

# Anlagestiftung Swiss Life

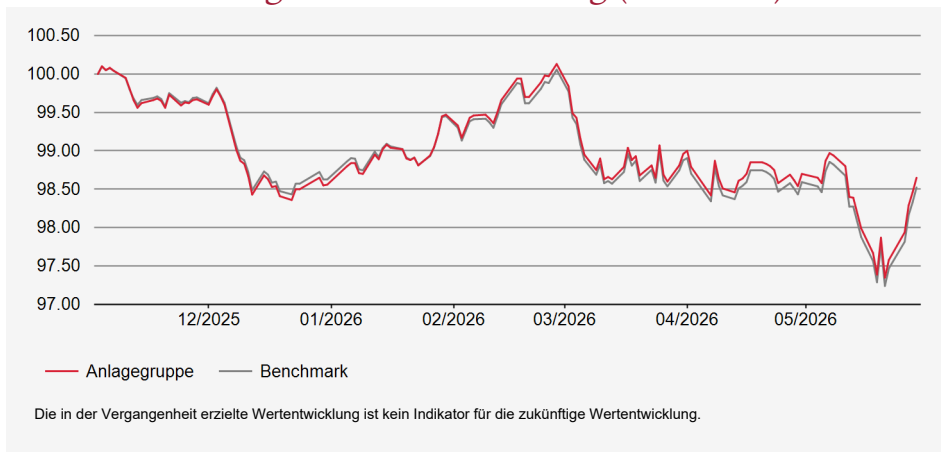
## Obligationen CHF Inland SPM

**Nettovermögen (NAV) in Mio. CHF: 1'037.47**  
**Nettovermögen pro Anspruch in CHF: 98.65**

### Anlagestrategie

Anlagen in auf CHF lautende Forderungspapiere von Schuldern mit Domizil hauptsächlich in der Schweiz. Aktive Titelselektion, Durationsteuerung und Zinskurvenpositionierung. Schuldnerbegrenzung: 10% (Ausnahmen: bis 25% in jedes Pfandbriefinstitut, Schweizerische Eidgenossenschaft ohne Begrenzung). Referenz-Indexfremde Schuldner: max. 10%. Durchschnittliche Ratingqualität: mindestens A+. Umsetzung mittels Einsatz des Swiss Life iFunds (CH) Bond Swiss Francs Domestic (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	0.09%	-0.05%	-1.48%	-	-	-	-	-
Benchmark	-0.11%	-0.07%	-1.53%	-	-	-	-	-

### Statistische Angaben (annualisiert)

	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Aufl.
Volatilität Anlagegruppe (in %)	-	-	-	-	2.77
Volatilität Benchmark (in %)	-	-	-	-	2.65
Tracking Error ex post (in %)	-	-	-	-	0.16
Information Ratio	-	-	-	-	1.34
Sharpe Ratio	-	-	-	-	-0.82
Korrelation	-	-	-	-	1.00
Beta	-	-	-	-	1.05
Jensen-Alpha	-	-	-	-	0.34
Maximum Drawdown (in %)	-	-	-	-	-2.78
Recovery Period (Jahre)	-	-	-	-	-

### Performance

Datenhistorie unzureichend

### Produktinformationen

**Valorenummer:** 148323393  
**ISIN:** CH1483233933  
**LEI:** 254900M0YGKYAE29FA28  
**Bloomberg-Code:** SWLISP SW  
**Benchmark:** SIX SBI Dom AAA-BBB TR CHF  
**Währung:** CHF  
**Domizil:** Schweiz  
**Aufgatedatum:** 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](http://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](http://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 Inland SPM

## Portfoliostruktur nach Branchen

	Anlagegruppe	Benchmark
Pfandbriefinstitute	33.75%	39.73%
Finanzwesen	30.25%	16.63%
Staatlich und staatsnah	17.50%	28.83%
Basiskonsumgüter	9.64%	7.39%
Industrial	3.94%	3.15%
Versorgungsbetriebe	3.31%	2.29%
Kommunikation	0.53%	0.89%
Grundstoffe	0.47%	0.66%
Andere	0.22%	0.44%
Liquidität	0.38%	-

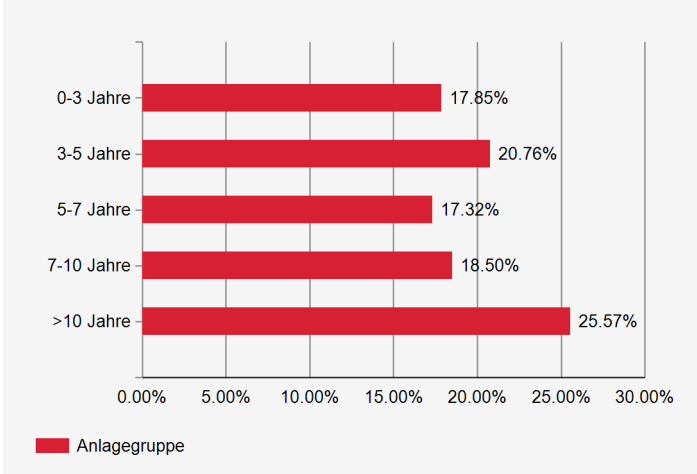
## Grösste Schuldner und Rating

	Rating	Anlagegruppe
Pfandbriefbank	AAA	21.39%
Pfandbriefzentrale	AAA	12.36%
Eidgenossenschaft	AAA	11.35%
UBS Group AG	AA	3.10%
Zürcher Kantonalbank	AA+	2.03%

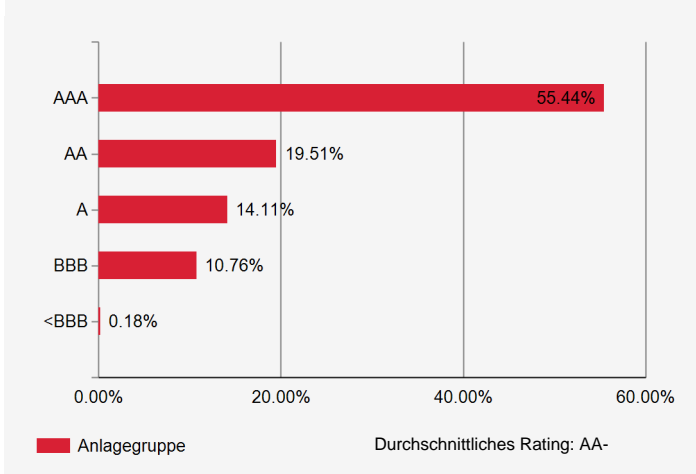
## Weitere Angaben zu den Schuldnern

Anzahl Schuldner	121
Anteil Benchmarkfremde Schuldner	0.28%

## Fälligkeitstruktur der Anlagen



## Anlagen nach Rating



## Duration und Rendite auf Verfall

	Anlagegruppe	Benchmark
Modified Duration	7.8	7.7
Theoretische Rendite auf Verfall*	0.87%	0.74%

\* vor Währungsabsicherung