

31. Oktober 2022

Anlagestiftung Swiss Life Hypotheken Schweiz ESG PM

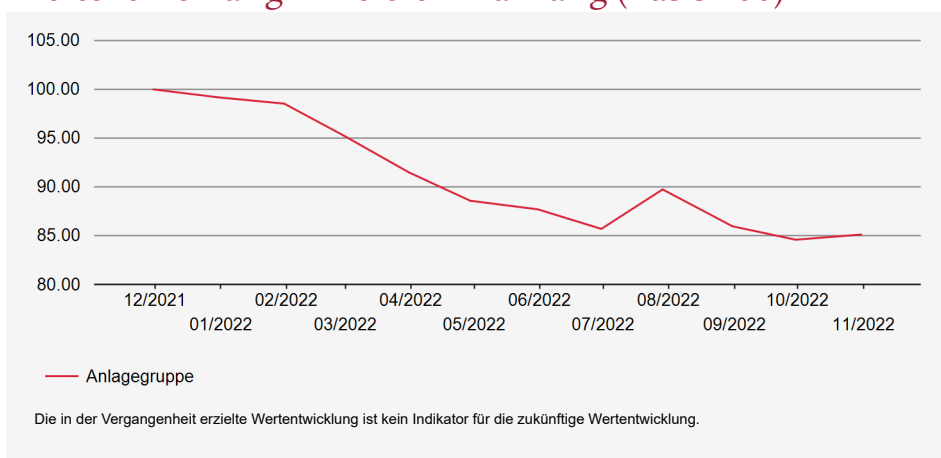


Nettovermögen (NAV) in Mio. CHF: 189.53
Nettovermögen pro Anspruch in CHF: 85.14

Anlagestrategie

Investitionen in nachhaltige Schweizer Hypotheken: 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 in Referenzwährung

	KUMULIERTE PERFORMANCE				ANNUALISIERTE PERFORMANCE			
	YTD	1 MONAT	3 MONATE	1 JAHR	3 JAHRE	5 JAHRE	10 JAHRE	AUFL.
ANLAGEGRUPPE	-14.16%	0.63%	-5.15%	-	-	-	-	-

Statistische Angaben

Durchschnittliche Restlaufzeit (Jahre)	9.22
Modified Duration (excl. Forward Hypotheken)*	7.44
Modified Duration (inkl. Forward Hypotheken)*	8.06
Bruttorendite auf Verfall	2.57%
Durchschnittliche Belehnung	58%
Anzahl Hypotheken	378
Rendite-Differenz zu Schweizer Staatsanleihen	1.50%

*inkl. Liquidität

Performance

Datenhistorie unzureichend

Produktinformationen

Valorennummer: 112778775

ISIN: CH1127787757

LEI: 254900V4K2D79T13EF45

Bloomberg-Code: SLHSEPM SW

Währung: CHF

Domizil: Schweiz

Aufledgedatum: 30/11/2021

Ausgabepreis: 100.00

Jahresabschluss: 30.9

Ausgabe/Rücknahme: Monatlich

Ausgabe-/Rücknahmekommission: Keine

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: 30/09/2022 0.35%

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

Performance: Gesamtertrag über einen bestimmten Betrachtungszeitraum auf der Basis von zeitgewichteten Renditen.

Statistische Angaben: Die Risikokennzahlen basieren auf logarithmierten, monatlichen zeitgewichteten Renditen.

Vermögensstruktur

HYPOTHEKEN	90.00%
OBLIGATIONEN	5.30%
LIQUIDITÄT	4.70%
DERIVATE	0.00%

Verteilung nach Belehnungshöhe

<40%	10.01%
40 - 50%	14.31%
50 - 60%	11.26%
60 - 70%	55.92%
>70%	8.51%

Art der Pfandobjekte

EINFAMILIENHÄUSER	28.82%
EIGENTUMSWOHNUNGEN	51.11%
MEHRFAMILIENHÄUSER	11.65%
KOMMERZIELL GENUTZTE LIEGENSCHAFTEN	8.43%

Anteil Hypothekenarten

FESTHYPOTHEKEN	98.50%
SARON HYPOTHEKEN	1.42%
VARIABLE HYPOTHEKEN	0.08%

Geografische Verteilung der Liegenschaften

ZÜRICH	25.22%
ESPACE MITTELLAND	11.65%
INNERSCHWEIZ	11.47%
NORDWESTSCHWEIZ	6.06%
OSTSCHWEIZ	1.98%
TESSIN	0.92%
GENFERSEEREGION	42.70%

Verfallstruktur der Hypotheken

1-3 JAHRE	11.34%
3-5 JAHRE	11.41%
5-7 JAHRE	16.19%
7-10 JAHRE	27.97%
10-15 JAHRE	18.49%
>15 JAHRE	14.60%

Hypotheken mit Zahlungsausständen grösser 90 Tage

ANZAHL HYPOTHEKARSCHULDNER	-
RELATIVER GESAMTWERT DER HYPOTHEKEN MIT ZAHLUNGS AUSSTÄNDEN	-
DURCHSCHNITTLICHE BELEHNUNG	-