

31. Oktober 2024

Anlagestiftung Swiss Life Hypothesen Schweiz ESG PM

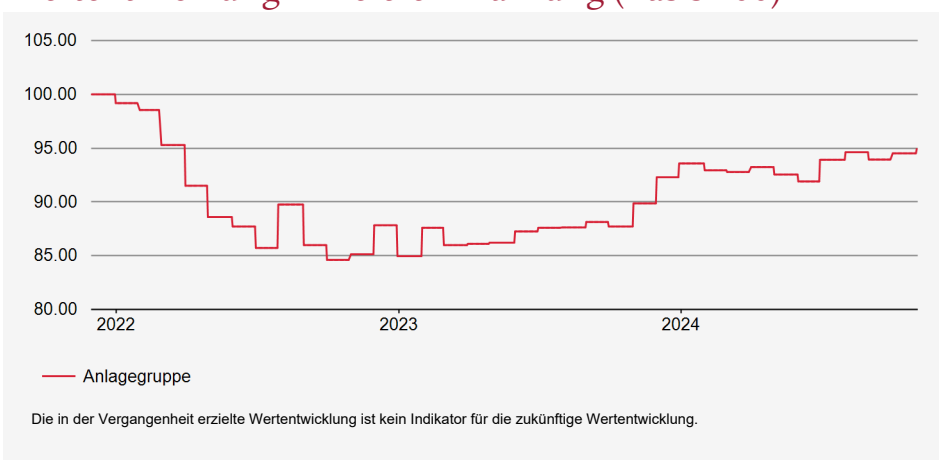


Nettovermögen (NAV) in Mio. CHF: 220.25
Nettovermögen pro Anspruch in CHF: 94.92

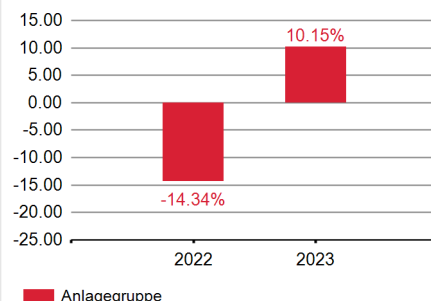
Anlagestrategie

Investitionen in nachhaltige Schweizer Hypothesen: mindestens 85% nach Abzug der flüssigen Mittel. Zielduration von 8. Umsetzung mittels Einsatz des «Swiss Life ESG Mortgage Fund» Teilvermögen des Swiss Life Mortgage Funds, ein vertraglicher Umbrella-Fonds schweizerischen Rechts.

Wertentwicklung in Referenzwährung (Basis 100)



Performance



Produktinformationen

Valorennummer: 112778775

ISIN: CH1127787757

LEI: 254900V4K2D79T13EF45

Bloomberg-Code: SLHSEPM SW

Währung: CHF

Domizil: Schweiz

Aufledgedatum: 30/11/2021

Erstausgabepreis: 100.00

Jahresabschluss: 30.9

Ausgabe/Rücknahme: Monatlich

Verwässerungsschutz:

Ausgabe- / Rücknahmekommission zugunsten der Anlagegruppe gemäss Konditionenübersicht.

Ausschüttungspraxis: Thesaurierung

Asset Manager:

Swiss Life Asset Management AG

Kurspublikationen: Bloomberg: ASSL

www.swisslife.ch/anlagestiftung

Betriebsaufwandquote TER KGAST

ex ante: 0.35%

ex post per: 30/09/2024 0.35%

Performance in Referenzwährung

	Kumulierte Performance				Annualisierte Performance			
	YTD	1 Monat	3 Monate	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Aufl.
Anlagegruppe	1.43%	0.42%	0.32%	5.62%	-	-	-	-1.77%

Statistische Angaben

Durchschnittliche Restlaufzeit (Jahre)	8.34
Modified Duration (exkl. Forward Hypothesen)*	7.21
Modified Duration (inkl. Forward Hypothesen)*	7.55
Bruttorendite auf Verfall	1.54%
Durchschnittliche Belehnung	59%
Anzahl Hypothesen	700
Rendite-Differenz zu Schweizer Staatsanleihen	1.15%

*inkl. Liquidität

PM-Tranche: Der Erwerb dieser Tranche ist nur im Rahmen einer speziellen Vereinbarung mit Swiss Life Asset Management AG möglich.

Ausgabe: Monatlich, unter Einhaltung einer 1-monatigen Zeichnungsfrist.

Rückgabe: Monatlich, unter Einhaltung einer 6-monatigen Kündigungsfrist. Erstmalige Rückgabe 30. Januar 2024

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.

Vermögensstruktur

Hypotheken	95.28%
Geldmarktfonds	3.13%
Liquidität	1.60%
Derivate	0.00%

Verteilung nach Belehnungshöhe

<40%	8.90%
40 - 50%	14.12%
50 - 60%	13.84%
60 - 70%	51.58%
>70%	11.56%

Art der Pfandobjekte

EINFAMILIENHÄUSER	35.05%
EIGENTUMSWOHNUNGEN	52.88%
MEHRFAMILIENHÄUSER	7.44%
KOMMERZIELL GENUTZTE LIEGENSCHAFTEN	4.63%

Geografische Verteilung der Liegenschaften

Zürich	27.01%
Espace Mittelland	15.50%
Innerschweiz	7.87%
Nordwestschweiz	7.13%
Ostschweiz	2.19%
Tessin	1.15%
Genferseeregion	39.15%

Verfallstruktur der Hypotheken

1-3 JAHRE	9.10%
3-5 JAHRE	16.81%
5-7 JAHRE	5.50%
7-10 JAHRE	50.54%
10-15 JAHRE	10.94%
>15 JAHRE	7.10%

Hypothekenarten

Festhypotheken	98.54%
Saron Hypotheken	1.40%
Variable Hypotheken	0.06%

ESG Verteilung

Minergie	51.83%
GEAK	45.47%
THPE	2.61%
Kein Label/Zertifikat	0.09%

Hypotheken mit Zahlungsausständen grösser 90 Tage

Durchschnittliche Belehnung	-
Anzahl Hypothekarschuldner	-
Relativer Gesamtwert der Hypotheken mit Zahlungsausständen	-