



Anlagestiftung Swiss Life

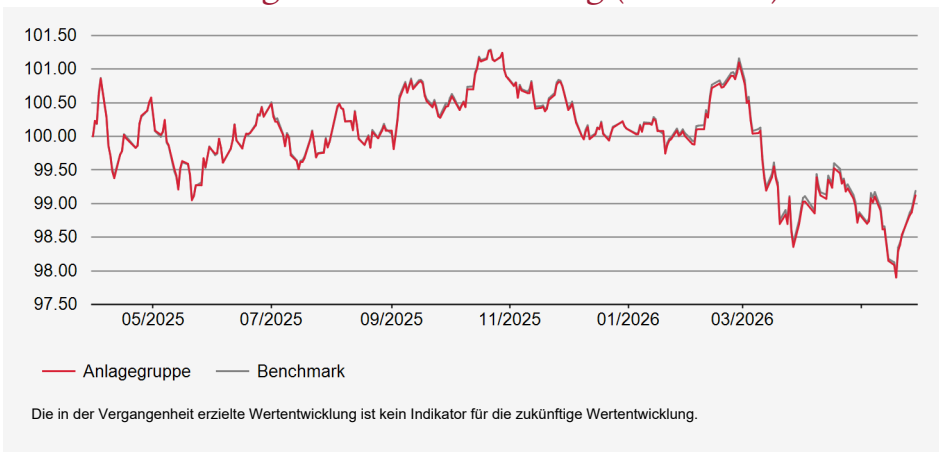
Obligationen Global Aggregate ex CHF Indexiert SPM (CHF hedged)

Nettovermögen (NAV) in Mio. CHF: 24.35
Nettovermögen pro Anspruch in CHF: 991.24

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 ex CHF Total Return (CHF hedged) nachzubilden. Umsetzung mittels Einsatz des Swiss Life Index Funds (CH) Bond Global Aggregate 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	-0.99%	0.28%	-1.95%	-0.72%	-	-	-	-0.75%
Benchmark	-0.93%	0.32%	-1.95%	-0.66%	-	-	-	-0.70%

Statistische Angaben (annualisiert)

	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Aufl.
Volatilität Anlagegruppe (in %)	2.86	-	-	-	2.68
Volatilität Benchmark (in %)	2.88	-	-	-	2.78
Tracking Error ex post (in %)	0.08	-	-	-	0.09
Information Ratio	-0.69	-	-	-	-0.61
Sharpe Ratio	-0.24	-	-	-	-0.26
Korrelation	1.00	-	-	-	1.00
Beta	0.99	-	-	-	1.00
Jensen-Alpha	-0.06	-	-	-	-0.06
Maximum Drawdown (in %)	-3.33	-	-	-	-3.33
Recovery Period (Jahre)	-	-	-	-	-

Performance

Datenhistorie unzureichend

Produktinformationen

Valorenummer: 142759586
ISIN: CH1427595868
LEI: 2549009Q08QRLB0BEL51
Bloomberg-Code: SLAIGAP SW
Benchmark: BLOOMBERG GLO AGG EX CHF TR IND HEDGED CHF
Währung: CHF
Domizil: Schweiz
Aufledgedatum: 31/03/2025
Erstausgabepreis: 1000.00
Jahresabschluss: 30.09
Ausgabe/Rücknahme: Täglich
Annaheschluss: 14:00 Uhr (T-1)
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
Betriebsaufwandquote TER KGAST ex ante: 0.00%
ex post per: 30/09/2025 0.00%

SPM-Tranche: Die SPM-Tranche steht sowohl Anlegern mit einer speziellen Vereinbarung mit der Swiss Life Asset Management AG (SLAM CH) sowie Vermögensverwaltungskunden und Kunden von Kooperationspartnern der SLAM CH (jeweils mit Zusatzvereinbarung) offen.

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 Aggregate ex CHF Indexiert SPM (CHF hedged)

Portfoliostruktur nach Branchen

	Anlagegruppe	Benchmark
Treasury	54.43%	53.98%
MBS Pass-Through	10.19%	9.83%
Industrie	9.20%	9.49%
Agency	7.44%	8.01%
Financial Institutions	7.26%	7.07%
Local Authority	3.16%	3.12%
Supranational	2.75%	2.74%
Covered	1.91%	1.84%
Versorgung	1.88%	1.79%
Sovereign	1.41%	1.33%
CMBS	0.04%	0.61%
ABS	0.01%	0.19%
Liquidität	0.31%	-

Grösste Schuldner und Rating

	Anlagegruppe	Benchmark	
United States of America	AA+	29.24%	28.98%
Japan	A+	7.61%	7.32%
People's Republic of China	A+	7.57%	7.60%
French Republic	A+	3.03%	3.08%
United Kingdom of Great Britain and Northern Ireland	AA-	3.03%	3.02%
Republic of Italy	BBB+	2.82%	2.80%
Federal Republic of Germany	AAA	2.41%	2.40%
China Development Bank	A+	2.34%	2.36%
Kingdom of Spain	A	1.87%	1.81%
European Union	AAA	1.09%	1.02%

Portfoliostruktur nach Fälligkeit

	Anlagegruppe	Benchmark
0-3 Jahre	23.64%	24.17%
3-5 Jahre	18.72%	19.00%
5-7 Jahre	12.28%	12.27%
7-10 Jahre	14.95%	14.15%
> 10 Jahre	30.41%	30.41%

Duration und Rendite auf Verfall

	Anlagegruppe	Benchmark
Modified Duration	6.2	6.2
Theoretische Rendite auf Verfall*	3.78%	3.78%

* vor Währungsabsicherung

Portfoliostruktur nach Rating

	Anlagegruppe	Benchmark
AAA	11.37%	11.96%
AA	38.68%	38.72%
A	34.86%	35.20%
BBB	14.77%	14.12%
BB	-	-
NR	-	0.00%
Liquidität	0.31%	-

Portfoliostruktur nach Ländern/Regionen

	Anlagegruppe	Benchmark
Vereinigte Staaten	40.01%	40.44%
China	10.50%	10.82%
Japan	7.90%	8.17%
Frankreich	5.83%	5.26%
Deutschland	5.63%	4.82%
Vereinigtes Königreich	4.19%	4.34%
Kanada	4.12%	3.69%
Italien	3.33%	3.27%
Supranational	2.73%	2.72%
Andere	15.45%	16.47%
Liquidität	0.31%	-