

Anlagestiftung Swiss Life

Obligationen Global Staaten+ PM (CHF hedged)

Nettovermögen (NAV) in Mio. CHF: 843.35
Nettovermögen pro Anspruch in CHF: 109.87

Anlagestrategie

Anlagen in Forderungspapiere von Staaten und staatsnahen Institutionen. 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 des Swiss Life iFunds (CH) Bond Global Government+ (CHF hedged); Anlagefonds schweizerischen Rechts der Kategorie "Übrige Fonds für traditionelle Anlagen".

Wertentwicklung in Referenzwährung (Basis 100)



Performance in Referenzwährung

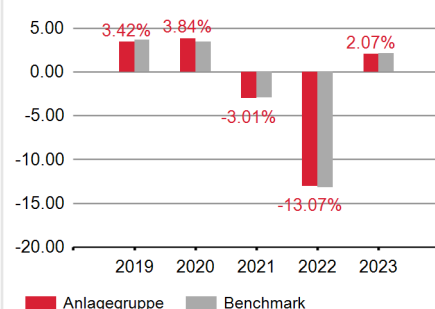
	Kumulierte Performance				Annualisierte Performance			
	YTD	1 Monat	3 Monate	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Aufl.
Anlagegruppe	-1.42%	-1.96%	-0.65%	3.92%	-4.28%	-2.75%	-0.63%	0.68%
Benchmark	-1.09%	-1.64%	-0.26%	3.99%	-4.22%	-2.76%	-0.64%	0.46%

Statistische Angaben (annualisiert)

	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Aufl.
Volatilität Anlagegruppe (in %)	5.29	5.13	4.39	3.75	3.60
Volatilität Benchmark (in %)	4.89	5.21	4.43	3.82	3.55
Tracking Error ex post (in %)	0.49	0.58	0.62	0.60	0.70
Information Ratio	-0.14	-0.09	0.03	0.03	0.31
Sharpe Ratio	0.46	-1.00	-0.68	-0.09	0.25
Korrelation	1.00	0.99	0.99	0.99	0.98
Beta	1.08	0.98	0.98	0.97	0.99
Jensen-Alpha	-0.28	-0.16	-0.04	0.00	0.22
Maximum Drawdown (in %)	-3.60	-17.01	-19.23	-19.23	-19.23
Recovery Period (Jahre)	0.28	-	-	-	-

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.
Verwässerungsschutz: Konditionenübersicht abrufbar unter: 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.

Performance



Produktinformationen

Valorennummer: 11956107
ISIN: CH0119561071
LEI: 254900H7WEVS3K9ANR90
Bloomberg-Code: SWLGS PM SW
Benchmark: BLOOMBERG GLOBAL AGG TREAS EX CHF TR HEDGED CHF
Währung: CHF
Domizil: Schweiz
Aufliedatum: 14/12/2010
Erstausgabepreis: 100.00
Jahresabschluss: 30.09
Ausgabe/Rücknahme: Täglich
Annahmeschluss: 13.00 Uhr
Verwässerungsschutz: Ausgabe- / Rücknahmekommission zugunsten der Anlagegruppe gemäss Konditionenübersicht.

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: 30/09/2024 0.15%

Anlagestiftung Swiss Life

Obligationen Global Staaten+ PM (CHF hedged)

Portfoliostruktur nach Branchen

	Anlagegruppe	Benchmark
Staatlich und staatsnah	76.43%	100.00%
Finanzwesen	6.71%	-
Pfandbriefinstitute	3.67%	-
Industrie	0.09%	-
Supranational	4.27%	-
Liquidität	9.24%	-
Währungsabsicherung	-0.40%	-

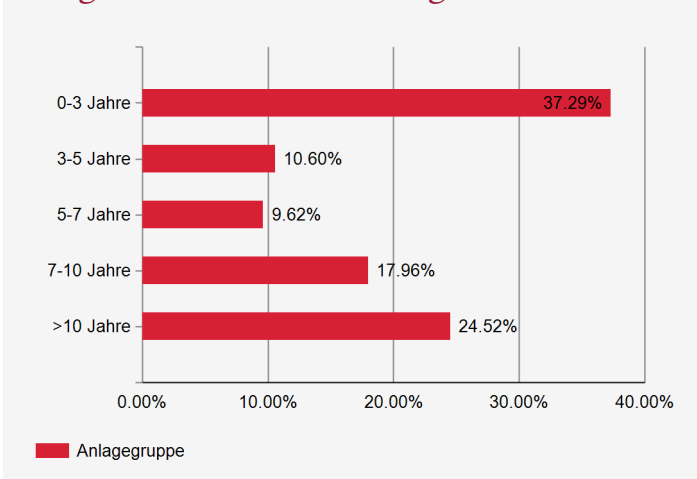
Grösste Schuldner und Rating

		Anlagegruppe
Japan	A+	21.50%
US Treasury N/B	AAA	14.69%
Italien	BBB-	5.80%
People's Republic of China	A+	5.56%
Spanien	A-	4.59%

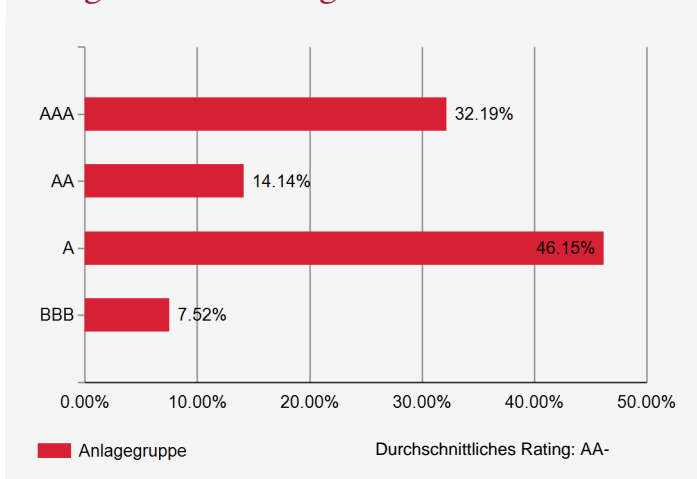
Weitere Angaben zu den Schuldnern

Anzahl Schuldner	65
Anteil Benchmarkfremde Schuldner	3.38%

Fälligkeitstruktur der Anlagen



Anlagen nach Rating



Duration und Rendite auf Verfall

	Anlagegruppe	Benchmark
Modified Duration*	7.5	7.2
Theoretische Rendite auf Verfall*	3.30%	3.17%

* Vor Währungsabsicherung, unter Berücksichtigung der Derivate

Portfolio nach Währungen und Duration

	Anlagegruppe		Benchmark	
	Gewichtung	Duration	Gewichtung	Duration
JPY	30.87%	5.00	17.20%	8.96
EUR	22.09%	9.94	23.19%	7.09
USD	17.84%	13.08	34.11%	5.83
GBP	9.16%	9.06	5.29%	8.91
Andere	20.04%	6.87	20.21%	7.08

Portfoliostruktur nach Ländern/Regionen

	Anlagegruppe	Benchmark
Japan	24.05%	17.20%
Vereinigte Staaten	16.30%	34.11%
Italien	6.43%	5.05%
China	6.16%	10.02%
Spanien	5.24%	3.29%
Vereinigtes Königreich	4.86%	5.29%
Deutschland	3.71%	4.35%
Europäische Region (EUR)	10.99%	9.73%
Europäische Region (Ex EUR)	5.03%	0.45%
Asien-Pazifik-Raum	1.81%	1.29%
Andere	6.57%	9.22%
Liquidität, Absicherung	8.84%	-