



Anlagestiftung Swiss Life

Obligationen Emerging Markets Short Term (CHF hedged)

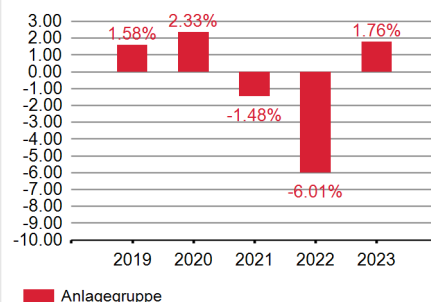
SwissLife

Nettovermögen (NAV) in Mio. CHF: 123.11
Nettovermögen pro Anspruch in CHF: 96.06

Anlagestrategie

Anlagen in auf US Dollar oder auf andere Hartwährungen lautende Forderungspapiere von Unternehmen und Staaten aus Schwellenländern (Emerging Markets) inklusive Agencies und Supranationals mit einer kurzen Restlaufzeit (mehrheitlich unter 3 Jahren). Aktive Titelselektion, Durationsteuerung und Zinskurvenpositionierung. Schuldnerbegrenzung: 10%. Durchschnittliche Ratingqualität: mindestens BBB-. Fremdwährungsrisiken werden zu mindestens 90% gegen Schweizerfranken abgesichert. Umsetzung mittels Einsatz des Swiss Life Funds (LUX) Bond Emerging Markets Short Term CHF AM Cap; Anlagefonds nach luxemburgischem Recht.

Performance



Wertentwicklung in Referenzwährung (Basis 100)



Produktinformationen

Valorennummer: 38013680
ISIN: CH0380136801
LEI: 254900EGYJLGZXIT6O90
Bloomberg-Code: SLOSTCH SW
Währung: CHF
Domizil: Schweiz
Aufgatedatum: 29/09/2017
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: 0.57%

ex post per: 30/09/2024 0.57%

Performance in Referenzwährung

	Kumulierte Performance				Annualisierte Performance			
	YTD	1 Monat	3 Monate	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Aufl.
Anlagegruppe	1.52%	-0.74%	0.52%	3.78%	-1.07%	-0.44%	-	-0.57%

Statistische Angaben (annualisiert)

	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Aufl.
Volatilität Anlagegruppe (in %)	2.11	2.69	2.67	-	2.30
Sharpe Ratio	1.09	-0.68	-0.23	-	-0.19
Maximum Drawdown (in %)	-0.86	-7.60	-8.82	-	-8.82
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.

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 Emerging Markets Short Term (CHF hedged)

Portfoliostruktur nach Branchen

	Anlagegruppe
Finanzwesen	35.76%
Staatlich und staatsnah	17.37%
Kommunikation	8.56%
Energie	8.11%
Nicht-Basiskonsumgüter	6.64%
Basiskonsumgüter	6.59%
Grundstoffe	5.82%
Versorgungsbetriebe	4.46%
Andere	6.38%
Liquidität	0.38%
Währungsabsicherung	-0.08%

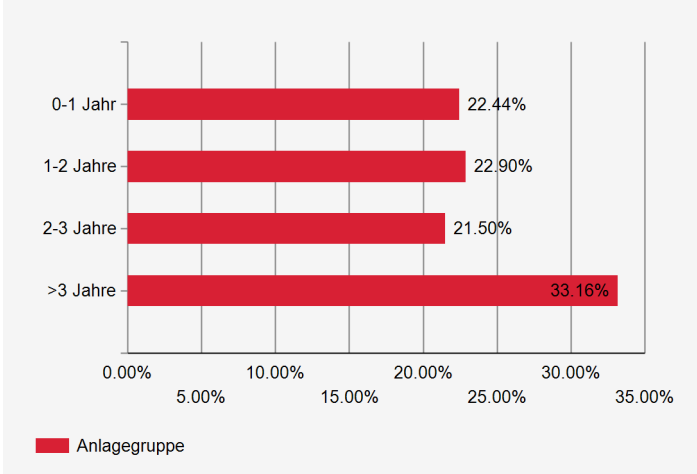
Grösste Schuldner und Rating

		Anlagegruppe
HDFC Bank Ltd	BBB-	3.27%
United Mexican States	BBB	3.23%
First Abu Dhabi Bank PJSC	AA-	3.19%
OTP Bank Nyrt	BBB-	2.91%
Reliance Industries Ltd	BBB	2.54%

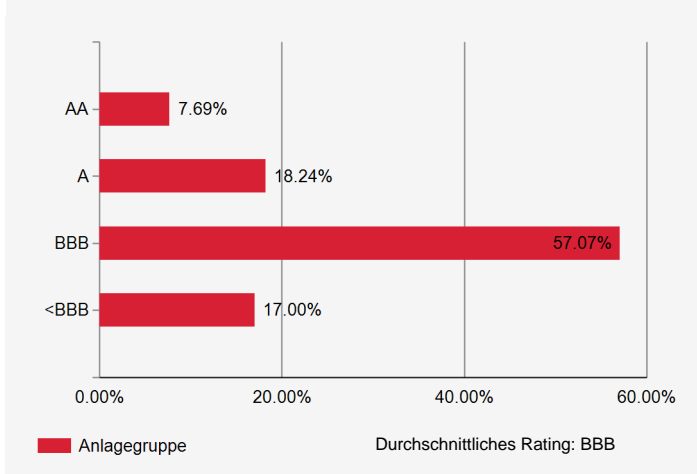
Weitere Angaben zu den Schuldnern

Anzahl Schuldner	94
------------------	----

Fälligkeitstruktur der Anlagen



Anlagen nach Rating



Duration und Rendite auf Verfall

	Anlagegruppe
Modified Duration*	2.1
Theoretische Rendite auf Verfall*	5.35%

* Vor Währungsabsicherung, unter Berücksichtigung der Derivate

Portfolio nach Währungen und Duration

	Anlagegruppe	
	Gewichtung	Duration
CHF	100.64%	0.10
EUR	-0.02%	-348.32
USD	-0.61%	-316.97

Portfoliostruktur nach Ländern/Regionen

	Anlagegruppe
China	10.99%
Indien	10.73%
Vereinigte Arabische Emirate	8.19%
Mexiko	6.49%
Indonesien	6.45%
Ungarn	4.96%
Katar	3.85%
Schwellenländer Asien Pazifik	15.85%
Schwellenländer Lateinamerika	12.78%
Schwellenländer Europa	4.31%
Andere	15.10%
Liquidität, Absicherung	0.30%