Jahre)	0.16	-	-	-	-

Performance



Produktinformationen

Valorenummer: 39561964
ISIN: CH0395619643
LEI: 254900OLXTUB1EYJLV86
Bloomberg-Code: SWLAEPM SW
Benchmark: MSCI Emerging Markets, in CHF
Währung: CHF
Domizil: Schweiz
Aufledgedatum: 31/01/2018
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@:
50% Amundi / 50% Robeco

Externe Beratung:
PPCmetrics erbringt folgende Dienstleistungen: Beratung betreffend geeigneter Mandatsstrukturen, 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: 0.46%
ex post per: 30/09/2024 0.46%

PM-Tranche: Der Erwerb dieser Tranche ist nur im Rahmen einer speziellen Vereinbarung mit Swiss Life Asset Management AG möglich.

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.

Verwässerungsschutz: Konditionenübersicht abrufbar unter: www.swisslife.ch/anlagestiftung, «Rechtliche Dokumente» (Änderungen jederzeit ohne Vorankündigung möglich).

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.

Portfoliostruktur nach Branchen

	Anlagegruppe	Benchmark
Finanzen	25.01%	24.21%
Informationstechnologie	21.01%	21.95%
Zyklische Konsumgüter	17.75%	14.58%
Kommunikationsdienste	9.27%	10.27%
Immobilien	5.55%	1.66%
Industrieunternehmen	5.15%	6.30%
Nichtzyklische Konsumgüter	4.20%	4.72%
Roh- und Grundstoffe	3.84%	5.91%
Versorgungsbetriebe	3.00%	2.62%
Energie	2.68%	4.45%
Gesundheitswesen	1.66%	3.33%
Liquidität	0.89%	-

Grösste Positionen

	Anlagegruppe	Benchmark
TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFACTURING CO LT	8.14%	8.73%
TENCENT HOLDINGS LTD	5.16%	5.27%
ALIBABA GROUP HOLDING LTD	3.73%	3.40%
SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	3.60%	2.59%
HDFC BANK LTD	2.92%	1.53%
NASPERS LTD	1.79%	0.27%
ICICI BANK LTD ADR	1.53%	-
HCL TECHNOLOGIES LTD	0.91%	0.11%
PICC PROPERTY & CASUALTY CO LTD	0.90%	0.08%
INFOSYS LTD	0.89%	-

Portfoliostruktur nach Ländern/Regionen

	Anlagegruppe	Benchmark
China	29.75%	31.24%
Indien	17.47%	18.36%
Taiwan	13.66%	17.06%
Korea	11.03%	9.09%
Brasilien	4.56%	4.35%
Südafrika	4.51%	3.00%
Übrige Länder Asien	5.37%	4.25%
Übrige Länder EMEA	9.85%	9.85%
Übrige Länder Amerika	2.91%	2.80%
Liquidität	0.89%	-

Portfoliostruktur nach Währungen

	Anlagegruppe	Benchmark
HKD	22.28%	25.17%
INR	14.41%	18.36%
TWD	13.87%	17.09%
KRW	11.18%	9.09%
USD	9.32%	2.85%
EUR	1.75%	0.57%
Übrige	27.19%	26.88%

Weitere Angaben zu den Gesellschaften

Anzahl Gesellschaften	260
Anteil Nicht-Benchmark-Gesellschaften	4.42%