

Anlagestiftung Swiss Life Oligationen Global Unternehmen ex CHF Indexiert PM (CHF hedged)



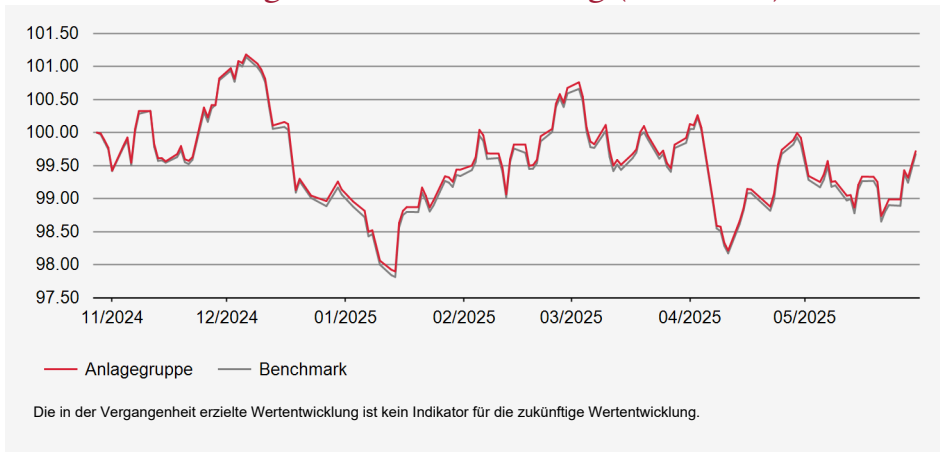
SwissLife

Nettovermögen (NAV) in Mio. CHF: 14.83
Nettovermögen pro Anspruch in CHF: 997.19

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 Bloomberg Global Aggregate Corporate ex CHF (CHF hedged) nachzubilden. Umsetzung mittels Einsatz des Swiss Life Index Funds (CH) Bond Global Corporate 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	0.59%	-0.20%	-0.95%	-	-	-	-	-
Benchmark	0.62%	-0.14%	-0.91%	-	-	-	-	-

Statistische Angaben (annualisiert)

	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Aufl.
Volatilität Anlagegruppe (in %)	-	-	-	-	3.26
Volatilität Benchmark (in %)	-	-	-	-	3.30
Tracking Error ex post (in %)	-	-	-	-	0.12
Information Ratio	-	-	-	-	0.57
Sharpe Ratio	-	-	-	-	-0.28
Korrelation	-	-	-	-	1.00
Beta	-	-	-	-	0.99
Jensen-Alpha	-	-	-	-	0.06
Maximum Drawdown (in %)	-	-	-	-	-3.24
Recovery Period (Jahre)	-	-	-	-	-

Performance

Datenhistorie unzureichend

Produktinformationen

Valorennummer: 137660510

ISIN: CH1376605106

LEI: 254900M7W666VL12J929

Bloomberg-Code: SLAIGUP SW

Benchmark: Bloomberg Global Aggregate Corporate ex CHF Total Return (CHF hedged)

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 Unternehmen ex CHF Indexiert PM (CHF hedged)

Portfoliostruktur nach Branchen

	Anlagegruppe	Benchmark
Industrial	51.84%	51.50%
Financial Institutions	38.70%	39.32%
Utilities	8.65%	9.18%
Liquidität	0.81%	-

Grösste Schuldner und Rating

	Anlagegruppe	Benchmark
UBS Group AG	AA-	2.06%
JPMorgan Chase & Co	A+	1.52%
Bank of America, New York	A+	1.49%
Goldman Sachs Group Inc/The	A	1.42%
Morgan Stanley	A+	1.37%
Nestle SA	AA-	1.29%
Cooperatieve Rabobank UA	A-	1.12%
Wells Fargo & Co	A	0.99%
Takeda Pharmaceutical Co Ltd	BBB+	0.96%
HSBC Holdings PLC	A-	0.95%

Portfoliostruktur nach Fälligkeit

	Anlagegruppe	Benchmark
0-3 Jahre	24.07%	23.39%
3-5 Jahre	20.89%	21.05%
5-7 Jahre	14.85%	13.91%
7-10 Jahre	14.89%	15.68%
> 10 Jahre	25.31%	25.97%

Duration und Rendite auf Verfall

	Anlagegruppe	Benchmark
Modified Duration*	5.8	5.8
Theoretische Rendite auf Verfall*	5.09%	5.08%

* Vor Währungsabsicherung, unter Berücksichtigung der Derivate

Portfoliostruktur nach Rating

	Anlagegruppe	Benchmark
AAA	0.60%	0.70%
AA	9.32%	7.86%
A	47.83%	44.02%
BBB	41.44%	47.37%
BB	-	0.04%
Liquidität	0.81%	-

Portfoliostruktur nach Ländern/Regionen

	Anlagegruppe	Benchmark
Vereinigte Staaten	56.66%	56.53%
Niederlande	6.47%	5.12%
Vereinigtes Königreich	6.15%	6.40%
Frankreich	6.03%	6.38%
Kanada	4.87%	5.16%
Japan	3.58%	2.36%
Deutschland	2.01%	2.48%
Luxemburg	1.87%	1.33%
Australien	1.67%	1.93%
Andere	9.89%	12.31%
Liquidität	0.81%	-