31. März 2024

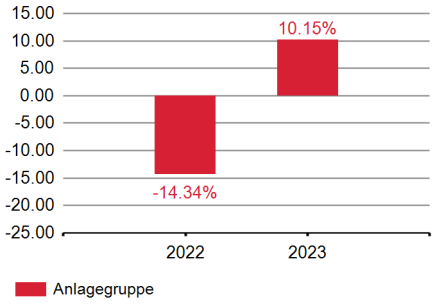
Anlagestiftung Swiss Life Hypotheken Schweiz ESG PM

Nettovermögen (NAV) in Mio. CHF: 215.50
Nettovermögen pro Anspruch in CHF: 93.24

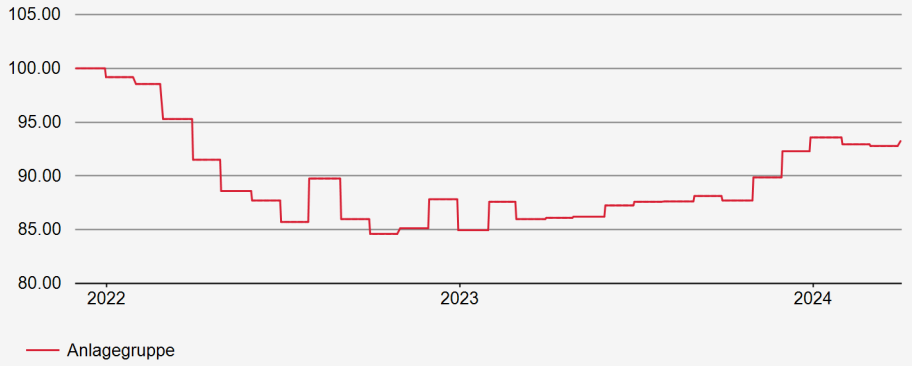
Anlagestrategie

Investitionen in nachhaltige Schweizer Hypotheken: mindestens 85% nach Abzug der flüssigen Mittel. Zielduration von 8. Umsetzung mittels Einsatz des «Swiss Life ESG Mortgage Fund» Teilvermögen des Swiss Life Mortgage Funds, ein vertraglicher Umbrella-Fonds schweizerischen Rechts.

Performance



Wertentwicklung in Referenzwährung (Basis 100)



Die in der Vergangenheit erzielte Wertentwicklung ist kein Indikator für die zukünftige Wertentwicklung.

Performance in Referenzwährung

	Kumulierte Performance				Annualisierte Performance			
	YTD	1 Monat	3 Monate	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Aufl.
Anlagegruppe	-0.36%	0.50%	-0.36%	8.28%	-	-	-	-2.95%

Statistische Angaben

Durchschnittliche Restlaufzeit (Jahre)	8.73
Modified Duration (exkl. Forward Hypotheken)*	6.76
Modified Duration (inkl. Forward Hypotheken)*	7.75
Bruttorendite auf Verfall	1.73%
Durchschnittliche Belehnung	59%
Anzahl Hypotheken	630
Rendite-Differenz zu Schweizer Staatsanleihen	1.03%

*inkl. Liquidität

Produktinformationen

Valorennummer: 112778775
ISIN: CH1127787757
LEI: 254900V4K2D79T13EF45
Bloomberg-Code: SLHSEPM SW
Währung: CHF
Domizil: Schweiz
Auflagedatum: 30/11/2021
Erstausgabepreis: 100.00
Jahresabschluss: 30.9
Ausgabe/Rücknahme: Monatlich
Ausgabe-/Rücknahmekommission: Keine
Ausschüttungspraxis: Thesaurierung
Asset Manager:
Swiss Life Asset Management AG
Kurspublikationen: Bloomberg: ASSL
www.swisslife.ch/anlagestiftung
Betriebsaufwandquote TER KGAST
ex ante: 0.35%
ex post per: 30/09/2023 0.35%

PM-Tranche: Der Erwerb dieser Tranche ist nur im Rahmen einer speziellen Vereinbarung mit Swiss Life Asset Management AG möglich.
Ausgabe: Monatlich, unter Einhaltung einer 1-monatigen Zeichnungsfrist.
Rückgabe: Monatlich, unter Einhaltung einer 6-monatigen Kündigungsfrist. Erstmalige Rückgabe 30. Januar 2024
Performance: Gesamtertrag über einen bestimmten Betrachtungszeitraum auf der Basis von zeitgewichteten Renditen.
Statistische Angaben: Die Risikokennzahlen basieren auf logarithmierten, monatlichen zeitgewichteten Renditen.

31. März 2024

Anlagestiftung Swiss Life Hypotheken Schweiz ESG PM

Vermögensstruktur

Hypotheken	95.58%
Liquidität	4.42%
Derivate	0.00%

Verteilung nach Belehnungshöhe

<40%	9.37%
40 - 50%	13.03%
50 - 60%	14.91%
60 - 70%	51.91%
>70%	10.79%

Geografische Verteilung der Liegenschaften

Zürich	28.17%
Espace Mittelland	14.22%
Innerschweiz	8.45%
Nordwestschweiz	6.62%
Ostschweiz	1.59%
Tessin	1.19%
Genferseeregion	39.77%

Art der Pfandobjekte

EINFAMILIENHÄUSER	34.19%
EIGENTUMSWOHNUNGEN	52.88%
MEHRFAMILIENHÄUSER	7.81%
KOMMERZIELL GENUTZTE LIEGENSCHAFTEN	5.12%

Verfallstruktur der Hypotheken

1-3 JAHRE	7.95%
3-5 JAHRE	13.21%
5-7 JAHRE	9.48%
7-10 JAHRE	41.07%
10-15 JAHRE	18.60%
>15 JAHRE	9.69%

Hypothekenarten

Festhypotheken	98.23%
Saron Hypotheken	1.66%
Variable Hypotheken	0.11%

ESG Verteilung

Minergie	53.13%
GEAK	44.24%
THPE	2.64%
Kein Label/Zertifikat	-

Hypotheken mit Zahlungsausständen grösser 90 Tage

Durchschnittliche Belehnung	-
Anzahl Hypothekarschuldner	-
Relativer Gesamtwert der Hypotheken mit Zahlungsausständen	-

Haftungsausschluss: Die vorliegende Publikation begründet weder eine Aufforderung noch eine Empfehlung zum Erwerb oder Verkauf von Anlageinstrumenten, sondern dient lediglich zu Informationszwecken. Sämtliche Dokumente, welche die rechtliche Grundlage für eine allfällige Investition bilden, können kostenlos bei der Anlagestiftung Swiss Life, c/o Swiss Life AG, Postfach, 8022 Zürich, Tel. 043 547 71 11 und unter www.swisslife.ch/anlagestiftung bezogen werden. Der Kreis der Anleger ist beschränkt auf Einrichtungen der 2. Säule und der Säule 3a sowie sonstige steuerbefreite Einrichtungen mit Sitz in der Schweiz, die ihrem Zweck nach der beruflichen Vorsorge dienen und Personen, die kollektive Anlagen für diese Einrichtungen verwalten, von der Eidgenössischen Finanzmarktaufsicht FINMA beaufsichtigt werden und bei der Stiftung ausschliesslich Gelder für diese Einrichtungen anlegen. Zusätzlich müssen die erwähnten Anleger eine spezielle Vereinbarung mit der Swiss Life Asset Management AG abgeschlossen haben. Die vergangene Performance stellt keinen Indikator für die laufende und zukünftige Entwicklung dar. Sämtliche Produkt- und Firmennamen sind Marken™ oder eingetragene® Warenzeichen ihrer jeweiligen Inhaber. Ihre Verwendung stellt keine Zugehörigkeit zu ihnen und keine Zustimmung durch sie dar. **Quelle:** Swiss Life Asset Managers. Alle Rechte vorbehalten.