

# Anlagestiftung Swiss Life

## Aktien Schweiz Protect Flex SPM



**Nettovermögen (NAV) in Mio. CHF: 106.75**  
**Nettovermögen pro Anspruch in CHF: 110.54**

### 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	4.20%	2.57%	-0.13%	-	-	-	-	-

### Statistische Angaben (annualisiert)

	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Aufl.
Volatilität Anlagegruppe (in %)	-	-	-	-	11.69
Sharpe Ratio	-	-	-	-	1.47
Maximum Drawdown (in %)	-	-	-	-	-7.50
Recovery Period (Jahre)	-	-	-	-	0.19

### Performance

Datenhistorie unzureichend

### Produktinformationen

**Valorenummer:** 148323399

**ISIN:** CH1483233990

**LEI:** 254900ZUTROYHLYQ4E86

**Bloomberg-Code:** SACPFSP SW

**Währung:** CHF

**Domizil:** Schweiz

**Aufledgedatum:** 03/11/2025

**Erstausgabepreis:** 100.00

**Jahresabschluss:** 30.09

**Ausgabe/Rücknahme:** Täglich

**Annahmeschluss:** 13:00 Uhr

**Verwässerungsschutz:**

Ausgabe- / Rücknahmekommission zugunsten der Anlagegruppe gemäss Konditionenübersicht.

**Asset Manager**

Swisslife Asset Management AG

**Kurspublikationen:** Bloomberg: ASSL  
[www.swisslife.ch/anlagestiftung](http://www.swisslife.ch/anlagestiftung)

**SPM-Tranche:** Die SPM-Tranche steht sowohl Anlegern mit einer speziellen Vereinbarung mit der Swiss Life Asset Management AG (SLAM CH) sowie Vermögensverwaltungskunden und Kunden von Kooperationspartnern der SLAM CH (jeweils mit Zusatzvereinbarung) offen.

**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](http://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 Protect Flex SPM



### Portfoliostruktur nach Branchen

	Anlagegruppe
Gesundheitswesen	33.97%
Finanzen	17.51%
Nichtzyklische Konsumgüter	13.32%
Industrieunternehmen	10.33%
Roh- und Grundstoffe	7.23%
Zyklische Konsumgüter	5.88%
Future auf Aktienindex	5.84%
Kommunikationsdienste	1.10%
Informationstechnologie	0.99%
Liquidität	3.82%

### Grösste Positionen

	Anlagegruppe
ROCHE HOLDING AG	15.01%
NOVARTIS AG-REG	14.98%
NESTLE SA-REG	13.32%
ABB LTD-REG	8.56%
UBS GROUP AG-REG	7.15%
CIE FINANCIERE RICHEMO-A REG	5.88%
ZURICH INSURANCE GROUP AG	5.29%
HOLCIM LTD	2.66%
LONZA GROUP AG-REG	2.29%
SWISS RE AG	2.28%