29. Februar 2024

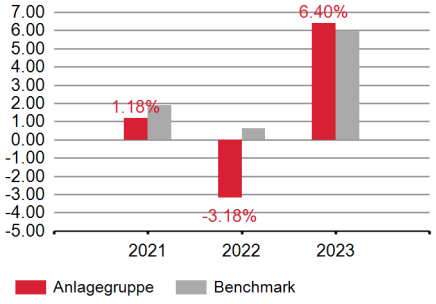
Anlagestiftung Swiss Life Senior Secured Loans (CHF hedged)

Nettovermögen (NAV) in Mio. CHF: 140.47
Nettovermögen pro Anspruch in CHF: 104.02

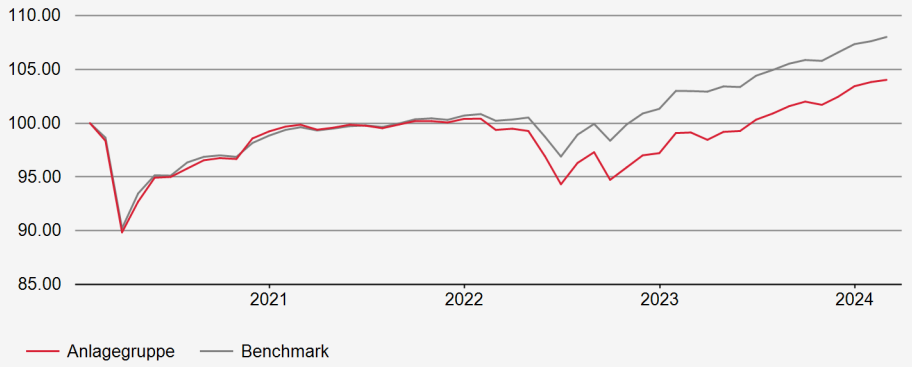
Anlagestrategie

Die Anlagegruppe strebt stabile hohe Erträge bei einer minimalen Preisvolatilität und einer geringen Zinsduration an. Die Anlagegruppe investiert vorwiegend in erstrangige Senior Secured Loans von Unternehmen aus entwickelten Ländern. Mindestens 85% werden in erstrangigen Senior Secured Loans angelegt. Höchstens 5% werden beim selben Schuldner angelegt. Höchstens 25% werden in derselben Industriegruppe angelegt. Fremdwährungsrisiken werden zu mindestens 90% gegen Schweizerfranken abgesichert. Umsetzung mittels Einsatz des Swiss Life Loan Fund (LUX) S.A., SICAV-SIF Senior Secured Loans V AM-Shares (CHF hedged); Anlagefonds nach luxemburgischem Recht.

Performance



Wertentwicklung in Referenzwährung (Basis 100)



Die in der Vergangenheit erzielte Wertentwicklung ist kein Indikator für die zukünftige Wertentwicklung.

Produktinformationen

Valorennummer: 51215713
ISIN: CH0512157139
LEI: 254900TFN2RL5B1QJ986
Bloomberg-Code: SWSSLCH SW
Benchmark: JPM Lev Loans Upper Tier (80% US + 20% EU) CHFh
Währung: CHF
Domizil: Schweiz
Auflagedatum: 31/01/2020
Erstausgabepreis: 100.00
Jahresabschluss: 30.09
Ausgabe/Rücknahme: Monatlich
Annahmeschluss: 14.30 Uhr
Zeichnungen: Ultimo - 2
Rücknahmen: Ultimo - 5
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: 0.65%
ex post per: 30/09/2023 0.65%

Performance in Referenzwährung

	Kumulierte Performance				Annualisierte Performance			
	YTD	1 Monat	3 Monate	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Aufl.
Anlagegruppe	0.57%	0.19%	1.54%	4.93%	1.37%	-	-	0.97%
Benchmark	0.62%	0.37%	1.36%	4.88%	2.72%	-	-	1.90%

Statistische Angaben (annualisiert)

	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Aufl.
Volatilität Anlagegruppe (in %)	1.77	3.63	-	-	6.01
Volatilität Benchmark (in %)	1.19	2.82	-	-	5.60
Tracking Error ex post (in %)	0.86	1.05	-	-	1.08
Information Ratio	0.06	-1.30	-	-	-0.86
Sharpe Ratio	1.83	0.29	-	-	0.15
Korrelation	0.90	0.98	-	-	0.98
Beta	1.34	1.26	-	-	1.06
Jensen-Alpha	-1.08	-1.98	-	-	-1.04
Maximum Drawdown (in %)	-0.69	-6.07	-	-	-10.15
Recovery Period (Jahre)	0.08	1.08	-	-	1.50

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.
Annahmeschluss: Ultimo = letzter Bankwerktag des Monats
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 Senior Secured Loans (CHF hedged)

Portfoliostruktur nach Branchen

	Anlagegruppe	Benchmark
Dienstleistungen	13.98%	8.93%
Gesundheitswesen	9.81%	11.48%
Technologie	8.67%	9.17%
Glücksspiel/Freizeit	7.45%	9.87%
Kabel und Satellit	6.72%	7.78%
Chemikalien	6.55%	7.59%
Finanzwesen	5.97%	4.63%
Automobile	4.48%	3.35%
Lebensmittel und Getränke	4.35%	4.98%
Baugewerbe	3.89%	3.56%
Andere	21.77%	28.66%
Liquidität	6.36%	-

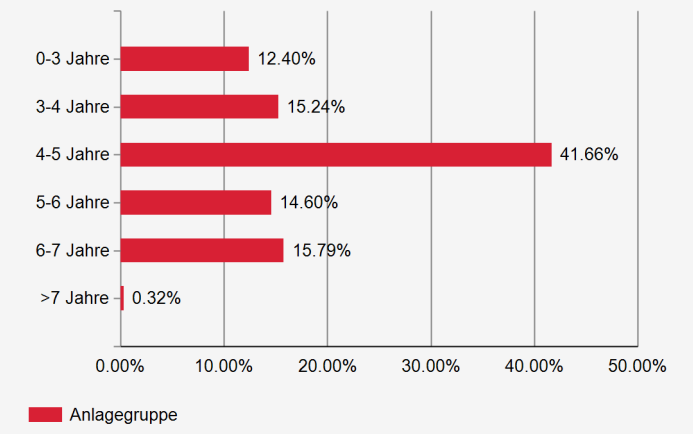
Grösste Schuldner und Rating

		Anlagegruppe
Entain Holdings Gibraltar Ltd	BB	1.51%
Asurion LLC	B+	1.42%
Telenet International Finance Sarl	BB-	1.23%
Grifols SA	BB-	1.22%
Jane Street Group LLC	BB	1.14%

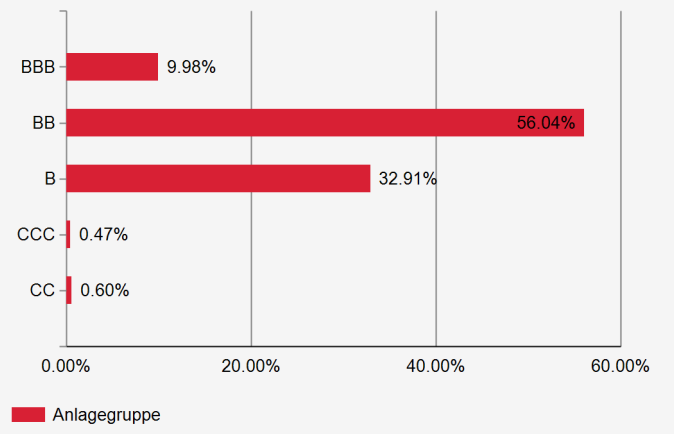
Weitere Angaben zu den Schuldnern

Anzahl Schuldner	221

Fälligkeitstruktur der Anlagen



Anlagen nach Rating



Portefeuillestruktur nach Währungen / Rendite (ohne Liquidität)

	Anlagegruppe		Benchmark	
	Gewichtung	Rendite	Gewichtung	Rendite
USD	60.36%	9.00%	80.00%	8.16%
EUR	39.64%	7.96%	20.00%	7.41%
Durchschnitt	-	8.59%	-	8.01%

Portfoliostruktur nach Ländern/Regionen

	Anlagegruppe	Benchmark
Vereinigte Staaten	55.14%	77.18%
Vereinigtes Königreich	9.83%	6.69%
Niederlande	7.22%	1.79%
Luxemburg	4.34%	0.42%
Belgien	3.62%	1.81%
Deutschland	3.49%	1.97%
Spanien	2.03%	1.15%
Frankreich	1.92%	0.33%
Kanada	1.69%	3.79%
Schweiz	1.35%	0.42%
Andere	3.00%	4.46%
Liquidität	6.36%	-

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.