

Anlagestiftung Swiss Life

Obligationen Global Unternehmen (CHF hedged)

Nettovermögen (NAV) in Mio. CHF: 793.54
Nettovermögen pro Anspruch in CHF: 119.98

Anlagestrategie

Anlagen in Forderungspapiere von Unternehmen inklusive Agencies und Supranationals. Aktive Titelselektion, Durationsteuerung und Zinskurvenpositionierung. Schuldnerbegrenzung: 10%. Forderungspapiere benchmarkfremder 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); Anlagenfonds schweizerischen Rechts der Kategorie "Übrige Fonds für traditionelle Anlagen".

Wertentwicklung in Referenzwährung (Basis 100)



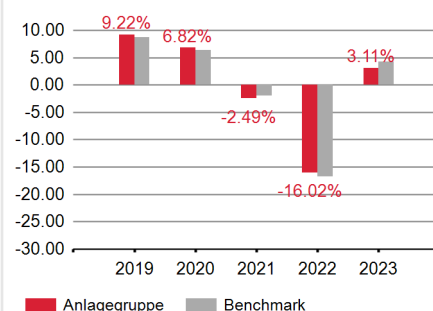
Performance in Referenzwährung

	Kumulierte Performance				Annualisierte Performance			
	YTD	1 Monat	3 Monate	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Aufl.
Anlagegruppe	0.37%	-1.89%	-0.21%	7.25%	-4.61%	-1.96%	-0.10%	1.32%
Benchmark	-0.08%	-2.05%	-0.04%	7.55%	-4.65%	-2.00%	0.01%	1.28%

Statistische Angaben (annualisiert)

	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Aufl.
Volatilität Anlagegruppe (in %)	6.01	7.06	6.85	5.43	5.19
Volatilität Benchmark (in %)	6.77	7.89	7.61	5.86	5.38
Tracking Error ex post (in %)	0.84	1.00	0.95	0.86	0.96
Information Ratio	-0.36	0.05	0.03	-0.13	0.04
Sharpe Ratio	0.93	-0.78	-0.32	0.03	0.29
Korrelation	1.00	1.00	1.00	0.99	0.98
Beta	0.89	0.89	0.90	0.92	0.95
Jensen-Alpha	0.40	-0.55	-0.19	-0.09	0.11
Maximum Drawdown (in %)	-3.05	-20.25	-21.47	-21.47	-21.47
Recovery Period (Jahre)	0.27	-	-	-	-

Performance



Produktinformationen

Valorennummer: 11955702
ISIN: CH0119557020
LEI: 254900C3B00LU0UJ428
Bloomberg-Code: SWLGUNT SW
Benchmark: BLOOMBERG GLO AGG CORP IND HEDGED CHF
Währung: CHF
Domizil: Schweiz
Aufgatedatum: 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: 0.53%

ex post per: 30/09/2024 0.53%

Anlagestiftung Swiss Life

Obligationen Global Unternehmen (CHF hedged)

Portfoliostruktur nach Branchen

	Anlagegruppe	Benchmark
Finanzwesen	48.17%	38.39%
Basiskonsumgüter	12.58%	16.27%
Energie	7.39%	6.05%
Versorgungsbetriebe	6.31%	9.00%
Industrie	6.14%	7.17%
Kommunikation	5.57%	7.87%
Nicht-Basiskonsumgüter	4.86%	7.59%
Technologie	4.75%	4.76%
Andere	2.04%	2.89%
Liquidität	3.40%	-
Währungsabsicherung	-1.21%	-

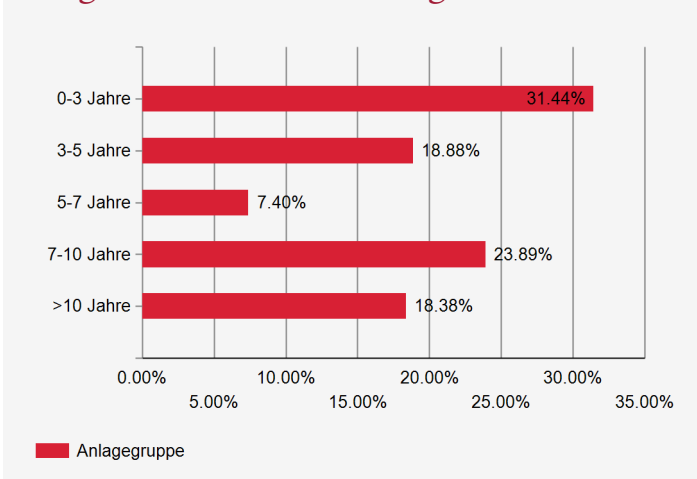
Grösste Schuldner und Rating

	Anlagegruppe	Benchmark
JPMorgan Chase & Co	A-	2.16%
Banco Santander SA, Madrid	BBB+	2.09%
Porsche Automobil Holding SE	BBB	2.08%
Groupe BPCE	BBB+	1.76%
Credit Agricole Group	BBB+	1.76%

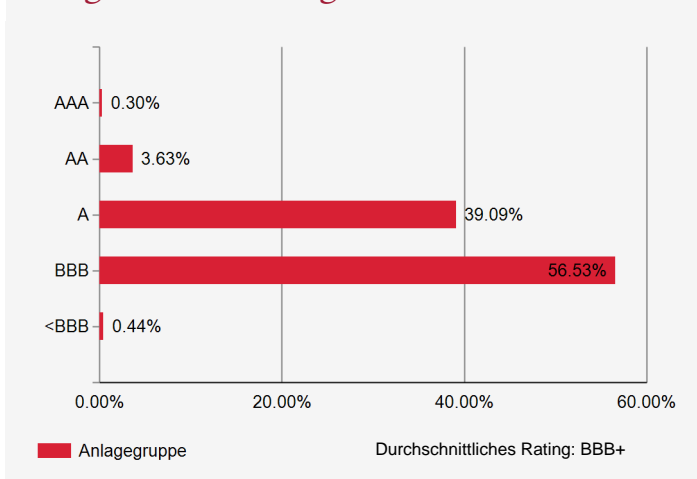
Weitere Angaben zu den Schuldnern

Anzahl Schuldner	229
Anteil Benchmarkfremde Schuldner	4.25%

Fälligkeitstruktur der Anlagen



Anlagen nach Rating



Duration und Rendite auf Verfall

	Anlagegruppe	Benchmark
Modified Duration*	6.1	6.0
Theoretische Rendite auf Verfall*	5.00%	4.96%

* Vor Währungsabsicherung, unter Berücksichtigung der Derivate

Portfolio nach Währungen und Duration

	Anlagegruppe		Benchmark	
	Gewichtung	Duration	Gewichtung	Duration
USD	55.40%	8.34	67.44%	6.58
EUR	29.54%	3.34	23.74%	4.44
CHF	5.76%	2.19	0.37%	4.34
JPY	3.01%	2.15	0.69%	4.08
Andere	6.28%	4.00	7.77%	5.60

Portfoliostruktur nach Ländern/Regionen

	Anlagegruppe	Benchmark
Vereinigte Staaten	37.86%	56.22%
Frankreich	9.64%	6.17%
Vereinigtes Königreich	9.22%	6.85%
Deutschland	5.21%	5.02%
Japan	4.54%	3.38%
Spanien	4.34%	2.24%
Schweiz	4.08%	1.49%
Europäische Region (EUR)	9.49%	5.81%
Asien-Pazifik-Raum	3.32%	2.24%
Europäische Region (Ex EUR)	3.12%	1.58%
Andere	7.00%	9.01%
Liquidität, Absicherung	2.19%	-