

Anlagestiftung Swiss Life Obligationen CHF Ausland

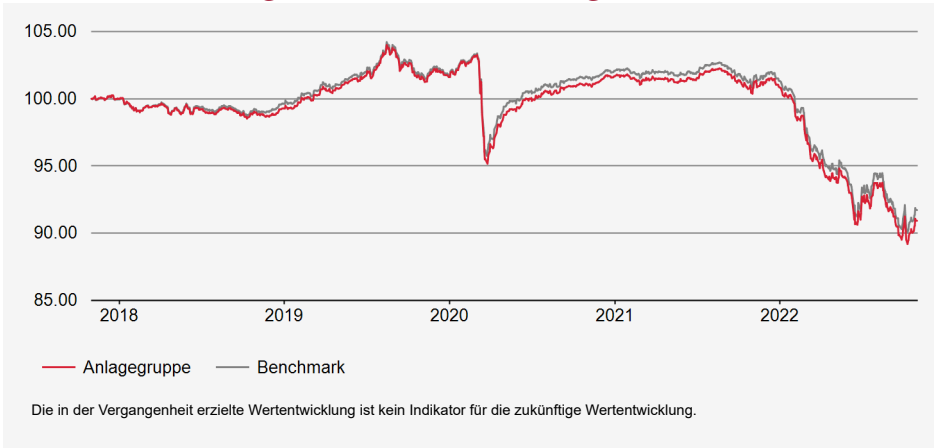


Nettovermögen (NAV) in Mio. CHF: 316.65
Nettovermögen pro Anspruch in CHF: 137.55

Anlagestrategie

Anlagen in auf CHF lautende Forderungspapiere von Schuldern, die vorwiegend im Ausland domiziliert sind. Aktive Titelselektion, Durationsteuerung und Zinskurvenpositionierung. Schuldnerbegrenzung: 10%. Benchmarkfremde Schuldner: max. 20%. Durchschnittliche Ratingqualität: mindestens A. Umsetzung mittels Einsatz des Swiss Life iFunds (CH) Bond Swiss Francs Foreign (CHF); Anlagefonds schweizerischen Rechts der Kategorie "Übrige Fonds für traditionelle Anlagen".

Wertentwicklung in Referenzwährung (Basis 100)



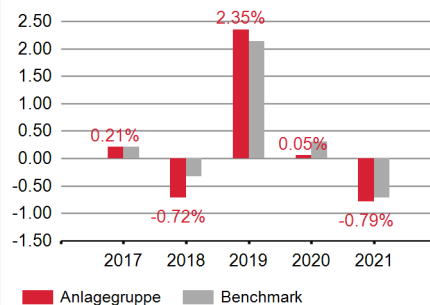
Performance in Referenzwährung

	KUMULIERTE PERFORMANCE				ANNUALISIERTE PERFORMANCE			
	YTD	1 MONAT	3 MONATE	1 JAHR	3 JAHRE	5 JAHRE	10 JAHRE	AUFL.
ANLAGEGRUPPE	-9.84%	0.77%	-2.99%	-9.47%	-3.65%	-1.88%	-0.15%	1.52%
BENCHMARK	-9.48%	0.72%	-2.88%	-9.08%	-3.44%	-1.71%	-0.10%	1.67%

Statistische Angaben (annualisiert)

	1 JAHR	3 JAHRE	5 JAHRE	10 JAHRE	AUFL.
Volatilität Anlagegruppe (in %)	4.70	5.19	4.22	3.27	3.25
Volatilität Benchmark (in %)	-	4.89	4.00	3.12	3.10
Tracking Error ex post (in %)	0.38	0.43	0.35	0.36	0.89
Information Ratio	-1.02	-0.47	-0.49	-0.15	-0.16
Sharpe Ratio	-2.02	-0.60	-0.29	0.13	0.43
Korrelation	1.00	1.00	1.00	0.99	0.96
Beta	1.00	1.06	1.05	1.04	1.01
Jensen-Alpha	-0.41	-0.04	-0.12	-0.08	-0.17
Maximum Drawdown (in %)	-12.15	-13.61	-14.23	-14.23	-14.23
Recovery Period (Jahre)	-	-	-	-	-

Performance



Produktinformationen

Valorennummer: 1245477
ISIN: CH0012454770
LEI: 2549002XPEQH1AZYBW05
Bloomberg-Code: SWAOBAU SW
Benchmark: SBI Foreign AAA - BBB TR
Währung: CHF
Domizil: Schweiz
Aufgatedatum: 30/09/2001
Ausgabepreis: 100.00
Jahresabschluss: 30.09
Ausgabe/Rücknahme: Täglich
Annahmeschluss: 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: 0.27%
ex post per: 30/09/2022 0.27%

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.

Portfoliostruktur nach Branchen

	Anlagegruppe	Benchmark
FINANZWESEN	59.93%	48.81%
PFANDBRIEFINSTITUTE	10.54%	12.29%
STAATLICH UND STAATSNÄH	4.74%	17.22%
ENERGIE	3.61%	3.20%
BASISKONSUMGÜTER	3.31%	4.57%
KOMMUNIKATION	3.10%	2.78%
INDUSTRIE	2.25%	5.23%
VERSORGBETRIEBE	1.88%	1.98%
SUPRANATIONAL	7.27%	-
ANDERE	2.37%	3.91%
LIQUIDITÄT	0.98%	-

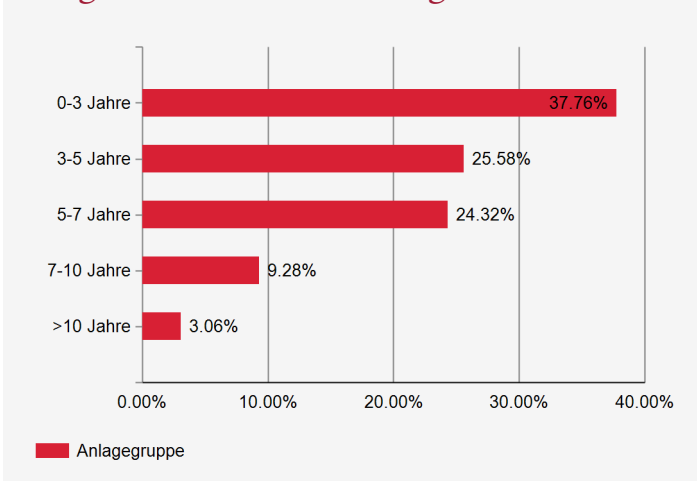
Grösste Schuldner und Rating

	Rating	Anlagegruppe
Müchener Hypothekenbank	AA-	3.75%
Credit Agricole Group	AA-	3.32%
Pfandbriefbank	AAA	2.90%
Pfandbriefzentrale	AAA	2.65%
Commonwealth Bank of Australia	AA	2.57%

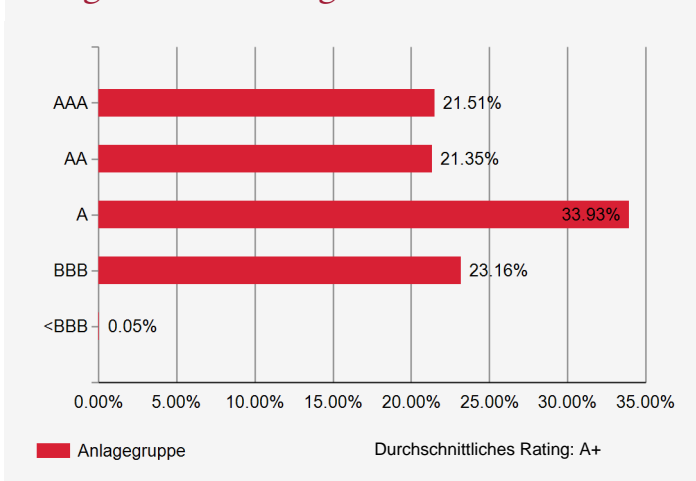
Weitere Angaben zu den Schuldnern

Anzahl Schuldner	121
Anteil Nicht-Benchmark-Schuldner	9.65%

Fälligkeitstruktur der Anlagen



Anlagen nach Rating



Duration und Rendite auf Verfall

	Anlagegruppe	Benchmark
Modified Duration*	4.4	4.3
Theoretische Rendite auf Verfall*	2.41%	2.24%

* Vor Währungsabsicherung, unter Berücksichtigung der Derivate

Portfoliostruktur nach Ländern/Regionen

	Anlagegruppe	Benchmark
VEREINIGTE STAATEN	16.87%	16.04%
FRANKREICH	13.19%	14.54%
DEUTSCHLAND	9.30%	11.56%
AUSTRALIEN	7.83%	8.06%
KANADA	7.81%	9.15%
SCHWEIZ	7.40%	0.54%
VEREINIGTES KÖNIGREICH	6.35%	4.82%
EUROPÄISCHE REGION (EUR)	8.11%	17.02%
SCHWELLENLÄNDER LATEINAMERIKA	6.78%	5.71%
SCHWELLENLÄNDER IM MITTLEREN OSTEN	4.98%	2.01%
ANDERE	10.41%	10.55%
LIQUIDITÄT, ABSICHERUNG	0.98%	-