

Anlagestiftung Swiss Life

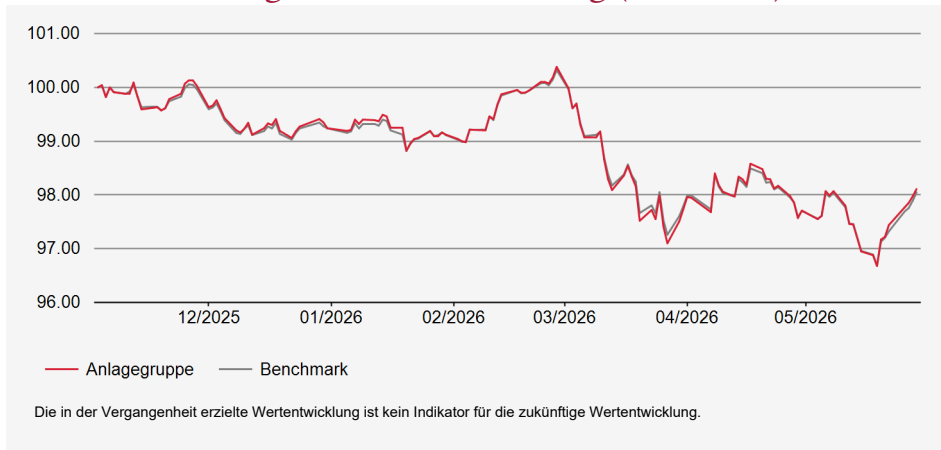
Obligationen Global Aggregate SPM (CHF hedged)

Nettovermögen (NAV) in Mio. CHF: 69.06
Nettovermögen pro Anspruch in CHF: 98.11

Anlagestrategie

Anlagen in Forderungspapiere von Schuldern mit Domizil im In- oder Ausland (seit 1.1.2011 CHF hedged). Aktive Titelselektion, Durationsteuerung und Zinskurvenpositionierung. Schuldnerbegrenzung: 10% (Ausnahme: sofern in der Benchmark vertreten, max. 5%-Punkte mehr als Benchmarkgewichtung). Forderungspapiere benchmarkfremder Schuldner: max.10%. Durchschnittliche Ratingqualität: mindestens A-. Fremdwährungsrisiken werden zu mindestens 90% gegen Schweizerfranken abgesichert. Umsetzung mittels Einsatz Swiss Life iFunds (CH) Bond Global Aggregate (CHF hedged); 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	-1.14%	0.41%	-2.26%	-	-	-	-	-
Benchmark	-1.20%	0.35%	-2.27%	-	-	-	-	-

Statistische Angaben (annualisiert)

	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Aufl.
Volatilität Anlagegruppe (in %)	-	-	-	-	4.25
Volatilität Benchmark (in %)	-	-	-	-	4.03
Tracking Error ex post (in %)	-	-	-	-	0.24
Information Ratio	-	-	-	-	0.38
Sharpe Ratio	-	-	-	-	-0.76
Korrelation	-	-	-	-	1.00
Beta	-	-	-	-	1.05
Jensen-Alpha	-	-	-	-	0.28
Maximum Drawdown (in %)	-	-	-	-	-3.69
Recovery Period (Jahre)	-	-	-	-	-

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.

Benchmark: Die Benchmark wurde per 1. Juli 2012 gewechselt. Für Informationen betreffend die frühere Benchmark wenden Sie sich bitte an die Anlagestiftung Swiss Life.

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.

Performance

Datenhistorie unzureichend

Produktinformationen

Valorennummer: 148323394

ISIN: CH1483233941

LEI: 254900F82G5L48XPDV74

Bloomberg-Code: SLOBACS SW

Benchmark: BLOOMBERG GLO AGG EX SEC EX CNY HEDGED CHF

Währung: CHF

Domizil: Schweiz

Aufliedatum: 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

Anlagestiftung Swiss Life

Obligationen Global Aggregate SPM (CHF hedged)

Portfoliostruktur nach Branchen

	Anlagegruppe	Benchmark
Staatlich und staatsnah	45.14%	72.49%
Finanzwesen	24.36%	11.47%
Basiskonsumgüter	7.08%	3.90%
Kommunikation	5.65%	2.09%
Technologie	2.58%	1.17%
Nicht-Basiskonsumgüter	2.47%	1.68%
Versorgungsbetriebe	1.92%	2.89%
Energie	1.62%	1.67%
Supranational	5.92%	-
Andere	1.52%	2.63%
Liquidität	1.71%	-
Währungsabsicherung	0.02%	-

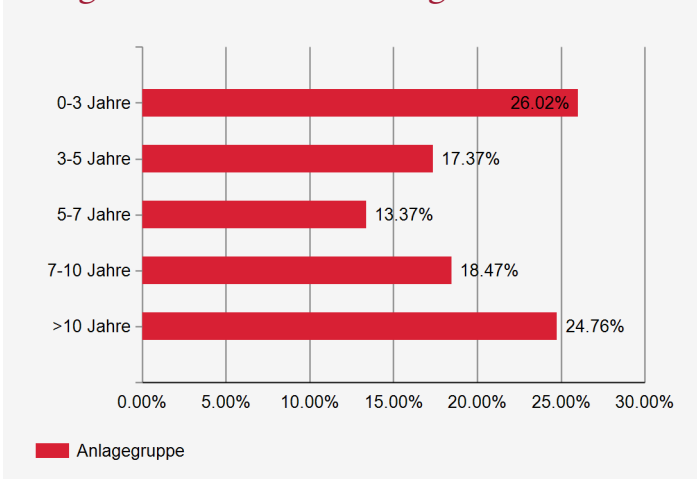
Grösste Schuldner und Rating

	Rating	Anlagegruppe
Japan	A+	9.39%
Italien	BBB+	5.73%
US Treasury N/B	AA+	4.78%
Spanien	A+	3.41%
Frankreich	A+	3.29%

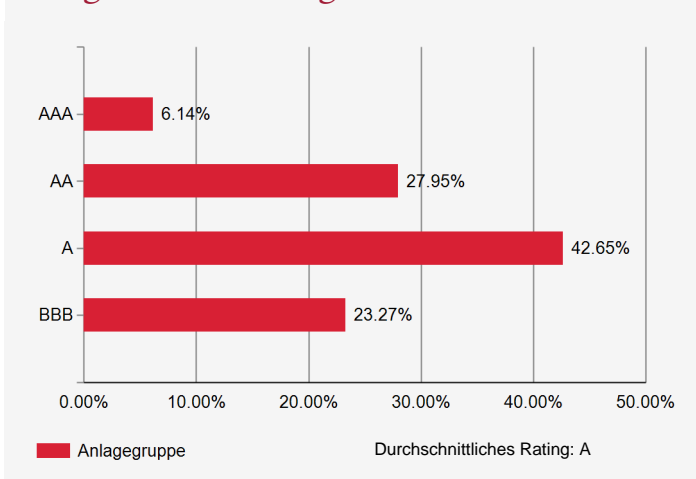
Weitere Angaben zu den Schuldnern

Anzahl Schuldner	118
Anteil Benchmarkfremde Schuldner	0.00%

Fälligkeitstruktur der Anlagen



Anlagen nach Rating



Duration und Rendite auf Verfall

	Anlagegruppe	Benchmark
Modified Duration	6.6	6.4
Theoretische Rendite auf Verfall*	3.64%	3.94%

* vor Währungsabsicherung

Portfoliostruktur nach Ländern/Regionen

	Anlagegruppe	Benchmark
Vereinigte Staaten	27.24%	38.64%
Japan	12.53%	10.59%
Kanada	10.26%	4.65%
Italien	7.16%	4.12%
Vereinigtes Königreich	7.08%	5.55%
Frankreich	5.63%	6.29%
Spanien	5.22%	2.96%
Europäische Region (EUR)	10.65%	12.46%
Europäische Region (Ex EUR)	4.28%	1.37%
Schwellenländer Lateinamerika	4.17%	0.86%
Andere	4.05%	12.50%
Liquidität, Absicherung	1.74%	-