

31. Mai 2025

Anlagestiftung Swiss Life

Aktien Global ex Schweiz ESG Indexiert

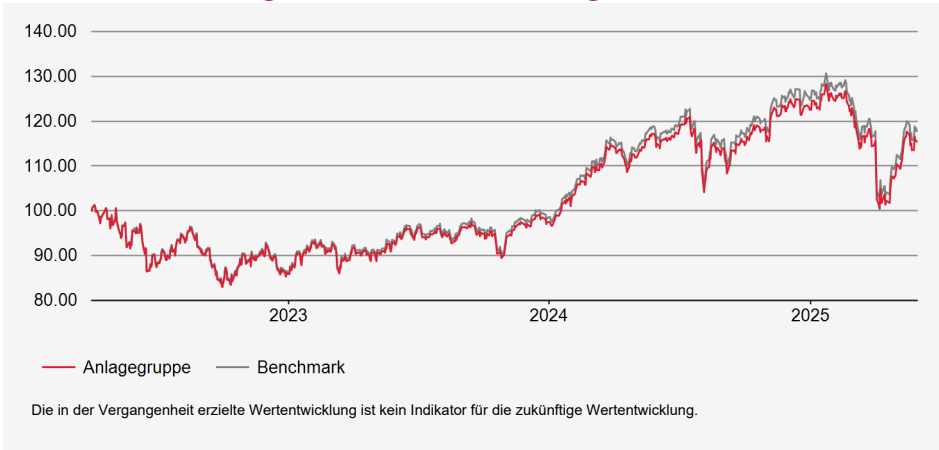


Nettovermögen (NAV) in Mio. CHF: 546.19
Nettovermögen pro Anspruch in CHF: 115.45

Anlagestrategie

Die Anlagegruppe wird mit einem indexierten Ansatz verwaltet und zeichnet sich durch eine breite Diversifikation und einen geringen Tracking Error aus. Das Anlageziel besteht darin, die Benchmark MSCI World ex Switzerland Selection Total Return nachzubilden. Umsetzung mittels Einsatz des Swiss Life Index Funds II (CH) Equity ESG Global ex Switzerland PF; vertraglicher Anlagefonds schweizerischen Rechts der Art "Übrige Fonds für traditionelle Anlagen". Es wird kein Securities Lending betrieben und es werden keine Investitionen in Titel getätigt, die vom Schweizer Verein für verantwortungsbewusste Kapitalanlagen (www.svk-asir.ch) zum Ausschluss empfohlen sind.

Wertentwicklung in Referenzwährung (Basis 100)



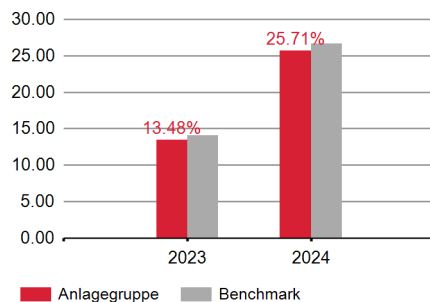
Performance in Referenzwährung

	Kumulierte Performance				Annualisierte Performance			
	YTD	1 Monat	3 Monate	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Aufl.
Anlagegruppe	-5.81%	7.16%	-6.06%	0.43%	6.63%	-	-	4.64%
Benchmark	-5.63%	7.23%	-5.97%	1.05%	7.26%	-	-	5.29%

Statistische Angaben (annualisiert)

	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Aufl.
Volatilität Anlagegruppe (in %)	14.59	15.70	-	-	15.25
Volatilität Benchmark (in %)	14.66	15.74	-	-	15.29
Tracking Error ex post (in %)	0.08	0.13	-	-	0.13
Information Ratio	-7.38	-5.04	-	-	-4.84
Sharpe Ratio	-0.02	0.35	-	-	0.23
Korrelation	1.00	1.00	-	-	1.00
Beta	1.00	1.00	-	-	1.00
Jensen-Alpha	-0.62	-0.62	-	-	-0.64
Maximum Drawdown (in %)	-21.66	-21.66	-	-	-21.66
Recovery Period (Jahre)	-	-	-	-	-

Performance



Produktinformationen

Valorennummer: 117189932
ISIN: CH1171899326
LEI: 254900Q154AKVWL8UQ41
Bloomberg-Code: SWAEICI SW
Benchmark: MSCI World ex Switzerland Selection (TR)
Währung: CHF
Domizil: Schweiz
Auflagedatum: 31/03/2022
Erstausgabepreis: 1000.00
Jahresabschluss: 30.09
Ausgabe/Rücknahme: Täglich
Annahmeschluss: 14.00 Uhr (T-1)
Verwässerungsschutz:
Ausgabe- / Rücknahmekommission zugunsten der Anlagegruppe gemäss Konditionenübersicht.
Asset Management:
Swiss Life Asset Management AG
Überwachung Asset Manager:
Überwachung der Anlageresultate des eingesetzten Vermögensverwalters durch PPCmetrics
Kurspublikationen: Bloomberg: ASSL
www.swisslife.ch/anlagestiftung
Betriebsaufwandquote TER KGAST
ex ante: 0.36%
ex post per: 30/09/2024 0.52%

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.

Anlagestiftung Swiss Life

Aktien Global ex Schweiz ESG Indexiert



Grösste Positionen

	Anlagegruppe	Benchmark
NVIDIA CORP	8.98%	8.98%
MICROSOFT CORP	8.85%	8.86%
TESLA INC	2.73%	2.73%
ALPHABET INC-CL A	2.73%	2.73%
ALPHABET INC-CL C	2.33%	2.33%
VISA INC-CLASS A SHARES	1.71%	1.71%
ELI LILLY & CO	1.62%	1.62%
MASTERCARD INC - A	1.30%	1.30%
PROCTER & GAMBLE CO/THE	1.08%	1.09%
JOHNSON & JOHNSON	1.02%	1.02%

Portfoliostruktur nach Ländern/Regionen

	Anlagegruppe	Benchmark
Vereinigte Staaten	73.51%	73.55%
Japan	5.96%	5.97%
Vereinigtes Königreich	3.79%	3.79%
Kanada	3.42%	3.42%
Frankreich	3.21%	3.20%
Niederlande	1.83%	1.83%
Australien	1.47%	1.47%
Deutschland	1.33%	1.33%
Schweden	1.20%	1.21%
Dänemark	1.05%	1.05%
Spanien	0.74%	0.74%
Italien	0.72%	0.72%
Andere	1.74%	1.73%
Liquidität	0.05%	-

Portfoliostruktur nach Branchen

	Anlagegruppe	Benchmark
Informationstechnologie	28.39%	28.41%
Finanzen	16.56%	16.56%
Industrieunternehmen	10.82%	10.82%
Zyklische Konsumgüter	10.25%	10.25%
Gesundheitswesen	9.72%	9.71%
Kommunikationsdienste	8.37%	8.38%
Nichtzyklische Konsumgüter	6.11%	6.11%
Roh- und Grundstoffe	3.28%	3.29%
Energie	2.28%	2.28%
Immobilien	2.20%	2.20%
Versorgungsbetriebe	1.98%	1.98%
Liquidität	0.05%	-

Portfoliostruktur nach Währungen

	Anlagegruppe	Benchmark
USD	73.85%	73.98%
EUR	8.36%	8.35%
JPY	6.02%	5.97%
GBP	3.82%	3.79%
CAD	3.42%	3.42%
AUD	1.48%	1.47%
DKK	1.05%	1.05%
SEK	0.93%	0.93%
HKD	0.55%	0.55%
Sonstige	0.51%	0.50%