31. März 2024

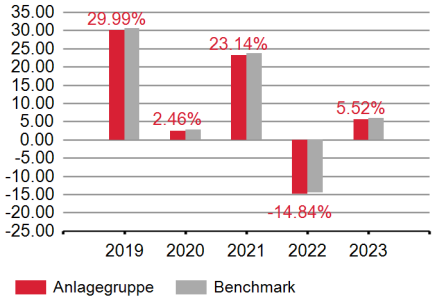
Anlagestiftung Swiss Life
Aktien Schweiz Large Caps Indexiert

Nettovermögen (NAV) in Mio. CHF: 504.42
Nettovermögen pro Anspruch in CHF: 147.89

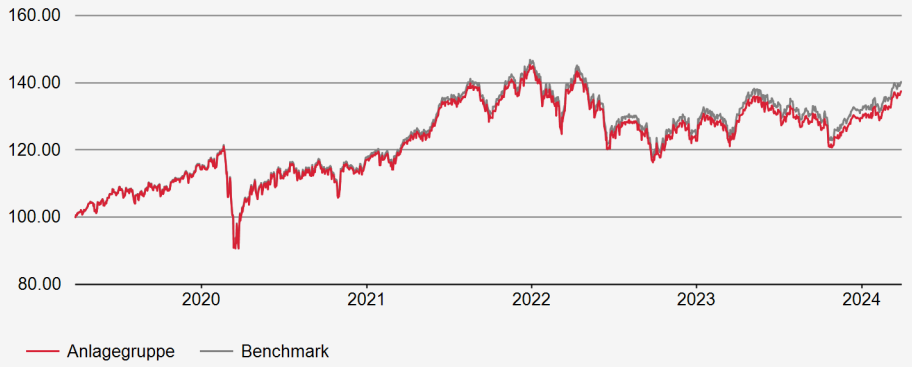
Anlagestrategie

Anlagen in Beteiligungspapiere von Gesellschaften, die im SPI 20 vertreten sind. Indexierte Umsetzung, wobei die Benchmark vollständig nachgebildet wird („full replication"). Die Gewichtung pro Gesellschaft darf maximal +/- 0.5 %-Punkte von der Benchmarkgewichtung abweichen. Umsetzung mittels Einsatz des Swiss Life iFunds (CH) Equity Switzerland (CHF); Anlagefonds schweizerischen Rechts der Kategorie "Übrige Fonds für traditionelle Anlagen.

Performance



Wertentwicklung in Referenzwährung (Basis 100)



Die in der Vergangenheit erzielte Wertentwicklung ist kein Indikator für die zukünftige Wertentwicklung.

Produktinformationen

Valorennummer: 39561885
ISIN: CH0395618850
LEI: 254900P0FZIREAGSUQ60
Bloomberg-Code: SLASLCI SW
Benchmark: SPI 20 Total Return®
Währung: CHF
Domizil: Schweiz
Auflagedatum: 01/02/2018
Erstausgabepreis: 100.00
Jahresabschluss: 30.09
Ausgabe/Rücknahme: Täglich
Annahmeschluss: 14.30 Uhr
Ausgabe-/Rücknahmekommission: Keine
Ausschüttungspraxis: Thesaurierung
Asset Manager gemäss Swiss Life Best Select Invest Plus®: Pictet 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: 0.35%
ex post per: 30/09/2023 0.35%

Performance in Referenzwährung

	Kumulierte Performance				Annualisierte Performance			
	YTD	1 Monat	3 Monate	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Aufl.
Anlagegruppe	6.15%	3.90%	6.15%	6.84%	4.12%	6.44%	-	6.56%
Benchmark	6.32%	3.99%	6.32%	7.36%	4.56%	6.87%	-	6.99%

Statistische Angaben (annualisiert)

	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Aufl.
Volatilität Anlagegruppe (in %)	9.95	12.56	12.20	-	12.44
Volatilität Benchmark (in %)	10.00	12.60	12.25	-	12.49
Tracking Error ex post (in %)	0.07	0.06	0.06	-	0.07
Information Ratio	-7.96	-7.32	-6.65	-	-6.17
Sharpe Ratio	0.50	0.29	0.52	-	0.53
Korrelation	1.00	1.00	1.00	-	1.00
Beta	0.99	1.00	1.00	-	1.00
Jensen-Alpha	-0.49	-0.42	-0.40	-	-0.40
Maximum Drawdown (in %)	-11.20	-19.89	-25.04	-	-25.04
Recovery Period (Jahre)	0.38	-	1.00	-	1.00

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.

31. März 2024

Anlagestiftung Swiss Life
Aktien Schweiz Large Caps Indexiert

Portfoliostruktur nach Branchen

	Anlagegruppe	Benchmark
Gesundheitswesen	34.47%	34.50%
Verbrauchsgüter	26.37%	26.39%
Finanzen	19.39%	19.41%
Industrieunternehmen	14.95%	14.96%
Grundstoffe	2.56%	2.56%
Telekommunikation	1.12%	1.12%
Technologie	1.07%	1.06%
Verbraucherservice	-	-
Erdöl und Erdgas	-	-
Versorger	-	-
Liquidität	0.09%	-

Grösste Positionen

	Anlagegruppe	Benchmark
NESTLE SA-REG	20.45%	20.47%
NOVARTIS AG-REG	14.32%	14.34%
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	12.91%	12.92%
UBS GROUP AG-REG	7.17%	7.18%
CIE FINANCIERE RICHEMONT-REG	5.91%	5.92%
ZURICH INSURANCE GROUP AG	5.70%	5.70%
ABB LTD-REG	5.42%	5.42%
HOLCIM LTD	3.54%	3.54%
SIKA AG	3.45%	3.45%
LONZA GROUP AG-REG	3.22%	3.22%

Portfoliostruktur nach Unternehmensgrösse

	Anlagegruppe		Benchmark	
	Anteil	Anzahl	Anteil	Anzahl
Grosse Unternehmen	96.70%	17	96.79%	17
Mittlere Unternehmen	3.21%	3	3.21%	3
Kleine Unternehmen	-	-	-	-
Liquidität	0.09%	-	-	-

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 Marken™ 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.