

# Anlagestiftung Swiss Life

## Obligationen Global Aggregate PM (CHF hedged)

**Nettovermögen (NAV) in Mio. CHF: 69.06**  
**Nettovermögen pro Anspruch in CHF: 116.14**

### Anlagestrategie

Anlagen in 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). Forderungspapiere benchmarkfremder Schuldner: max.10%.  
 Durchschnittliche Ratingqualität: mindestens A-. Fremdwährungsrisiken werden zu mindestens 90% gegen Schweizerfranken abgesichert. Umsetzung mittels Einsatz Swiss Life iFunds (CH) Bond Global Aggregate (CHF hedged); Anlagefonds schweizerischen Rechts der Kategorie "Übrige Fonds für traditionelle Anlagen".

### Wertentwicklung in Referenzwährung (Basis 100)



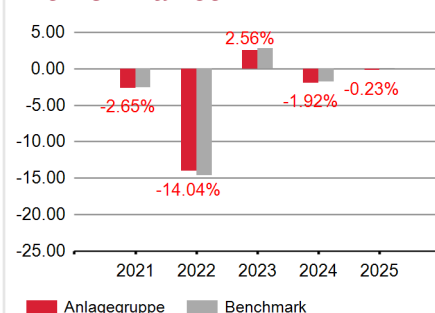
### Performance in Referenzwährung

	Kumulierte Performance				Annualisierte Performance			
	YTD	1 Monat	3 Monate	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Aufl.
Anlagegruppe	-1.17%	0.41%	-2.28%	-1.04%	-0.64%	-3.12%	-0.90%	0.79%
Benchmark	-1.20%	0.35%	-2.27%	-1.13%	-0.51%	-3.10%	-1.03%	0.58%

### Statistische Angaben (annualisiert)

	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Aufl.
Volatilität Anlagegruppe (in %)	3.39	4.39	5.03	4.32	5.47
Volatilität Benchmark (in %)	3.22	4.24	5.17	4.38	5.46
Tracking Error ex post (in %)	0.22	0.33	0.50	0.48	1.32
Information Ratio	0.41	-0.40	-0.03	0.28	0.16
Sharpe Ratio	-0.30	-0.33	-0.72	-0.17	0.14
Korrelation	1.00	1.00	1.00	0.99	0.97
Beta	1.05	1.03	0.97	0.98	0.98
Jensen-Alpha	0.15	-0.09	-0.13	0.12	0.23
Maximum Drawdown (in %)	-4.00	-6.02	-18.95	-19.52	-19.52
Recovery Period (Jahre)	-	-	-	-	-

### Performance



### Produktinformationen

**Valorennummer:** 3026055  
**ISIN:** CH0030260555  
**LEI:** 254900F82G5L48XPDV74  
**Bloomberg-Code:** SLOFGPM SW  
**Benchmark:** BLOOMBERG GLO AGG EX SEC EX CNY HEDGED CHF  
**Währung:** CHF  
**Domizil:** Schweiz  
**Aufgatedatum:** 31/05/2007  
**Erstausgabepreis:** 100.00  
**Jahresabschluss:** 30.09  
**Ausgabe/Rücknahme:** Täglich  
**Annahmeschluss:** 13:00 Uhr  
**Verwässerungsschutz:** Ausgabe- / Rücknahmekommission zugunsten der Anlagegruppe gemäss Konditionenübersicht.  
**Asset Management:** Swiss Life Asset Management AG  
**Überwachung Asset Manager:** Überwachung der Anlageresultate des eingesetzten Vermögensverwalters durch PPCmetrics  
**Kurspublikationen:** Bloomberg: ASSL  
[www.swisslife.ch/anlagestiftung](http://www.swisslife.ch/anlagestiftung)  
**Betriebsaufwandquote TER KGAST ex ante:** 0.15%  
**ex post per:** 30/09/2025 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.

**Betriebsaufwandquote TER KGAST:** Die Betriebsaufwandquote TER KGAST deckt sämtliche Kosten mit Ausnahme der Transaktionskosten und der transaktionsbezogenen steuerlichen Abgaben ab.

**Verwässerungsschutz:** Konditionenübersicht abrufbar unter: [www.swisslife.ch/anlagestiftung](http://www.swisslife.ch/anlagestiftung), «Rechtliche Dokumente» (Änderungen jederzeit ohne Vorankündigung möglich).

**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 Aggregate PM (CHF hedged)

### Portfoliostruktur nach Branchen

	Anlagegruppe	Benchmark
Staatlich und staatsnah	45.14%	72.49%
Finanzwesen	24.36%	11.47%
Basiskonsumgüter	7.08%	3.90%
Kommunikation	5.65%	2.09%
Technologie	2.58%	1.17%
Nicht-Basiskonsumgüter	2.47%	1.68%
Versorgungsbetriebe	1.92%	2.89%
Energie	1.62%	1.67%
Supranational	5.92%	-
Andere	1.52%	2.63%
Liquidität	1.71%	-
Währungsabsicherung	0.02%	-

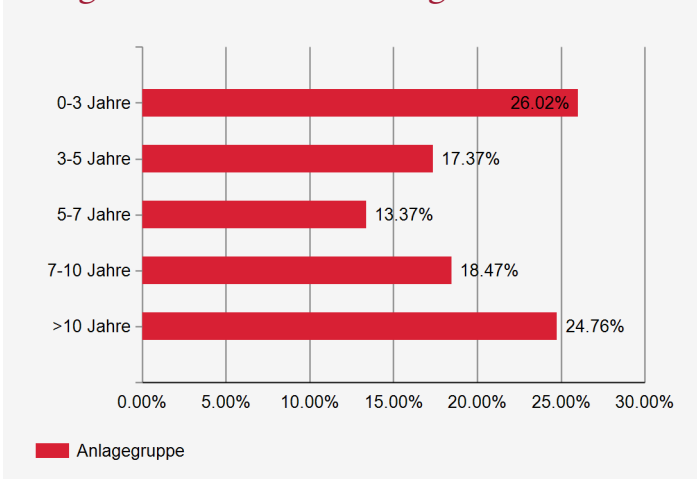
### Grösste Schuldner und Rating

	Rating	Anlagegruppe
Japan	A+	9.39%
Italien	BBB+	5.73%
US Treasury N/B	AA+	4.78%
Spanien	A+	3.41%
Frankreich	A+	3.29%

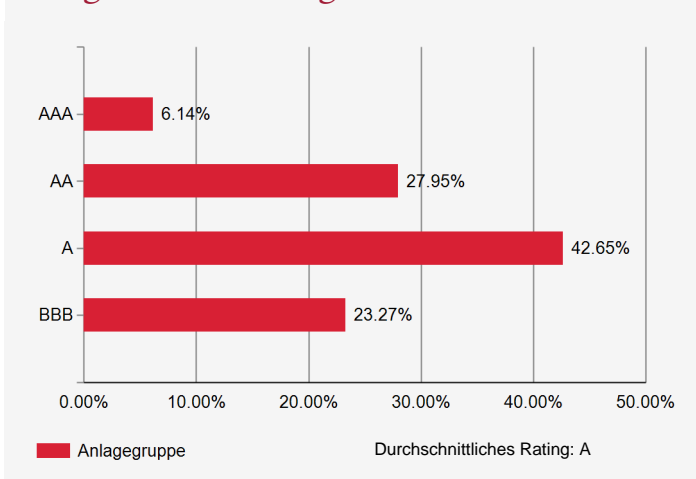
### Weitere Angaben zu den Schuldnern

Anzahl Schuldner	118
Anteil Benchmarkfremde Schuldner	0.00%

### Fälligkeitstruktur der Anlagen



### Anlagen nach Rating



### Duration und Rendite auf Verfall

	Anlagegruppe	Benchmark
Modified Duration	6.6	6.4
Theoretische Rendite auf Verfall*	3.64%	3.94%

\* vor Währungsabsicherung

### Portfoliostruktur nach Ländern/Regionen

	Anlagegruppe	Benchmark
Vereinigte Staaten	27.24%	38.64%
Japan	12.53%	10.59%
Kanada	10.26%	4.65%
Italien	7.16%	4.12%
Vereinigtes Königreich	7.08%	5.55%
Frankreich	5.63%	6.29%
Spanien	5.22%	2.96%
Europäische Region (EUR)	10.65%	12.46%
Europäische Region (Ex EUR)	4.28%	1.37%
Schwellenländer Lateinamerika	4.17%	0.86%
Andere	4.05%	12.50%
Liquidität, Absicherung	1.74%	-