29. Februar 2024

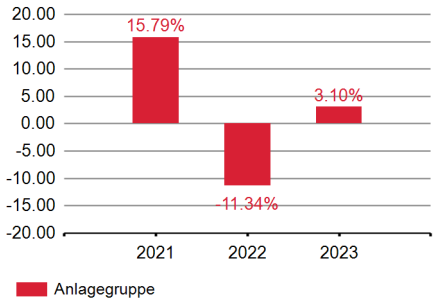
Anlagestiftung Swiss Life Aktien Schweiz Protect Flex

Nettovermögen (NAV) in Mio. CHF: 168.68
Nettovermögen pro Anspruch in CHF: 109.06

Anlagestrategie

SMI-indexierte Anlagestrategie mit aktiv verwalteter Optionsabsicherungsstrategie. Anlageuniversum besteht aus Gesellschaften des SMI; die Gewichtung erfolgt nach der Marktkapitalisierung. 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. Je nach Markteinschätzung kann auf den Verkauf der Put-Option und/oder der Call-Option verzichtet werden. Umsetzung mittels Einsatz des SLF (CH) Equity Switzerland Protect Enhanced.

Performance



Wertentwicklung in Referenzwährung (Basis 100)

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

Performance in Referenzwährung

	Kumulierte Performance				Annualisierte Performance			
	YTD	1 Monat	3 Monate	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Aufl.
Anlagegruppe	1.87%	0.57%	3.80%	3.35%	3.10%	-	-	2.75%

Statistische Angaben (annualisiert)

	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Aufl.
Volatilität Anlagegruppe (in %)	7.03	9.36	-	-	9.04
Sharpe Ratio	0.25	0.29	-	-	0.27
Maximum Drawdown (in %)	-9.05	-15.35	-	-	-15.35
Recovery Period (Jahre)	-	-	-	-	-

Produktinformationen

Valorennummer: 58002332
ISIN: CH0580023320
LEI: 254900ZUTROYHLYQ4E86
Bloomberg-Code: SLASPFC SW
Währung: CHF
Domizil: Schweiz
Auflagedatum: 18/12/2020
Erstausgabepreis: 100.00
Jahresabschluss: 30.09
Ausgabe/Rücknahme: Täglich
Annahmeschluss: 14.30 Uhr
Ausgabe-/Rücknahmekommission: Keine
Ausschüttungspraxis: Thesaurierung
Asset Manager
Swisslife Asset Management AG
Kurspublikationen: Bloomberg: ASSL
www.swisslife.ch/anlagestiftung
Betriebsaufwandquote TER KGAST
ex ante: 0.45%
ex post per: 30/09/2023 0.45%

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.
Tracking Error ex ante: Der erwartete Tracking Error für die nächsten 12 Monate entspricht dem ex post 3 Jahres Tracking Error.

29. Februar 2024

Anlagestiftung Swiss Life
Aktien Schweiz Protect Flex

Portfoliostruktur nach Branchen

	Anlagegruppe
Gesundheitswesen	34.88%
Finanzen	17.89%
Nichtzyklische Konsumgüter	14.81%
Roh- und Grundstoffe	8.65%
Industrieunternehmen	7.92%
Zyklische Konsumgüter	6.01%
Future auf Aktienindex	1.31%
Kommunikationsdienste	1.02%
Informationstechnologie	1.02%
Liquidität / Darlehen	6.48%

Grösste Positionen

	Anlagegruppe
NOVARTIS AG-REG	15.09%
NESTLE SA-REG	14.81%
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	12.99%
UBS GROUP AG-REG	6.15%
CIE FINANCIERE RICHEMO-A REG	6.01%
ZURICH INSURANCE GROUP AG	5.48%
ABB LTD-REG	5.24%
SIKA AG-REG	3.26%
HOLCIM LTD	3.04%
ALCON INC	2.99%

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.