

# Anlagestiftung Swiss Life

## Aktien Schweiz Large Caps Indexiert

**Nettovermögen (NAV) in Mio. CHF: 699.96**  
**Nettovermögen pro Anspruch in CHF: 162.83**

### Anlagestrategie

Die Anlagegruppe wird mit einem indexierten Ansatz verwaltet und zeichnet sich durch eine breite Diversifikation und einen geringen Tracking Error aus. Das Anlageziel besteht darin, die Benchmark SPI® 20 Total Return nachzubilden. Umsetzung mittels Einsatz des Swiss Life Index Funds (CH) Equity Switzerland Large Cap; vertraglicher Anlagefonds schweizerischen Rechts der Art "Übrige Fonds für traditionelle Anlagen". Es wird kein Securities Lending betrieben und es werden keine Investitionen in Titel getätigt, die vom Schweizer Verein für verantwortungsbewusste Kapitalanlagen (www.svvk-asir.ch) zum Ausschluss empfohlen sind.

### Wertentwicklung in Referenzwährung (Basis 100)



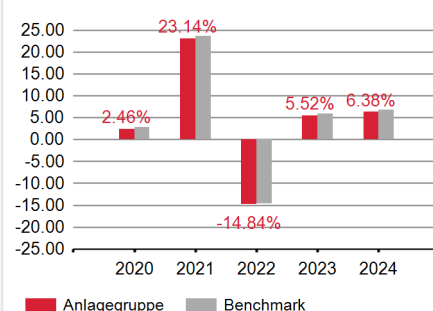
### Performance in Referenzwährung

	Kumulierte Performance				Annualisierte Performance			
	YTD	1 Monat	3 Monate	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Aufl.
Anlagegruppe	9.86%	-1.90%	9.86%	10.10%	3.18%	8.08%	-	7.04%
Benchmark	9.97%	-1.90%	9.97%	10.43%	3.57%	8.51%	-	7.45%

### Statistische Angaben (annualisiert)

	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Aufl.
Volatilität Anlagegruppe (in %)	12.62	12.38	12.50	-	12.40
Volatilität Benchmark (in %)	12.74	12.45	12.56	-	12.45
Tracking Error ex post (in %)	0.15	0.10	0.09	-	0.08
Information Ratio	-2.27	-3.90	-5.01	-	-4.95
Sharpe Ratio	0.69	0.18	0.60	-	0.55
Korrelation	1.00	1.00	1.00	-	1.00
Beta	0.99	0.99	1.00	-	1.00
Jensen-Alpha	-0.24	-0.37	-0.39	-	-0.38
Maximum Drawdown (in %)	-8.49	-18.85	-19.89	-	-25.04
Recovery Period (Jahre)	0.11	1.69	1.69	-	1.00

### Performance



### Produktinformationen

**Valorennummer:** 39561885

**ISIN:** CH0395618850

**LEI:** 254900P0FZIREAGSUQ60

**Bloomberg-Code:** SLASLCI SW

**Benchmark:** SPI® 20 Total Return

**Währung:** CHF

**Domizil:** Schweiz

**Aufgagedatum:** 01/02/2018

**Erstausgabepreis:** 100.00

**Jahresabschluss:** 30.09

**Ausgabe/Rücknahme:** Täglich

**Annahmeschluss:** 13.00 Uhr

**Verwässerungsschutz:**

Ausgabe- / Rücknahmekommission zugunsten der Anlagegruppe gemäss Konditionenübersicht.

**Ausschüttungspraxis:** Thesaurierung

**Asset Manager gemäss**

**Swiss Life Best Select Invest Plus®:**  
Swiss Life Asset Management AG

**Externe Beratung:**

PPCmetrics erbringt folgende Dienstleistungen: Beratung betreffend geeigneter Mandatsstruktur, Unterstützung bei der Selektion geeigneter Asset Manager sowie Unterstützung bei der laufenden Überwachung des Asset Managers und Beurteilung der Anlageresultate.

**Kurspublikationen:** Bloomberg: ASSL  
www.swisslife.ch/anlagestiftung

**Betriebsaufwandquote TER KGAST**

**ex ante:** 0.16%

**ex post per:** 30/09/2024 0.26%

**Asset Manager:** 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.

**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.

# Anlagestiftung Swiss Life

## Aktien Schweiz Large Caps Indexiert



### Grösste Positionen

	Anlagegruppe	Benchmark
NESTLE SA-REG	17.72%	17.72%
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	15.45%	15.45%
NOVARTIS AG-REG	14.60%	14.60%
ZURICH INSURANCE GROUP AG	6.81%	6.81%
UBS GROUP AG-REG	6.46%	6.46%
CIE FINANCIERE RICHEMO-A REG	6.22%	6.23%
ABB LTD-REG	5.46%	5.46%
HOLCIM LTD	3.88%	3.88%
SWISS RE AG	3.34%	3.34%
ALCON INC	3.15%	3.15%

### Portfoliostruktur nach Ländern/Regionen

	Anlagegruppe	Benchmark
Schweiz	99.97%	100.00%
Liquidität	0.03%	-

### Portfoliostruktur nach Branchen

	Anlagegruppe	Benchmark
Gesundheitswesen	37.11%	37.12%
Finanzen	20.49%	20.49%
Nichtzyklische Konsumgüter	17.72%	17.72%
Roh- und Grundstoffe	8.80%	8.80%
Industrieunternehmen	7.71%	7.71%
Zyklische Konsumgüter	6.22%	6.23%
Kommunikationsdienste	0.98%	0.98%
Informationstechnologie	0.94%	0.95%
Liquidität	0.03%	-

### Portfoliostruktur nach Währungen

	Anlagegruppe	Benchmark
CHF	100.00%	100.00%