

# Anlagestiftung Swiss Life

## Aktien Global Protect Flex (CHF hedged)



**Nettovermögen (NAV) in Mio. CHF: 770.85**  
**Nettovermögen pro Anspruch in CHF: 153.34**

### Anlagestrategie

Regelbasierte aktive Anlagestrategie mit ergänzender Absicherungsstrategie. Anlageuniversum besteht aus Gesellschaften der wichtigsten ausländischen Börsenindizes (S&P 500, Euro Stoxx 50, FTSE 100 und Nikkei 225) sowie dem SMI; die Gewichtung erfolgt nach der Marktkapitalisierung. Die Fremdwährungsrisiken werden zu mindestens 90% gegen CHF abgesichert. Investitionen können in Form von Beteiligungspapieren, kollektiven Anlagen oder derivativen Instrumenten erfolgen. Der ergänzende Einsatz einer Absicherungsstrategie, bestehend aus Optionen, bewirkt bei stark sinkenden Märkten eine Verminderung der Kursverluste und bei stark steigenden Märkten eine Limitierung des Aufwärtspotentials („Put Spread Collar“). Je nach Markteinschätzung kann auf den Verkauf der Put-Option und/oder der Call-Option verzichtet werden. Umsetzung mittels Einsatz des SLF (CH) Equity Global Protect (CHF hedged).

### Wertentwicklung in Referenzwährung (Basis 100)



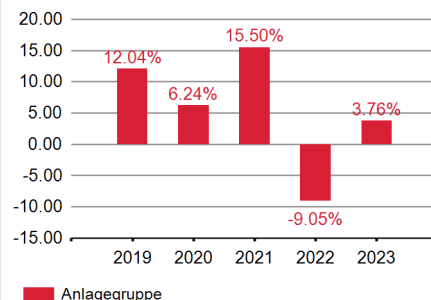
### Performance in Referenzwährung

	Kumulierte Performance				Annualisierte Performance			
	YTD	1 Monat	3 Monate	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Aufl.
Anlagegruppe	11.78%	-0.73%	1.36%	20.21%	2.58%	5.79%	-	5.15%

### Statistische Angaben (annualisiert)

	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Aufl.
Volatilität Anlagegruppe (in %)	6.78	10.17	9.90	-	8.41
Sharpe Ratio	2.50	0.18	0.55	-	0.62
Maximum Drawdown (in %)	-6.62	-14.58	-15.99	-	-15.99
Recovery Period (Jahre)	0.14	1.43	0.63	-	0.63

### Performance



### Produktinformationen

**Valorennummer:** 31952442

**ISIN:** CH0319524424

**LEI:** 254900LUAQC3MCOMWL48

**Bloomberg-Code:** SLAGPCH SW

**Währung:** CHF

**Domizil:** Schweiz

**Aufledgedatum:** 29/04/2016

**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:**

Swiss Life Asset Management AG

**Kurspublikationen:** Bloomberg: ASSL

[www.swisslife.ch/anlagestiftung](http://www.swisslife.ch/anlagestiftung)

**Betriebsaufwandquote TER KGAST**

**ex ante:** 0.60%

**ex post per:** 30/09/2024 0.60%

**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](http://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 Protect Flex (CHF hedged)



### Portfoliostruktur nach Branchen

	Anlagegruppe
Informationstechnologie	16.51%
Finanzen	15.62%
Industrieunternehmen	12.75%
Gesundheitswesen	12.65%
Nichtzyklische Konsumgüter	7.69%
Zyklische Konsumgüter	7.45%
Versorgungsbetriebe	5.49%
Kommunikationsdienste	5.28%
Roh- und Grundstoffe	3.87%
Energie	3.02%
Immobilien	2.83%
Future auf Aktienindex	0.79%
Liquidität / Darlehen	6.05%

### Grösste Positionen

	Anlagegruppe
T-MOBILE US INC	0.87%
WALMART INC	0.78%
INTL BUSINESS MACHINES CORP	0.77%
CISCO SYSTEMS INC	0.73%
CHUBB LTD	0.71%
JOHNSON & JOHNSON	0.70%
PEPSICO INC	0.67%
MOTOROLA SOLUTIONS INC	0.64%
ACCENTURE PLC-CL A	0.62%
ABBVIE INC	0.61%

### Portfoliostruktur nach Ländern/Regionen

	Anlagegruppe
USA und Kanada	69.29%
Europäische Region (EUR)	10.06%
Asien-Pazifik-Raum	7.89%
Europäische Region (Ex EUR)	5.55%
Future auf Aktienindex	0.79%
Schwellenländer Lateinamerika	0.34%
Schwellenländer Europa	0.03%
Liquidität / Darlehen	6.05%

**Haftungsausschluss:** Die vorliegende Publikation begründet weder eine Aufforderung noch eine Empfehlung zum Erwerb oder Verkauf von Anlageinstrumenten, sondern dient lediglich zu Informationszwecken. Sämtliche Dokumente, welche die rechtliche Grundlage für eine allfällige Investition bilden, können kostenlos bei der Anlagestiftung Swiss Life, c/o Swiss Life AG, Postfach, 8022 Zürich, Tel. 043 547 71 11 und unter [www.swisslife.ch/anlagestiftung](http://www.swisslife.ch/anlagestiftung) bezogen werden. Der Kreis der Anleger ist beschränkt auf Einrichtungen der 2. Säule und der Säule 3a sowie sonstige steuerbefreite Einrichtungen mit Sitz in der Schweiz, die ihrem Zweck nach der beruflichen Vorsorge dienen und Personen, die kollektive Anlagen für diese Einrichtungen verwalten, von der Eidgenössischen Finanzmarktaufsicht FINMA beaufsichtigt werden und bei der Stiftung ausschliesslich Gelder für diese Einrichtungen anlegen. Die vergangene Performance stellt keinen Indikator für die laufende und zukünftige Entwicklung dar. Sämtliche Produkt- und Firmennamen sind Marken<sup>TM</sup> oder eingetragene<sup>®</sup> Warenzeichen ihrer jeweiligen Inhaber. Ihre Verwendung stellt keine Zugehörigkeit zu ihnen und keine Zustimmung durch sie dar. **Quelle:** Swiss Life Asset Managers. Alle Rechte vorbehalten.