

Anlagestiftung Swiss Life

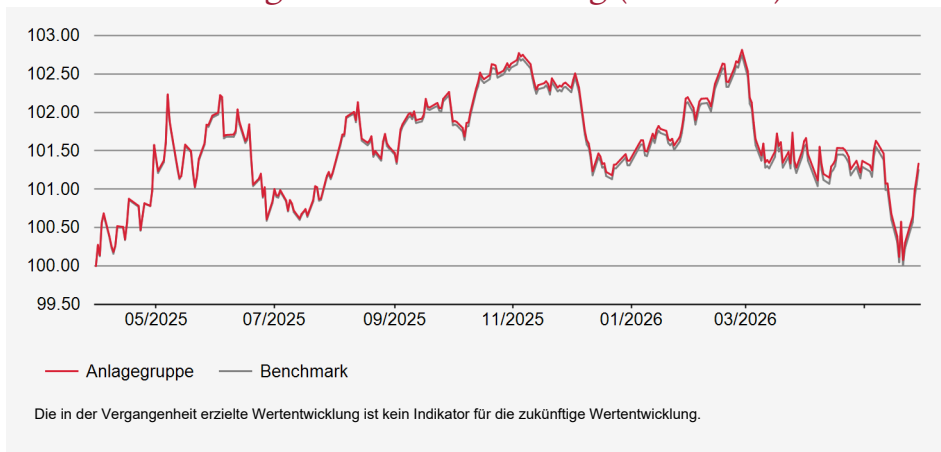
Obligationen CHF AAA-BBB ESG Indexiert SPM

Nettovermögen (NAV) in Mio. CHF: 2.99
Nettovermögen pro Anspruch in CHF: 1'013.34

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	-0.04%	-0.03%	-1.44%	-0.61%	-	-	-	1.15%
Benchmark	-0.06%	-0.04%	-1.45%	-0.67%	-	-	-	1.08%

Statistische Angaben (annualisiert)

	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Aufl.
Volatilität Anlagegruppe (in %)	2.44	-	-	-	2.61
Volatilität Benchmark (in %)	2.44	-	-	-	2.71
Tracking Error ex post (in %)	0.02	-	-	-	0.02
Information Ratio	2.62	-	-	-	2.84
Sharpe Ratio	-0.24	-	-	-	0.41
Korrelation	1.00	-	-	-	1.00
Beta	1.00	-	-	-	1.00
Jensen-Alpha	0.06	-	-	-	0.07
Maximum Drawdown (in %)	-2.66	-	-	-	-2.66
Recovery Period (Jahre)	-	-	-	-	-

Performance

Datenhistorie unzureichend

Produktinformationen

Valorenummer: 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

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 CHF AAA-BBB ESG Indexiert SPM

Portfoliostruktur nach Branchen

	Anlagegruppe	Benchmark
Covered	35.87%	36.00%
Local Authority	19.42%	19.17%
Treasury	15.26%	15.41%
Financial Institutions	11.25%	11.10%
Industrie	9.17%	9.41%
Agency	4.62%	5.05%
Supranational	2.11%	2.17%
Versorgung	1.28%	1.18%
Sovereign	0.74%	0.51%
Liquidität	0.30%	-

Grösste Schuldner und Rating

	Anlagegruppe	Benchmark	
Pfandbriefbank schweizerischer Hypothekarinstitute AG	AAA	16.46%	16.60%
Swiss Confederation	AAA	15.30%	15.41%
Pfandbriefzentrale der schweizerischen Kantonalbanken AG	AAA	15.19%	15.30%
Canton of Geneva Switzerland	AA	1.37%	1.40%
Zürcher Kantonalbank	AA+	1.33%	1.22%
Luzerner Kantonalbank AG	AA-	1.24%	1.26%
Credit Agricole Group	AA	1.22%	1.09%
City of Zurich Switzerland	AAA	1.13%	1.22%
UBS Group AG	AA	0.81%	0.87%
Basellandschaftliche Kantonalbank	AA	0.74%	0.76%

Portfoliostruktur nach Fälligkeit

	Anlagegruppe	Benchmark
0-3 Jahre	20.82%	22.24%
3-5 Jahre	21.03%	20.61%
5-7 Jahre	17.69%	17.03%
7-10 Jahre	16.83%	17.15%
> 10 Jahre	23.63%	22.97%

Duration und Rendite auf Verfall

	Anlagegruppe	Benchmark
Modified Duration	7.3	7.2
Theoretische Rendite auf Verfall*	0.77%	0.76%

* vor Währungsabsicherung

Portfoliostruktur nach Rating

	Anlagegruppe	Benchmark
AAA	60.47%	60.92%
AA	18.77%	18.51%
A	14.23%	14.30%
BBB	6.03%	6.27%
NR	0.19%	-
Liquidität	0.30%	-

Portfoliostruktur nach Ländern/Regionen

	Anlagegruppe	Benchmark
Schweiz	77.63%	77.94%
Frankreich	3.25%	3.41%
Vereinigte Staaten	3.16%	3.31%
Deutschland	2.95%	2.82%
Kanada	2.33%	2.40%
Supranational	1.93%	2.01%
Australien	1.29%	1.26%
Österreich	1.22%	0.96%
Niederlande	0.87%	0.91%
Andere	5.07%	4.98%
Liquidität	0.30%	-