



# Anlagestiftung Swiss Life

## Obligationen Global Unternehmen ex CHF Indexiert SPM (CHF hedged)

SwissLife

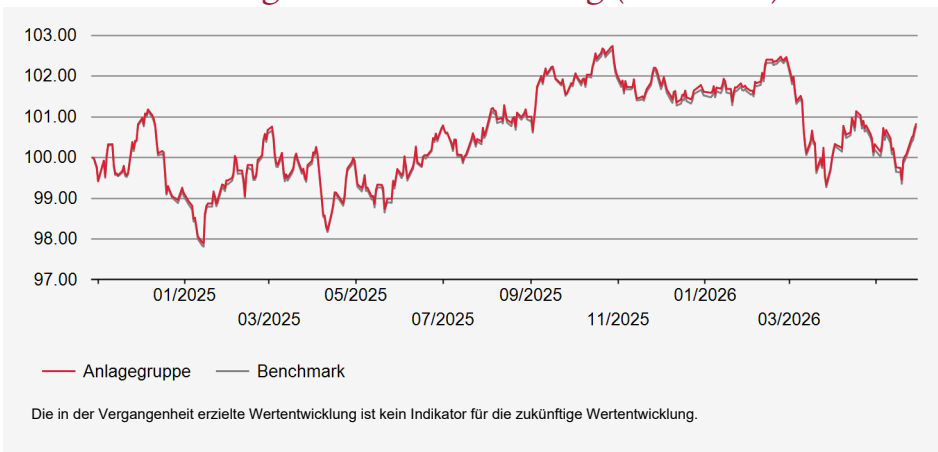
Nettovermögen (NAV) in Mio. CHF: 35.30

Nettovermögen pro Anspruch in CHF: 1'008.25

### 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)



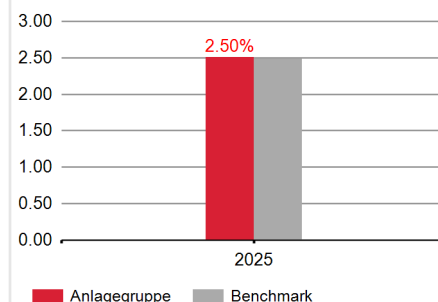
### Performance in Referenzwährung

|              | Kumulierte Performance |         |          |        | Annualisierte Performance |         |          |       |
|--------------|------------------------|---------|----------|--------|---------------------------|---------|----------|-------|
|              | YTD                    | 1 Monat | 3 Monate | 1 Jahr | 3 Jahre                   | 5 Jahre | 10 Jahre | Aufl. |
| Anlagegruppe | -0.78%                 | 0.49%   | -1.60%   | 1.11%  | -                         | -       | -        | 0.52% |
| Benchmark    | -0.76%                 | 0.56%   | -1.63%   | 1.09%  | -                         | -       | -        | 0.48% |

### Statistische Angaben (annualisiert)

|                                 | 1 Jahr | 3 Jahre | 5 Jahre | 10 Jahre | Aufl. |
|---------------------------------|--------|---------|---------|----------|-------|
| Volatilität Anlagegruppe (in %) | 3.11   | -       | -       | -        | 3.09  |
| Volatilität Benchmark (in %)    | 3.16   | -       | -       | -        | 3.13  |
| Tracking Error ex post (in %)   | 0.14   | -       | -       | -        | 0.13  |
| Information Ratio               | 0.16   | -       | -       | -        | 0.32  |
| Sharpe Ratio                    | 0.36   | -       | -       | -        | 0.11  |
| Korrelation                     | 1.00   | -       | -       | -        | 1.00  |
| Beta                            | 0.99   | -       | -       | -        | 0.99  |
| Jensen-Alpha                    | 0.04   | -       | -       | -        | 0.05  |
| Maximum Drawdown (in %)         | -3.32  | -       | -       | -        | -3.32 |
| Recovery Period (Jahre)         | -      | -       | -       | -        | -     |

### Performance



### 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

Aufgagedatum: 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: 0.01%

ex post per: 30/09/2025 0.01%

**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 Unternehmen ex CHF Indexiert SPM

### (CHF hedged)

#### Portfoliostruktur nach Branchen

|                        | Anlagegruppe | Benchmark |
|------------------------|--------------|-----------|
| Industrie              | 51.84%       | 51.70%    |
| Financial Institutions | 38.05%       | 38.54%    |
| Versorgung             | 9.89%        | 9.75%     |
| Liquidität             | 0.23%        | -         |

#### Grösste Schuldner und Rating

|                             | Anlagegruppe | Benchmark |       |
|-----------------------------|--------------|-----------|-------|
| Morgan Stanley              | A+           | 1.46%     | 1.43% |
| JPMorgan Chase & Co         | A+           | 1.42%     | 1.44% |
| Bank of America, New York   | A+           | 1.29%     | 1.35% |
| Goldman Sachs Group Inc/The | A            | 1.27%     | 1.13% |
| Citigroup Inc               | BBB+         | 0.94%     | 0.92% |
| Wells Fargo & Co            | A            | 0.94%     | 0.90% |
| Amazon.com Inc              | AA-          | 0.87%     | 0.76% |
| HSBC Holdings PLC           | A-           | 0.86%     | 0.95% |
| AT&T Inc                    | BBB          | 0.86%     | 0.84% |
| Verizon Communications Inc  | BBB+         | 0.81%     | 0.81% |

#### Portfoliostruktur nach Fälligkeit

|            | Anlagegruppe | Benchmark |
|------------|--------------|-----------|
| 0-3 Jahre  | 21.39%       | 21.73%    |
| 3-5 Jahre  | 20.52%       | 21.29%    |
| 5-7 Jahre  | 15.07%       | 14.44%    |
| 7-10 Jahre | 16.55%       | 16.21%    |
| > 10 Jahre | 26.48%       | 26.32%    |

#### Duration und Rendite auf Verfall

|                                   | Anlagegruppe | Benchmark |
|-----------------------------------|--------------|-----------|
| Modified Duration                 | 5.9          | 5.8       |
| Theoretische Rendite auf Verfall* | 4.66%        | 4.65%     |

\* vor Währungsabsicherung

#### Portfoliostruktur nach Rating

|            | Anlagegruppe | Benchmark |
|------------|--------------|-----------|
| AAA        | 0.66%        | 0.60%     |
| AA         | 8.85%        | 8.71%     |
| A          | 44.63%       | 44.62%    |
| BBB        | 45.64%       | 46.07%    |
| Liquidität | 0.23%        | -         |

#### Portfoliostruktur nach Ländern/Regionen

|                        | Anlagegruppe | Benchmark |
|------------------------|--------------|-----------|
| Vereinigte Staaten     | 56.81%       | 56.38%    |
| Vereinigtes Königreich | 6.70%        | 6.77%     |
| Frankreich             | 6.20%        | 6.16%     |
| Deutschland            | 5.17%        | 4.79%     |
| Kanada                 | 5.16%        | 5.20%     |
| Japan                  | 3.27%        | 3.47%     |
| Australien             | 2.25%        | 2.30%     |
| Spanien                | 1.88%        | 2.20%     |
| Niederlande            | 1.76%        | 1.56%     |
| Andere                 | 10.59%       | 11.16%    |
| Liquidität             | 0.23%        | -         |