

Anlagestiftung Swiss Life

Obligationen Global (CHF hedged)

Nettovermögen (NAV) in Mio. CHF: 142.68
Nettovermögen pro Anspruch in CHF: 117.64

Anlagestrategie

Anlagen in Forderungspapiere von Schuldern mit Domizil im In- oder Ausland (seit 1.1.2011 CHF hedged). 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 Swiss Life iFunds (CH) Bond Global Aggregate (CHF hedged); Anlagefonds schweizerischen Rechts der Kategorie "Übrige Fonds für traditionelle Anlagen".

Wertentwicklung in Referenzwährung (Basis 100)



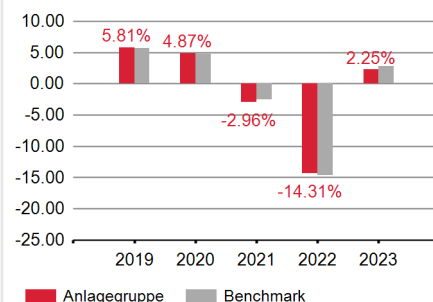
Performance in Referenzwährung

	Kumulierte Performance				Annualisierte Performance			
	YTD	1 Monat	3 Monate	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Aufl.
Anlagegruppe	-1.66%	-2.16%	-0.78%	4.24%	-4.82%	-2.73%	-0.63%	0.71%
Benchmark	-1.19%	-1.83%	-0.23%	4.80%	-4.60%	-2.57%	-0.43%	0.81%

Statistische Angaben (annualisiert)

	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Aufl.
Volatilität Anlagegruppe (in %)	5.91	5.96	5.31	4.31	5.41
Volatilität Benchmark (in %)	5.68	6.18	5.43	4.38	5.57
Tracking Error ex post (in %)	0.43	0.60	0.53	0.57	1.40
Information Ratio	-1.29	-0.36	-0.31	-0.35	-0.07
Sharpe Ratio	0.46	-0.95	-0.56	-0.08	0.09
Korrelation	1.00	1.00	1.00	0.99	0.97
Beta	1.04	0.96	0.97	0.98	0.94
Jensen-Alpha	-0.69	-0.43	-0.23	-0.20	-0.07
Maximum Drawdown (in %)	-4.13	-18.55	-20.24	-20.24	-20.24
Recovery Period (Jahre)	0.37	-	-	-	-

Performance



Produktinformationen

Valorennummer: 1245479
ISIN: CH0012454796
LEI: 254900F82G5L48XPDV74
Bloomberg-Code: SWAOBFG SW
Benchmark: BLOOMBERG GLO AGG EX SEC EX CNY HEDGED CHF
Währung: CHF
Domizil: Schweiz
Aufgatedatum: 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

Betriebsaufwandquote TER KGAST

ex ante: 0.46%

ex post per: 30/09/2024 0.46%

Benchmark: Die Benchmark wurde per 1. Juli 2012 gewechselt. Für Informationen betreffend die frühere Benchmark wenden Sie sich bitte an die Anlagestiftung Swiss Life.

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 Global (CHF hedged)

Portfoliostruktur nach Branchen

	Anlagegruppe	Benchmark
Staatlich und staatsnah	50.22%	72.20%
Finanzwesen	20.24%	11.56%
Basiskonsumgüter	6.88%	4.04%
Kommunikation	2.91%	1.97%
Nicht-Basiskonsumgüter	2.51%	1.83%
Versorgungsbetriebe	2.04%	2.74%
Technologie	1.54%	1.14%
Energie	1.41%	1.72%
Supranational	5.11%	-
Andere	2.03%	2.79%
Liquidität	5.23%	-
Währungsabsicherung	-0.12%	-

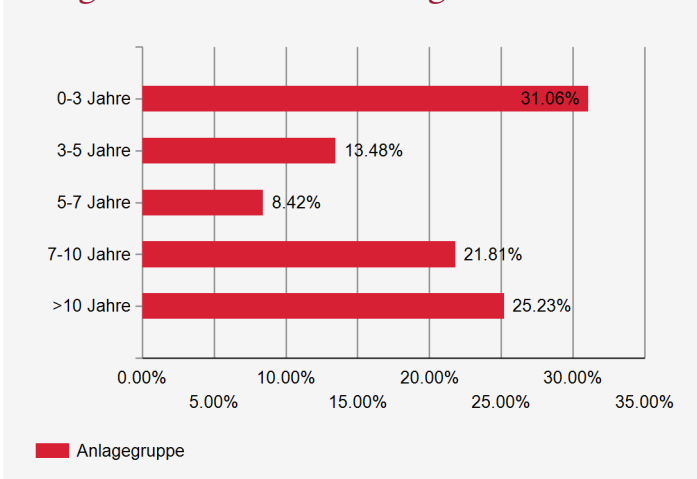
Grösste Schuldner und Rating

	Rating	Anlagegruppe
Japan	A+	16.98%
US Treasury N/B	AAA	7.78%
Italien	BBB	5.62%
Spanien	A	2.60%
BNG Bank NV	AAA	1.95%

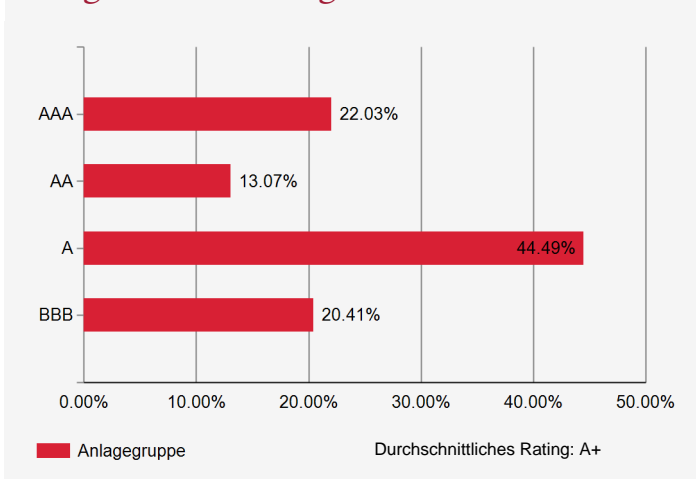
Weitere Angaben zu den Schuldnern

Anzahl Schuldner	130
Anteil Benchmarkfremde Schuldner	0.00%

Fälligkeitstruktur der Anlagen



Anlagen nach Rating



Duration und Rendite auf Verfall

	Anlagegruppe	Benchmark
Modified Duration*	7.2	6.8
Theoretische Rendite auf Verfall*	3.74%	3.70%

* Vor Währungsabsicherung, unter Berücksichtigung der Derivate

Portfoliostruktur nach Ländern/Regionen

	Anlagegruppe	Benchmark
Vereinigte Staaten	25.23%	37.83%
Japan	19.80%	13.15%
Kanada	8.29%	4.33%
Italien	7.06%	4.02%
Deutschland	5.59%	5.87%
Frankreich	5.48%	6.24%
Vereinigtes Königreich	3.82%	5.33%
Europäische Region (EUR)	10.68%	8.93%
Europäische Region (Ex EUR)	3.64%	1.61%
Schwellenländer Lateinamerika	1.68%	0.04%
Andere	3.62%	12.66%
Liquidität, Absicherung	5.10%	-