

Anlagestiftung Swiss Life

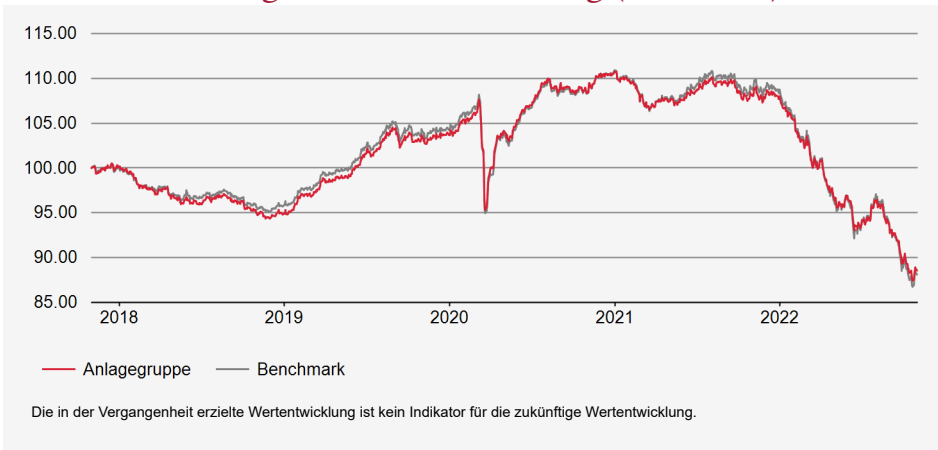
Obligationen Global Unternehmen (CHF hedged)

Nettovermögen (NAV) in Mio. CHF: 645.43
Nettovermögen pro Anspruch in CHF: 113.21

Anlagestrategie

Anlagen in auf Fremdwährungen lautende Forderungspapiere von Unternehmen inklusive Agencies und Supranationals. Aktive Titelselektion, Durationsteuerung und Zinskurvenpositionierung. Schuldnerbegrenzung: 10%. Benchmarkfremde Schuldner: max.10%. Durchschnittliche Ratingqualität: mindestens BBB. Fremdwährungsrisiken werden zu mindestens 90% gegen Schweizerfranken abgesichert. Umsetzung mittels Einsatz des Swiss Life iFunds (CH) Bond Global Corporates (CHF hedged); Anlagfonds schweizerischen Rechts der Kategorie "Übrige Fonds für traditionelle Anlagen".

Wertentwicklung in Referenzwährung (Basis 100)



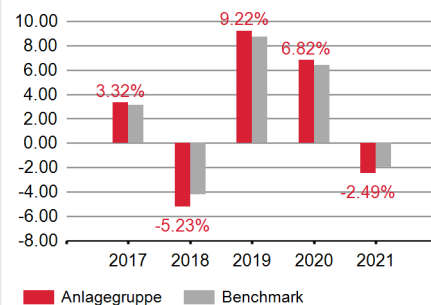
Performance in Referenzwährung

	KUMULIERTE PERFORMANCE				ANNUALISIERTE PERFORMANCE			
	YTD	1 MONAT	3 MONATE	1 JAHR	3 JAHRE	5 JAHRE	10 JAHRE	AUFL.
ANLAGEGRUPPE	-17.99%	-0.96%	-8.11%	-18.12%	-5.11%	-2.40%	-0.07%	1.05%
BENCHMARK	-18.97%	-0.87%	-8.80%	-19.06%	-5.47%	-2.50%	-0.05%	0.92%

Statistische Angaben (annualisiert)

	1 JAHR	3 JAHRE	5 JAHRE	10 JAHRE	AUFL.
Volatilität Anlagegruppe (in %)	7.12	7.28	6.10	5.05	5.06
Volatilität Benchmark (in %)	-	8.00	6.58	5.25	5.11
Tracking Error ex post (in %)	1.02	0.93	0.83	0.86	0.96
Information Ratio	0.91	0.39	0.12	-0.03	0.13
Sharpe Ratio	-2.75	-0.64	-0.28	0.10	0.30
Korrelation	1.00	1.00	0.99	0.99	0.98
Beta	0.89	0.91	0.92	0.95	0.97
Jensen-Alpha	-1.04	-0.08	-0.04	0.00	0.17
Maximum Drawdown (in %)	-19.83	-21.06	-21.06	-21.06	-21.06
Recovery Period (Jahre)	-	-	-	-	-

Performance



Produktinformationen

Valorennummer: 11955702

ISIN: CH0119557020

LEI: 254900C3B00OLU0UJ428

Bloomberg-Code: SWLGUNT SW

Benchmark: BLOOMBERG GLO AGG
CORP IND 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: 0.53%

ex post per: 30/09/2022 0.53%

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 Unternehmen (CHF hedged)

Portfoliostruktur nach Branchen

	Anlagegruppe	Benchmark
FINANZWESEN	44.31%	39.49%
BASISKONSUMGÜTER	19.28%	15.58%
VERSORGUNGSBETRIEBE	7.69%	8.40%
INDUSTRIE	6.96%	7.08%
NICHT-BASISKONSUMGÜTER	6.31%	6.97%
ENERGIE	6.10%	5.88%
KOMMUNIKATION	3.80%	8.36%
TECHNOLOGIE	3.38%	5.15%
ANDERE	0.98%	3.13%
LIQUIDITÄT	1.41%	-
WÄHRUNGSABSICHERUNG	-0.22%	-

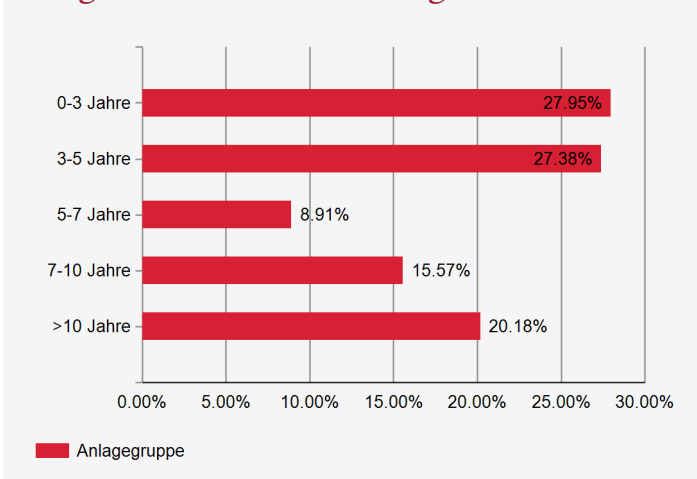
Grösste Schuldner und Rating

		Anlagegruppe
British American Tobacco PLC	BBB	2.17%
Hyundai Motor Co	BBB+	1.98%
JPMorgan Chase & Co	A-	1.96%
Banco Santander SA, Madrid	BBB	1.94%
Blackstone Inc	BBB	1.86%

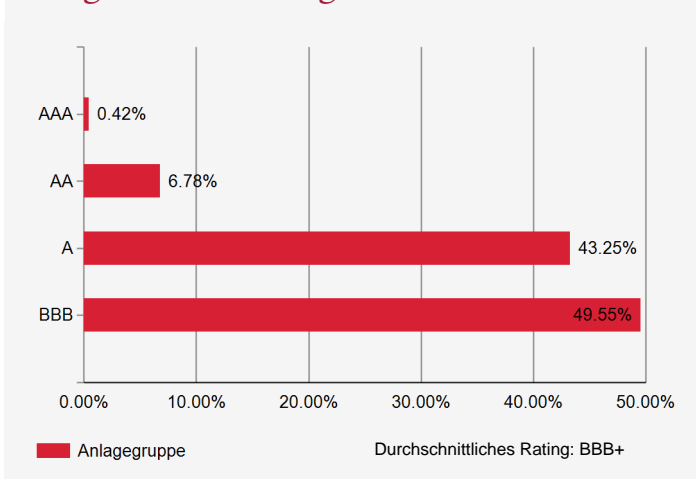
Weitere Angaben zu den Schuldnern

Anzahl Schuldner	190
Anteil Nicht-Benchmark-Schuldner	3.90%

Fälligkeitstruktur der Anlagen



Anlagen nach Rating



Duration und Rendite auf Verfall

	Anlagegruppe	Benchmark
Modified Duration*	5.8	6.1
Theoretische Rendite auf Verfall*	5.64%	5.65%

* Vor Währungsabsicherung, unter Berücksichtigung der Derivate

Portfolio nach Währungen und Duration

	Anlagegruppe		Benchmark	
	Gewichtung	Duration	Gewichtung	Duration
USD	67.09%	6.74	68.81%	6.75
EUR	25.92%	4.01	22.18%	5.05
GBP	3.89%	3.23	3.96%	6.94
JPY	0.33%	2.44	0.79%	4.51
Andere	2.77%	2.10	4.30%	5.30

Portfoliostruktur nach Ländern/Regionen

	Anlagegruppe	Benchmark
VEREINIGTE STAATEN	42.05%	55.43%
VEREINIGTES KÖNIGREICH	7.54%	7.24%
FRANKREICH	7.13%	6.02%
JAPAN	6.52%	3.49%
DEUTSCHLAND	4.08%	4.42%
KANADA	3.85%	5.44%
SPANIEN	3.38%	1.98%
EUROPÄISCHE REGION (EUR)	8.92%	5.74%
EUROPÄISCHE REGION (EX EUR)	8.68%	2.95%
SCHWELLENLÄNDER ASIEN PAZIFIK	4.10%	1.08%
ANDERE	2.57%	6.22%
LIQUIDITÄT, ABSICHERUNG	1.19%	-