

# Anlagestiftung Swiss Life

## Obligationen CHF AAA-BBB Responsible Indexiert PM



**Nettovermögen (NAV) in Mio. CHF: 1.02**  
**Nettovermögen pro Anspruch in CHF: 1'019.58**

### 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 SBI® ESG AAA-BBB Total Return nachzubilden. Umsetzung mittels Einsatz des Swiss Life Index Funds (CH) Bond Responsible Swiss Francs AAA-BBB; 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.svkv-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	-	0.38%	-	-	-	-	-	-
Benchmark	-	0.35%	-	-	-	-	-	-

### Statistische Angaben (annualisiert)

	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Aufl.
Volatilität Anlagegruppe (in %)	-	-	-	-	2.83
Volatilität Benchmark (in %)	-	-	-	-	2.83
Tracking Error ex post (in %)	-	-	-	-	0.04
Information Ratio	-	-	-	-	2.82
Sharpe Ratio	-	-	-	-	2.67
Korrelation	-	-	-	-	1.00
Beta	-	-	-	-	1.00
Jensen-Alpha	-	-	-	-	0.18
Maximum Drawdown (in %)	-	-	-	-	-1.18
Recovery Period (Jahre)	-	-	-	-	-

### Performance

Datenhistorie unzureichend

### Produktinformationen

**Valorennummer:** 142759585  
**ISIN:** CH1427595850  
**LEI:** 2549007FEM7DLVNXSM63  
**Bloomberg-Code:** SLAICRP SW  
**Benchmark:** SBI® ESG AAA-BBB Total Return  
**Währung:** CHF  
**Domizil:** Schweiz  
**Aufledgedatum:** 31/03/2025  
**Erstausgabepreis:** 1000.00  
**Jahresabschluss:** 30.09  
**Ausgabe/Rücknahme:** Täglich  
**Annahmeschluss:** 13.00 Uhr  
**Verwässerungsschutz:**  
Ausgabe- / Rücknahmekommission zugunsten der Anlagegruppe gemäss Konditionenübersicht.  
**Asset management:**  
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](http://www.swisslife.ch/anlagestiftung)  
**Betriebsaufwandquote TER KGAST ex ante:** 0.01%

**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](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

## Obligationen CHF AAA-BBB Responsible Indexiert PM

### Portfoliostruktur nach Branchen

	Anlagegruppe	Benchmark
Covered	36.07%	36.22%
Local Authority	18.94%	18.53%
Treasury	15.98%	16.22%
Financial Institutions	11.47%	11.92%
Industrial	9.62%	9.21%
Agency	4.17%	4.48%
Supranational	2.25%	2.07%
Utilities	1.12%	1.13%
Sovereign	0.27%	0.19%
ABS	-	0.04%
Liquidität	0.11%	-

### Grösste Schuldner und Rating

	Anlagegruppe	Benchmark
Pfandbriefbank schweizerischer Hypothekarinstitute AG	AAA	17.19%
Swiss Confederation	AAA	16.00%
Pfandbriefzentrale der schweizerischen Kantonalbanken AG	AAA	14.66%
Credit Agricole Group	AA-	1.45%
Canton of Geneva Switzerland	AA	1.31%
Zürcher Kantonalbank	AA+	1.28%
City of Zurich Switzerland	AAA	1.18%
Luzerner Kantonalbank AG	AA-	1.17%
Emissionszentrale fuer Gemeinnuetzige Wohnbautraeger Genossenschaft EGW	AAA	0.80%
UBS Group AG	AA-	0.72%

### Portfoliostruktur nach Fälligkeit

	Anlagegruppe	Benchmark
0-3 Jahre	21.56%	23.14%
3-5 Jahre	23.01%	21.15%
5-7 Jahre	13.62%	15.11%
7-10 Jahre	16.60%	15.93%
> 10 Jahre	25.21%	24.66%

### Duration und Rendite auf Verfall

	Anlagegruppe	Benchmark
Modified Duration*	7.5	7.3
Theoretische Rendite auf Verfall*	0.65%	0.64%

\* Vor Währungsabsicherung, unter Berücksichtigung der Derivate

### Portfoliostruktur nach Rating

	Anlagegruppe	Benchmark
AAA	60.63%	61.28%
AA	18.58%	18.39%
A	13.55%	13.94%
BBB	7.10%	6.39%
NR	0.03%	-
Liquidität	0.11%	-

### Portfoliostruktur nach Ländern/Regionen

	Anlagegruppe	Benchmark
Schweiz	80.98%	81.40%
Frankreich	2.65%	2.90%
Kanada	2.51%	2.51%
Deutschland	2.19%	2.32%
Vereinigte Staaten	1.68%	1.72%
Österreich	1.52%	0.90%
Vereinigtes Königreich	1.09%	0.78%
Niederlande	1.05%	1.27%
Australien	1.04%	0.83%
Andere	5.17%	5.39%
Liquidität	0.11%	-