

Anlagestiftung Swiss Life

Aktien Schweiz Protect Flex PM

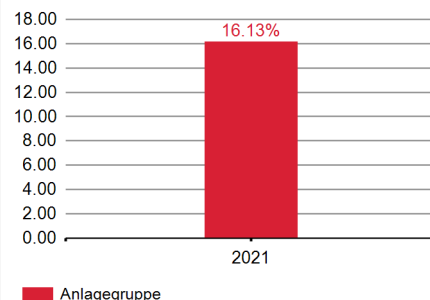


Nettovermögen (NAV) in Mio. CHF: 160.03
Nettovermögen pro Anspruch in CHF: 105.32

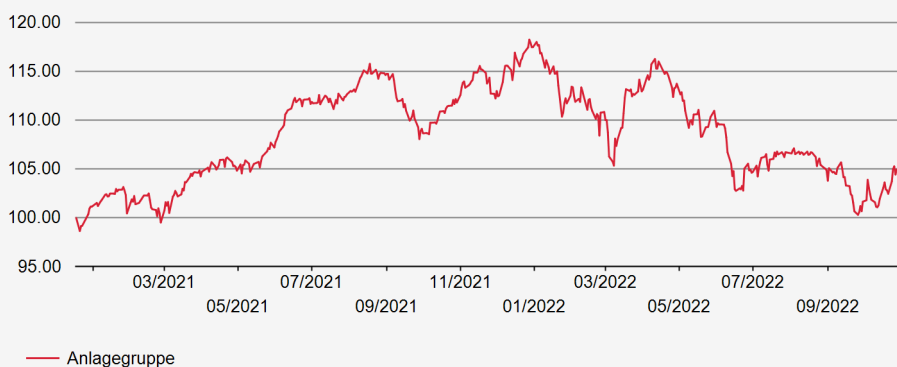
Anlagestrategie

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.

Produktinformationen

Valorennummer: 58002364
ISIN: CH0580023643
LEI: 254900ZUTROYHLYQ4E86
Bloomberg-Code: SLSPFPM SW
Währung: CHF
Domizil: Schweiz
Aufgatedatum: 18/12/2020
Ausgabepreis: 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 TERK GAST
ex ante: 0.16%
ex post per: 30/09/2022 0.16%

Performance in Referenzwährung

	KUMULIERTE PERFORMANCE				ANNUALISIERTE PERFORMANCE			
	YTD	1 MONAT	3 MONATE	1 JAHR	3 JAHRE	5 JAHRE	10 JAHRE	AUFL.
ANLAGEGRUPPE	-10.35%	3.60%	-1.29%	-5.80%	-	-	-	2.81%

Statistische Angaben (annualisiert)

	1 JAHR	3 JAHRE	5 JAHRE	10 JAHRE	AUFL.
Volatilität Anlagegruppe (in %)	10.90	-	-	-	10.20
Sharpe Ratio	-0.51	-	-	-	0.32
Maximum Drawdown (in %)	-15.16	-	-	-	-15.16
Recovery Period (Jahre)	-	-	-	-	-

PM-Tranche: 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.

Portfoliostruktur nach Branchen

	Anlagegruppe
GESUNDHEITSWESEN	38.20%
NICHTZYKLISCHE KONSUMGÜTER	15.56%
FINANZEN	15.27%
ROH- UND GRUNDSTOFFE	7.01%
INDUSTRIEUNTERNEHMEN	5.10%
ZYKLISCHE KONSUMGÜTER	4.26%
FUTURE AUF AKTIENINDEX	1.64%
KOMMUNIKATIONSDIENSTE	1.05%
INFORMATIONSTECHNOLOGIE	0.68%
LIQUIDITÄT / DARLEHEN	11.23%

Grösste Positionen

	Anlagegruppe
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	16.14%
NESTLE SA-REG	15.56%
NOVARTIS AG-REG	15.39%
ZURICH INSURANCE GROUP AG	5.36%
UBS GROUP AG-REG	4.31%
CIE FINANCIERE RICHEMO-A REG	4.26%
ABB LTD-REG	3.77%
LONZA GROUP AG-REG	3.20%
SIKA AG-REG	2.89%
ALCON INC	2.54%