

Anlagestrategie

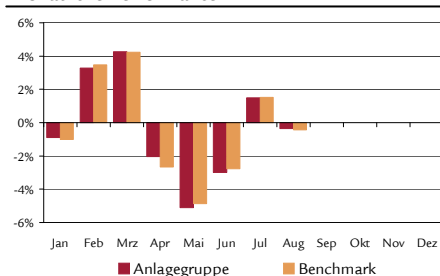
- Anlagen in Beteiligungspapiere von Gesellschaften, die im Swiss Performance Index (SPI) vertreten sind
- Large Caps werden passiv abgedeckt, Small & Mid Caps werden aktiv verwaltet (Core-Satellite)
- Gesellschaftsbegrenzung: 25% (Ausnahme: bei sehr hoher Benchmarkgewichtung max. 30%)
- Umsetzung mittels Einsatz der Swiss Life iFunds (CH) Equity Switzerland (CHF) und Equity Switzerland Small & Mid Cap (CHF)

Produkteinformationen

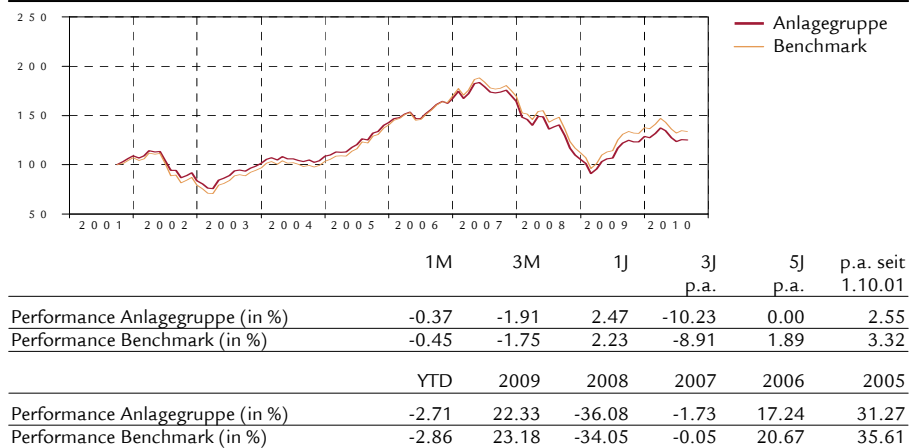
Valorennummer	1245481
ISIN	CH0012454812
Benchmark	Swiss Performance Index
Währung	CHF
Lancierungsdatum	1.10.2001
Lancierungspreis	100.00
Jahresabschluss	30.09.
Ausgabe/Rücknahme	täglich
Annahmeschluss	14.30 Uhr
Asset Manager gemäss	Swiss Life Best Select Invest Plus® *
Large Caps (passiv)	Pictet Asset Management AG
Small & Mid Caps (aktiv)	Mirabaud & Cie
Externe Beratung	PPCmetrics erbringt folgende Dienstleistungen: Beratung betreffend geeigneter Mandatsstrukturen (Core-Satellite), Unterstützung bei der Selektion geeigneter Asset Manager sowie Unterstützung bei der laufenden Überwachung der Asset Manager und Beurteilung der Anlageresultate.
Kurspublikationen	Bloomberg: ASSL www.swisslife.ch/anlagestiftung
Kosten	
- direkte All-in Fee p.a. **	0.22%
- indirekt Kosten p.a. ***	0.28%
Ausgabe-/Rücknahmekommission	keine
Ausschüttungspraxis	Thesaurierung

- * Die Auswahl der Manager, deren permanente Überwachung und die gesamte Prozessbegleitung erfolgen nach objektiven Kriterien und bester institutioneller Praxis durch Swiss Life Asset Management AG
- ** Die All-in Fee deckt sämtliche Aufwände mit Ausnahme der fiskalischen Abgaben und Transaktionskosten ab.
- *** durch den Einsatz von institutionellen Fonds

Monatliche Performance



Indizierte Wertentwicklung und Performances



Statistische Angaben (annualisiert)

	1J	3J	5J	seit 1.10.01
Volatilität Anlagegruppe (in %)	10.29	17.12	15.01	14.53
Volatilität Benchmark (in %)	10.28	17.14	15.19	15.21
Tracking Error (in %)	0.80	1.37	1.30	1.87
Sharpe Ratio	0.22	-0.71	-0.10	0.07
Korrelation	1.00	1.00	1.00	0.99

Portfeuillestruktur nach Unternehmensgrösse¹⁾

	Anlagegruppe		Benchmark	
	Anteil	Anzahl	Anteil	Anzahl
Grosse Unternehmen	83.8%	0	83.9%	20
Mittlere Unternehmen	12.8%	36	14.3%	80
Kleine Unternehmen	2.6%	11	1.8%	122
Liquide Mittel	0.8%	-	-	-
Total	100.0%	47	100.0%	222

¹⁾ unter Berücksichtigung der Derivate und Kollektivanlagen

Kennzahlen

	31.12.2009	31.08.2010
Vermögen in Mio. CHF	95.4	93.5
Nettoinventarwert in CHF	128.61	125.13
Aufgelaufener Ertrag in CHF seit 30.09.	2.33	4.98
Kapitalwert in CHF	126.28	120.15

Portfeuillestruktur nach Branchen²⁾

	Anlagegruppe	Benchmark
Gesundheitswesen	29.0%	28.9%
Nahrungsmittel & Getränke	21.3%	21.6%
Banken	13.1%	14.9%
Industrie, Energie & Ressourcen	11.3%	10.4%
Versicherungen	6.2%	6.4%
Chemie, Öl & Gas	6.1%	6.0%
Güter & Dienstleistungen	4.3%	4.1%
Technologie, Medien, Telekom	3.0%	1.9%
Übrige	4.9%	5.8%
Liquide Mittel	0.8%	-
Total	100.0%	100.0%

²⁾ unter Berücksichtigung der Derivate und Kollektivanlagen

Grösste Positionen³⁾

	Anlagegruppe	Benchmark
Nestlé	20.4%	20.4%
Novartis	14.7%	14.7%
Roche GS	10.9%	10.9%
UBS	6.9%	6.9%
Credit Suisse Group	5.4%	5.4%
ABB	5.1%	5.1%
Zürich Financial Services	3.7%	3.7%
Syngenta	2.5%	2.5%
Richemont	2.3%	2.3%
Transocean	2.0%	2.0%

³⁾ unter Berücksichtigung der Derivate und Kollektivanlagen

Disclaimer

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, Postfach, 8022 Zürich, Tel. 043 284 79 79 bezogen werden. Der Kreis der Anleger ist auf in der Schweiz domizilierte steuerbefreite Einrichtungen der 2. Säule und der Säule 3a sowie patronale Wohlfahrtsfonds beschränkt. Die vergangene Performance stellt keinen Indikator für die laufende und zukünftige Entwicklung dar. Die Performancecedaten lassen die bei der Ausgabe und Rücknahme der Anteile allenfalls erhobenen Kommissionen und Kosten unberücksichtigt.