

Anlagestiftung Swiss Life

Obligationen Global Staaten+ (CHF hedged)

Nettovermögen (NAV) in Mio. CHF: 843.35
Nettovermögen pro Anspruch in CHF: 105.65

Anlagestrategie

Anlagen in 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). Forderungspapiere benchmarkfremder 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)



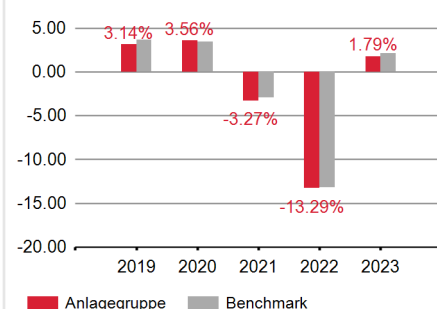
Performance in Referenzwährung

	Kumulierte Performance				Annualisierte Performance			
	YTD	1 Monat	3 Monate	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Aufl.
Anlagegruppe	-1.65%	-1.99%	-0.72%	3.63%	-4.54%	-3.01%	-0.90%	0.40%
Benchmark	-1.09%	-1.64%	-0.26%	3.99%	-4.22%	-2.76%	-0.64%	0.46%

Statistische Angaben (annualisiert)

	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Aufl.
Volatilität Anlagegruppe (in %)	5.30	5.13	4.39	3.75	3.60
Volatilität Benchmark (in %)	4.89	5.21	4.43	3.82	3.55
Tracking Error ex post (in %)	0.50	0.59	0.62	0.60	0.70
Information Ratio	-0.72	-0.54	-0.39	-0.43	-0.10
Sharpe Ratio	0.40	-1.05	-0.74	-0.16	0.17
Korrelation	1.00	0.99	0.99	0.99	0.98
Beta	1.08	0.98	0.98	0.97	0.99
Jensen-Alpha	-0.57	-0.43	-0.30	-0.26	-0.06
Maximum Drawdown (in %)	-3.70	-17.43	-20.00	-20.00	-20.00
Recovery Period (Jahre)	0.27	-	-	-	-

Performance



Produktinformationen

Valorennummer: 11955694

ISIN: CH0119556949

LEI: 254900H7WEVS3K9ANR90

Bloomberg-Code: SWLGGSTP SW

Benchmark: BLOOMBERG GLOBAL AGG TREAS EX CHF TR HEDGED CHF

Währung: CHF

Domizil: Schweiz

Auflagedatum: 14/12/2010

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: 0.42%

ex post per: 30/09/2024 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.

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 Staaten+ (CHF hedged)

Portfoliostruktur nach Branchen

	Anlagegruppe	Benchmark
Staatlich und staatsnah	76.43%	100.00%
Finanzwesen	6.71%	-
Pfandbriefinstitute	3.67%	-
Industrie	0.09%	-
Supranational	4.27%	-
Liquidität	9.24%	-
Währungsabsicherung	-0.40%	-

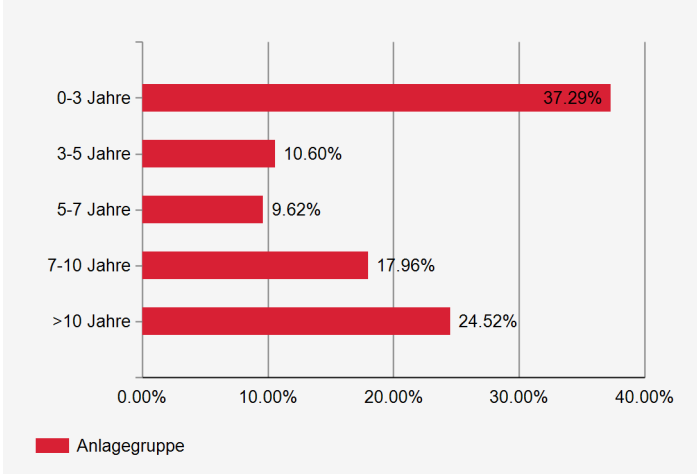
Grösste Schuldner und Rating

	Rating	Anlagegruppe
Japan	A+	21.50%
US Treasury N/B	AAA	14.69%
Italien	BBB-	5.80%
People's Republic of China	A+	5.56%
Spanien	A-	4.59%

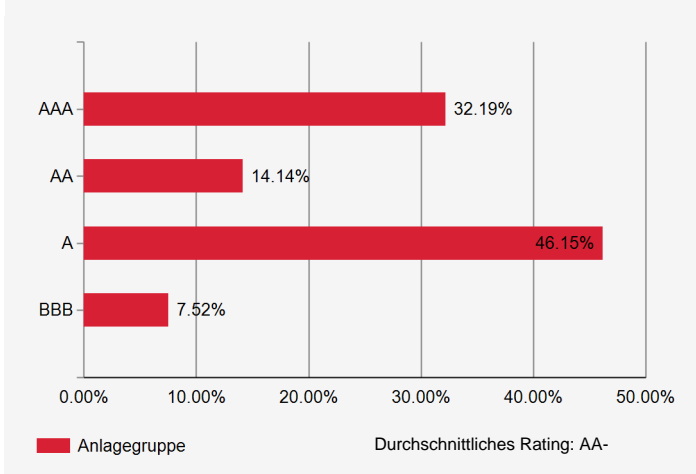
Weitere Angaben zu den Schuldnern

Anzahl Schuldner	65
Anteil Benchmarkfremde Schuldner	3.38%

Fälligkeitstruktur der Anlagen



Anlagen nach Rating



Duration und Rendite auf Verfall

	Anlagegruppe	Benchmark
Modified Duration*	7.5	7.2
Theoretische Rendite auf Verfall*	3.30%	3.17%

* Vor Währungsabsicherung, unter Berücksichtigung der Derivate

Portfolio nach Währungen und Duration

	Anlagegruppe		Benchmark	
	Gewichtung	Duration	Gewichtung	Duration
JPY	30.87%	5.00	17.20%	8.96
EUR	22.09%	9.94	23.19%	7.09
USD	17.84%	13.08	34.11%	5.83
GBP	9.16%	9.06	5.29%	8.91
Andere	20.04%	6.87	20.21%	7.08

Portfoliostruktur nach Ländern/Regionen

	Anlagegruppe	Benchmark
Japan	24.05%	17.20%
Vereinigte Staaten	16.30%	34.11%
Italien	6.43%	5.05%
China	6.16%	10.02%
Spanien	5.24%	3.29%
Vereinigtes Königreich	4.86%	5.29%
Deutschland	3.71%	4.35%
Europäische Region (EUR)	10.99%	9.73%
Europäische Region (Ex EUR)	5.03%	0.45%
Asien-Pazifik-Raum	1.81%	1.29%
Andere	6.57%	9.22%
Liquidität, Absicherung	8.84%	-