

Anlagestiftung Swiss Life

Obligationen Global Aggregate (CHF hedged)

Nettovermögen (NAV) in Mio. CHF: 69.06
Nettovermögen pro Anspruch in CHF: 114.83

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)



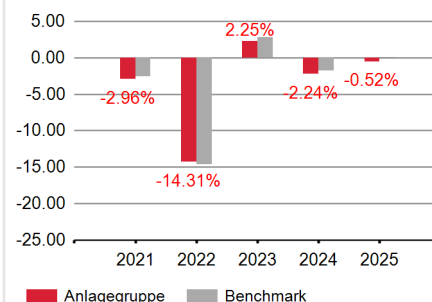
Performance in Referenzwährung

	Kumulierte Performance				Annualisierte Performance			
	YTD	1 Monat	3 Monate	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Aufl.
Anlagegruppe	-1.30%	0.38%	-2.36%	-1.34%	-0.94%	-3.42%	-1.21%	0.56%
Benchmark	-1.20%	0.35%	-2.27%	-1.13%	-0.51%	-3.10%	-1.03%	0.69%

Statistische Angaben (annualisiert)

	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Aufl.
Volatilität Anlagegruppe (in %)	3.38	4.39	5.03	4.32	5.30
Volatilität Benchmark (in %)	3.22	4.24	5.17	4.38	5.44
Tracking Error ex post (in %)	0.21	0.33	0.50	0.48	1.36
Information Ratio	-0.98	-1.34	-0.63	-0.36	-0.09
Sharpe Ratio	-0.39	-0.40	-0.78	-0.24	0.07
Korrelation	1.00	1.00	1.00	0.99	0.97
Beta	1.05	1.03	0.97	0.98	0.94
Jensen-Alpha	-0.15	-0.40	-0.42	-0.19	-0.10
Maximum Drawdown (in %)	-4.17	-6.49	-19.51	-20.24	-20.24
Recovery Period (Jahre)	-	-	-	-	-

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.
Asset Management: Swiss Life Asset Management AG
Überwachung Asset Manager: Überwachung der Anlageresultate des eingesetzten Vermögensverwalters durch PPCmetrics
Kurspublikationen: Bloomberg: ASSL
www.swisslife.ch/anlagestiftung
Betriebsaufwandquote TER KGAST ex ante: 0.44%
ex post per: 30/09/2025 0.44%

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

Portfoliostruktur nach Branchen

	Anlagegruppe	Benchmark
Staatlich und staatsnah	45.14%	72.49%
Finanzwesen	24.36%	11.47%
Basiskonsumgüter	7.08%	3.90%
Kommunikation	5.65%	2.09%
Technologie	2.58%	1.17%
Nicht-Basiskonsumgüter	2.47%	1.68%
Versorgungsbetriebe	1.92%	2.89%
Energie	1.62%	1.67%
Supranational	5.92%	-
Andere	1.52%	2.63%
Liquidität	1.71%	-
Währungsabsicherung	0.02%	-

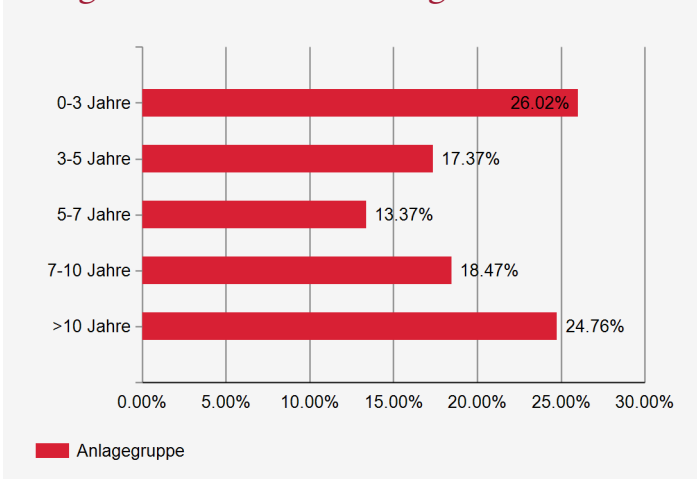
Grösste Schuldner und Rating

		Anlagegruppe
Japan	A+	9.39%
Italien	BBB+	5.73%
US Treasury N/B	AA+	4.78%
Spanien	A+	3.41%
Frankreich	A+	3.29%

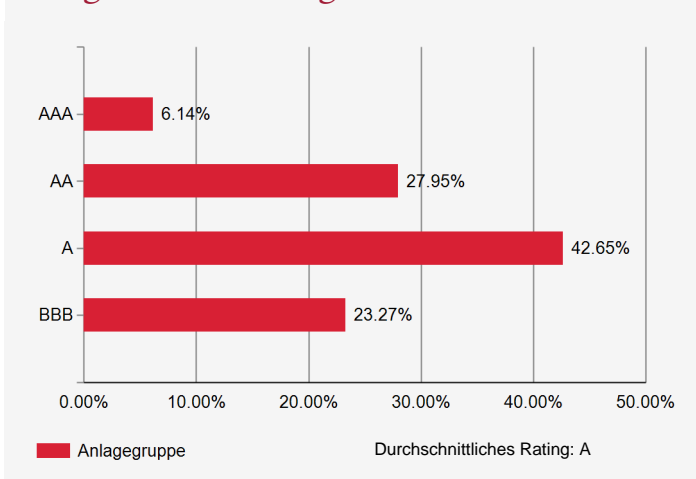
Weitere Angaben zu den Schuldnern

Anzahl Schuldner	118
Anteil Benchmarkfremde Schuldner	0.00%

Fälligkeitstruktur der Anlagen



Anlagen nach Rating



Duration und Rendite auf Verfall

	Anlagegruppe	Benchmark
Modified Duration	6.6	6.4
Theoretische Rendite auf Verfall*	3.64%	3.94%

* vor Währungsabsicherung

Portfoliostruktur nach Ländern/Regionen

	Anlagegruppe	Benchmark
Vereinigte Staaten	27.24%	38.64%
Japan	12.53%	10.59%
Kanada	10.26%	4.65%
Italien	7.16%	4.12%
Vereinigtes Königreich	7.08%	5.55%
Frankreich	5.63%	6.29%
Spanien	5.22%	2.96%
Europäische Region (EUR)	10.65%	12.46%
Europäische Region (Ex EUR)	4.28%	1.37%
Schwellenländer Lateinamerika	4.17%	0.86%
Andere	4.05%	12.50%
Liquidität, Absicherung	1.74%	-