

31. Mai 2026

Anlagestiftung Swiss Life Obligationen CHF Inland PM

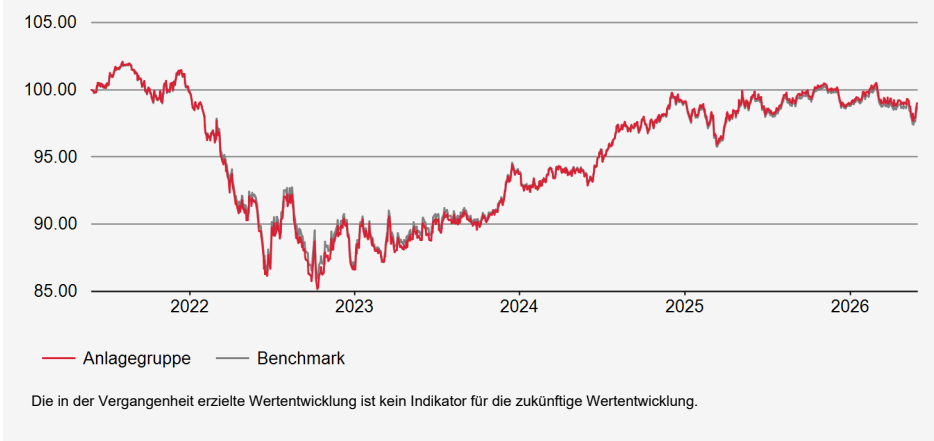


Nettovermögen (NAV) in Mio. CHF: 1'037.47
Nettovermögen pro Anspruch in CHF: 149.31

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)



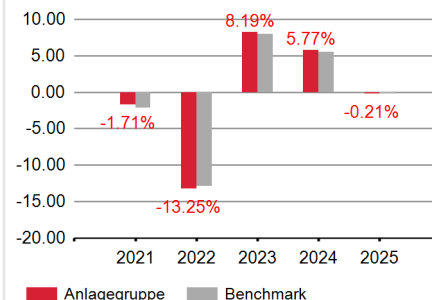
Performance in Referenzwährung

	Kumulierte Performance				Annualisierte Performance			
	YTD	1 Monat	3 Monate	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Aufl.
Anlagegruppe	0.07%	-0.05%	-1.48%	-0.59%	3.22%	-0.19%	0.13%	2.13%
Benchmark	-0.11%	-0.07%	-1.53%	-0.75%	2.94%	-0.25%	0.01%	1.97%

Statistische Angaben (annualisiert)

	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Aufl.
Volatilität Anlagegruppe (in %)	2.65	3.19	5.02	4.63	3.97
Volatilität Benchmark (in %)	2.60	3.19	4.88	4.47	3.92
Tracking Error ex post (in %)	0.12	0.15	0.34	0.36	0.41
Information Ratio	1.38	1.87	0.19	0.32	0.40
Sharpe Ratio	-0.21	0.75	-0.13	0.06	0.52
Korrelation	1.00	1.00	1.00	1.00	0.99
Beta	1.02	1.00	1.03	1.03	1.01
Jensen-Alpha	0.17	0.28	0.08	0.11	0.15
Maximum Drawdown (in %)	-2.78	-3.84	-16.56	-19.21	-19.21
Recovery Period (Jahre)	-	0.15	-	-	-

Performance



Produktinformationen

Valorennummer: 3026053
ISIN: CH0030260530
LEI: 254900M0YGKYAE29FA28
Bloomberg-Code: SLOCIPM SW
Benchmark: SIX SBI Dom AAA-BBB TR CHF
Währung: CHF
Domizil: Schweiz
Auflagedatum: 31/05/2007
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
Betriebsaufwandquote TER KGAST
ex ante: 0.08%
ex post per: 30/09/2025 0.08%

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

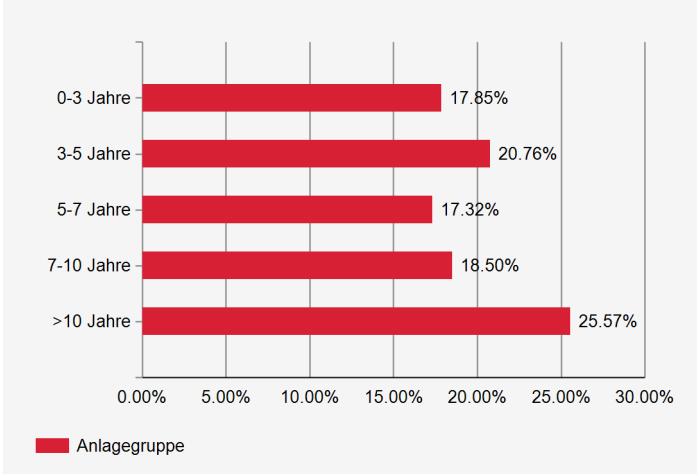
Grösste Schuldner und Rating

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

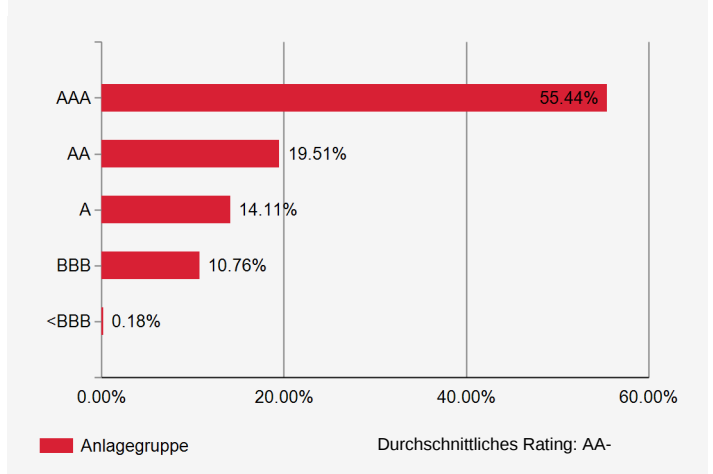
Weitere Angaben zu den Schuldnern

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