

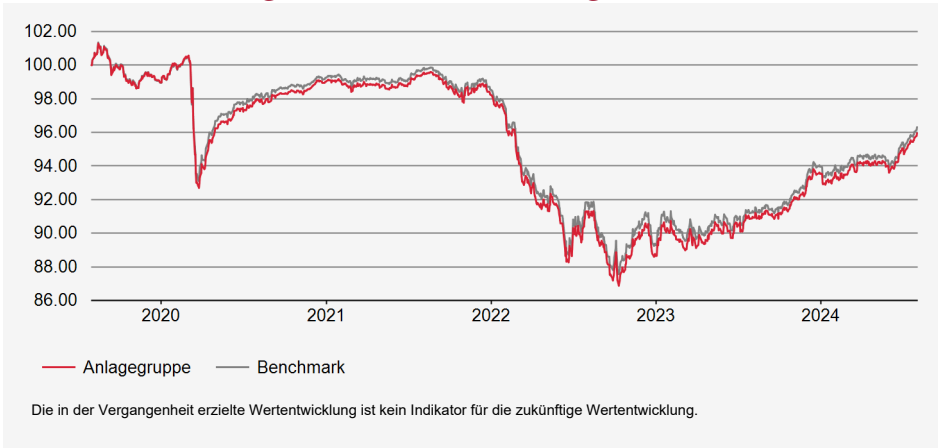
# Anlagestiftung Swiss Life Obligationen CHF Ausland

**Nettovermögen (NAV) in Mio. CHF: 308.79**  
**Nettovermögen pro Anspruch in CHF: 149.03**

## Anlagestrategie

Anlagen in auf CHF lautende Forderungspapiere von Schuldern, die vorwiegend im Ausland domiziliert sind. Aktive Titelselektion, Durationsteuerung und Zinskurvenpositionierung. Schuldnerbegrenzung: 10%. Forderungspapiere benchmarkfremder 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)



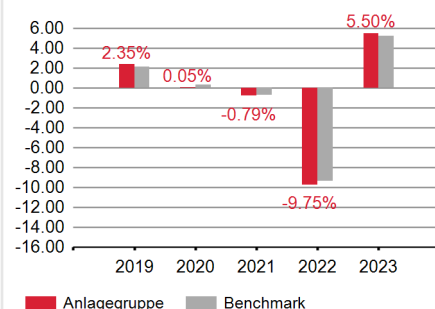
## Performance in Referenzwährung

	Kumulierte Performance				Annualisierte Performance			
	YTD	1 Monat	3 Monate	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Aufl.
Anlagegruppe	2.58%	0.95%	1.85%	5.58%	-1.17%	-0.82%	0.25%	1.76%
Benchmark	2.50%	0.96%	1.83%	5.58%	-1.14%	-0.75%	0.32%	1.88%

## Statistische Angaben (annualisiert)

	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Aufl.
Volatilität Anlagegruppe (in %)	2.05	3.91	4.51	3.40	3.22
Volatilität Benchmark (in %)	2.09	3.88	4.30	3.26	3.08
Tracking Error ex post (in %)	0.11	0.25	0.34	0.32	0.86
Information Ratio	0.06	-0.12	-0.22	-0.22	-0.13
Sharpe Ratio	1.88	-0.45	-0.20	0.17	0.48
Korrelation	1.00	1.00	1.00	1.00	0.96
Beta	0.98	1.00	1.05	1.04	1.01
Jensen-Alpha	0.09	-0.02	-0.04	-0.09	-0.14
Maximum Drawdown (in %)	-0.98	-12.77	-14.23	-14.23	-14.23
Recovery Period (Jahre)	0.15	-	-	-	-

## 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  
**Erstausgabepreis:** 100.00  
**Jahresabschluss:** 30.09  
**Ausgabe/Rücknahme:** Täglich  
**Annahmeschluss:** 13.00 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](http://www.swisslife.ch/anlagestiftung)  
**Betriebsaufwandquote TER KGAST ex ante:** 0.27%  
**ex post per:** 30/09/2023 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	65.78%	48.92%
Staatlich und staatsnah	6.36%	15.27%
Pfandbriefinstitute	5.82%	16.82%
Versorgungsbetriebe	3.87%	2.28%
Nicht-Basiskonsumgüter	3.78%	3.44%
Industrie	2.62%	5.16%
Basiskonsumgüter	2.50%	3.97%
Grundstoffe	0.80%	0.65%
Supranational	6.49%	-
Andere	1.39%	3.49%
Liquidität	0.61%	-

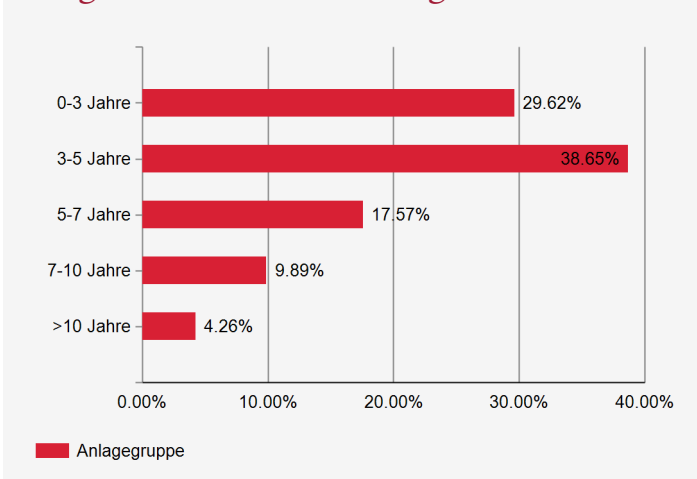
## Grösste Schuldner und Rating

		Anlagegruppe
Banco Santander SA, Madrid	A+	4.24%
Bank of Nova Scotia/The	AA	4.14%
Groupe BPCE	AA-	4.01%
Müchener Hypothekenbank	AA	3.87%
Credit Agricole Group	AA-	2.99%

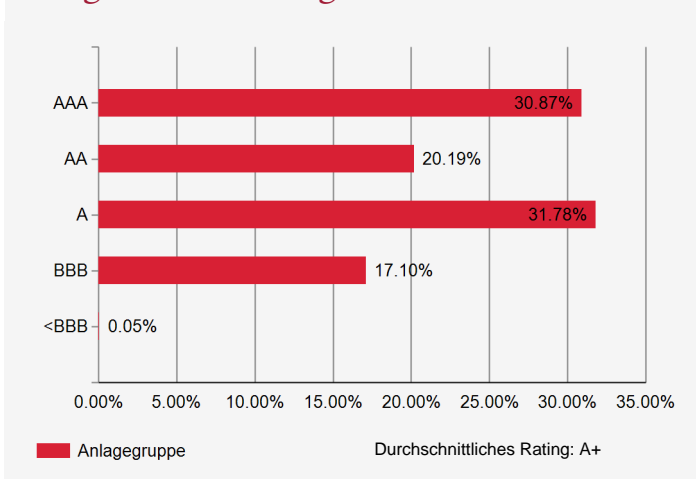
## Weitere Angaben zu den Schuldnern

Anzahl Schuldner	109
Anteil Benchmarkfremde Schuldner	3.54%

## Fälligkeitstruktur der Anlagen



## Anlagen nach Rating



## Duration und Rendite auf Verfall

	Anlagegruppe	Benchmark
Modified Duration*	4.1	4.2
Theoretische Rendite auf Verfall*	1.32%	1.24%

\* Vor Währungsabsicherung, unter Berücksichtigung der Derivate

## Portfoliostruktur nach Ländern/Regionen

	Anlagegruppe	Benchmark
Frankreich	15.68%	16.05%
Deutschland	13.80%	14.05%
Kanada	12.87%	11.69%
Vereinigte Staaten	9.01%	12.18%
Australien	6.27%	6.74%
Spanien	6.10%	4.29%
Vereinigtes Königreich	4.95%	4.43%
Europäische Region (Ex EUR)	9.13%	6.31%
Europäische Region (EUR)	5.72%	9.99%
Schwellenländer Lateinamerika	5.61%	3.87%
Andere	10.27%	10.41%
Liquidität, Absicherung	0.61%	-