

31. März 2025

Anlagestiftung Swiss Life Senior Secured Loans (CHF hedged)

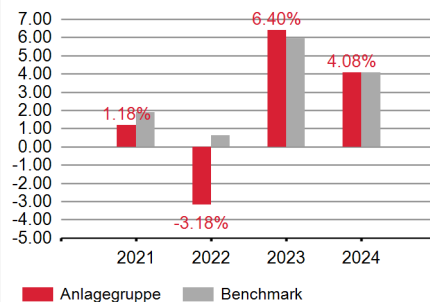


Nettovermögen (NAV) in Mio. CHF: 161.58
Nettovermögen pro Anspruch in CHF: 107.37

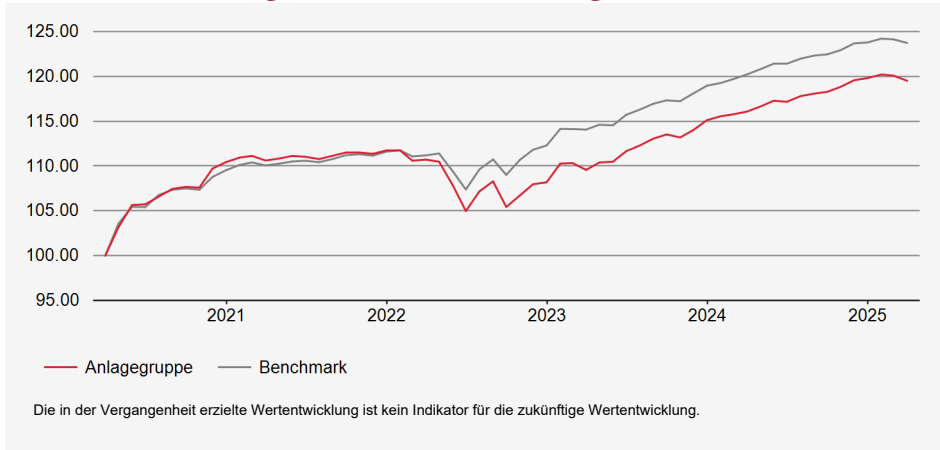
Anlagestrategie

Die Anlagegruppe strebt stabile hohe Erträge bei einer minimalen Preisvolatilität und einer geringen Zinsduration an. Die Anlagegruppe investiert vorwiegend in erstrangige Senior Secured Loans von Unternehmen aus entwickelten Ländern. Mindestens 85% werden in erstrangigen Senior Secured Loans angelegt. Höchstens 5% werden beim selben Schuldner angelegt. Höchstens 25% werden in derselben Industriegruppe angelegt. Fremdwährungsrisiken werden zu mindestens 90% gegen Schweizerfranken abgesichert. Umsetzung mittels Einsatz des Swiss Life Loan Fund (LUX) S.A., SICAV-SIF Senior Secured Loans V AM-Shares (CHF hedged); Anlagfonds nach luxemburgischem Recht.

Performance



Wertentwicklung in Referenzwährung (Basis 100)



Produktinformationen

Valorennummer: 51215713
ISIN: CH0512157139
LEI: 254900TFN2RL5B1QJ986
Bloomberg-Code: SWSSLCH SW
Benchmark: JPM Lev Loans Upper Tier (80% US + 20% EU) CHFh
Währung: CHF
Domizil: Schweiz
Aufgatedatum: 31/01/2020
Erstausgabepreis: 100.00
Jahresabschluss: 30.09
Ausgabe/Rücknahme: Monatlich
Annahmeschluss: 13.00 Uhr
Zeichnungen: Ultimo -2
Rücknahmen: Ultimo -5
Ausgabe- / Rücknahmekommission: Keine

Performance in Referenzwährung

	Kumulierte Performance				Annualisierte Performance			
	YTD	1 Monat	3 Monate	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Aufl.
Anlagegruppe	-0.26%	-0.48%	-0.26%	2.95%	2.57%	3.62%	-	1.39%
Benchmark	-0.05%	-0.32%	-0.05%	2.92%	3.62%	4.35%	-	2.15%

Statistische Angaben (annualisiert)

	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Aufl.
Volatilität Anlagegruppe (in %)	1.15	3.58	3.40	-	5.36
Volatilität Benchmark (in %)	0.96	2.78	2.83	-	4.99
Tracking Error ex post (in %)	0.29	1.05	0.98	-	0.97
Information Ratio	0.12	-1.00	-0.74	-	-0.79
Sharpe Ratio	1.67	0.45	0.96	-	0.21
Korrelation	0.98	0.97	0.97	-	0.98
Beta	1.19	1.25	1.16	-	1.06
Jensen-Alpha	-0.33	-1.73	-1.36	-	-0.88
Maximum Drawdown (in %)	-0.59	-5.19	-6.07	-	-10.15
Recovery Period (Jahre)	-	1.00	1.08	-	1.50

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: 0.60%
ex post per: 30/09/2024 0.61%

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.
Annahmeschluss: Ultimo = letzter Bankwerktag des Monats
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 Senior Secured Loans (CHF hedged)

Portfoliostruktur nach Branchen

	Anlagegruppe	Benchmark
Dienstleistungen	16.55%	9.37%
Gesundheitswesen	9.11%	7.66%
Technologie	8.41%	8.53%
Glücksspiel/Freizeit	7.73%	11.50%
Finanzwesen	7.12%	5.86%
Chemikalien	6.48%	5.30%
Kabel und Satellit	5.16%	2.31%
Automobile	4.81%	3.72%
Lebensmittel und Getränke	4.64%	5.20%
Industrieunternehmen	4.33%	8.11%
Andere	23.61%	32.44%
Liquidität	2.05%	-

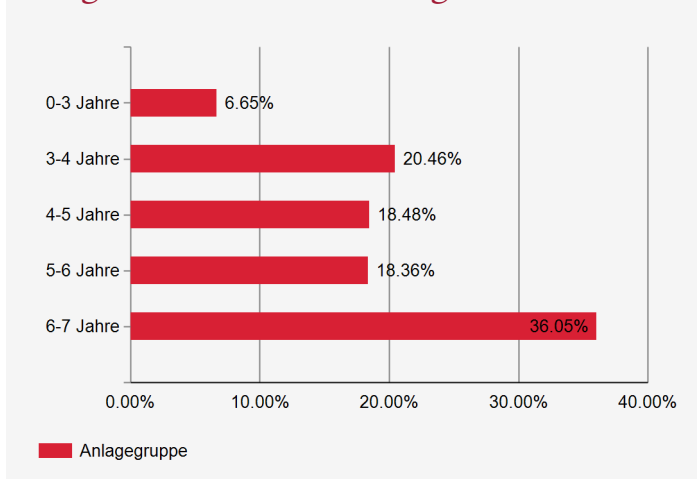
Grösste Schuldner und Rating

	Rating	Anlagegruppe
Quikrete	BB-	1.58%
Belron	BB-	1.52%
Action	BB	1.50%
Asurion	B+	1.43%
Entain	BB-	1.40%

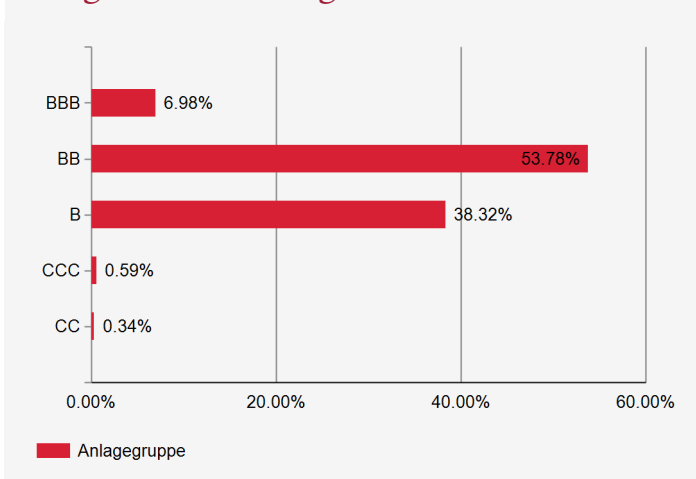
Weitere Angaben zu den Schuldnern

Anzahl Schuldner	244
------------------	-----

Fälligkeitstruktur der Anlagen



Anlagen nach Rating



Portfeuillestruktur nach Währungen / Rendite (ohne Liquidität)

	Anlagegruppe		Benchmark	
	Gewichtung	Rendite	Gewichtung	Rendite
USD	67.96%	7.81%	80.00%	7.46%
EUR	32.04%	5.85%	20.00%	5.65%
Durchschnitt	-	7.18%	-	7.09%

Portfoliostruktur nach Ländern/Regionen

	Anlagegruppe	Benchmark
Vereinigte Staaten	58.69%	84.56%
Vereinigtes Königreich	9.98%	4.76%
Niederlande	6.31%	1.76%
Luxemburg	4.26%	0.61%
Deutschland	3.56%	0.56%
Belgien	3.08%	1.60%
Frankreich	2.53%	-
Schweiz	2.08%	0.33%
Spanien	1.68%	1.45%
Kanada	1.46%	1.72%
Andere	4.32%	2.65%
Liquidität	2.05%	-