

31. März 2025

# Anlagestiftung Swiss Life Obligationen CHF Inland



**Nettovermögen (NAV) in Mio. CHF: 831.91**  
**Nettovermögen pro Anspruch in CHF: 167.03**

## 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)



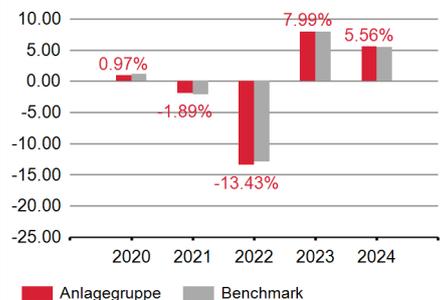
## Performance in Referenzwährung

	Kumulierte Performance				Annualisierte Performance			
	YTD	1 Monat	3 Monate	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Aufl.
Anlagegruppe	-1.58%	-0.77%	-1.58%	3.35%	1.35%	-0.27%	0.04%	2.21%
Benchmark	-1.63%	-0.78%	-1.63%	3.33%	1.36%	-0.30%	0.12%	2.28%

## Statistische Angaben (annualisiert)

	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Aufl.
Volatilität Anlagegruppe (in %)	3.80	5.50	5.01	4.68	3.79
Volatilität Benchmark (in %)	3.78	5.37	4.88	4.53	3.77
Tracking Error ex post (in %)	0.13	0.40	0.35	0.37	0.44
Information Ratio	0.19	0.00	0.10	-0.21	-0.16
Sharpe Ratio	0.61	0.08	-0.11	0.06	0.52
Korrelation	1.00	1.00	1.00	1.00	0.99
Beta	1.01	1.02	1.02	1.03	1.00
Jensen-Alpha	0.01	-0.01	0.05	-0.09	-0.08
Maximum Drawdown (in %)	-3.88	-9.22	-16.75	-19.71	-19.71
Recovery Period (Jahre)	-	1.18	-	-	-

## Performance



## Produktinformationen

**Valorennummer:** 1239071  
**ISIN:** CH0012390719  
**LEI:** 254900M0YGKYAE29FA28  
**Bloomberg-Code:** SWAOBIN SW  
**Benchmark:** SBI Domestic AAA - BBB TR  
**Währung:** CHF  
**Domizil:** Schweiz  
**Aufgagedatum:** 30/09/2001  
**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](http://www.swisslife.ch/anlagestiftung)  
**Betriebsaufwandquote TER KGAST ex ante:** 0.26%  
**ex post per:** 30/09/2024 0.27%

**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](http://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	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%	-

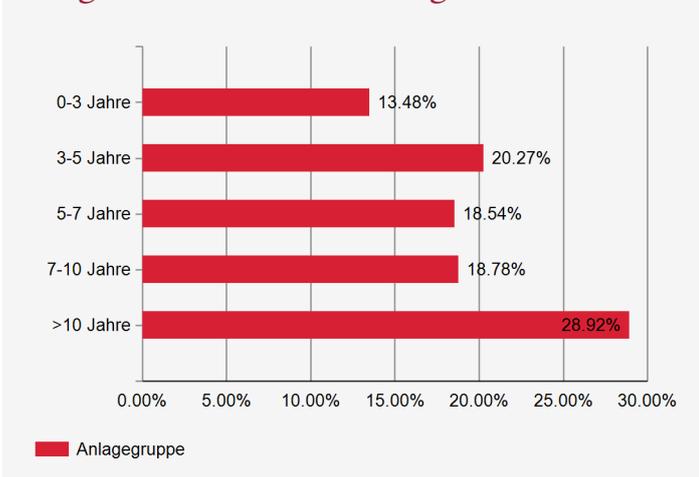
## Grösste Schuldner und Rating

	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%

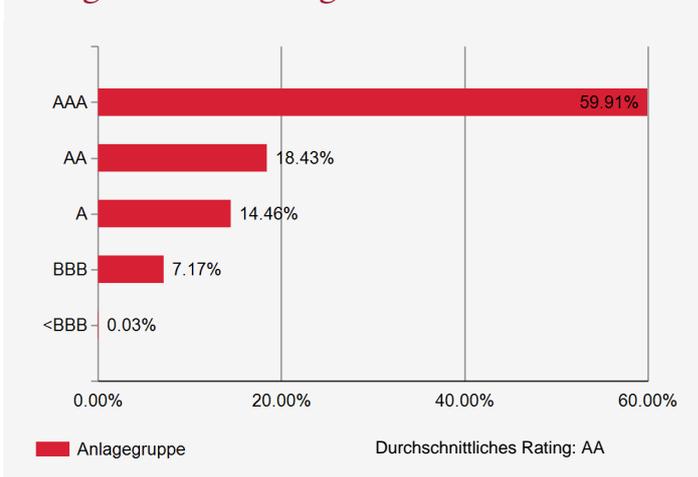
## Weitere Angaben zu den Schuldnern

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