

Anlagestiftung Swiss Life

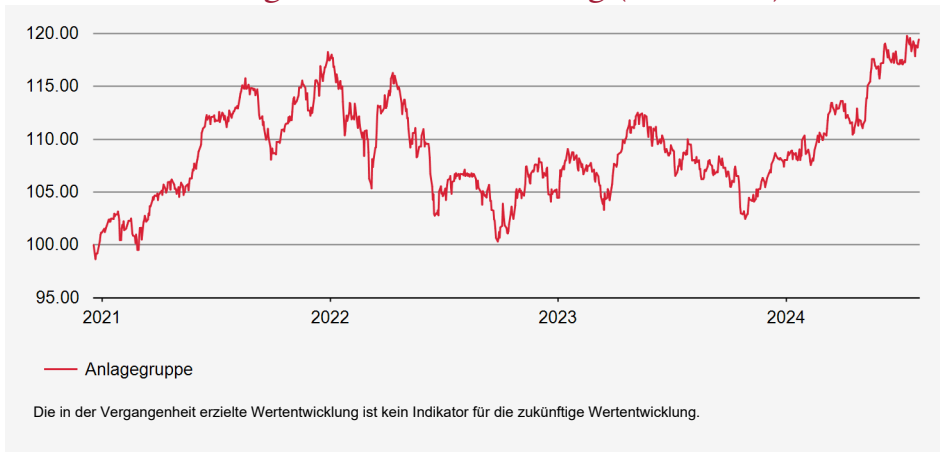
Aktien Schweiz Protect Flex PM

Nettovermögen (NAV) in Mio. CHF: 177.54
Nettovermögen pro Anspruch in CHF: 119.44

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.

Wertentwicklung in Referenzwährung (Basis 100)



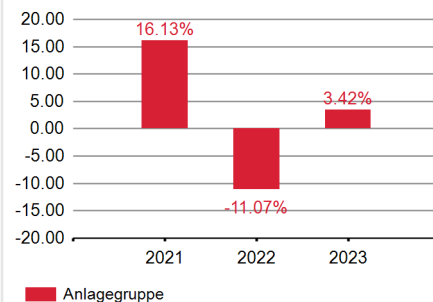
Performance in Referenzwährung

	Kumulierte Performance				Annualisierte Performance			
	YTD	1 Monat	3 Monate	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Aufl.
Anlagegruppe	10.55%	1.99%	7.23%	9.08%	1.97%	-	-	5.03%

Statistische Angaben (annualisiert)

	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Aufl.
Volatilität Anlagegruppe (in %)	8.65	9.37	-	-	9.10
Sharpe Ratio	0.82	0.14	-	-	0.49
Maximum Drawdown (in %)	-6.42	-15.16	-	-	-15.16
Recovery Period (Jahre)	0.25	1.69	-	-	1.69

Performance



Produktinformationen

Valorennummer: 58002364

ISIN: CH0580023643

LEI: 254900ZUTROYHLYQ4E86

Bloomberg-Code: SLSPFPM SW

Währung: CHF

Domizil: Schweiz

Aufledgedatum: 18/12/2020

Erstausgabepreis: 100.00

Jahresabschluss: 30.09

Ausgabe/Rücknahme: Täglich

Annahmeschluss: 13.00 Uhr

Ausgabe- / Rücknahmekommission:
Keine

Ausschüttungspraxis: Thesaurierung

Asset Manager

Swisslife Asset Management AG

Kurspublikationen: Bloomberg: ASSL
www.swisslife.ch/anlagestiftung

Betriebsaufwandquote TERK GAST

ex ante: 0.15%

ex post per: 30/09/2023 0.15%

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

Betriebsaufwandquote TER K GAST: Die Betriebsaufwandquote TER K GAST 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 Schweiz Protect Flex PM



Portfoliostruktur nach Branchen

	Anlagegruppe
Gesundheitswesen	36.38%
Finanzen	17.06%
Nichtzyklische Konsumgüter	14.93%
Roh- und Grundstoffe	8.82%
Industrieunternehmen	8.17%
Zyklische Konsumgüter	5.22%
Kommunikationsdienste	0.99%
Informationstechnologie	0.94%
Future auf Aktienindex	0.07%
Liquidität / Darlehen	7.41%

Grösste Positionen

	Anlagegruppe
NESTLE SA-REG	14.93%
NOVARTIS AG-REG	14.66%
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	14.56%
UBS GROUP AG-REG	6.25%
ABB LTD-REG	5.72%
CIE FINANCIERE RICHEMO-A REG	5.22%
ZURICH INSURANCE GROUP AG	5.13%
HOLCIM LTD	3.24%
LONZA GROUP AG-REG	3.17%
SIKA AG-REG	3.10%