

# Anlagestiftung Swiss Life Aktien Global ESG



**Nettovermögen (NAV) in Mio. CHF: 5.94**  
**Nettovermögen pro Anspruch in CHF: 94.26**

## Anlagestrategie

Die Anlagegruppe folgt einem Core-Satellite-Ansatz. Der Core-Teil des Portfolios mit rund 70% wird aktiv verwaltet und investiert mehrheitlich in Large und Mid-Caps und zeichnet sich durch ein starkes ESG-Profil aus. Die Umsetzung erfolgt durch den Swiss Life Funds (LUX) Equity ESG Global. Der Satellite-Teil des Portfolios von rund 30% investiert mehrheitlich in Small und Mid-Caps, die einen grossen Teil ihrer Einnahmen mit Produkten und Dienstleistungen erzielen, welche die ökologische Nachhaltigkeit fördern. Die Umsetzung der Satelliten erfolgt mit jeweils rund 10% in Swiss Life Funds (LUX) Equity Climate Impact, Swiss Life Funds (LUX) Equity Green Buildings & Infrastructure Impact und Swiss Life Funds (LUX) Equity Environment & Biodiversity Impact. Die Prozentsätze können innerhalb vorgegebener Bandbreiten schwanken. Die Gesellschaftsbegrenzung beträgt 5%.

## Wertentwicklung in Referenzwährung (Basis 100)



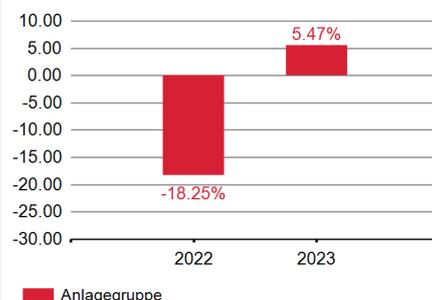
## Performance in Referenzwährung

|              | Kumulierte Performance |         |          |        | Annualisierte Performance |         |          |        |
|--------------|------------------------|---------|----------|--------|---------------------------|---------|----------|--------|
|              | YTD                    | 1 Monat | 3 Monate | 1 Jahr | 3 Jahre                   | 5 Jahre | 10 Jahre | Aufl.  |
| Anlagegruppe | 7.70%                  | 5.55%   | 10.50%   | 7.81%  | -                         | -       | -        | -2.59% |

## Statistische Angaben (annualisiert)

|                                 | 1 Jahr | 3 Jahre | 5 Jahre | 10 Jahre | Aufl.  |
|---------------------------------|--------|---------|---------|----------|--------|
| Volatilität Anlagegruppe (in %) | 11.61  | -       | -       | -        | 16.18  |
| Sharpe Ratio                    | 0.51   | -       | -       | -        | -0.20  |
| Maximum Drawdown (in %)         | -9.99  | -       | -       | -        | -21.96 |
| Recovery Period (Jahre)         | 0.23   | -       | -       | -        | -      |

## Performance



## Produktinformationen

**Valorenummer:** 113873862  
**ISIN:** CH1138738625  
**LEI:** 254900RNJ8UYJ3OTB72  
**Bloomberg-Code:** SWAGECI SW  
**Währung:** CHF  
**Domizil:** Schweiz  
**Aufledgedatum:** 30/11/2021  
**Erstausgabepreis:** 100.00  
**Jahresabschluss:** 30.9  
**Ausgabe/Rücknahme:** Täglich  
**Annahmeschluss:** 11 Uhr  
**Ausgabe-/Rücknahmekommission:** Keine  
**Ausschüttungspraxis:** Thesaurierung  
**Asset Manager:**  
Swiss Life Asset Management AG  
**Kurspublikationen:** Bloomberg: ASSL  
[www.swisslife.ch/anlagestiftung](http://www.swisslife.ch/anlagestiftung)  
**Betriebsaufwandquote TER KGAST**  
**ex ante:** 0.64%  
**ex post per:** 30/09/2023 0.64%

**Betriebsaufwandquote TER KGAST:** Die Betriebsaufwandquote TER KGAST deckt sämtliche Kosten mit Ausnahme der Transaktionskosten und der transaktionsbezogenen steuerlichen Abgaben ab.

**Performance:** Gesamtertrag über einen bestimmten Betrachtungszeitraum auf der Basis von zeitgewichteten Renditen.

**Statistische Angaben:** Die Risikokennzahlen basieren auf logarithmierten, monatlichen zeitgewichteten Renditen.

## Portfoliostruktur nach Branchen

|                            | Anlagegruppe |
|----------------------------|--------------|
| Informationstechnologie    | 22.21%       |
| Industrieunternehmen       | 18.50%       |
| Finanzen                   | 10.11%       |
| Zyklische Konsumgüter      | 9.25%        |
| Gesundheitswesen           | 8.18%        |
| Nichtzyklische Konsumgüter | 6.63%        |
| Kommunikationsdienste      | 5.55%        |
| Roh- und Grundstoffe       | 5.26%        |
| Versorgungsbetriebe        | 4.57%        |
| Immobilien                 | 3.81%        |
| Energie                    | 2.83%        |
| Equity index future        | 1.77%        |
| Liquidität                 | 1.32%        |

## Grösste Positionen

|                            | Anlagegruppe |
|----------------------------|--------------|
| MICROSOFT CORP             | 3.73%        |
| NVIDIA CORP                | 3.12%        |
| APPLE INC                  | 2.73%        |
| AMAZON.COM INC             | 1.48%        |
| ALPABET INC-CL             | 1.40%        |
| META PLATFORMS INC-CLASS A | 1.15%        |
| REPUBLIC SERVICES INC      | 0.88%        |
| BROADCOM INC               | 0.82%        |
| JPMORGAN CHASE & CO        | 0.79%        |
| WASTE MANAGEMENT INC       | 0.75%        |

## Portfoliostruktur nach Ländern/Regionen

|                                    | Anlagegruppe |
|------------------------------------|--------------|
| USA und Kanada                     | 66.44%       |
| Asien-Pazifik-Raum                 | 9.95%        |
| Europäische Region (Ex EUR)        | 9.41%        |
| Europäische Region (EUR)           | 8.93%        |
| Future auf Aktienindex             | 1.77%        |
| Norway                             | 1.21%        |
| Schwellenländer im mittleren Osten | 0.45%        |
| Schwellenländer Asien Pazifik      | 0.37%        |
| Schwellenländer Lateinamerika      | 0.10%        |
| Portugal                           | 0.06%        |
| Liquidität / Darlehen              | 1.32%        |

## Portfoliostruktur nach Währungen

|        | Anlagegruppe |
|--------|--------------|
| USD    | 61.08%       |
| EUR    | 11.56%       |
| JPY    | 7.26%        |
| GBP    | 4.04%        |
| CHF    | 1.78%        |
| Übrige | 14.27%       |