

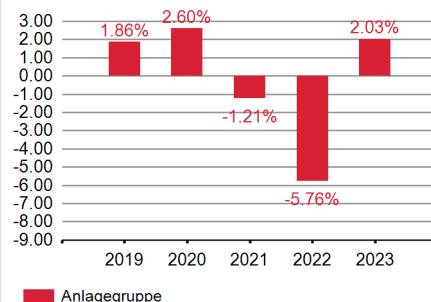
Anlagestiftung Swiss Life Obligationen Emerging Markets Short Term PM (CHF hedged)

Nettovermögen (NAV) in Mio. CHF: 132.47
Nettovermögen pro Anspruch in CHF: 97.33

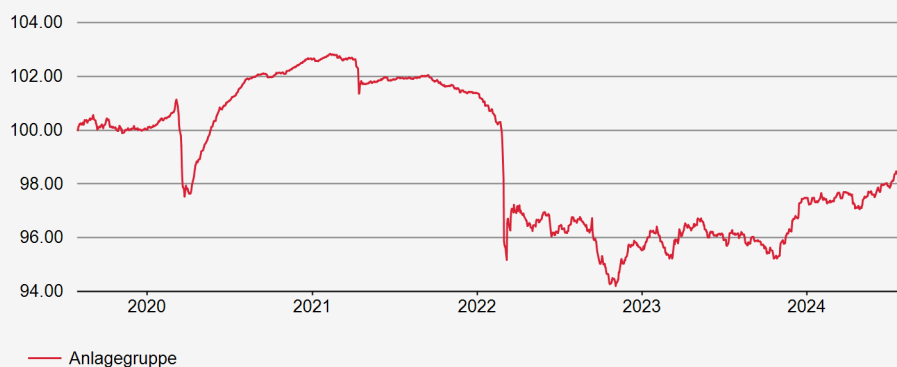
Anlagestrategie

Anlagen in auf US Dollar oder auf andere Hartwährungen lautende Forderungspapiere von Unternehmen und Staaten aus Schwellenländern (Emerging Markets) inklusive Agencies und Supranationals mit einer kurzen Restlaufzeit (mehrheitlich unter 3 Jahren). Aktive Titelselektion, Durationsteuerung und Zinskurvenpositionierung. Schuldnerbegrenzung: 10%. Durchschnittliche Ratingqualität: mindestens BBB-. Fremdwährungsrisiken werden zu mindestens 90% gegen Schweizerfranken abgesichert. Umsetzung mittels Einsatz des Swiss Life Funds (LUX) Bond Emerging Markets Short Term CHF AM Cap; Anlagefonds nach luxemburgischem Recht.

Performance



Wertentwicklung in Referenzwährung (Basis 100)



Die in der Vergangenheit erzielte Wertentwicklung ist kein Indikator für die zukünftige Wertentwicklung.

Produktinformationen

Valorennummer: 38013685

ISIN: CH0380136850

LEI: 254900EGYJLGZXIT6O90

Bloomberg-Code: SLOSTPM SW

Währung: CHF

Domizil: Schweiz

Aufledgedatum: 29/09/2017

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:
PCMetrics unterstützt die laufende Überwachung des Asset Managers sowie die Beurteilung der Anlageresultate.

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

Betriebsaufwandquote TER KGAST

ex ante: 0.24%

ex post per: 30/09/2023 0.24%

Performance in Referenzwährung

	Kumulierte Performance				Annualisierte Performance			
	YTD	1 Monat	3 Monate	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Aufl.
Anlagegruppe	1.15%	0.69%	1.54%	2.54%	-1.10%	-0.28%	-	-0.39%

Statistische Angaben (annualisiert)

	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Aufl.
Volatilität Anlagegruppe (in %)	2.02	2.60	2.63	-	2.29
Sharpe Ratio	0.46	-0.66	-0.14	-	-0.10
Maximum Drawdown (in %)	-1.02	-7.68	-8.39	-	-8.39
Recovery Period (Jahre)	0.09	-	-	-	-

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

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 Emerging Markets Short Term PM (CHF hedged)

Portfoliostruktur nach Branchen

	Anlagegruppe
Finanzwesen	33.68%
Staatlich und staatsnah	18.20%
Energie	7.86%
Kommunikation	6.72%
Grundstoffe	6.40%
Nicht-Basiskonsumgüter	6.34%
Basiskonsumgüter	6.13%
Versorgungsbetriebe	4.18%
Andere	6.00%
Liquidität	4.61%
Währungsabsicherung	-0.11%

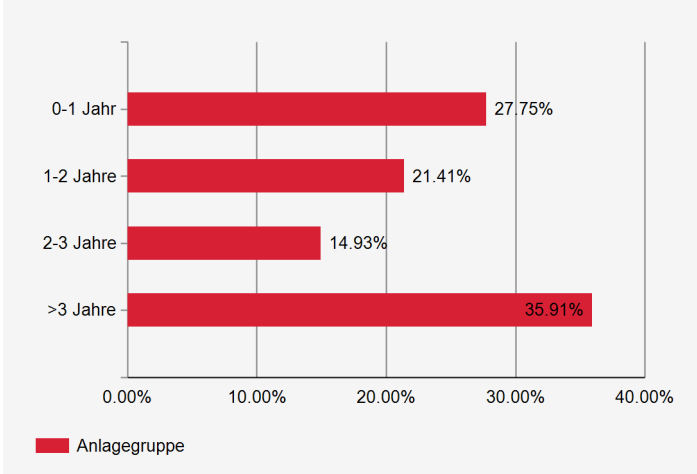
Grösste Schuldner und Rating

		Anlagegruppe
HDFC Bank Ltd	BBB-	3.14%
First Abu Dhabi Bank PJSC	AA-	3.05%
United Mexican States	BBB	3.04%
OTP Bank Nyrt	BBB-	2.70%
US Treasury N/B	AAA	2.45%

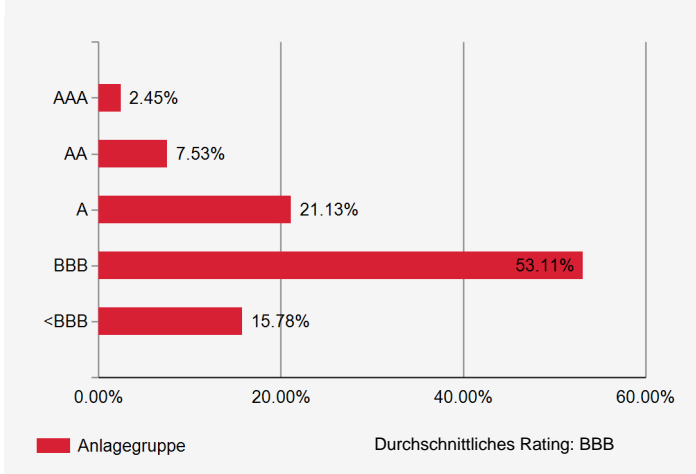
Weitere Angaben zu den Schuldnern

Anzahl Schuldner	90
------------------	----

Fälligkeitstruktur der Anlagen



Anlagen nach Rating



Duration und Rendite auf Verfall

	Anlagegruppe
Modified Duration*	2.1
Theoretische Rendite auf Verfall*	5.59%

* Vor Währungsabsicherung, unter Berücksichtigung der Derivate

Portfolio nach Währungen und Duration

	Anlagegruppe	
	Gewichtung	Duration
CHF	100.11%	0.12
EUR	0.02%	356.95
USD	-0.13%	-1497.27

Portfoliostruktur nach Ländern/Regionen

	Anlagegruppe
Indien	9.73%
China	9.16%
Vereinigte Arabische Emirate	8.53%
Mexiko	6.11%
Indonesien	6.07%
Ungarn	4.60%
Chile	4.25%
Schwellenländer Asien Pazifik	12.98%
Schwellenländer Lateinamerika	9.70%
Schwellenländer im mittleren Osten	6.59%
Andere	17.78%
Liquidität, Absicherung	4.50%