31. Juli 2025

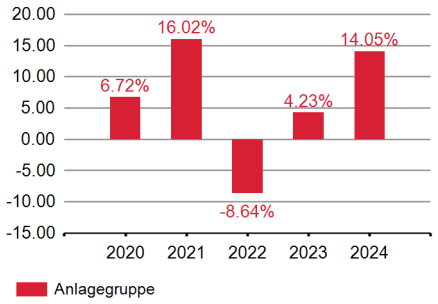
Anlagestiftung Swiss Life
Aktien Global Protect Flex PM (CHF hedged)

Nettovermögen (NAV) in Mio. CHF: 460.02
Nettovermögen pro Anspruch in CHF: 170.97

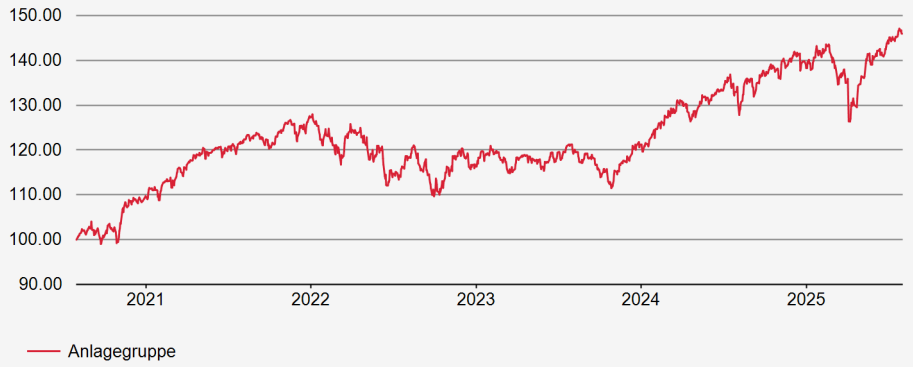
Anlagestrategie

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).

Performance



Wertentwicklung in Referenzwährung (Basis 100)



Die in der Vergangenheit erzielte Wertentwicklung ist kein Indikator für die zukünftige Wertentwicklung.

Performance in Referenzwährung

	Kumulierte Performance				Annualisierte Performance			
	YTD	1 Monat	3 Monate	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Aufl.
Anlagegruppe	5.55%	1.03%	8.33%	8.85%	7.13%	7.85%	-	5.96%

Statistische Angaben (annualisiert)

	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Aufl.
Volatilität Anlagegruppe (in %)	8.01	9.50	9.77	-	8.44
Sharpe Ratio	0.99	0.62	0.74	-	0.70
Maximum Drawdown (in %)	-12.00	-12.00	-14.29	-	-15.96
Recovery Period (Jahre)	0.22	0.22	1.42	-	0.63

Produktinformationen

Valorennummer: 31954200
ISIN: CH0319542004
LEI: 254900LUAQC3MC0MWL48
Bloomberg-Code: SLAGCPM SW
Währung: CHF
Domizil: Schweiz
Auflagedatum: 29/04/2016
Erstausgabepreis: 100.00
Jahresabschluss: 30.09
Ausgabe/Rücknahme: Täglich
Annahmeschluss: 13.00 Uhr
Verwässerungsschutz:
Ausgabe- / Rücknahmekommission zugunsten der Anlagegruppe gemäss Konditionenübersicht.
Asset Manager:
Swiss Life Asset Management AG
Kurspublikationen: Bloomberg: ASSL
www.swisslife.ch/anlagestiftung
Betriebsaufwandquote TER KGAST
ex ante: 0.14%
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.

31. Juli 2025

Anlagestiftung Swiss Life
Aktien Global Protect Flex PM (CHF hedged)

Portfoliostruktur nach Branchen

	Anlagegruppe
Informationstechnologie	16.73%
Finanzen	14.87%
Industrieunternehmen	11.84%
Gesundheitswesen	11.20%
Zyklische Konsumgüter	7.77%
Nichtzyklische Konsumgüter	7.17%
Versorgungsbetriebe	5.74%
Kommunikationsdienste	5.27%
Immobilien	3.24%
Energie	3.22%
Future auf Aktienindex	3.20%
Roh- und Grundstoffe	2.75%
Liquidität	7.00%

Grösste Positionen

	Anlagegruppe
WALMART INC	0.82%
AMPHENOL CORP-CL A	0.80%
INTL BUSINESS MACHINES CORP	0.80%
CONSOLIDATED EDISON INC	0.78%
MICROSOFT CORP	0.73%
CHUBB LTD	0.70%
CISCO SYSTEMS INC	0.70%
REPUBLIC SERVICES INC	0.64%
AUTOZONE INC	0.63%
WASTE CONNECTIONS INC	0.62%

Portfoliostruktur nach Ländern/Regionen

	Anlagegruppe
USA und Kanada	65.53%
Europäische Region (EUR)	10.79%
Asien-Pazifik-Raum	7.53%
Europäische Region (Ex EUR)	5.51%
Future auf Aktienindex	3.20%
Schwellenländer Lateinamerika	0.44%
Liquidität	7.00%

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. Dieses Dokument wurde möglicherweise mithilfe künstlicher Intelligenz erstellt. **Quelle:** Swiss Life Asset Managers. Alle Rechte vorbehalten.