

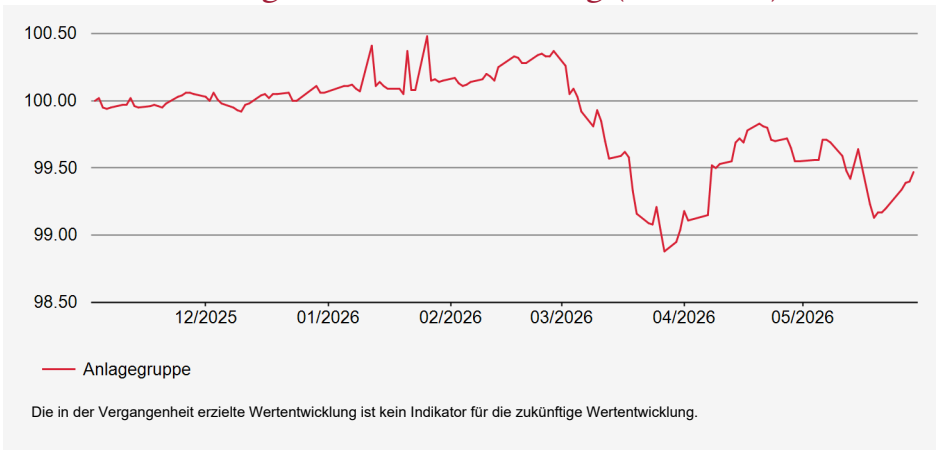
Anlagestiftung Swiss Life Obligationen Emerging Markets Short Term SPM (CHF hedged)

Nettovermögen (NAV) in Mio. CHF: 190.22
Nettovermögen pro Anspruch in CHF: 99.47

Anlagestrategie

Anlagen in auf US Dollar oder auf andere Hartwährungen lautende Forderungspapiere von Unternehmen und Staaten aus Schwellenländern (Emerging Markets) inklusive Agencies und Supranationals mit einer kurzen Restlaufzeit (mehrheitlich unter 3 Jahren). Aktive Titelselektion, Durationsteuerung und Zinskurvenpositionierung. Schuldnerbegrenzung: 10%. Durchschnittliche Ratingqualität: mindestens BBB-. Fremdwährungsrisiken werden zu mindestens 90% gegen Schweizerfranken abgesichert. Umsetzung mittels Einsatz des Swiss Life Funds (LUX) Bond Emerging Markets Short Term CHF 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	-0.59%	-0.08%	-0.90%	-	-	-	-	-

Statistische Angaben (annualisiert)

	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Aufl.
Volatilität Anlagegruppe (in %)	-	-	-	-	2.03
Sharpe Ratio	-	-	-	-	-0.42
Maximum Drawdown (in %)	-	-	-	-	-1.59
Recovery Period (Jahre)	-	-	-	-	-

Performance

Datenhistorie unzureichend

Produktinformationen

Valorenummer: 148323398

ISIN: CH1483233982

LEI: 254900EGYJLGZXIT6O90

Bloomberg-Code: SLOESCS SW

Währung: CHF

Domizil: Schweiz

Aufledgedatum: 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 Short Term SPM (CHF hedged)

Portfoliostruktur nach Branchen

	Anlagegruppe
Staatlich und staatsnah	30.81%
Finanzwesen	26.14%
Kommunikation	9.38%
Energie	6.49%
Basiskonsumgüter	6.14%
Grundstoffe	4.34%
Versorgungsbetriebe	3.38%
Nicht-Basiskonsumgüter	3.12%
Andere	4.41%
Liquidität	6.27%
Währungsabsicherung	-0.48%

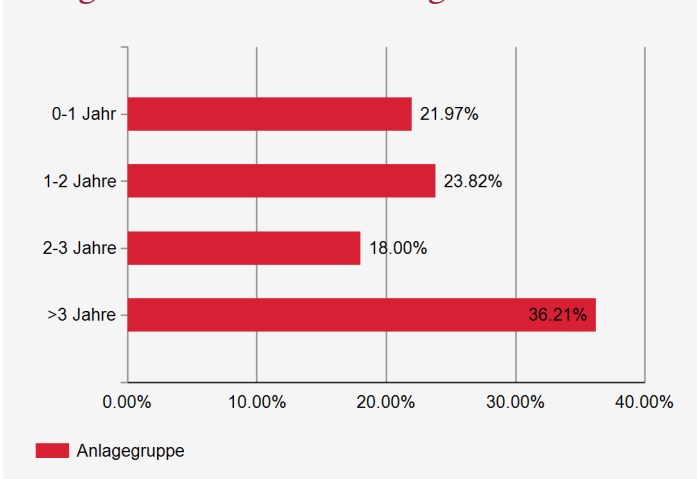
Grösste Schuldner und Rating

		Anlagegruppe
Kingdom of Saudi Arabia	A+	3.31%
US Treasury N/B	AA+	3.14%
Republic of the Philippines	BBB	2.22%
Romania	BBB-	1.96%
United Mexican States	BBB-	1.84%

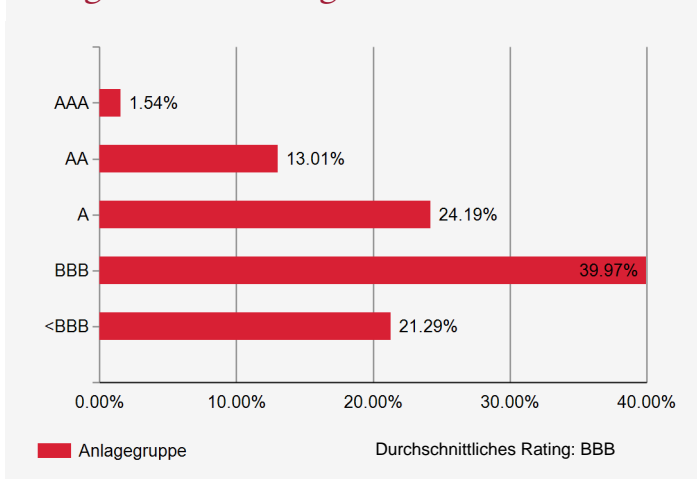
Weitere Angaben zu den Schuldnern

Anzahl Schuldner	132
------------------	-----

Fälligkeitstruktur der Anlagen



Anlagen nach Rating



Duration und Rendite auf Verfall

	Anlagegruppe
Modified Duration	2.3
Theoretische Rendite auf Verfall*	4.89%

* vor Währungsabsicherung

Portfoliostruktur nach Ländern/Regionen

	Anlagegruppe
China	7.05%
Vereinigte Arabische Emirate	6.39%
Mexiko	5.18%
Saudiarabien	4.66%
Indonesien	4.12%
Südkorea	4.05%
Indien	3.92%
Schwellenländer Lateinamerika	16.04%
Schwellenländer Asien Pazifik	14.26%
Schwellenländer Europa	7.24%
Andere	21.28%
Liquidität, Absicherung	5.79%