

31. Oktober 2021

# Anlagestiftung Swiss Life Aktien Schweiz Protect Flex PM

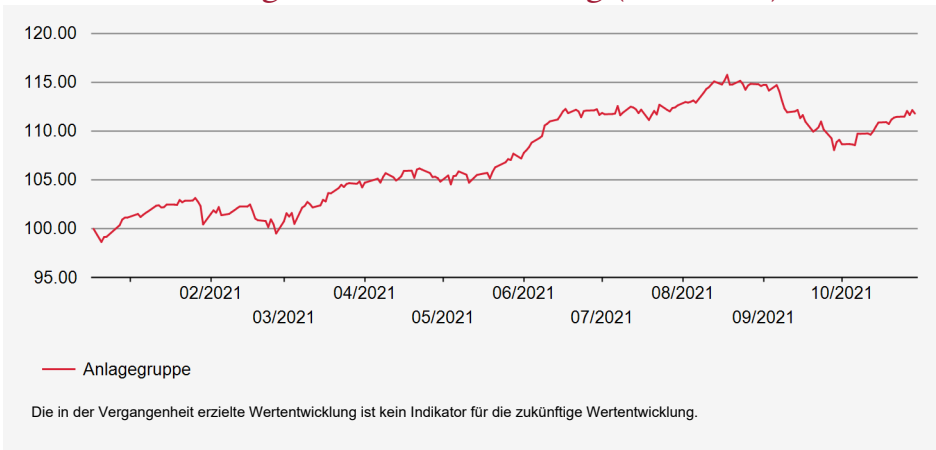


**Nettovermögen (NAV) in Mio. CHF: 71.02**  
**Nettovermögen pro Anspruch in CHF: 111.81**

## 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.    |
| <b>ANLAGEGRUPPE</b> | <b>10.53%</b>          | <b>2.47%</b> | <b>-0.74%</b> | <b>-</b> | <b>-</b>                  | <b>-</b> | <b>-</b> | <b>-</b> |

## Statistische Angaben (annualisiert)

|                                 | 1 JAHR | 3 JAHRE | 5 JAHRE | 10 JAHRE | AUFL. |
|---------------------------------|--------|---------|---------|----------|-------|
| Volatilität Anlagegruppe (in %) | -      | -       | -       | -        | 9.08  |
| Sharpe Ratio                    | -      | -       | -       | -        | 1.41  |
| Maximum Drawdown (in %)         | -      | -       | -       | -        | -6.65 |
| Recovery Period (Jahre)         | -      | -       | -       | -        | -     |

## Performance

Datenhistorie unzureichend

## Produktinformationen

**Valorennummer:** 58002364  
**ISIN:** CH0580023643  
**LEI:** 254900ZUTROYHLYQ4E86  
**Bloomberg-Code:** SLSPPFM 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](http://www.swisslife.ch/anlagestiftung)  
**Betriebsaufwandquote TERK GAST**  
**ex ante:** 0.15%  
**ex post per:** 30/09/2021 0.15%

**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           | 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%        |