

31. März 2025

Anlagestiftung Swiss Life Obligationen Emerging Markets Short Term PM (CHF hedged)



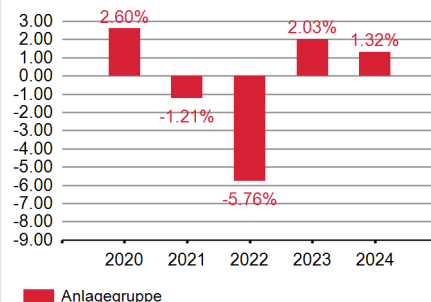
SwissLife

Nettovermögen (NAV) in Mio. CHF: 75.52
Nettovermögen pro Anspruch in CHF: 98.60

Anlagestrategie

Anlagen in auf US Dollar oder auf andere Hartwährungen lautende Forderungspapiere von Unternehmen und Staaten aus Schwellenländern (Emerging Markets) inklusive Agencies und Supranationals mit einer kurzen Restlaufzeit (mehrheitlich unter 3 Jahren). Aktive Titelselektion, Durationsteuerung und Zinskurvenpositionierung. Schuldnerbegrenzung: 10%. Durchschnittliche Ratingqualität: mindestens BBB-. Fremdwährungsrisiken werden zu mindestens 90% gegen Schweizerfranken abgesichert. Umsetzung mittels Einsatz des Swiss Life Funds (LUX) Bond Emerging Markets Short Term CHF AM Cap; Anlagefonds nach luxemburgischem Recht.

Performance



Wertentwicklung in Referenzwährung (Basis 100)



Produktinformationen

Valorennummer: 38013685
ISIN: CH0380136850
LEI: 254900EGYJLGZXT6O90
Bloomberg-Code: SLOSTPM SW
Währung: CHF
Domizil: Schweiz
Aufgatedatum: 29/09/2017
Erstausgabepreis: 100.00
Jahresabschluss: 30.09
Ausgabe/Rücknahme: Täglich
Annahmeschluss: 13.00 Uhr
Verwässerungsschutz: Ausgabe- / Rücknahmekommission zugunsten der Anlagegruppe gemäss Konditionenübersicht.
Ausschüttungspraxis: Thesaurierung

Asset Manager gemäss Swiss Life Best Select Invest Plus®: Swiss Life Asset Management AG

Überwachung Asset Manager: PPCmetrics unterstützt die laufende Überwachung des Asset Managers sowie die Beurteilung der Anlageresultate.

Kurspublikationen: Bloomberg: ASSL
www.swisslife.ch/anlagestiftung

Betriebsaufwandquote TER KGAST ex ante: 0.30%
ex post per: 30/09/2024 0.30%

Performance in Referenzwährung

	Kumulierte Performance				Annualisierte Performance			
	YTD	1 Monat	3 Monate	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Aufl.
Anlagegruppe	1.14%	0.10%	1.14%	2.27%	0.92%	0.42%	-	-0.19%

Statistische Angaben (annualisiert)

	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Aufl.
Volatilität Anlagegruppe (in %)	1.77	2.16	2.36	-	2.25
Sharpe Ratio	0.72	0.00	0.06	-	-0.05
Maximum Drawdown (in %)	-1.36	-3.08	-8.39	-	-8.39
Recovery Period (Jahre)	-	1.11	-	-	-

PM-Tranche: Der Erwerb dieser Tranche ist nur im Rahmen einer speziellen Vereinbarung mit Swiss Life Asset Management AG möglich.

Asset Manager: Die Auswahl der Manager, deren permanente Überwachung und die gesamte Prozessbegleitung erfolgen nach objektiven Kriterien und bester institutioneller Praxis durch Swiss Life Asset Management AG.

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.

Portfoliostruktur nach Branchen

	Anlagegruppe
Finanzwesen	35.24%
Staatlich und staatsnah	19.14%
Kommunikation	9.65%
Basiskonsumgüter	6.63%
Energie	5.41%
Nicht-Basiskonsumgüter	5.16%
Grundstoffe	4.87%
Versorgungsbetriebe	4.55%
Andere	7.30%
Liquidität	2.78%
Währungsabsicherung	-0.73%

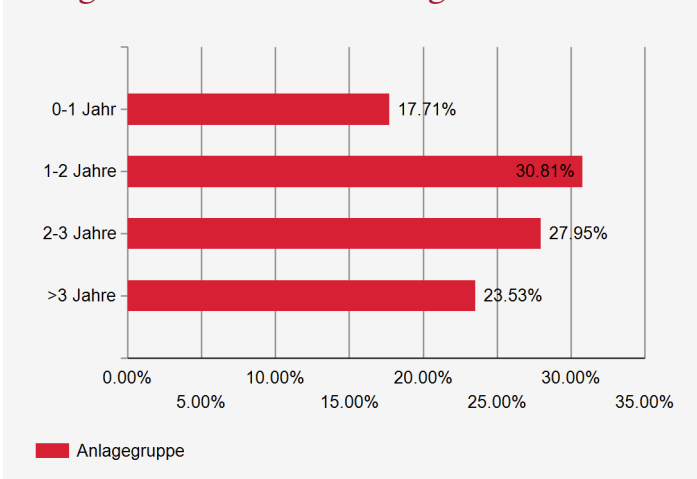
Grösste Schuldner und Rating

		Anlagegruppe
HDFC Bank Ltd	BBB-	2.68%
Erste Group Bank AG	BBB+	2.47%
MCB Group Ltd	BBB-	2.23%
United Mexican States	BBB	2.05%
Republic of Indonesia	BBB	2.03%

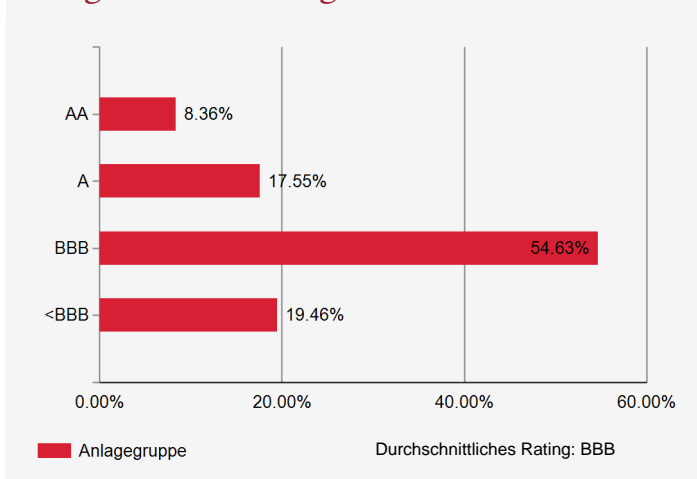
Weitere Angaben zu den Schuldnern

Anzahl Schuldner	93
------------------	----

Fälligkeitstruktur der Anlagen



Anlagen nach Rating



Duration und Rendite auf Verfall

	Anlagegruppe
Modified Duration*	2.1
Theoretische Rendite auf Verfall*	5.30%

* Vor Währungsabsicherung, unter Berücksichtigung der Derivate

Portfolio nach Währungen und Duration

	Anlagegruppe	
	Gewichtung	Duration
CHF	99.93%	0.12

Portfoliostruktur nach Ländern/Regionen

	Anlagegruppe
Indien	9.42%
China	7.99%
Indonesien	7.25%
Vereinigte Arabische Emirate	5.45%
Mexiko	4.72%
Ungarn	4.51%
Malaysia	3.83%
Schwellenländer Asien Pazifik	14.33%
Schwellenländer Lateinamerika	12.59%
Schwellenländer im mittleren Osten	7.29%
Andere	20.57%
Liquidität, Absicherung	2.05%