

Anlagestiftung Swiss Life

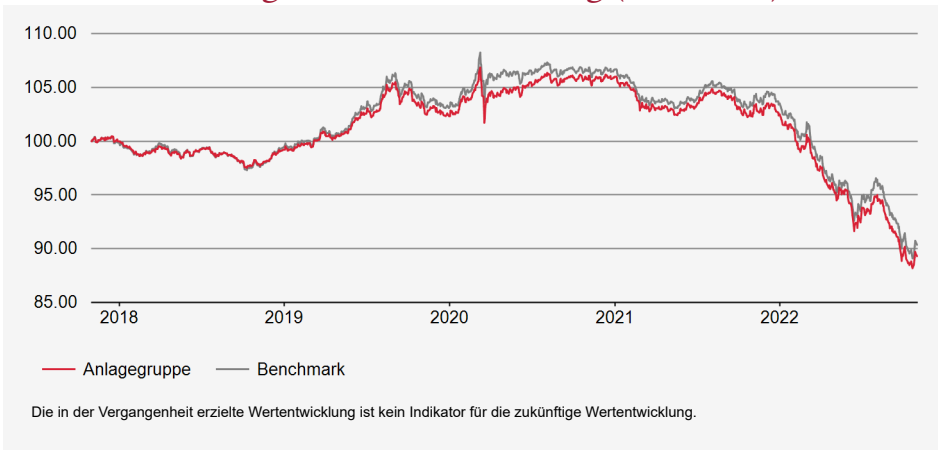
Obligationen Global Staaten+ (CHF hedged)

Nettovermögen (NAV) in Mio. CHF: 569.39
Nettovermögen pro Anspruch in CHF: 106.04

Anlagestrategie

Anlagen in auf Fremdwährungen lautende Forderungspapiere von Staaten und staatsnahen Institutionen. Aktive Titelselektion, Durationsteuerung und Zinskurvenpositionierung. Schuldnerbegrenzung: 10% (Ausnahme: sofern in der Benchmark vertreten, max. 5%-Punkte mehr als Benchmarkgewichtung). Benchmarkfremde Schuldner: max. 10%. Durchschnittliche Ratingqualität: mindestens A+. Fremdwährungsrisiken werden zu mindestens 90% gegen Schweizerfranken abgesichert. Umsetzung mittels Einsatz des Swiss Life iFunds (CH) Bond Global Government+ (CHF hedged); Anlagefonds schweizerischen Rechts der Kategorie "Übrige Fonds für traditionelle Anlagen".

Wertentwicklung in Referenzwährung (Basis 100)



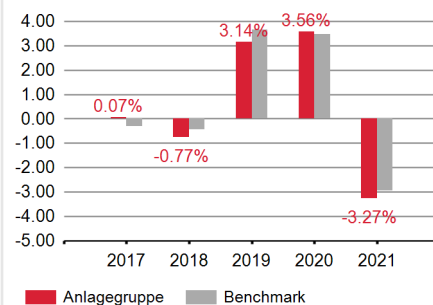
Performance in Referenzwährung

	KUMULIERTE PERFORMANCE				ANNUALISIERTE PERFORMANCE			
	YTD	1 MONAT	3 MONATE	1 JAHR	3 JAHRE	5 JAHRE	10 JAHRE	AUFL.
ANLAGEGRUPPE	-12.87%	-0.13%	-5.86%	-12.72%	-4.85%	-2.24%	-0.30%	0.49%
BENCHMARK	-12.70%	-0.41%	-6.08%	-12.56%	-4.70%	-2.00%	-0.10%	0.51%

Statistische Angaben (annualisiert)

	1 JAHR	3 JAHRE	5 JAHRE	10 JAHRE	AUFL.
Volatilität Anlagegruppe (in %)	5.00	4.08	3.65	3.37	3.38
Volatilität Benchmark (in %)	-	4.14	3.78	3.40	3.32
Tracking Error ex post (in %)	0.65	0.66	0.58	0.62	0.72
Information Ratio	-0.25	-0.22	-0.40	-0.32	-0.01
Sharpe Ratio	-2.63	-1.07	-0.43	0.08	0.28
Korrelation	0.99	0.99	0.99	0.98	0.98
Beta	0.95	0.97	0.96	0.97	0.99
Jensen-Alpha	-0.73	-0.25	-0.29	-0.19	-0.01
Maximum Drawdown (in %)	-14.80	-17.46	-17.46	-17.46	-17.46
Recovery Period (Jahre)	-	-	-	-	-

Performance



Produktinformationen

Valorennummer: 11955694

ISIN: CH0119556949

LEI: 254900H7WEVS3K9ANR90

Bloomberg-Code: SWLGSTP SW

Benchmark: BLOOMBERG GLOBAL AGG TREAS EX CHF TR HEDGED CHF

Währung: CHF

Domizil: Schweiz

Aufgatedatum: 14/12/2010

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: 0.42%

ex post per: 30/09/2022 0.42%

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.

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 Staaten+ (CHF hedged)

Portfoliostruktur nach Branchen

	Anlagegruppe	Benchmark
STAATLICH UND STAATSNAH	80.82%	100.00%
FINANZWESEN	10.26%	-
BASISKONSUMGÜTER	0.50%	-
INDUSTRIE	0.11%	-
SUPRANATIONAL	6.91%	-
LIQUIDITÄT	2.27%	-
WÄHRUNGSABSICHERUNG	-0.88%	-

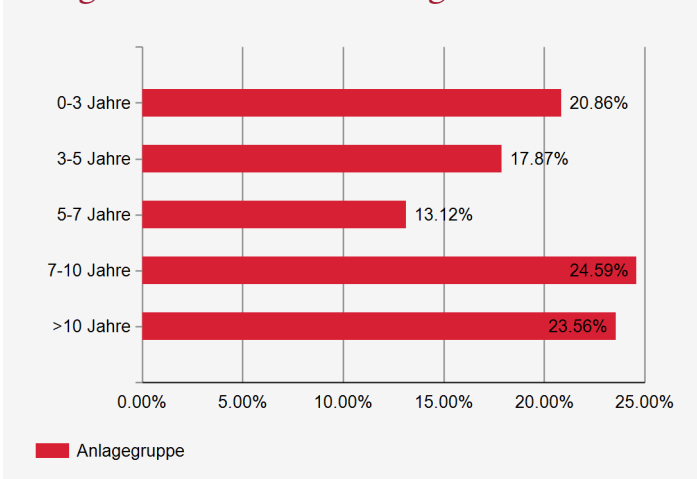
Grösste Schuldner und Rating

	Rating	Anlagegruppe
US Treasury N/B	AA+	32.15%
Japan	A+	12.82%
Italien	BBB-	5.52%
People's Republic of China	A+	5.50%
Kreditanstalt fuer Wiederaufbau	AAA	4.88%

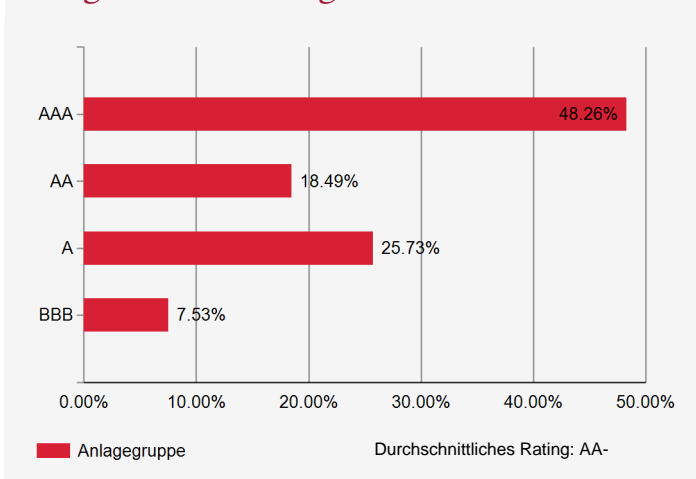
Weitere Angaben zu den Schuldnern

Anzahl Schuldner	79
Anteil Nicht-Benchmark-Schuldner	0.30%

Fälligkeitstruktur der Anlagen



Anlagen nach Rating



Duration und Rendite auf Verfall

	Anlagegruppe	Benchmark
Modified Duration*	6.4	7.4
Theoretische Rendite auf Verfall*	2.64%	2.84%

* Vor Währungsabsicherung, unter Berücksichtigung der Derivate

Portfolio nach Währungen und Duration

	Anlagegruppe		Benchmark	
	Gewichtung	Duration	Gewichtung	Duration
EUR	35.77%	4.07	22.26%	7.21
USD	33.46%	5.60	32.92%	5.88
JPY	13.22%	12.38	21.27%	9.35
GBP	7.16%	7.38	5.29%	10.24
Andere	10.39%	7.09	18.26%	6.88

Portfoliostruktur nach Ländern/Regionen

	Anlagegruppe	Benchmark
VEREINIGTE STAATEN	32.13%	32.92%
JAPAN	13.73%	21.27%
DEUTSCHLAND	8.83%	4.03%
KANADA	5.76%	1.79%
ITALIEN	5.51%	4.88%
CHINA	5.49%	8.37%
VEREINIGTES KÖNIGREICH	3.59%	5.29%
EUROPÄISCHE REGION (EUR)	16.56%	13.01%
ASIEN-PAZIFIK-RAUM	1.35%	1.53%
EUROPA	1.26%	-
ANDERE	4.39%	6.92%
LIQUIDITÄT, ABSICHERUNG	1.39%	-