

Anlagestiftung Swiss Life

Aktien Schweiz Large Caps Indexiert

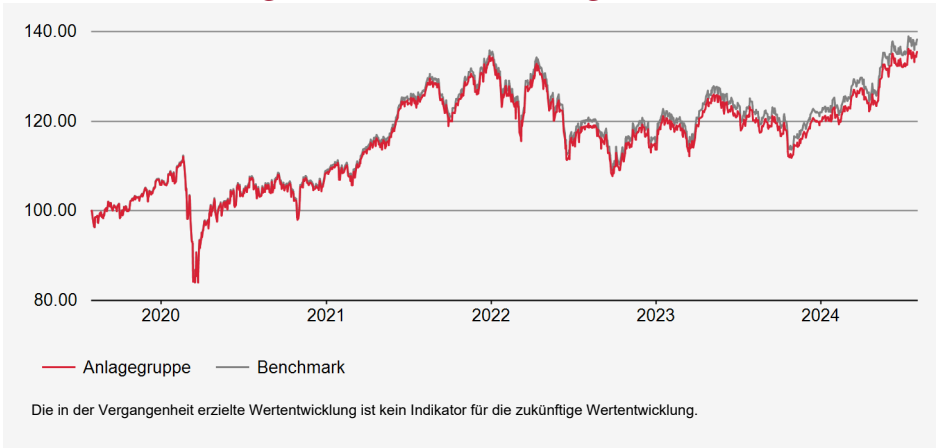


Nettovermögen (NAV) in Mio. CHF: 531.54
Nettovermögen pro Anspruch in CHF: 157.35

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 SPI® 20 Total Return nachzubilden. Umsetzung mittels Einsatz des Swiss Life Index Funds (CH) Equity Switzerland Large Cap; Anlagefonds schweizerischen Rechts der Kategorie "Übrige Fonds für traditionelle Anlagen.

Wertentwicklung in Referenzwährung (Basis 100)



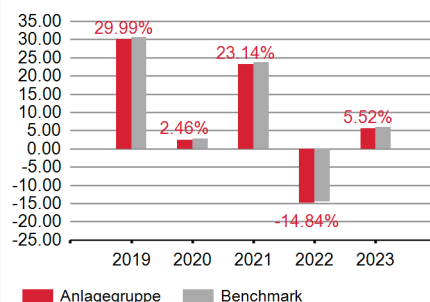
Performance in Referenzwährung

	Kumulierte Performance				Annualisierte Performance			
	YTD	1 Monat	3 Monate	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Aufl.
Anlagegruppe	12.94%	2.57%	9.31%	10.64%	2.64%	6.25%	-	7.22%
Benchmark	13.32%	2.60%	9.50%	11.18%	3.06%	6.68%	-	7.66%

Statistische Angaben (annualisiert)

	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Aufl.
Volatilität Anlagegruppe (in %)	11.49	12.85	12.43	-	12.43
Volatilität Benchmark (in %)	11.58	12.90	12.48	-	12.49
Tracking Error ex post (in %)	0.11	0.08	0.08	-	0.08
Information Ratio	-5.00	-5.40	-5.68	-	-5.69
Sharpe Ratio	0.74	0.16	0.48	-	0.57
Korrelation	1.00	1.00	1.00	-	1.00
Beta	0.99	1.00	1.00	-	1.00
Jensen-Alpha	-0.47	-0.41	-0.40	-	-0.40
Maximum Drawdown (in %)	-8.66	-19.89	-25.04	-	-25.04
Recovery Period (Jahre)	0.25	1.69	1.00	-	1.00

Performance



Produktinformationen

Valorennummer: 39561885

ISIN: CH0395618850

LEI: 254900P0FZIREAGSUQ60

Bloomberg-Code: SLASLCI SW

Benchmark: SPI® 20 Total Return

Währung: CHF

Domizil: Schweiz

Aufledgedatum: 01/02/2018

Erstausgabepreis: 100.00

Jahresabschluss: 30.09

Ausgabe/Rücknahme: Täglich

Annahmeschluss: 13.00 Uhr

Ausgabe- / Rücknahmekommission: Keine

Ausschüttungspraxis: Thesaurierung

Asset Manager gemäss

Swiss Life Best Select Invest Plus®:
Swiss Life Asset Management AG

Externe Beratung:

PPCmetrics erbringt folgende Dienstleistungen: Beratung betreffend geeigneter Mandatsstruktur, Unterstützung bei der Selektion geeigneter Asset Manager sowie Unterstützung bei der laufenden Überwachung des Asset Managers und Beurteilung der Anlageresultate.

Kurspublikationen: Bloomberg: ASSL
www.swisslife.ch/anlagestiftung

Betriebsaufwandquote TER KGAST

ex ante: 0.16%

ex post per: 30/09/2023 0.35%

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.

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

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

Anlagestiftung Swiss Life

Aktien Schweiz Large Caps Indexiert



Portfoliostruktur nach Branchen

	Anlagegruppe	Benchmark
Gesundheitswesen	38.48%	38.49%
Finanzen	18.06%	18.06%
Nichtzyklische Konsumgüter	17.94%	17.94%
Roh- und Grundstoffe	9.34%	9.34%
Industrieunternehmen	8.58%	8.58%
Zyklische Konsumgüter	5.53%	5.53%
Kommunikationsdienste	1.05%	1.05%
Informationstechnologie	1.00%	1.00%
Liquidität / Darlehen	0.03%	-

Grösste Positionen

	Anlagegruppe	Benchmark
NESTLE SA-REG	17.94%	17.94%
NOVARTIS AG-REG	15.48%	15.48%
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	15.42%	15.42%
UBS GROUP AG-REG	6.62%	6.62%
ABB LTD-REG	5.98%	5.98%
CIE FINANCIERE RICHEMO-A REG	5.53%	5.53%
ZURICH INSURANCE GROUP AG	5.43%	5.43%
HOLCIM LTD	3.42%	3.42%
LONZA GROUP AG-REG	3.36%	3.36%
SIKA AG-REG	3.29%	3.29%

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 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 MarkenTM oder eingetragene[®] 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.