

31. Mai 2026

Anlagestiftung Swiss Life

Obligationen Global Staaten+ SPM (CHF hedged)

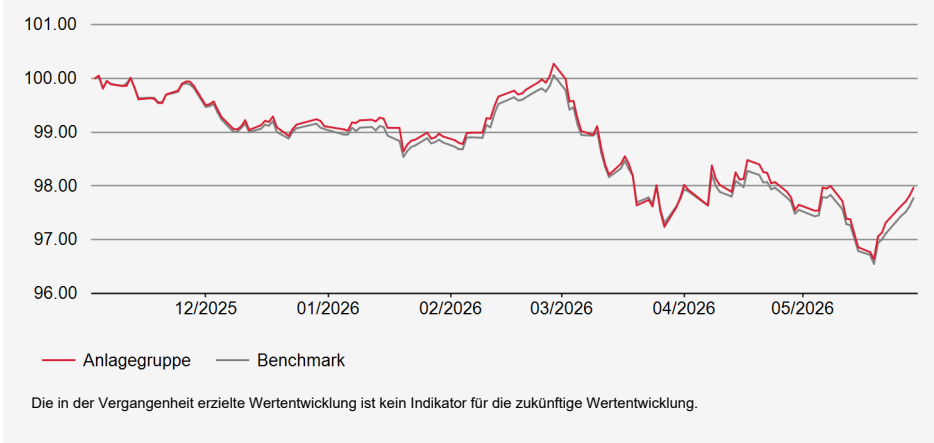


Nettovermögen (NAV) in Mio. CHF: 713.24
Nettovermögen pro Anspruch in CHF: 97.97

Anlagestrategie

Anlagen in Forderungspapiere von Staaten und staatsnahen Institutionen. Aktive Titelselektion, Durationsteuerung und Zinskurvenpositionierung. Schuldnerbegrenzung: 10% (Ausnahme: sofern in der Benchmark vertreten, max. 5%-Punkte mehr als Benchmarkgewichtung). Forderungspapiere benchmarkfremder Schuldner: max. 10%. Durchschnittliche Ratingqualität: mindestens A+. Fremdwährungsrisiken werden zu mindestens 90% gegen Schweizerfranken abgesichert. Umsetzung mittels Einsatz des Swiss Life iFunds (CH) Bond Global Government+ (CHF hedged); 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	-1.15%	0.33%	-2.29%	-	-	-	-	-
Benchmark	-1.29%	0.23%	-2.28%	-	-	-	-	-

Statistische Angaben (annualisiert)

	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Aufl.
Volatilität Anlagegruppe (in %)	-	-	-	-	4.08
Volatilität Benchmark (in %)	-	-	-	-	3.76
Tracking Error ex post (in %)	-	-	-	-	0.34
Information Ratio	-	-	-	-	0.81
Sharpe Ratio	-	-	-	-	-0.85
Korrelation	-	-	-	-	1.00
Beta	-	-	-	-	1.08
Jensen-Alpha	-	-	-	-	0.65
Maximum Drawdown (in %)	-	-	-	-	-3.62
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.
Benchmark: Die Benchmark wurde per 1. Juli 2012 gewechselt. Für Informationen betreffend die frühere Benchmark wenden Sie sich bitte an die Anlagestiftung Swiss Life.
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.

Performance

Datenhistorie unzureichend

Produktinformationen

Valorennummer: 148323395
ISIN: CH1483233958
LEI: 254900H7WEVS3K9ANR90
Bloomberg-Code: SLOGSPM SW
Benchmark: BLOOMBERG GLOBAL AGG TREAS EX CHF TR HEDGED CHF
Währung: CHF
Domizil: Schweiz
Auflagedatum: 03/11/2025
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

Anlagestiftung Swiss Life

Obligationen Global Staaten+ SPM (CHF hedged)

Portfoliostruktur nach Branchen

	Anlagegruppe	Benchmark
Staatlich und staatsnah	88.88%	100.00%
Finanzwesen	4.58%	-
Pfandbriefinstitute	2.15%	-
Supranational	5.43%	-
Liquidität	-1.08%	-
Währungsabsicherung	0.05%	-

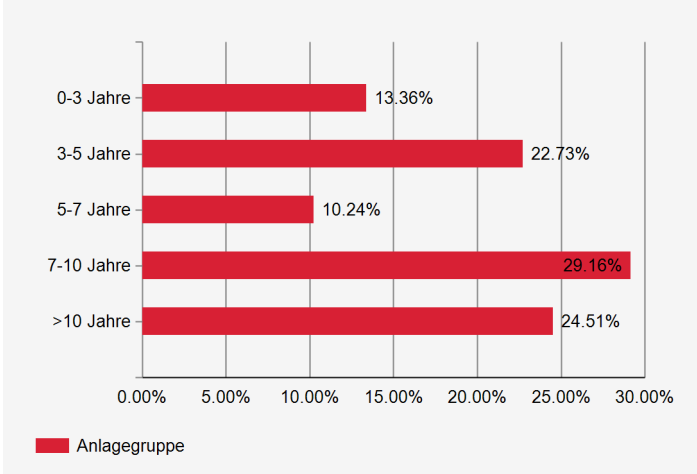
Grösste Schuldner und Rating

	Anlagegruppe	Benchmark
Japan	A+	10.92%
US Treasury N/B	AA+	10.89%
Vereinigtes Königreich	AA-	9.51%
People's Republic of China	A+	8.39%
Italien	BBB	7.20%

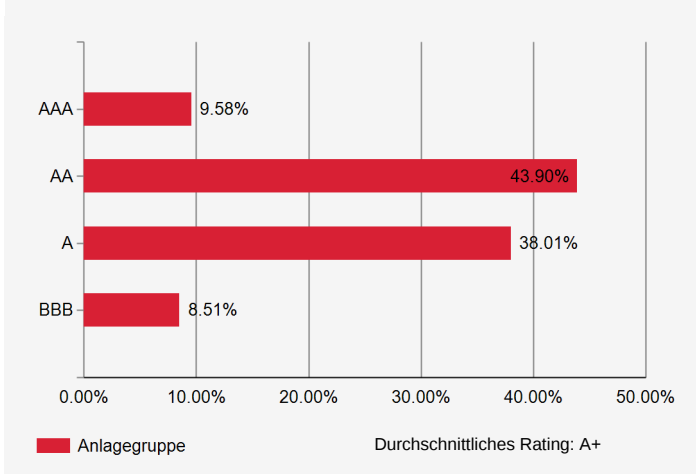
Weitere Angaben zu den Schuldnern

Anzahl Schuldner	48
Anteil Benchmarkfremde Schuldner	4.44%

Fälligkeitstruktur der Anlagen



Anlagen nach Rating



Duration und Rendite auf Verfall

	Anlagegruppe	Benchmark
Modified Duration	7.0	6.7
Theoretische Rendite auf Verfall*	3.25%	3.45%

* vor Währungsabsicherung

Portfoliostruktur nach Ländern/Regionen

	Anlagegruppe	Benchmark
Kanada	13.94%	1.86%
Japan	12.05%	13.44%
Vereinigte Staaten	11.93%	35.39%
Vereinigtes Königreich	10.39%	5.58%
China	9.16%	11.44%
Frankreich	8.07%	5.69%
Italien	7.87%	5.13%
Europäische Region (EUR)	15.99%	11.94%
Schwellenländer Lateinamerika	6.16%	0.85%
Europäische Region (Ex EUR)	2.47%	0.30%
Andere	3.00%	8.38%
Liquidität, Absicherung	-1.03%	-