

Anlagestiftung Swiss Life

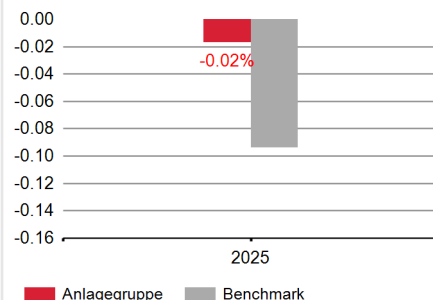
Obligationen CHF AAA-BBB Indexiert SPM

Nettovermögen (NAV) in Mio. CHF: 111.01
Nettovermögen pro Anspruch in CHF: 1'012.63

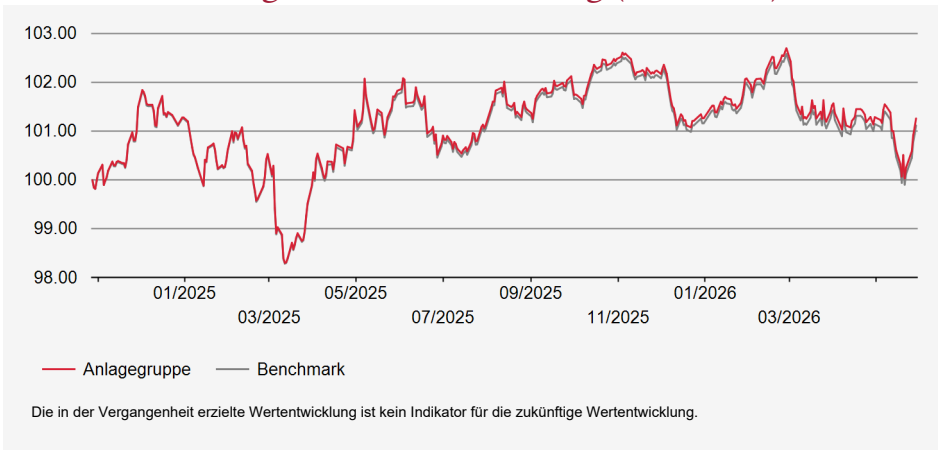
Anlagestrategie

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® AAA-BBB Total Return nachzubilden. Umsetzung mittels Einsatz des Swiss Life Index Funds (CH) Bond 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.svvk-asir.ch) zum Ausschluss empfohlen sind.

Performance



Wertentwicklung in Referenzwährung (Basis 100)



Produktinformationen

Valorennummer: 137660508
ISIN: CH1376605080
LEI: 254900HVSBMFQUTCBS55
Bloomberg-Code: SLAICHP SW
Benchmark: SBI® AAA-BBB Total Return
Währung: CHF
Domizil: Schweiz
Aufgagedatum: 28/10/2024
Erstausgabepreis: 1000.00
Jahresabschluss: 30.09
Ausgabe/Rücknahme: Täglich
Annahmeschluss: 13:00 Uhr
Verwässerungsschutz: Ausgabe- / Rücknahmekommission zugunsten der Anlagegruppe gemäss Konditionenübersicht.
Asset Manager gemäss Swiss Life Best Select Invest Plus®: Swiss Life Asset Management AG

Performance in Referenzwährung

	Kumulierte Performance				Annualisierte Performance			
	YTD	1 Monat	3 Monate	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Aufl.
Anlagegruppe	0.00%	-0.02%	-1.40%	-0.55%	-	-	-	0.80%
Benchmark	-0.04%	-0.03%	-1.43%	-0.62%	-	-	-	0.70%

Statistische Angaben (annualisiert)

	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Aufl.
Volatilität Anlagegruppe (in %)	2.39	-	-	-	2.61
Volatilität Benchmark (in %)	2.38	-	-	-	2.59
Tracking Error ex post (in %)	0.03	-	-	-	0.03
Information Ratio	2.70	-	-	-	2.58
Sharpe Ratio	-0.22	-	-	-	0.23
Korrelation	1.00	-	-	-	1.00
Beta	1.00	-	-	-	1.01
Jensen-Alpha	0.07	-	-	-	0.09
Maximum Drawdown (in %)	-2.59	-	-	-	-3.47
Recovery Period (Jahre)	-	-	-	-	0.15

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%

Anlagestiftung Swiss Life

Obligationen CHF AAA-BBB Indexiert SPM

Portfoliostruktur nach Branchen

	Anlagegruppe	Benchmark
Covered	33.93%	34.12%
Local Authority	18.39%	18.46%
Treasury	14.36%	14.54%
Industrie	12.75%	12.37%
Financial Institutions	10.68%	11.15%
Agency	5.06%	5.08%
Supranational	2.00%	2.05%
Versorgung	1.87%	1.75%
Sovereign	0.72%	0.48%
Liquidität	0.24%	-

Grösste Schuldner und Rating

	Anlagegruppe	Benchmark	
Pfandbriefbank schweizerischer Hypothekarinstitute AG	AAA	15.62%	15.66%
Swiss Confederation	AAA	14.40%	14.54%
Pfandbriefzentrale der schweizerischen Kantonalbanken AG	AAA	14.37%	14.43%
Canton of Geneva Switzerland	AA	1.24%	1.32%
Luzerner Kantonalbank AG	AA-	1.21%	1.19%
City of Zurich Switzerland	AA+	1.19%	1.15%
Zürcher Kantonalbank	AAA	1.17%	1.15%
Credit Agricole Group	AA-	1.01%	1.03%
Nestle SA	AA	0.94%	1.00%
UBS Group AG	AA+	0.76%	0.82%

Portfoliostruktur nach Fälligkeit

	Anlagegruppe	Benchmark
0-3 Jahre	22.14%	23.24%
3-5 Jahre	21.23%	20.79%
5-7 Jahre	16.98%	17.09%
7-10 Jahre	17.24%	16.79%
> 10 Jahre	22.40%	22.09%

Duration und Rendite auf Verfall

	Anlagegruppe	Benchmark
Modified Duration	7.1	7.0
Theoretische Rendite auf Verfall*	0.77%	0.77%

* vor Währungsabsicherung

Portfoliostruktur nach Rating

	Anlagegruppe	Benchmark
AAA	57.49%	57.78%
AA	19.08%	19.28%
A	15.53%	15.64%
BBB	7.47%	7.30%
NR	0.20%	-
Liquidität	0.24%	-

Portfoliostruktur nach Ländern/Regionen

	Anlagegruppe	Benchmark
Schweiz	75.12%	75.69%
Vereinigte Staaten	5.17%	4.69%
Frankreich	3.53%	3.60%
Deutschland	3.27%	3.24%
Kanada	2.36%	2.50%
Supranational	1.86%	1.90%
Australien	1.22%	1.24%
Österreich	0.98%	0.91%
Spanien	0.94%	0.84%
Andere	5.30%	5.40%
Liquidität	0.24%	-