

Anlagestiftung Swiss Life

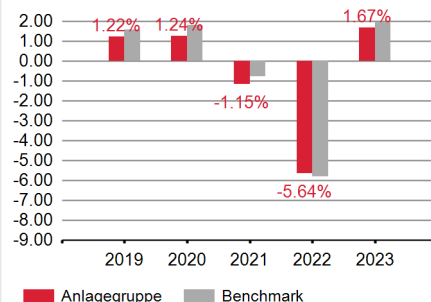
Obligationen Global Unternehmen Short Term (CHF hedged)

Nettovermögen (NAV) in Mio. CHF: 1'298.53
Nettovermögen pro Anspruch in CHF: 98.17

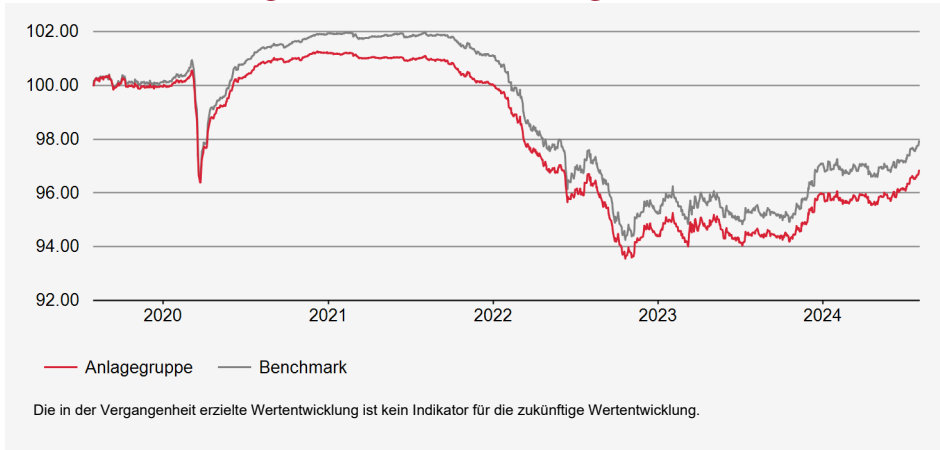
Anlagestrategie

Anlagen in Forderungspapiere von Unternehmen inklusive Agencies und Supranationals mit einer kurzen Restlaufzeit (mehrheitlich unter 3 Jahren). 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 Short Term (CHF hedged); Anlagefonds schweizerischen Rechts der Kategorie "Übrige Fonds für traditionelle Anlagen".

Performance



Wertentwicklung in Referenzwährung (Basis 100)



Produktinformationen

Valorennummer: 22073699
ISIN: CH0220736992
LEI: 2549003DSGO0RN37K507
Bloomberg-Code: SWLOGNT SW
Benchmark: BLOOMBERG GLO AGG CORP 1-3 YR IND HEDGED CHF
Währung: CHF
Domizil: Schweiz
Aufliedatum: 11/10/2013
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 Anlagesresultate.

Kurspublikationen: Bloomberg: ASSL
www.swisslife.ch/anlagestiftung

Betriebsaufwandquote TER KGAST ex ante: 0.38%
ex post per: 30/09/2023 0.38%

Performance in Referenzwährung

	Kumulierte Performance				Annualisierte Performance			
	YTD	1 Monat	3 Monate	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Aufl.
Anlagegruppe	0.90%	0.72%	1.31%	2.43%	-1.41%	-0.64%	-0.34%	-0.17%
Benchmark	0.86%	0.77%	1.38%	2.61%	-1.33%	-0.41%	-0.18%	-0.03%

Statistische Angaben (annualisiert)

	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Aufl.
Volatilität Anlagegruppe (in %)	1.42	2.08	2.20	1.66	1.61
Volatilität Benchmark (in %)	1.75	2.29	2.37	1.74	1.69
Tracking Error ex post (in %)	0.38	0.30	0.27	0.32	0.32
Information Ratio	-0.48	-0.27	-0.86	-0.48	-0.45
Sharpe Ratio	0.58	-0.97	-0.33	-0.01	0.08
Korrelation	0.99	0.99	1.00	0.98	0.98
Beta	0.81	0.90	0.92	0.93	0.94
Jensen-Alpha	0.02	-0.28	-0.27	-0.15	-0.13
Maximum Drawdown (in %)	-0.53	-7.45	-7.61	-8.08	-8.08
Recovery Period (Jahre)	0.16	-	-	-	-

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	54.55%	51.41%
Basiskonsumgüter	14.22%	12.14%
Nicht-Basiskonsumgüter	8.26%	9.77%
Energie	5.19%	4.02%
Technologie	3.66%	4.19%
Industrie	3.51%	5.96%
Versorgungsbetriebe	2.89%	5.20%
Grundstoffe	2.12%	2.05%
Andere	2.60%	5.28%
Liquidität	1.17%	-
Währungsabsicherung	1.83%	-

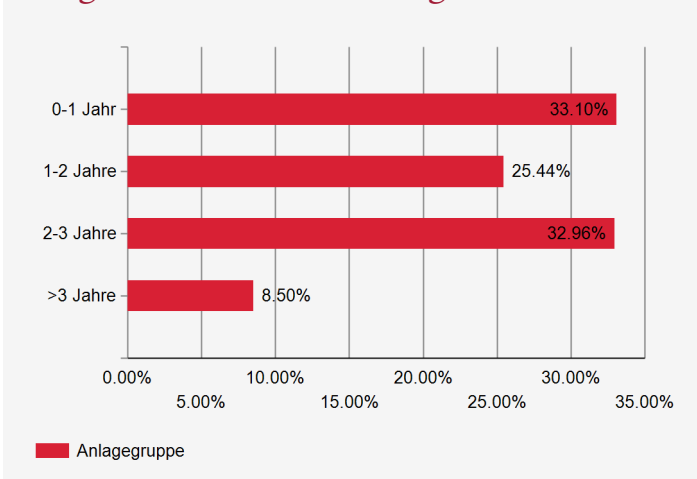
Grösste Schuldner und Rating

		Anlagegruppe
Banco Santander SA, Madrid	A-	3.14%
UBS Group AG	A+	2.50%
Morgan Stanley NE US	A	2.19%
Broadcom Inc	BBB-	2.19%
Société Générale, Paris	BBB	2.16%

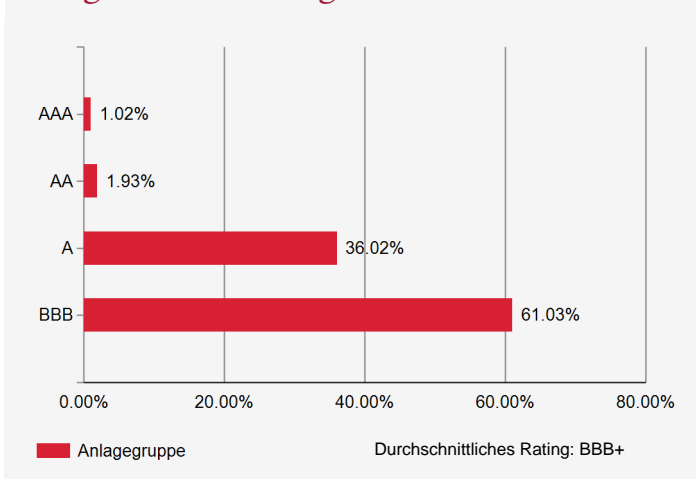
Weitere Angaben zu den Schuldnern

Anzahl Schuldner	143
Anteil Benchmarkfremde Schuldner	7.29%

Fälligkeitstruktur der Anlagen



Anlagen nach Rating



Duration und Rendite auf Verfall

	Anlagegruppe	Benchmark
Modified Duration*	1.9	1.8
Theoretische Rendite auf Verfall*	4.21%	4.49%

* Vor Währungsabsicherung, unter Berücksichtigung der Derivate

Portfolio nach Währungen und Duration

	Anlagegruppe		Benchmark	
	Gewichtung	Duration	Gewichtung	Duration
USD	62.65%	1.85	60.59%	1.93
EUR	23.79%	1.88	29.51%	2.05
CHF	9.05%	1.93	0.46%	2.06
GBP	3.39%	1.64	3.80%	1.93
Andere	1.12%	2.21	5.65%	2.09

Portfoliostruktur nach Ländern/Regionen

	Anlagegruppe	Benchmark
Vereinigte Staaten	33.52%	46.28%
Vereinigtes Königreich	10.19%	6.77%
Frankreich	8.77%	7.44%
Schweiz	7.33%	2.05%
Kanada	7.29%	5.66%
Deutschland	5.58%	6.18%
Spanien	5.38%	3.25%
Europäische Region (EUR)	7.75%	6.93%
Schwellenländer Asien Pazifik	3.48%	2.45%
Asien-Pazifik-Raum	2.99%	4.66%
Andere	4.70%	8.31%
Liquidität, Absicherung	3.01%	-