

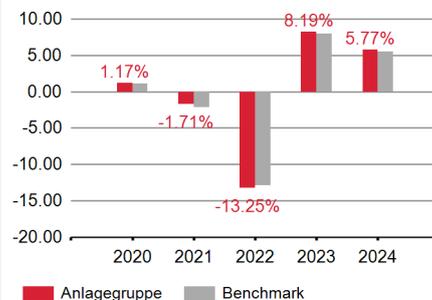
Anlagestiftung Swiss Life Obligationen CHF Inland PM

Nettovermögen (NAV) in Mio. CHF: 831.91
Nettovermögen pro Anspruch in CHF: 147.20

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".

Performance



Wertentwicklung in Referenzwährung (Basis 100)



Produktinformationen

Valorennummer: 3026053
ISIN: CH0030260530
LEI: 254900M0YGKYAE29FA28
Bloomberg-Code: SLOCIPM SW
Benchmark: SBI Domestic AAA - BBB TR
Währung: CHF
Domizil: Schweiz
Aufgagedatum: 31/05/2007
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: 0.08%

ex post per: 30/09/2024 0.08%

Performance in Referenzwährung

	Kumulierte Performance				Annualisierte Performance			
	YTD	1 Monat	3 Monate	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Aufl.
Anlagegruppe	-1.55%	-0.75%	-1.55%	3.54%	1.55%	-0.08%	0.24%	2.19%
Benchmark	-1.63%	-0.78%	-1.63%	3.33%	1.36%	-0.30%	0.12%	2.02%

Statistische Angaben (annualisiert)

	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Aufl.
Volatilität Anlagegruppe (in %)	3.81	5.50	5.01	4.68	4.03
Volatilität Benchmark (in %)	3.78	5.37	4.88	4.53	3.98
Tracking Error ex post (in %)	0.14	0.40	0.35	0.37	0.43
Information Ratio	1.51	0.48	0.63	0.31	0.40
Sharpe Ratio	0.66	0.11	-0.07	0.11	0.53
Korrelation	1.00	1.00	1.00	1.00	0.99
Beta	1.01	1.02	1.03	1.03	1.01
Jensen-Alpha	0.19	0.18	0.24	0.10	0.16
Maximum Drawdown (in %)	-3.84	-9.13	-16.56	-19.21	-19.21
Recovery Period (Jahre)	-	1.17	-	-	-

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.

Anlagestiftung Swiss Life Obligationen CHF Inland PM

Portfoliostruktur nach Branchen

	Anlagegruppe	Benchmark
Pfandbriefinstitute	32.97%	78.59%
Finanzwesen	27.44%	32.29%
Staatlich und staatsnah	21.76%	58.97%
Basiskonsumgüter	7.19%	14.62%
Versorgungsbetriebe	4.72%	4.87%
Industrial	2.71%	5.62%
Nicht-Basiskonsumgüter	1.20%	0.86%
Fonds	-	0.62%
Andere	0.72%	3.57%
Liquidität	1.29%	-

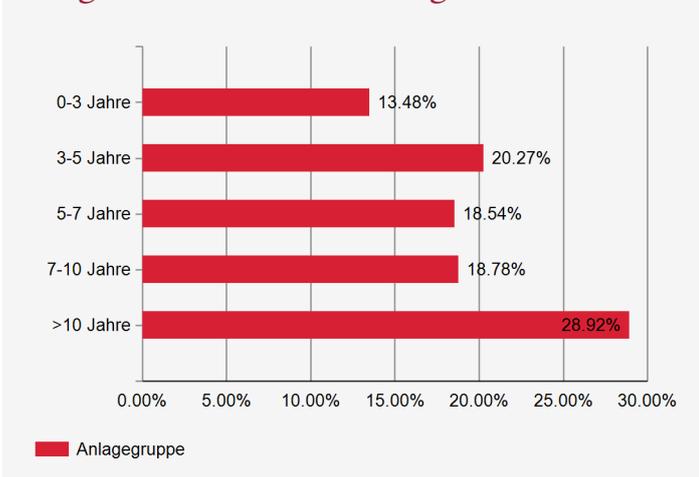
Grösste Schuldner und Rating

	Rating	Anlagegruppe
Pfandbriefbank	AAA	18.35%
Pfandbriefzentrale	AAA	14.43%
Eidgenossenschaft	AAA	14.28%
UBS Group AG	AA-	2.42%
Zürcher Kantonalbank	AA+	2.36%

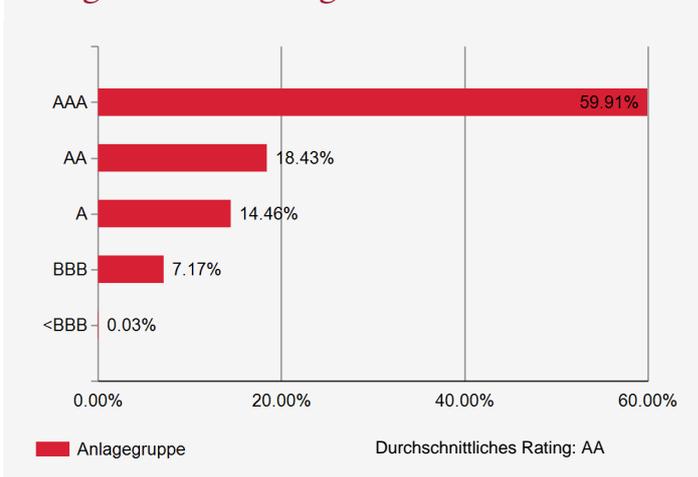
Weitere Angaben zu den Schuldnern

Anzahl Schuldner	120
Anteil Benchmarkfremde Schuldner	0.16%

Fälligkeitstruktur der Anlagen



Anlagen nach Rating



Duration und Rendite auf Verfall

	Anlagegruppe	Benchmark
Modified Duration*	7.8	7.7
Theoretische Rendite auf Verfall*	0.97%	0.90%

* Vor Währungsabsicherung, unter Berücksichtigung der Derivate