

Anlagestiftung Swiss Life

Aktien Global Protect Flex PM (CHF hedged)

Nettovermögen (NAV) in Mio. CHF: 770.85
Nettovermögen pro Anspruch in CHF: 159.38

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. 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)



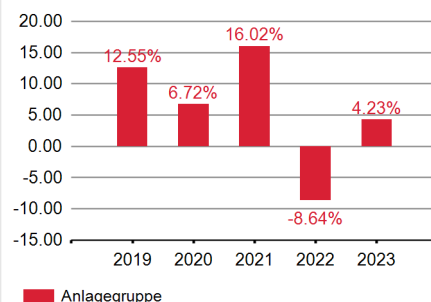
Performance in Referenzwährung

| | Kumulierte Performance | | | | Annualisierte Performance | | | |
|--------------|------------------------|---------|----------|--------|---------------------------|---------|----------|-------|
| | YTD | 1 Monat | 3 Monate | 1 Jahr | 3 Jahre | 5 Jahre | 10 Jahre | Aufl. |
| Anlagegruppe | 12.22% | -0.69% | 1.47% | 20.77% | 3.04% | 6.27% | - | 5.63% |

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 | 2.57 | 0.22 | 0.60 | - | 0.67 |
| Maximum Drawdown (in %) | -6.60 | -14.29 | -15.96 | - | -15.96 |
| Recovery Period (Jahre) | 0.14 | 1.42 | 0.63 | - | 0.63 |

Performance



Produktinformationen

Valorennummer: 31954200

ISIN: CH0319542004

LEI: 254900LUAQC3MCOMWL48

Bloomberg-Code: SLAGCPM SW

Währung: CHF

Domizil: Schweiz

Aufgatedatum: 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

Betriebsaufwandquote TER KGAST

ex ante: 0.15%

ex post per: 30/09/2024 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.

Verwässerungsschutz: Konditionenübersicht abrufbar unter: 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 PM (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 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. Zusätzlich müssen die erwähnten Anleger eine spezielle Vereinbarung mit der Swiss Life Asset Management AG abgeschlossen haben. 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.