

Anlagestiftung Swiss Life

Aktien Global Protect Flex PM (CHF hedged)



Nettovermögen (NAV) in Mio. CHF: 1'233.36
Nettovermögen pro Anspruch in CHF: 135.93

Anlagestrategie

Regelbasierte aktive Anlagestrategie mit ergänzender Absicherungsstrategie. Anlageuniversum besteht aus Gesellschaften der wichtigsten ausländischen Börsenindices (S&P 500, Euro Stoxx 50, FTSE 100 und Nikkei 225) sowie dem SMI; die Gewichtung erfolgt nach der Marktkapitalisierung oder einem alternativen Gewichtungsschema (z.B. Gleichgewichtung oder Minimum Volatilität). 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 Enhanced (CHF hedged).

Wertentwicklung in Referenzwährung (Basis 100)



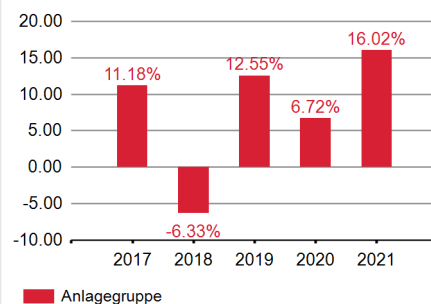
Performance in Referenzwährung

	KUMULIERTE PERFORMANCE				ANNUALISIERTE PERFORMANCE			
	YTD	1 MONAT	3 MONATE	1 JAHR	3 JAHRE	5 JAHRE	10 JAHRE	AUFL.
ANLAGEGRUPPE	-8.86%	5.78%	-2.20%	-6.66%	4.96%	3.85%	-	4.83%

Statistische Angaben (annualisiert)

	1 JAHR	3 JAHRE	5 JAHRE	10 JAHRE	AUFL.
Volatilität Anlagegruppe (in %)	12.89	10.85	9.45	-	8.44
Sharpe Ratio	-0.50	0.50	0.47	-	0.64
Maximum Drawdown (in %)	-14.29	-15.96	-15.96	-	-15.96
Recovery Period (Jahre)	-	0.63	0.63	-	0.63

Performance



Produktinformationen

Valorennummer: 31954200
ISIN: CH0319542004
LEI: 254900LUAQC3MC0MWL48
Bloomberg-Code: SLAGCPM SW
Währung: CHF
Domizil: Schweiz
Aufledgedatum: 29/04/2016
Ausgabepreis: 100.00
Jahresabschluss: 30.09
Ausgabe/Rücknahme: Täglich
Annahmeschluss: 14.30 Uhr
Ausgabe-/Rücknahmekommission: Keine
Ausschüttungspraxis: Thesaurierung
Asset Manager:
 Swiss Life Asset Management AG
Kurspublikationen: Bloomberg: ASSL
www.swisslife.ch/anlagestiftung
Betriebsaufwandquote TER KGAST
ex ante: 0.15%
ex post per: 30/09/2022 0.15%

PM-Tranche: Der Erwerb dieser Tranche ist nur im Rahmen einer speziellen Vereinbarung mit Swiss Life Asset Management AG möglich.

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.

Anlagestiftung Swiss Life

Aktien Global Protect Flex PM (CHF hedged)

Portfoliostruktur nach Branchen

	Anlagegruppe
FINANZEN	13.79%
INFORMATIONSTECHNOLOGIE	11.69%
GESUNDHEITSWESEN	10.37%
INDUSTRIEUNTERNEHMEN	10.05%
ZYKLISCHE KONSUMGÜTER	8.62%
NICHTZYKLISCHE KONSUMGÜTER	8.25%
FUTURE AUF AKTIENINDEX	6.62%
KOMMUNIKATIONSDIENSTE	6.30%
IMMOBILIEN	5.00%
VERSORGBUNGSBETRIEBE	4.78%
ROH- UND GRUNDSTOFFE	4.74%
ENERGIE	3.79%
LIQUIDITÄT / DARLEHEN	6.01%

Grösste Positionen

	Anlagegruppe
ELI LILLY & CO	1.65%
ALPHABET INC-CL C	1.12%
CHEVRON CORP	0.84%
PROLOGIS INC	0.82%
HOME DEPOT INC	0.81%
EXXON MOBIL CORP	0.81%
WASTE CONNECTIONS INC	0.75%
FAST RETAILING CO LTD	0.74%
JOHNSON & JOHNSON	0.67%
MICROSOFT CORP	0.66%

Portfoliostruktur nach Ländern/Regionen

	Anlagegruppe
USA UND KANADA	58.70%
EUROPÄISCHE REGION (EUR)	14.07%
EUROPÄISCHE REGION (EX EUR)	8.35%
FUTURE AUF AKTIENINDEX	6.62%
ASIEN-PAZIFIK-RAUM	5.93%
SCHWELLENLÄNDER ASIEN PAZIFIK	0.32%
LIQUIDITÄT / DARLEHEN	6.01%