



Anlagestiftung Swiss Life Obligationen Emerging Markets Unternehmen SPM (CHF hedged)

SwissLife

Nettovermögen (NAV) in Mio. CHF: 374.51
Nettovermögen pro Anspruch in CHF: 98.82

Anlagestrategie

Anlagen in auf US Dollar oder auf andere Hartwährungen lautende Forderungspapiere von Unternehmen und Staaten, inklusive Agencies und Supranationals aus Schwellenländern (Emerging Markets). Aktive Titelselektion, Durationsteuerung und Zinskurvenpositionierung. Schuldnerbegrenzung: 10%. Forderungspapiere benchmarkfremder Schuldner: max.35%. Durchschnittliche Ratingqualität: mindestens BBB-. Fremdwährungsrisiken werden zu mindestens 90% gegen Schweizerfranken abgesichert. Umsetzung mittels Einsatz des Swiss Life Funds (LUX) Bond Emerging Markets Corporates CHF-hedged AM Cap; Anlagefonds nach luxemburgischem Recht.

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 | -1.07% | 0.03% | -1.33% | - | - | - | - | - |
| Benchmark | -1.05% | 0.02% | -1.66% | - | - | - | - | - |

Statistische Angaben (annualisiert)

| | 1 Jahr | 3 Jahre | 5 Jahre | 10 Jahre | Aufl. |
|---------------------------------|--------|---------|---------|----------|-------|
| Volatilität Anlagegruppe (in %) | - | - | - | - | 3.53 |
| Volatilität Benchmark (in %) | - | - | - | - | 3.64 |
| Tracking Error ex post (in %) | - | - | - | - | 0.61 |
| Information Ratio | - | - | - | - | 0.01 |
| Sharpe Ratio | - | - | - | - | -0.56 |
| Korrelation | - | - | - | - | 0.99 |
| Beta | - | - | - | - | 0.95 |
| Jensen-Alpha | - | - | - | - | -0.03 |
| Maximum Drawdown (in %) | - | - | - | - | -2.81 |
| Recovery Period (Jahre) | - | - | - | - | - |

Performance

Datenhistorie unzureichend

Produktinformationen

Valorenummer: 148323397

ISIN: CH1483233974

LEI: 254900R4DORKK6JJUG51

Bloomberg-Code: SLOEUCS SW

Benchmark: JP Morgan CEMBI Broad Diversified IG Index (CHF Hedged)

Währung: CHF

Domizil: Schweiz

Auflagedatum: 03/11/2025

Erstausgabepreis: 100.00

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

Überwachung Asset Manager:

Überwachung der Anlageresultate des eingesetzten Vermögensverwalters durch PPCmetrics

Kurspublikationen: Bloomberg: ASSL
www.swisslife.ch/anlagestiftung

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 Emerging Markets Unternehmen SPM (CHF hedged)

Portfoliostruktur nach Branchen

| | Anlagegruppe | Benchmark |
|-------------------------|--------------|-----------|
| Finanzwesen | 32.39% | 41.05% |
| Kommunikation | 14.03% | 8.17% |
| Versorgungsbetriebe | 10.57% | 9.63% |
| Energie | 9.37% | 9.65% |
| Basiskonsumgüter | 8.01% | 5.08% |
| Grundstoffe | 5.16% | 11.66% |
| Staatlich und staatsnah | 4.90% | 1.05% |
| Nicht-Basiskonsumgüter | 4.81% | 5.42% |
| Supranational | 1.16% | - |
| Andere | 7.53% | 8.30% |
| Liquidität | 2.54% | - |
| Währungsabsicherung | -0.48% | - |

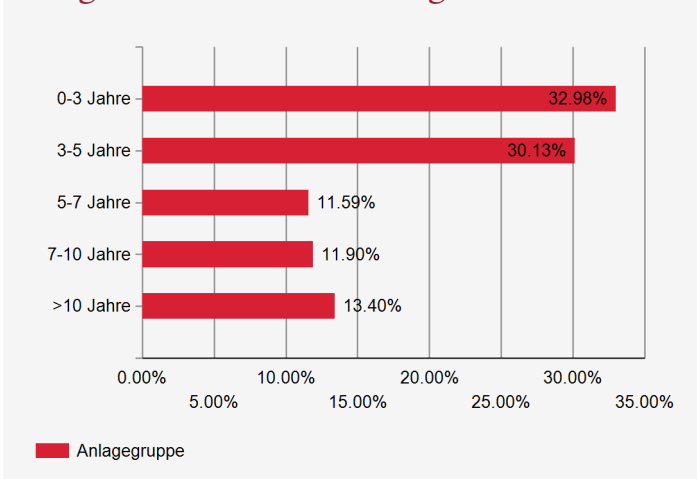
Grösste Schuldner und Rating

| | Rating | Anlagegruppe |
|---|--------|--------------|
| Erste Group Bank AG | BBB+ | 3.62% |
| US Treasury N/B | AA+ | 3.41% |
| Prosus NV | BBB | 2.41% |
| Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd | AA- | 2.04% |
| Saudi Arabian Oil Co | A+ | 1.94% |

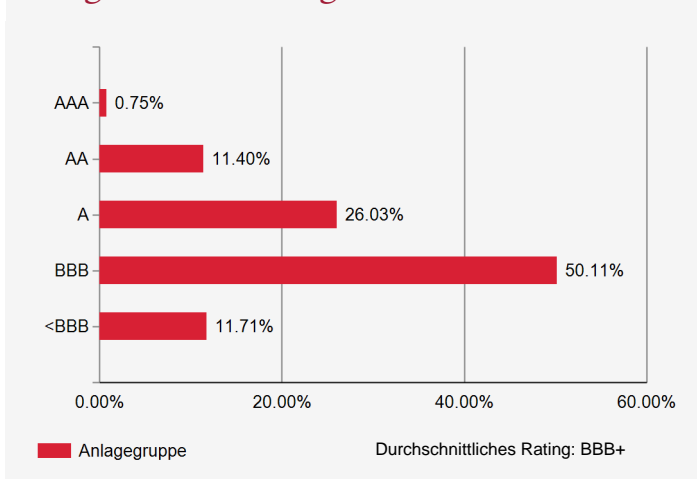
Weitere Angaben zu den Schuldnern

| | |
|----------------------------------|--------|
| Anzahl Schuldner | 148 |
| Anteil Benchmarkfremde Schuldner | 32.19% |

Fälligkeitstruktur der Anlagen



Anlagen nach Rating



Duration und Rendite auf Verfall

| | Anlagegruppe | Benchmark |
|-----------------------------------|--------------|-----------|
| Modified Duration | 5.0 | 4.5 |
| Theoretische Rendite auf Verfall* | 5.27% | 5.08% |

* vor Währungsabsicherung

Portfoliostruktur nach Ländern/Regionen

| | Anlagegruppe | Benchmark |
|------------------------------------|--------------|-----------|
| China | 7.71% | 12.58% |
| Vereinigte Arabische Emirate | 7.11% | 5.90% |
| Mexiko | 5.59% | 4.19% |
| Singapur | 5.30% | 3.61% |
| Südkorea | 5.01% | 7.18% |
| Saudiarabien | 4.95% | 6.51% |
| Hongkong | 4.27% | 3.99% |
| Schwellenländer Asien Pazifik | 15.18% | 17.79% |
| Schwellenländer Lateinamerika | 12.33% | 8.37% |
| Schwellenländer im mittleren Osten | 7.88% | 10.92% |
| Andere | 22.62% | 18.98% |
| Liquidität, Absicherung | 2.06% | - |