

Anlagestiftung Swiss Life

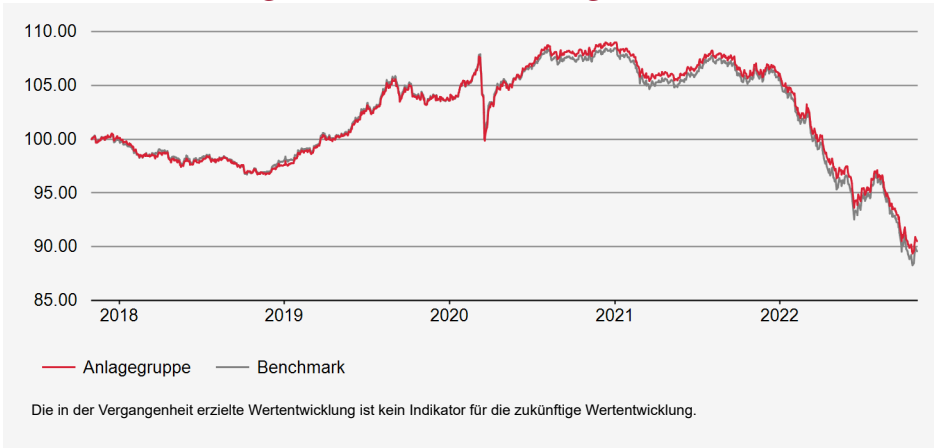
Obligationen Global PM (CHF hedged)

Nettovermögen (NAV) in Mio. CHF: 40.31
Nettovermögen pro Anspruch in CHF: 116.23

Anlagestrategie

Anlagen in auf Fremdwährungen lautende Forderungspapiere von Schuldern mit Domizil im In- oder Ausland (seit 1.1.2011 CHF hedged). Aktive Titelselektion, Durationsteuerung und Zinskurvenpositionierung. Schuldnerbegrenzung: 10% (Ausnahme: sofern in der Benchmark vertreten, max. 5%-Punkte mehr als Benchmarkgewichtung). Benchmarkfremde Schuldner: max. 10%. Durchschnittliche Ratingqualität: mindestens A-. Fremdwährungsrisiken werden zu mindestens 90% gegen Schweizerfranken abgesichert. Umsetzung mittels Einsatz Swiss Life iFunds (CH) Bond Global Government+ (CHF hedged) und Swiss Life iFunds (CH) Bond Global Corporates (CHF hedged); Anlagefonds schweizerischen Rechts der Kategorie "Übrige Fonds für traditionelle Anlagen".

Wertentwicklung in Referenzwährung (Basis 100)



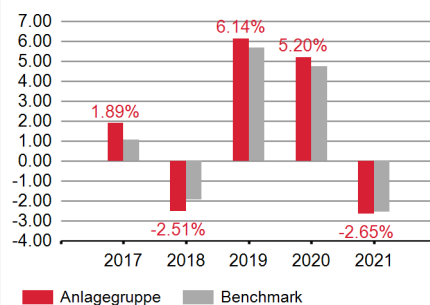
Performance in Referenzwährung

	KUMULIERTE PERFORMANCE				ANNUALISIERTE PERFORMANCE			
	YTD	1 MONAT	3 MONATE	1 JAHR	3 JAHRE	5 JAHRE	10 JAHRE	AUFL.
ANLAGEGRUPPE	-14.68%	-0.44%	-6.68%	-14.59%	-4.61%	-1.97%	0.15%	0.98%
BENCHMARK	-15.25%	-0.59%	-7.18%	-15.20%	-4.98%	-2.18%	-0.06%	0.67%

Statistische Angaben (annualisiert)

	1 JAHR	3 JAHRE	5 JAHRE	10 JAHRE	AUFL.
Volatilität Anlagegruppe (in %)	5.71	5.15	4.43	3.86	5.65
Volatilität Benchmark (in %)	-	5.28	4.55	3.86	5.64
Tracking Error ex post (in %)	0.68	0.51	0.49	0.62	1.45
Information Ratio	0.89	0.73	0.42	0.34	0.21
Sharpe Ratio	-2.68	-0.80	-0.29	0.18	0.20
Korrelation	1.00	1.00	0.99	0.99	0.97
Beta	0.92	0.97	0.97	0.99	0.97
Jensen-Alpha	-0.53	0.24	0.16	0.21	0.33
Maximum Drawdown (in %)	-16.51	-18.01	-18.01	-18.01	-18.01
Recovery Period (Jahre)	-	-	-	-	-

Performance



Produktinformationen

Valorennummer: 3026055

ISIN: CH0030260555

LEI: 254900F82G5L48XPDV74

Bloomberg-Code: SLOFGPM SW

Benchmark: 40% Bloomberg Global Aggregate Corporates 60% Bloomberg Global Aggregate Treasuries ex CH (Indices CHF hedged)

Währung: CHF

Domizil: Schweiz

Aufgedatum: 31/05/2007

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: 0.15%

ex post per: 30/09/2022 0.15%

PM-Tranche: Der Erwerb dieser Tranche ist nur im Rahmen einer speziellen Vereinbarung mit Swiss Life Asset Management AG möglich.

Benchmark: Die Benchmark wurde per 1. Juli 2012 gewechselt. Für Informationen betreffend die frühere Benchmark wenden Sie sich bitte an die Anlagestiftung Swiss Life.

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 PM (CHF hedged)

Portfoliostruktur nach Branchen

	Anlagegruppe	Benchmark
STAATLICH UND STAATSNAH	48.67%	60.00%
FINANZWESEN	23.71%	15.80%
BASISKONSUMGÜTER	7.93%	6.23%
VERSORGUNGSBETRIEBE	3.04%	3.36%
INDUSTRIE	2.82%	2.83%
NICHT-BASISKONSUMGÜTER	2.50%	2.79%
ENERGIE	2.41%	2.35%
KOMMUNIKATION	1.50%	3.34%
TECHNOLOGIE	1.34%	2.06%
SUPRANATIONAL	4.16%	-
OTHER	0.39%	1.25%
LIQUIDITÄT	2.13%	-
WÄHRUNGSABSICHERUNG	-0.62%	-

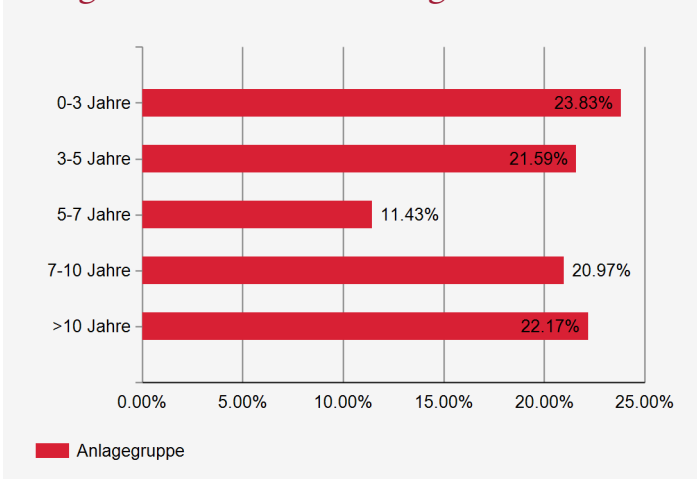
Grösste Schuldner und Rating

	Rating	Anlagegruppe
US Treasury N/B	AA+	19.36%
Japan	A+	7.72%
Italien	BBB-	3.32%
People's Republic of China	A+	3.31%
Kreditanstalt fuer Wiederaufbau	AAA	2.94%

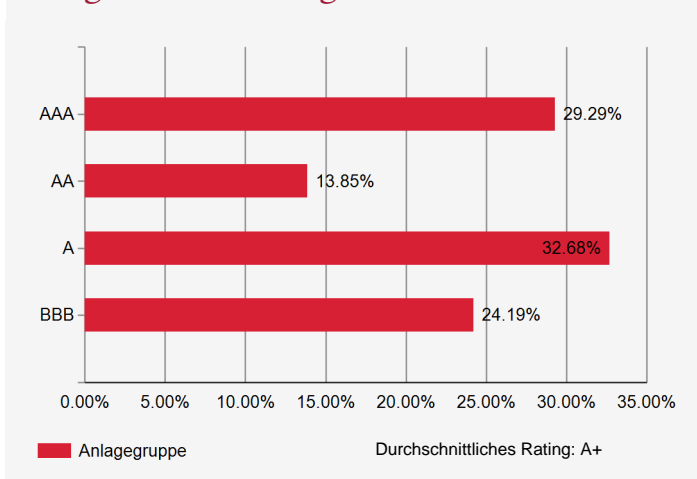
Weitere Angaben zu den Schuldnern

Anzahl Schuldner	269
Anteil Nicht-Benchmark-Schuldner	1.72%

Fälligkeitstruktur der Anlagen



Anlagen nach Rating



Duration und Rendite auf Verfall

	Anlagegruppe	Benchmark
Modified Duration*	6.2	6.9
Theoretische Rendite auf Verfall*	3.82%	3.96%

* Vor Währungsabsicherung, unter Berücksichtigung der Derivate

Portfolio nach Währungen und Duration

	Anlagegruppe		Benchmark	
	Gewichtung	Duration	Gewichtung	Duration
USD	46.70%	6.04	47.27%	6.23
EUR	31.80%	4.04	22.23%	6.35
JPY	8.09%	8.42	13.08%	7.41
Andere	13.41%	10.82	17.44%	15.17

Portfoliostruktur nach Ländern/Regionen

	Anlagegruppe	Benchmark
VEREINIGTE STAATEN	35.99%	41.92%
JAPAN	10.85%	14.15%
DEUTSCHLAND	6.93%	4.18%
VEREINIGTES KÖNIGREICH	5.14%	6.07%
KANADA	4.99%	3.25%
ITALIEN	3.32%	2.93%
CHINA	3.31%	5.02%
EUROPÄISCHE REGION (EUR)	13.51%	10.10%
EUROPÄISCHE REGION (EX EUR)	3.43%	1.18%
SCHWELLENLÄNDER ASIEN PAZIFIK	1.62%	0.43%
ANDERE	9.39%	10.76%
LIQUIDITÄT, ABSICHERUNG	1.52%	-