29. Februar 2024

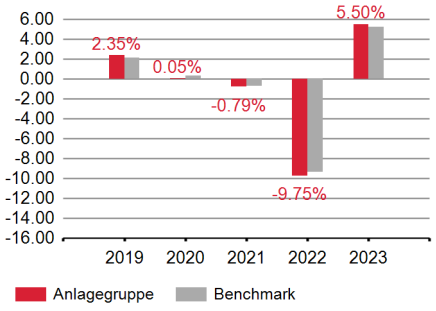
Anlagestiftung Swiss Life Obligationen CHF Ausland

Nettovermögen (NAV) in Mio. CHF: 349.28
Nettovermögen pro Anspruch in CHF: 145.35

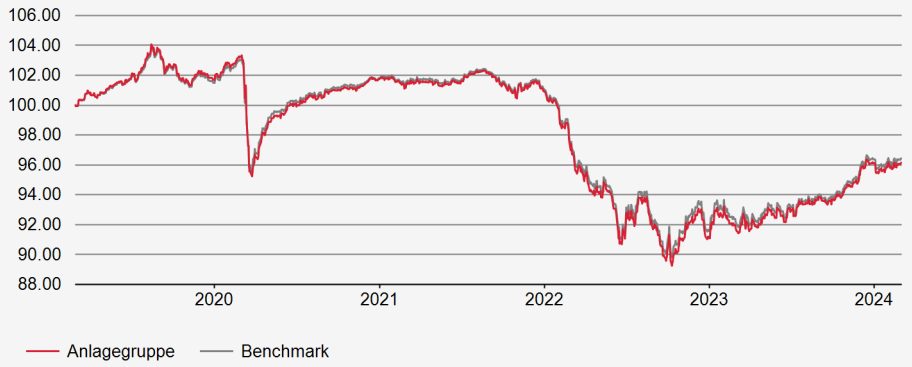
Anlagestrategie

Anlagen in auf CHF lautende Forderungspapiere von Schuldnern, die vorwiegend im Ausland domiziliert sind. Aktive Titelselektion, Durationsteuerung und Zinskurvenpositionierung. Schuldnerbegrenzung: 10%. Forderungspapiere benchmarkfremder Schuldner: max. 20%. Durchschnittliche Ratingqualität: mindestens A. Umsetzung mittels Einsatz des Swiss Life iFunds (CH) Bond Swiss Francs Foreign (CHF); Anlagefonds schweizerischen Rechts der Kategorie "Übrige Fonds für traditionelle Anlagen".

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	0.05%	0.07%	0.86%	4.76%	-1.68%	-0.78%	0.18%	1.68%
Benchmark	0.07%	0.06%	0.90%	4.61%	-1.63%	-0.72%	0.25%	1.81%

Statistische Angaben (annualisiert)

	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Aufl.
Volatilität Anlagegruppe (in %)	1.60	3.74	4.47	3.35	3.23
Volatilität Benchmark (in %)	1.63	3.71	4.26	3.21	3.08
Tracking Error ex post (in %)	0.14	0.25	0.35	0.32	0.86
Information Ratio	1.07	-0.19	-0.17	-0.23	-0.14
Sharpe Ratio	1.92	-0.54	-0.15	0.17	0.46
Korrelation	1.00	1.00	1.00	1.00	0.96
Beta	0.98	1.01	1.05	1.04	1.01
Jensen-Alpha	0.20	-0.03	-0.03	-0.10	-0.15
Maximum Drawdown (in %)	-1.25	-12.77	-14.23	-14.23	-14.23
Recovery Period (Jahre)	0.11	-	-	-	-

Produktinformationen

Valorennummer: 1245477
ISIN: CH0012454770
LEI: 2549002XPEQH1AZYBW05
Bloomberg-Code: SWAOBAU SW
Benchmark: SBI Foreign AAA - BBB TR
Währung: CHF
Domizil: Schweiz
Auflagedatum: 30/09/2001
Erstausgabepreis: 100.00
Jahresabschluss: 30.09
Ausgabe/Rücknahme: Täglich
Annahmeschluss: 14.30 Uhr
Ausgabe-/Rücknahmekommission: Keine
Ausschüttungspraxis: Thesaurierung
Asset Manager gemäss Swiss Life Best Select Invest Plus®: Swiss Life Asset Management AG
Überwachung Asset Manager: PPCmetrics unterstützt die laufende Überwachung des Asset Managers sowie die Beurteilung der Anlageresultate.
Kurspublikationen: Bloomberg: ASSL www.swisslife.ch/anlagestiftung
Betriebsaufwandquote TER KGAST
ex ante: 0.27%
ex post per: 30/09/2023 0.27%

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.
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.

29. Februar 2024

Anlagestiftung Swiss Life Obligationen CHF Ausland

Portfoliostruktur nach Branchen

	Anlagegruppe	Benchmark
Finanzwesen	66.27%	50.21%
Staatlich und staatsnah	6.62%	15.22%
Pfandbriefinstitute	6.22%	17.32%
Versorgungsbetriebe	3.77%	2.15%
Basiskonsumgüter	3.17%	2.94%
Nicht-Basiskonsumgüter	3.13%	2.58%
Industrie	2.77%	5.26%
Kommunikation	0.95%	2.03%
Supranational	6.46%	-
Andere	0.66%	2.30%
Liquidität	-0.01%	-

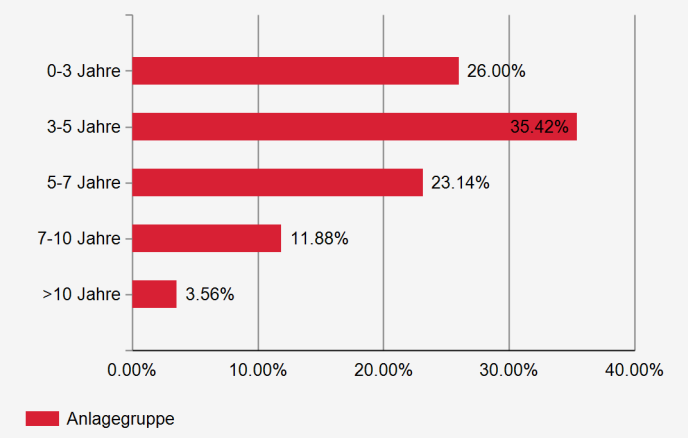
Grösste Schuldner und Rating

		Anlagegruppe
Bank of Nova Scotia/The	AA	3.92%
Müchner Hypothekenbank	AA	3.87%
Banco Santander SA, Madrid	A+	3.73%
Groupe BPCE	AA-	3.56%
Credit Agricole Group	AA	3.29%

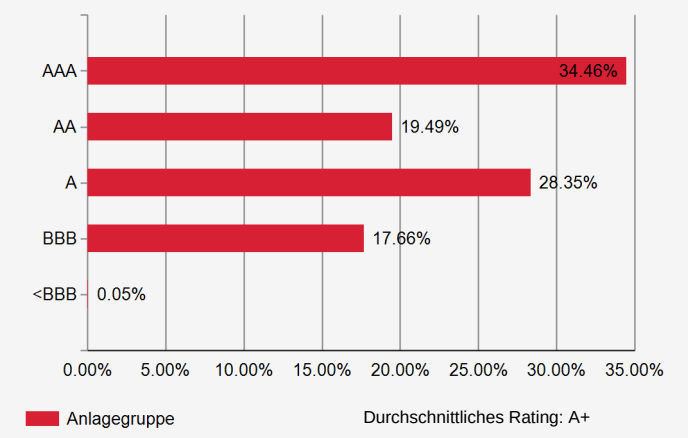
Weitere Angaben zu den Schuldnern

Anzahl Schuldner	116
Anteil Benchmarkfremde Schuldner	4.74%

Fälligkeitstruktur der Anlagen



Anlagen nach Rating



Duration und Rendite auf Verfall

	Anlagegruppe	Benchmark
Modified Duration*	4.3	4.2
Theoretische Rendite auf Verfall*	1.72%	1.63%

* Vor Währungsabsicherung, unter Berücksichtigung der Derivate

Portfoliostruktur nach Ländern/Regionen

	Anlagegruppe	Benchmark
Frankreich	16.31%	16.14%
Deutschland	14.37%	13.23%
Kanada	12.52%	11.47%
Vereinigte Staaten	9.30%	11.09%
Australien	6.49%	6.84%
Vereinigtes Königreich	5.05%	5.39%
Spanien	4.37%	3.62%
Europäische Region (Ex EUR)	9.17%	6.42%
Europäische Region (EUR)	8.11%	13.26%
Schwellenländer Lateinamerika	5.08%	4.37%
Andere	9.25%	8.18%
Liquidität, Absicherung	-0.01%	-

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. 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. **Quelle:** Swiss Life Asset Managers. Alle Rechte vorbehalten.