

Anlagestiftung Swiss Life

Aktien Schweiz Large Caps Indexiert PM

Nettovermögen (NAV) in Mio. CHF: 401.82
Nettovermögen pro Anspruch in CHF: 134.25

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."

Wertentwicklung in Referenzwährung (Basis 100)



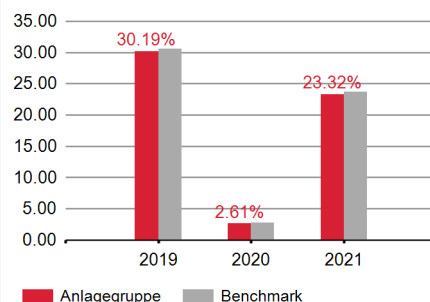
Performance in Referenzwährung

	KUMULIERTE PERFORMANCE				ANNUALISIERTE PERFORMANCE			
	YTD	1 MONAT	3 MONATE	1 JAHR	3 JAHRE	5 JAHRE	10 JAHRE	AUFL.
ANLAGEGRUPPE	-13.53%	4.99%	-2.99%	-8.15%	4.21%	-	-	6.40%
BENCHMARK	-13.40%	5.02%	-2.94%	-7.98%	4.44%	-	-	6.64%

Statistische Angaben (annualisiert)

	1 JAHR	3 JAHRE	5 JAHRE	10 JAHRE	AUFL.
Volatilität Anlagegruppe (in %)	15.37	13.95	-	-	13.14
Volatilität Benchmark (in %)	-	14.00	-	-	13.19
Tracking Error ex post (in %)	0.06	0.07	-	-	0.07
Information Ratio	-3.01	-3.41	-	-	-3.55
Sharpe Ratio	-0.52	0.34	-	-	0.52
Korrelation	1.00	1.00	-	-	1.00
Beta	1.00	1.00	-	-	1.00
Jensen-Alpha	-0.20	-0.22	-	-	-0.22
Maximum Drawdown (in %)	-19.80	-25.03	-	-	-25.03
Recovery Period (Jahre)	-	1.00	-	-	1.00

Performance



Produktinformationen

Valorennummer: 39561886

ISIN: CH0395618868

LEI: 254900P0FZIREAGSUQ60

Bloomberg-Code: SLASLPM SW

Benchmark: SPI 20 Total Return@

Währung: CHF

Domizil: Schweiz

Aufledgedatum: 31/01/2018

Ausgabepreis: 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: 0.20%

ex post per: 30/09/2022 0.20%

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

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 PM



Portfoliostruktur nach Branchen

	Anlagegruppe	Benchmark
GESUNDHEITSWESEN	41.58%	41.58%
VERBRAUCHSGÜTER	29.27%	29.28%
FINANZEN	15.28%	15.29%
INDUSTRIEUNTERNEHMEN	10.14%	10.14%
GRUNDSTOFFE	1.99%	1.98%
TELEKOMMUNIKATION	1.04%	1.05%
TECHNOLOGIE	0.68%	0.68%
VERBRAUCHERSERVICE	-	-
ERDÖL UND ERDGAS	-	-
VERSORGER	-	-
LIQUIDITÄT	0.01%	-

Grösste Positionen

	Anlagegruppe	Benchmark
NESTLE SA-REG	25.01%	25.01%
ROCHE HOLDING AG	19.49%	19.49%
NOVARTIS AG-REG	15.41%	15.41%
ZURICH INSURANCE GROUP AG	5.37%	5.36%
UBS GROUP AG-REG	4.32%	4.32%
CIE FINANCIERE RICHEMONT-REG	4.26%	4.26%
ABB LTD-REG	3.77%	3.77%
LONZA GROUP AG-REG	3.20%	3.20%
SIKA AG	2.89%	2.90%
ALCON INC	2.54%	2.54%

Portfoliostruktur nach Unternehmensgrösse

	Anlagegruppe		Benchmark	
	Anteil	Anzahl	Anteil	Anzahl
Grosse Unternehmen	98.26%	18	98.27%	18
Mittlere Unternehmen	1.73%	2	1.73%	2
Kleine Unternehmen	-	-	-	-
Liquidität	0.01%	-	-	-