

Anlagestiftung Swiss Life

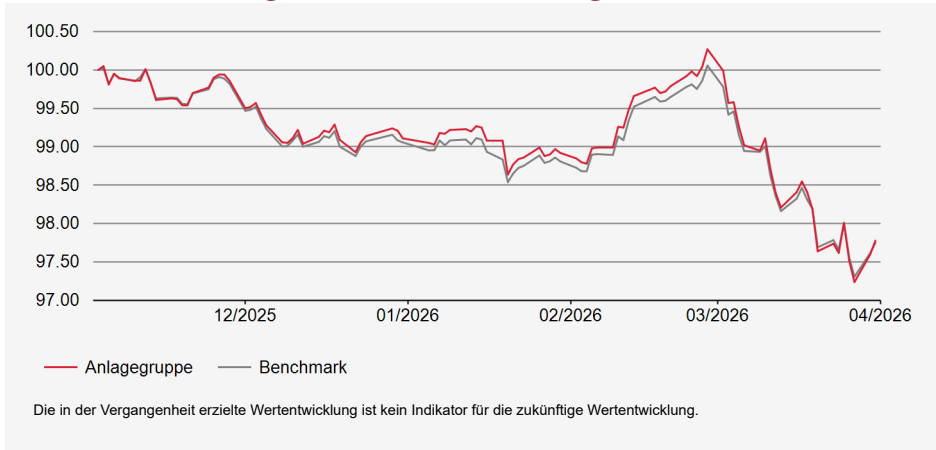
Obligationen Global Staaten+ SPM (CHF hedged)

Nettovermögen (NAV) in Mio. CHF: 610.37
Nettovermögen pro Anspruch in CHF: 97.78

Anlagestrategie

Anlagen in Forderungspapiere von Staaten und staatsnahen Institutionen. 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 des Swiss Life iFunds (CH) Bond Global Government+ (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	-1.34%	-2.48%	-1.34%	-	-	-	-	-
Benchmark	-1.32%	-2.30%	-1.32%	-	-	-	-	-

Statistische Angaben (annualisiert)

	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Aufl.
Volatilität Anlagegruppe (in %)	-	-	-	-	4.83
Volatilität Benchmark (in %)	-	-	-	-	4.47
Tracking Error ex post (in %)	-	-	-	-	0.38
Information Ratio	-	-	-	-	-0.02
Sharpe Ratio	-	-	-	-	-1.11
Korrelation	-	-	-	-	1.00
Beta	-	-	-	-	1.08
Jensen-Alpha	-	-	-	-	0.48
Maximum Drawdown (in %)	-	-	-	-	-3.02
Recovery Period (Jahre)	-	-	-	-	-

Performance

Datenhistorie unzureichend

Produktinformationen

Valorenummer: 148323395

ISIN: CH1483233958

LEI: 254900H7WEVS3K9ANR90

Bloomberg-Code: SLOGSPM SW

Benchmark: BLOOMBERG GLOBAL AGG
TREAS EX CHF TR HEDGED CHF

Währung: CHF

Domizil: Schweiz

Auflegedatum: 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.

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.

Anlagestiftung Swiss Life

Obligationen Global Staaten+ SPM (CHF hedged)

Portfoliostruktur nach Branchen

	Anlagegruppe	Benchmark
Staatlich und staatsnah	85.73%	100.00%
Finanzwesen	5.16%	-
Pfandbriefinstitute	3.58%	-
Supranational	5.59%	-
Liquidität	2.21%	-
Währungsabsicherung	-2.27%	-

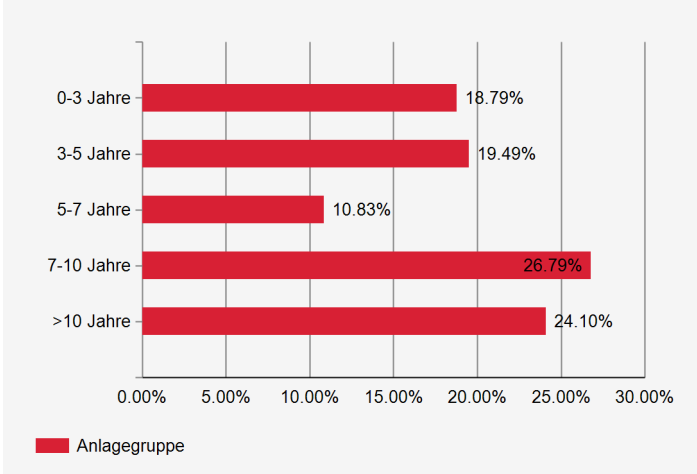
Grösste Schuldner und Rating

		Anlagegruppe
Japan	A+	10.46%
US Treasury N/B	AA+	10.33%
Vereinigtes Königreich	AA-	9.14%
People's Republic of China	A+	8.01%
Italien	BBB	6.22%

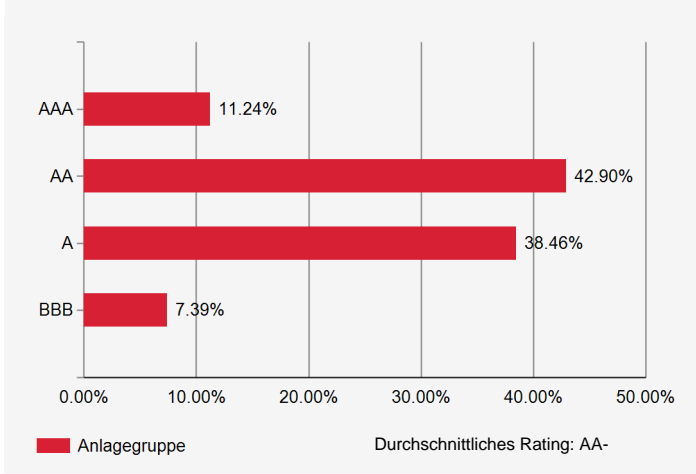
Weitere Angaben zu den Schuldnern

Anzahl Schuldner	61
Anteil Benchmarkfremde Schuldner	0.00%

Fälligkeitstruktur der Anlagen



Anlagen nach Rating



Duration und Rendite auf Verfall

	Anlagegruppe	Benchmark
Modified Duration	7.4	6.7
Theoretische Rendite auf Verfall*	3.29%	3.43%

* vor Währungsabsicherung

Portfoliostruktur nach Ländern/Regionen

	Anlagegruppe	Benchmark
Kanada	14.60%	1.82%
Japan	11.68%	13.93%
Vereinigte Staaten	11.45%	35.83%
Vereinigtes Königreich	10.10%	5.48%
China	8.84%	11.13%
Italien	6.87%	4.99%
Spanien	5.26%	3.31%
Europäische Region (EUR)	16.70%	14.03%
Schwellenländer Lateinamerika	6.97%	0.84%
Europäische Region (Ex EUR)	3.95%	0.28%
Andere	3.64%	8.36%
Liquidität, Absicherung	-0.06%	-