

31. Oktober 2021

Anlagestiftung Swiss Life Aktien Schweiz Protect Flex

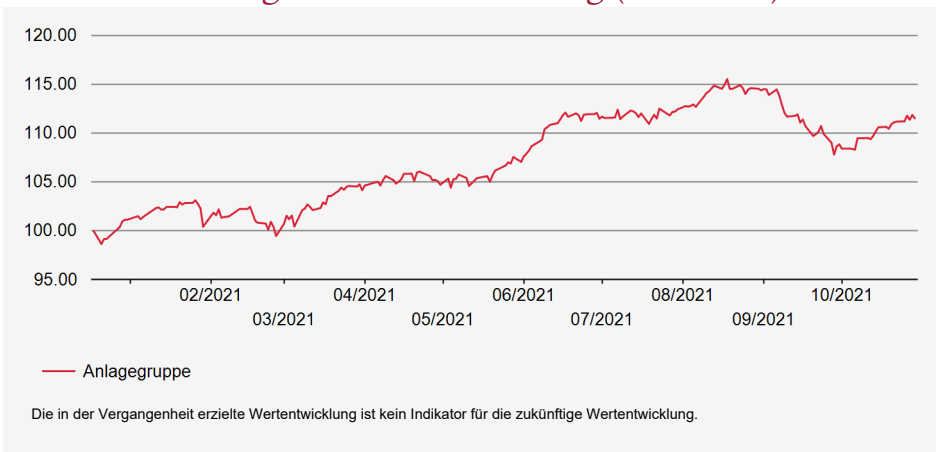


Nettovermögen (NAV) in Mio. CHF: 71.02
Nettovermögen pro Anspruch in CHF: 111.52

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	10.25%	2.44%	-0.82%	-	-	-	-	-

Statistische Angaben (annualisiert)

	1 JAHR	3 JAHRE	5 JAHRE	10 JAHRE	AUFL.
Volatilität Anlagegruppe (in %)	-	-	-	-	9.08
Sharpe Ratio	-	-	-	-	1.38
Maximum Drawdown (in %)	-	-	-	-	-6.68
Recovery Period (Jahre)	-	-	-	-	-

Performance

Datenhistorie unzureichend

Produktinformationen

Valorennummer: 58002332
ISIN: CH0580023320
LEI: 254900ZUTROYHLYQ4E86
Bloomberg-Code: SLASPCF SW
Währung: CHF
Domizil: Schweiz
Aufledgedatum: 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 TER KGAST
ex ante: 0.45%
ex post per: 30/09/2021 0.45%

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	37.10%
NICHTZYKLISCHE KONSUMGÜTER	17.12%
FINANZEN	16.10%
ROH- UND GRUNDSTOFFE	7.54%
INDUSTRIEUNTERNEHMEN	6.58%
FUTURE AUF AKTIENINDEX	4.85%
ZYKLISCHE KONSUMGÜTER	4.32%
INFORMATIONSTECHNOLOGIE	0.96%
KOMMUNIKATIONSDIENSTE	0.92%
LIQUIDITÄT / DARLEHEN	4.50%

Grösste Positionen

	Anlagegruppe
NESTLE SA-REG	17.12%
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	16.80%
NOVARTIS AG-REG	13.50%
ZURICH INSURANCE GROUP AG	4.43%
CIE FINANCIERE RICHEMO-A REG	4.32%
UBS GROUP AG-REG	4.23%
LONZA GROUP AG-REG	4.06%
ABB LTD-REG	3.52%
SIKA AG-REG	3.16%
ALCON INC	2.75%