

Anlagestiftung Swiss Life

Aktien Global Small Caps PM

Nettovermögen (NAV) in Mio. CHF: 113.10
Nettovermögen pro Anspruch in CHF: 126.47

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)



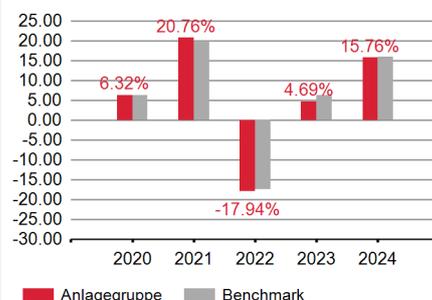
Performance in Referenzwährung

	Kumulierte Performance				Annualisierte Performance			
	YTD	1 Monat	3 Monate	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Aufl.
Anlagegruppe	-2.15%	2.85%	11.57%	-0.88%	4.07%	8.12%	-	3.21%
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	-	18.99
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	-0.52	-0.05	0.00	-	-0.57
Sharpe Ratio	-0.09	0.19	0.46	-	0.17
Korrelation	0.99	0.99	0.99	-	0.99
Beta	1.06	1.01	1.02	-	1.01
Jensen-Alpha	-0.98	-0.13	-0.15	-	-1.36
Maximum Drawdown (in %)	-21.52	-21.52	-27.52	-	-41.60
Recovery Period (Jahre)	-	-	-	-	0.73

Performance



Produktinformationen

Valorennummer: 40068790
ISIN: CH0400687908
LEI: 254900XCUD9NTWJQU706
Bloomberg-Code: SLAGSPM 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 Manager gemäss Swiss Life Best Select Invest Plus@:
 50% Invesco / 50% Dimensional

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: 0.59%

ex post per: 30/09/2024 0.59%

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
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%