

31. Mai 2025

Anlagestiftung Swiss Life Obligationen Global Staaten ex CHF Indexiert PM (CHF hedged)



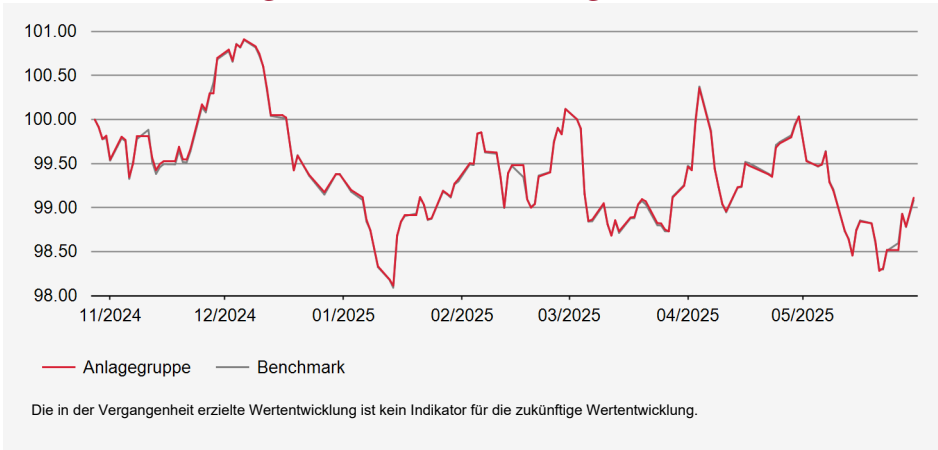
SwissLife

Nettovermögen (NAV) in Mio. CHF: 14.79
Nettovermögen pro Anspruch in CHF: 991.13

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 FTSE Non-CHF World Government Bond Index Total Return (CHF hedged) nachzubilden. Umsetzung mittels Einsatz des Swiss Life Index Funds (CH) Bond Global Government ex CHF (CHF hedged); 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	-0.27%	-0.92%	-1.01%	-	-	-	-	-
Benchmark	-0.30%	-0.95%	-1.03%	-	-	-	-	-

Statistische Angaben (annualisiert)

	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Aufl.
Volatilität Anlagegruppe (in %)	-	-	-	-	3.02
Volatilität Benchmark (in %)	-	-	-	-	3.04
Tracking Error ex post (in %)	-	-	-	-	0.08
Information Ratio	-	-	-	-	0.52
Sharpe Ratio	-	-	-	-	-0.60
Korrelation	-	-	-	-	1.00
Beta	-	-	-	-	0.99
Jensen-Alpha	-	-	-	-	0.04
Maximum Drawdown (in %)	-	-	-	-	-2.77
Recovery Period (Jahre)	-	-	-	-	-

Performance

Datenhistorie unzureichend

Produktinformationen

Valorennummer: 137660509
ISIN: CH1376605098
LEI: 254900WRQBH1EKTFLX93
Bloomberg-Code: SLAIGSP SW
Benchmark: FTSE Non-CHF World Government Bond Index Total Return (hdg)
Währung: CHF
Domizil: Schweiz
Auflagedatum: 28/10/2024
Erstausgabepreis: 1000.00
Jahresabschluss: 30.09
Ausgabe/Rücknahme: Täglich
Annahmeschluss: 14.00 Uhr (T-1)
Verwässerungsschutz:
Ausgabe- / Rücknahmekommission zugunsten der Anlagegruppe gemäss Konditionenübersicht.
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: 0.02%

PM-Tranche: Der Erwerb dieser Tranche ist nur im Rahmen einer speziellen Vereinbarung mit Swiss Life Asset Management AG möglich.
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

Obligationen Global Staaten ex CHF Indexiert PM (CHF hedged)

Portfoliostruktur nach Branchen

	Anlagegruppe	Benchmark
Treasury	99.15%	100.00%
Liquidität	0.85%	-

Grösste Schuldner und Rating

	Anlagegruppe	Benchmark	
United States of America	AA+	41.04%	41.45%
People's Republic of China	A+	10.20%	10.29%
Japan	A+	9.74%	9.84%
French Republic	AA-	6.64%	6.71%
Republic of Italy	BBB+	6.19%	6.21%
Federal Republic of Germany	AAA	5.29%	5.23%
United Kingdom of Great Britain and Northern Ireland	AA	5.06%	5.01%
Kingdom of Spain	A	4.07%	4.16%
Canada	AAA	1.74%	1.78%
Kingdom of Belgium	AA	1.44%	1.41%

Portfoliostruktur nach Fälligkeit

	Anlagegruppe	Benchmark
0-3 Jahre	27.64%	28.18%
3-5 Jahre	20.44%	20.11%
5-7 Jahre	12.78%	12.63%
7-10 Jahre	13.74%	13.99%
> 10 Jahre	25.40%	25.10%

Duration und Rendite auf Verfall

	Anlagegruppe	Benchmark
Modified Duration*	6.9	6.9
Theoretische Rendite auf Verfall*	3.48%	3.47%

* Vor Währungsabsicherung, unter Berücksichtigung der Derivate

Portfoliostruktur nach Rating

	Anlagegruppe	Benchmark
AAA	10.27%	10.44%
AA	56.11%	56.46%
A	25.91%	26.18%
BBB	6.86%	6.92%
Liquidität	0.85%	-

Portfoliostruktur nach Ländern/Regionen

	Anlagegruppe	Benchmark
Vereinigte Staaten	41.03%	41.45%
China	10.20%	10.29%
Japan	9.74%	9.84%
Frankreich	6.64%	6.71%
Italien	6.19%	6.21%
Deutschland	5.28%	5.23%
Vereinigtes Königreich	5.06%	5.01%
Spanien	4.07%	4.16%
Kanada	1.74%	1.78%
Andere	9.20%	9.32%
Liquidität	0.85%	-