

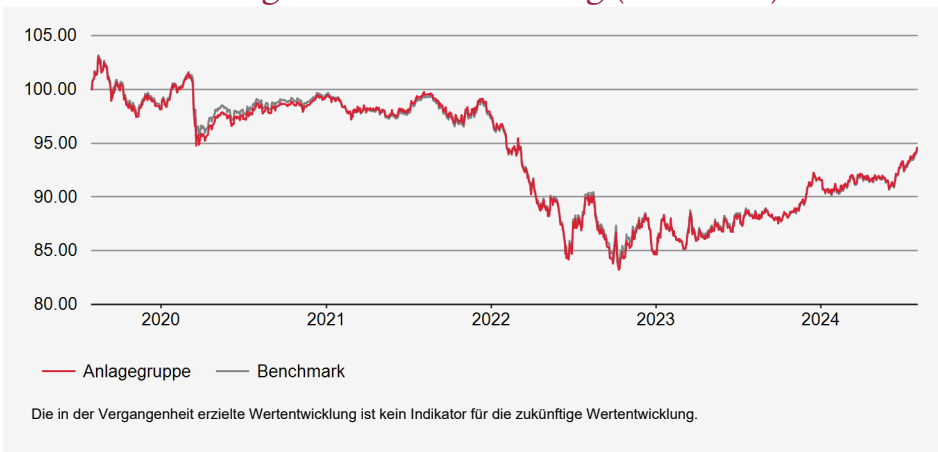
# Anlagestiftung Swiss Life Obligationen CHF Inland PM

**Nettovermögen (NAV) in Mio. CHF: 797.27**  
**Nettovermögen pro Anspruch in CHF: 146.00**

## Anlagestrategie

Anlagen in auf CHF lautende Forderungspapiere von Schuldern mit Domizil hauptsächlich in der Schweiz. Aktive Titelselektion, Durationsteuerung und Zinskurvenpositionierung. Schuldnerbegrenzung: 10% (Ausnahmen: bis 25% in jedes Pfandbriefinstitut, Schweizerische Eidgenossenschaft ohne Begrenzung). Referenz-Indexfremde Schuldner: max. 10%. Durchschnittliche Ratingqualität: mindestens A+. Umsetzung mittels Einsatz des Swiss Life iFunds (CH) Bond Swiss Francs Domestic (CHF); Anlagefonds schweizerischen Rechts der Kategorie "Übrige Fonds für traditionelle Anlagen".

## Wertentwicklung in Referenzwährung (Basis 100)



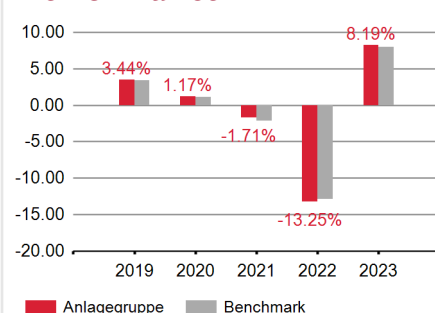
## Performance in Referenzwährung

	Kumulierte Performance				Annualisierte Performance			
	YTD	1 Monat	3 Monate	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Aufl.
Anlagegruppe	3.28%	1.36%	3.02%	7.18%	-1.63%	-1.11%	0.73%	2.23%
Benchmark	3.12%	1.29%	2.92%	6.82%	-1.61%	-1.14%	0.64%	2.06%

## Statistische Angaben (annualisiert)

	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Aufl.
Volatilität Anlagegruppe (in %)	3.94	6.07	5.89	4.75	4.08
Volatilität Benchmark (in %)	3.96	5.88	5.65	4.60	4.03
Tracking Error ex post (in %)	0.19	0.43	0.47	0.37	0.43
Information Ratio	1.94	-0.03	0.08	0.23	0.38
Sharpe Ratio	1.36	-0.37	-0.20	0.22	0.54
Korrelation	1.00	1.00	1.00	1.00	0.99
Beta	0.99	1.03	1.04	1.03	1.01
Jensen-Alpha	0.39	0.05	0.09	0.06	0.15
Maximum Drawdown (in %)	-2.14	-16.56	-19.21	-19.21	-19.21
Recovery Period (Jahre)	0.41	-	-	-	-

## Performance



## Produktinformationen

**Valorennummer:** 3026053  
**ISIN:** CH0030260530  
**LEI:** 254900M0YGKYAE29FA28  
**Bloomberg-Code:** SLOCIPM SW  
**Benchmark:** SBI Domestic AAA - BBB TR  
**Währung:** CHF  
**Domizil:** Schweiz  
**Aufgagedatum:** 31/05/2007  
**Erstausgabepreis:** 100.00  
**Jahresabschluss:** 30.09  
**Ausgabe/Rücknahme:** Täglich  
**Annahmeschluss:** 13.00 Uhr  
**Ausgabe- / Rücknahmekommission:** Keine  
**Ausschüttungspraxis:** Thesaurierung  
**Asset Manager gemäss Swiss Life Best Select Invest Plus®:** Swiss Life Asset Management AG  
**Überwachung Asset Manager:** PPCmetrics unterstützt die laufende Überwachung des Asset Managers sowie die Beurteilung der Anlageresultate.  
**Kurspublikationen:** Bloomberg: ASSL  
[www.swisslife.ch/anlagestiftung](http://www.swisslife.ch/anlagestiftung)  
**Betriebsaufwandquote TER KGAST ex ante:** 0.08%  
**ex post per:** 30/09/2023 0.08%

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

**Asset Manager:** Die Auswahl der Manager, deren permanente Überwachung und die gesamte Prozessbegleitung erfolgen nach objektiven Kriterien und bester institutioneller Praxis durch Swiss Life Asset Management AG.

**Betriebsaufwandquote TER KGAST:** Die Betriebsaufwandquote TER KGAST deckt sämtliche Kosten mit Ausnahme der Transaktionskosten und der transaktionsbezogenen steuerlichen Abgaben ab.

**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 Inland PM

## Portfoliostruktur nach Branchen

	Anlagegruppe	Benchmark
Pfandbriefinstitute	30.50%	39.06%
Finanzwesen	28.77%	15.49%
Staatlich und staatsnah	22.74%	30.54%
Basiskonsumgüter	6.79%	6.96%
Versorgungsbetriebe	5.13%	2.45%
Industrie	2.82%	2.82%
Nicht-Basiskonsumgüter	1.36%	0.38%
Kommunikation	0.69%	0.92%
Andere	0.27%	1.38%
Liquidität	0.93%	-

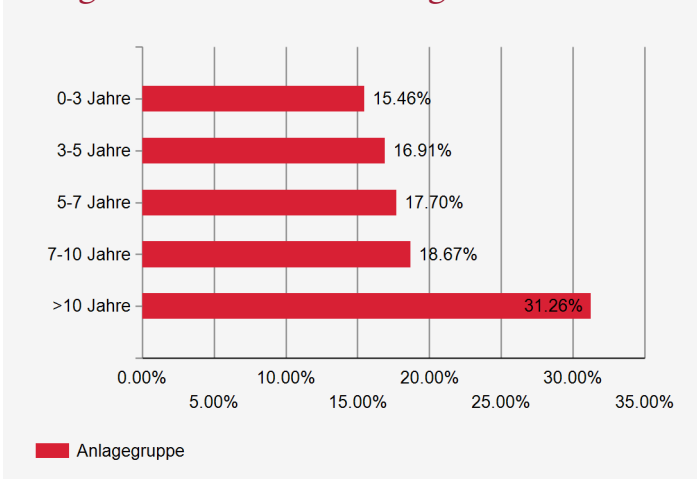
## Grösste Schuldner und Rating

	Rating	Anlagegruppe
Pfandbriefbank	AAA	16.73%
Pfandbriefzentrale	AAA	13.12%
Eidgenossenschaft	AAA	12.83%
Zürcher Kantonalbank	AA+	2.77%
Stadt Zürich	AAA	2.64%

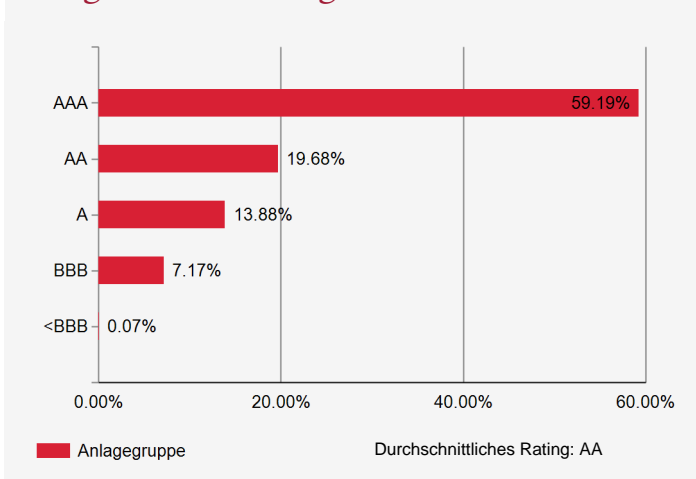
## Weitere Angaben zu den Schuldnern

Anzahl Schuldner	106
Anteil Benchmarkfremde Schuldner	0.31%

## Fälligkeitstruktur der Anlagen



## Anlagen nach Rating



## Duration und Rendite auf Verfall

	Anlagegruppe	Benchmark
Modified Duration*	8.0	7.9
Theoretische Rendite auf Verfall*	0.99%	0.91%

\* Vor Währungsabsicherung, unter Berücksichtigung der Derivate