



# Anlagestiftung Swiss Life

## Obligationen Global Unternehmen Short Term SPM (CHF hedged)

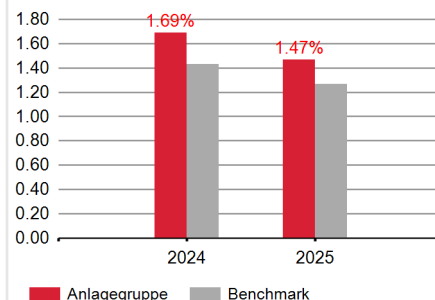
SwissLife

**Nettovermögen (NAV) in Mio. CHF: 1'569.21**  
**Nettovermögen pro Anspruch in CHF: 104.63**

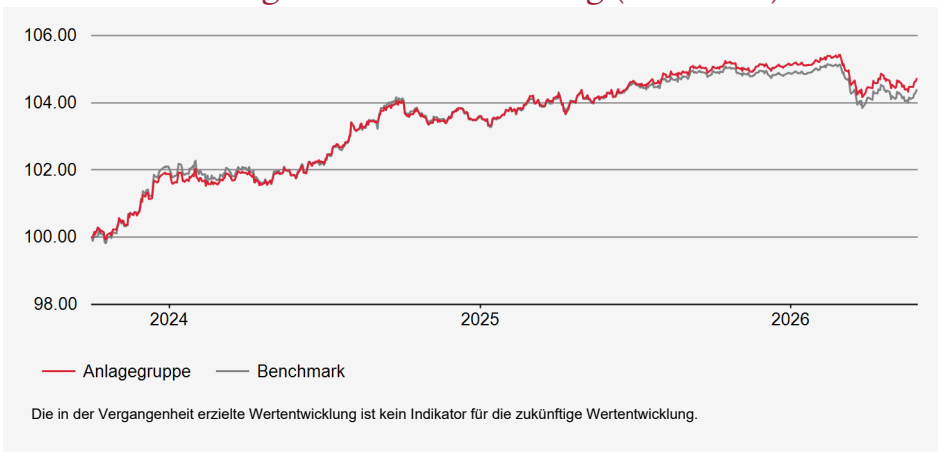
### Anlagestrategie

Anlagen in Forderungspapiere von Unternehmen inklusive Agencies und Supranationals mit einer kurzen Restlaufzeit (mehrheitlich unter 3 Jahren). Aktive Titelselektion, Durationsteuerung und Zinskurvenpositionierung. Schuldnerbegrenzung: 10%. Forderungspapiere benchmarkfremder Schuldner: max. 10%. Durchschnittliche Ratingqualität: mindestens BBB. Fremdwährungsrisiken werden zu mindestens 90% gegen Schweizerfranken abgesichert. Umsetzung mittels Einsatz des Swiss Life iFunds (CH) Bond Global Corporates Short Term (CHF hedged); Anlagefonds schweizerischen Rechts der Kategorie "Übrige Fonds für traditionelle Anlagen".

### Performance



### Wertentwicklung in Referenzwährung (Basis 100)



### Produktinformationen

**Valorennummer:** 129127773  
**ISIN:** CH1291277734  
**LEI:** 2549003DSGO0RN37K507  
**Bloomberg-Code:** SWLOSPM SW  
**Benchmark:** BLOOMBERG GLO AGG CORP 1-3 YR IND HEDGED CHF  
**Währung:** CHF  
**Domizil:** Schweiz  
**Aufledgedatum:** 02/10/2023  
**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)  
**Betriebsaufwandquote TER KGAST ex ante:** 0.04%  
**ex post per:** 30/09/2025 0.04%

### Performance in Referenzwährung

	Kumulierte Performance				Annualisierte Performance			
	YTD	1 Monat	3 Monate	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Aufl.
Anlagegruppe	-0.39%	0.17%	-0.67%	0.39%	-	-	-	1.75%
Benchmark	-0.47%	0.18%	-0.71%	0.09%	-	-	-	1.63%

### Statistische Angaben (annualisiert)

	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Aufl.
Volatilität Anlagegruppe (in %)	1.17	-	-	-	1.28
Volatilität Benchmark (in %)	1.21	-	-	-	1.43
Tracking Error ex post (in %)	0.10	-	-	-	0.24
Information Ratio	3.11	-	-	-	0.34
Sharpe Ratio	0.36	-	-	-	0.82
Korrelation	1.00	-	-	-	0.99
Beta	0.96	-	-	-	0.88
Jensen-Alpha	0.31	-	-	-	0.23
Maximum Drawdown (in %)	-1.19	-	-	-	-1.19
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.

**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 Global Unternehmen Short Term SPM (CHF hedged)

## Portfoliostruktur nach Branchen

	Anlagegruppe	Benchmark
Finanzwesen	53.80%	49.19%
Nicht-Basiskonsumgüter	10.20%	10.20%
Basiskonsumgüter	10.01%	12.35%
Kommunikation	7.39%	5.36%
Versorgungsbetriebe	5.09%	6.75%
Energie	4.87%	3.85%
Industrial	3.20%	6.39%
Technologie	2.56%	3.88%
Andere	0.85%	2.02%
Liquidität	1.96%	-
Währungsabsicherung	0.08%	-

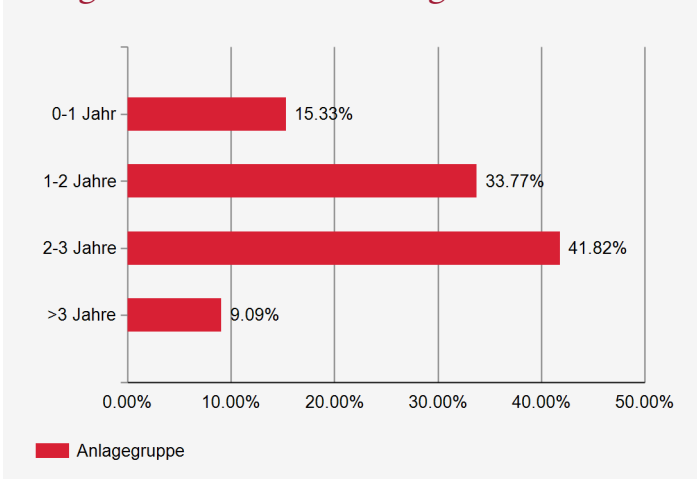
## Grösste Schuldner und Rating

		Anlagegruppe
Morgan Stanley NE US	A-	3.28%
Banco Santander SA, Madrid	BBB+	3.11%
Hyundai Motor Co	A-	2.32%
Barclays Capital PLC, London	BBB+	2.29%
Wells Fargo & Co	BBB+	2.22%

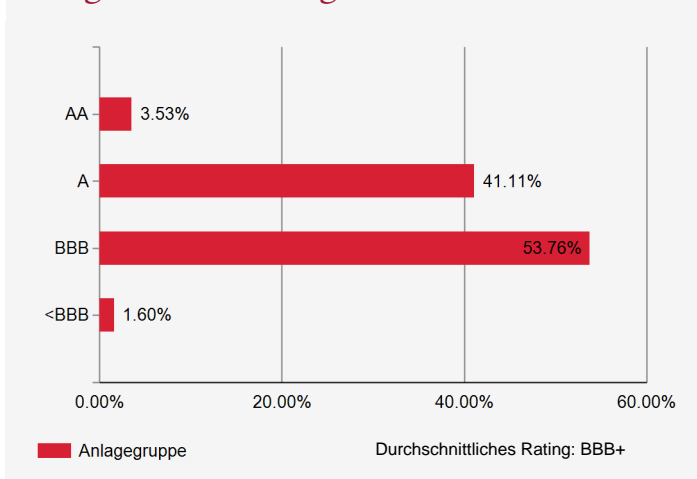
## Weitere Angaben zu den Schuldnern

Anzahl Schuldner	139
Anteil Benchmarkfremde Schuldner	2.54%

## Fälligkeitstruktur der Anlagen



## Anlagen nach Rating



## Duration und Rendite auf Verfall

	Anlagegruppe	Benchmark
Modified Duration	1.9	1.8
Theoretische Rendite auf Verfall*	4.01%	4.00%

\* vor Währungsabsicherung

## Portfolio nach Währungen und Duration

	Anlagegruppe		Benchmark	
	Gewichtung	Duration	Gewichtung	Duration
USD	58.63%	1.86	60.04%	1.81
EUR	22.64%	1.86	29.35%	1.80
CHF	7.02%	1.88	0.58%	1.96
GBP	6.96%	1.17	3.44%	1.78
Andere	4.75%	1.74	6.58%	1.84

## Portfoliostruktur nach Ländern/Regionen

	Anlagegruppe	Benchmark
Vereinigte Staaten	35.24%	47.09%
Frankreich	9.93%	7.34%
Deutschland	7.64%	6.02%
Kanada	7.41%	6.18%
Vereinigtes Königreich	7.22%	6.63%
Japan	5.72%	4.37%
Spanien	5.47%	3.34%
Europäische Region (EUR)	6.49%	6.84%
Europäische Region (Ex EUR)	5.43%	2.31%
Schwellenländer Asien Pazifik	3.81%	2.05%
Andere	3.61%	7.83%
Liquidität, Absicherung	2.03%	-