

Anlagestiftung Swiss Life

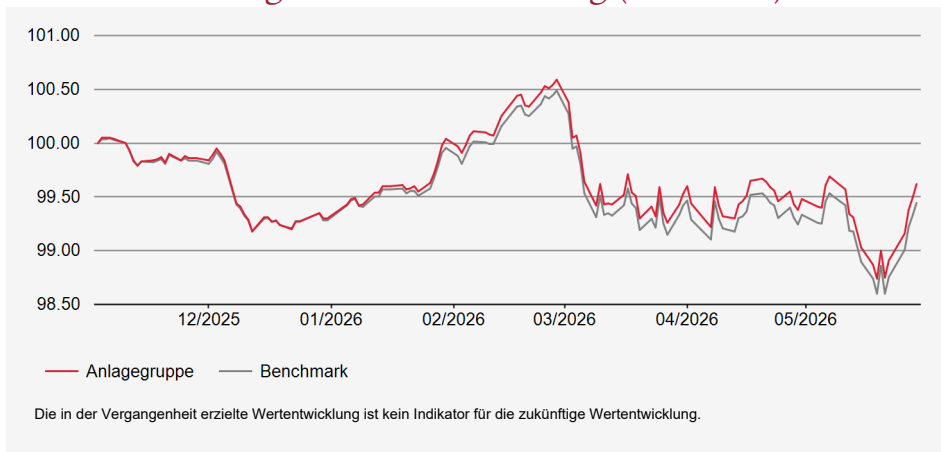
Obligationen CHF Ausland SPM

Nettovermögen (NAV) in Mio. CHF: 470.02
Nettovermögen pro Anspruch in CHF: 99.62

Anlagestrategie

Anlagen in auf CHF lautende Forderungspapiere von Schuldern, die vorwiegend im Ausland domiziliert sind. Aktive Titelselektion, Durationsteuerung und Zinskurvenpositionierung. Schuldnerbegrenzung: 10%. Forderungspapiere benchmarkfremder Schuldner: max. 20%. Durchschnittliche Ratingqualität: mindestens A. Umsetzung mittels Einsatz des Swiss Life iFunds (CH) Bond Swiss Francs Foreign (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	0.32%	0.14%	-0.96%	-	-	-	-	-
Benchmark	0.16%	0.11%	-1.04%	-	-	-	-	-

Statistische Angaben (annualisiert)

	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Aufl.
Volatilität Anlagegruppe (in %)	-	-	-	-	2.15
Volatilität Benchmark (in %)	-	-	-	-	2.10
Tracking Error ex post (in %)	-	-	-	-	0.08
Information Ratio	-	-	-	-	3.38
Sharpe Ratio	-	-	-	-	-0.28
Korrelation	-	-	-	-	1.00
Beta	-	-	-	-	1.03
Jensen-Alpha	-	-	-	-	0.33
Maximum Drawdown (in %)	-	-	-	-	-1.84
Recovery Period (Jahre)	-	-	-	-	-

Performance

Datenhistorie unzureichend

Produktinformationen

Valorennummer: 148323392
ISIN: CH1483233925
LEI: 2549002XPEQH1AZYBW05
Bloomberg-Code: SWILOSP SW
Benchmark: SBI Foreign AAA - BBB TR
Währung: CHF
Domizil: Schweiz
Aufgedatum: 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 CHF Ausland SPM

Portfoliostruktur nach Branchen

	Anlagegruppe	Benchmark
Finanzwesen	57.28%	43.91%
Staatlich und staatsnah	9.39%	20.85%
Basiskonsumgüter	5.79%	6.07%
Nicht-Basiskonsumgüter	5.56%	4.12%
Kommunikation	4.13%	4.24%
Versorgungsbetriebe	3.57%	3.53%
Pfandbriefinstitute	3.53%	10.05%
Industrial	3.18%	4.63%
Supranational	4.23%	-
Andere	3.31%	2.61%
Liquidität	0.04%	-

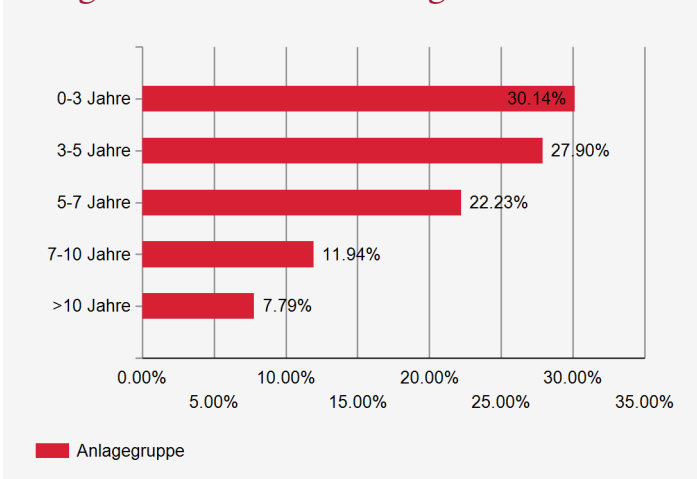
Grösste Schuldner und Rating

	Rating	Anlagegruppe
Credit Agricole Group	A+	4.14%
Groupe BPCE	AA	4.04%
Banco Santander SA, Madrid	A	3.47%
Müchener Hypothekenbank	AA-	2.65%
BNP Paribas SA, Paris	A-	2.09%

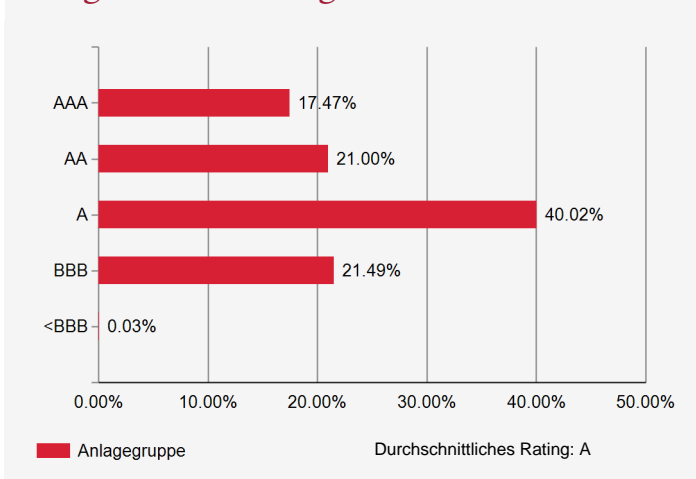
Weitere Angaben zu den Schuldnern

Anzahl Schuldner	140
Anteil Benchmarkfremde Schuldner	2.72%

Fälligkeitstruktur der Anlagen



Anlagen nach Rating



Duration und Rendite auf Verfall

	Anlagegruppe	Benchmark
Modified Duration	5.0	4.9
Theoretische Rendite auf Verfall*	1.05%	0.87%

* vor Währungsabsicherung

Portfoliostruktur nach Ländern/Regionen

	Anlagegruppe	Benchmark
Vereinigte Staaten	17.32%	15.68%
Frankreich	17.13%	14.97%
Deutschland	16.59%	14.71%
Kanada	10.30%	11.35%
Australien	6.04%	5.62%
Spanien	4.74%	3.81%
Vereinigtes Königreich	3.25%	3.11%
Schwellenländer Lateinamerika	6.66%	2.95%
Europäische Region (EUR)	5.91%	11.62%
Europäische Region (Ex EUR)	4.05%	5.86%
Andere	7.98%	10.32%
Liquidität, Absicherung	0.04%	-