

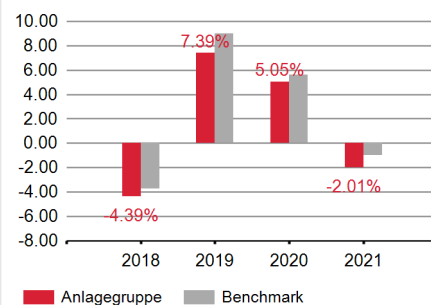
Anlagestiftung Swiss Life Obligationen Emerging Markets Unternehmen (CHF hedged)

Nettvermögen (NAV) in Mio. CHF: 301.86
Nettvermögen pro Anspruch in CHF: 86.37

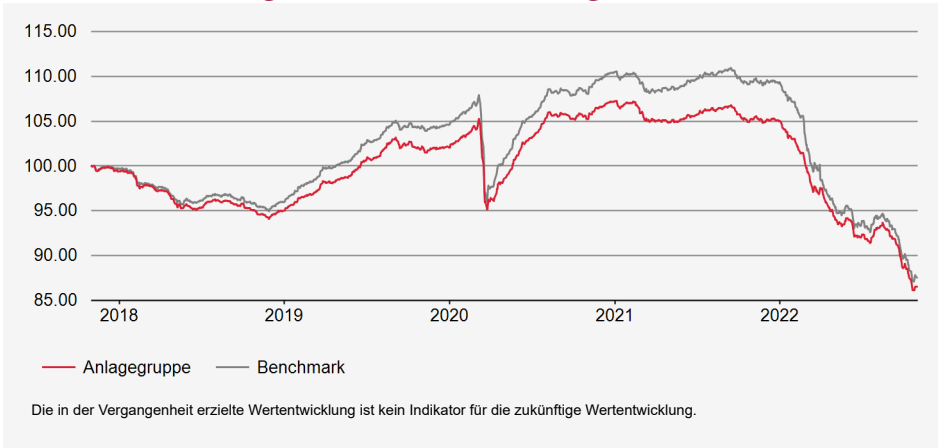
Anlagestrategie

Anlagen in auf US Dollar oder auf andere Hartwährungen lautende Forderungspapiere von Unternehmen aus Schwellenländern (Emerging Markets) inklusive Agencies und Supranationals. Aktive Titelselektion, Durationsteuerung und Zinskurvenpositionierung. Schuldnerbegrenzung: 10%. Benchmarkfremde Schuldner: max.20%. Durchschnittliche Ratingqualität: mindestens BBB. Fremdwährungsrisiken werden zu mindestens 90% gegen Schweizerfranken abgesichert. Umsetzung mittels Einsatz des Swiss Life Funds (LUX) Bond Emerging Markets Corporates CHF AM Cap; Anlagefonds nach luxemburgischem Recht.

Performance



Wertentwicklung in Referenzwährung (Basis 100)



Produktinformationen

Valorennummer: 36974875
ISIN: CH0369748758
LEI: 254900R4DORKK6JJUG51
Bloomberg-Code: SLOEMCH SW
Benchmark: JP Morgan CEMBI Broad Diversified IG Index (CHF Hedged)
Währung: CHF
Domizil: Schweiz
Aufgatedatum: 29/09/2017
Ausgabepreis: 100.00
Jahresabschluss: 30.09
Ausgabe/Rücknahme: Täglich
Annaheschluss: 14.30 Uhr
Ausgabe-/Rücknahmekommission: Keine
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: 0.77%
ex post per: 30/09/2022 0.77%

Performance in Referenzwährung

	KUMULIERTE PERFORMANCE				ANNUALISIERTE PERFORMANCE			
	YTD	1 MONAT	3 MONATE	1 JAHR	3 JAHRE	5 JAHRE	10 JAHRE	AUFL.
ANLAGEGRUPPE	-17.63%	-2.34%	-6.82%	-17.77%	-5.32%	-2.85%	-	-2.84%
BENCHMARK	-19.94%	-2.35%	-7.13%	-19.98%	-5.71%	-2.62%	-	-2.60%

Statistische Angaben (annualisiert)

	1 JAHR	3 JAHRE	5 JAHRE	10 JAHRE	AUFL.
Volatilität Anlagegruppe (in %)	5.53	6.98	5.77	-	5.68
Volatilität Benchmark (in %)	-	7.91	6.47	-	6.37
Tracking Error ex post (in %)	2.03	1.51	1.24	-	1.22
Information Ratio	1.09	0.26	-0.18	-	-0.20
Sharpe Ratio	-3.46	-0.70	-0.38	-	-0.38
Korrelation	0.95	0.99	0.99	-	0.99
Beta	0.84	0.87	0.88	-	0.88
Jensen-Alpha	-0.89	-0.27	-0.46	-	-0.47
Maximum Drawdown (in %)	-18.40	-19.70	-19.70	-	-19.70
Recovery Period (Jahre)	-	-	-	-	-

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.

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 Emerging Markets Unternehmen (CHF hedged)

Portfoliostruktur nach Branchen

	Anlagegruppe	Benchmark
FINANZWESEN	29.96%	38.17%
VERSORGUNGSBETRIEBE	14.40%	12.25%
ENERGIE	12.20%	10.43%
GRUNDSTOFFE	8.47%	9.51%
KOMMUNIKATION	8.08%	8.01%
INDUSTRIE	5.40%	4.10%
TECHNOLOGIE	4.98%	5.27%
BASISKONSUMGÜTER	4.79%	4.68%
SUPRANATIONAL	3.53%	-
ANDERE	6.26%	7.57%
LIQUIDITÄT	3.14%	-
WÄHRUNGSABSICHERUNG	-1.22%	-

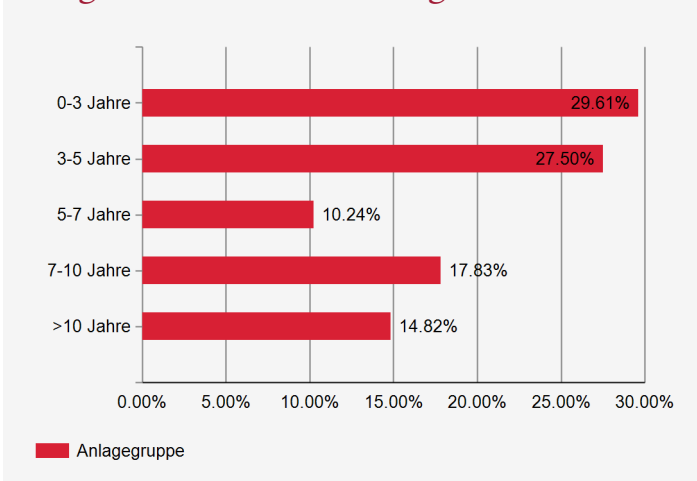
Grösste Schuldner und Rating

	Rating	Anlagegruppe
Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd	AA-	3.68%
Commercial Bank PSQC/The	A-	1.79%
United Overseas Bank Ltd	BBB+	1.67%
Bangkok Bank PCL	BBB	1.63%
EQUATE Petrochemical Co KSC	BBB	1.63%

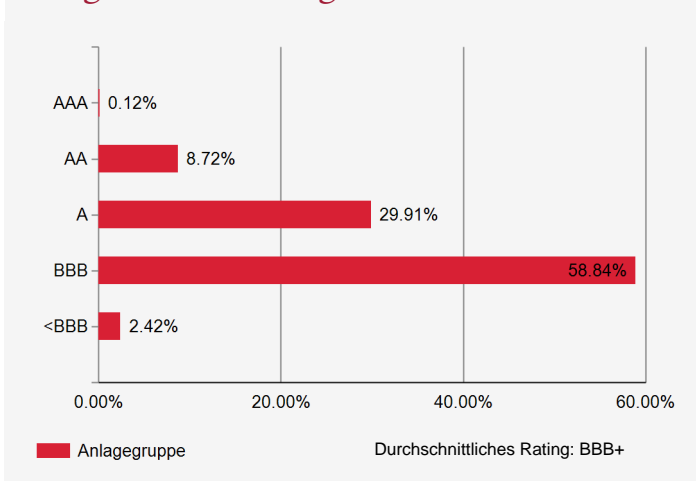
Weitere Angaben zu den Schuldnern

Anzahl Schuldner	204
Anteil Nicht-Benchmark-Schuldner	8.12%

Fälligkeitstruktur der Anlagen



Anlagen nach Rating



Duration und Rendite auf Verfall

	Anlagegruppe	Benchmark
Modified Duration*	4.4	4.6
Theoretische Rendite auf Verfall*	6.49%	6.67%

* Vor Währungsabsicherung, unter Berücksichtigung der Derivate

Portfolio nach Währungen und Duration

	Anlagegruppe		Benchmark	
	Gewichtung	Duration	Gewichtung	Duration
USD	100.00%	4.60	100.00%	4.88

Portfoliostruktur nach Ländern/Regionen

	Anlagegruppe	Benchmark
CHINA	11.39%	11.60%
INDIEN	7.82%	4.66%
SÜDKOREA	7.40%	7.61%
KATAR	6.92%	6.21%
VEREINIGTE ARABISCHE EMIRATE	6.55%	5.50%
THAILAND	5.86%	4.58%
CHILE	5.49%	4.00%
SCHWELLENLÄNDER ASIEN PAZIFIK	20.22%	22.15%
SCHWELLENLÄNDER LATEINAMERIKA	9.64%	12.79%
SCHWELLENLÄNDER IM MITTLEREN OSTEN	7.74%	10.38%
ANDERE	9.04%	10.52%
LIQUIDITÄT, ABSICHERUNG	1.92%	-