

# Anlagestiftung Swiss Life

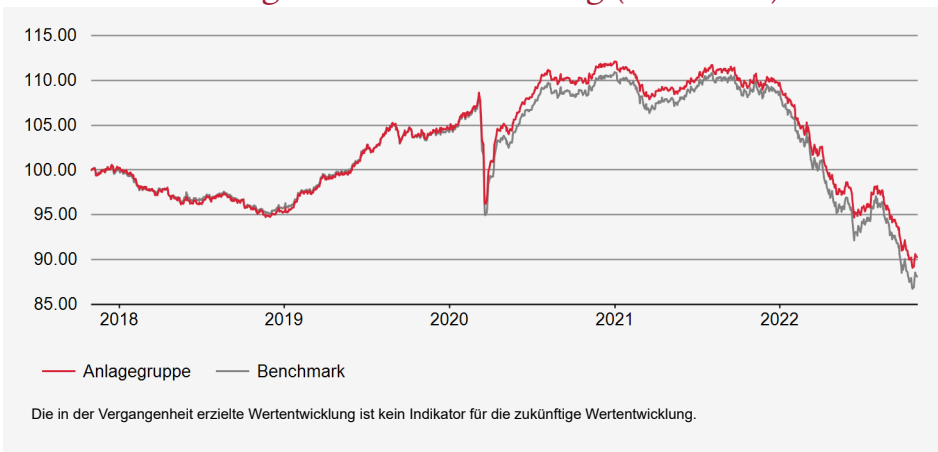
## Obligationen Global Unternehmen PM (CHF hedged)

**Nettovermögen (NAV) in Mio. CHF: 645.43**  
**Nettovermögen pro Anspruch in CHF: 118.60**

### Anlagestrategie

Anlagen in auf Fremdwährungen lautende Forderungspapiere von Unternehmen inklusive Agencies und Supranationals. Aktive Titelselektion, Durationsteuerung und Zinskurvenpositionierung. Schuldnerbegrenzung: 10%. Benchmarkfremde 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 (CHF hedged); Anlagenfonds schweizerischen Rechts der Kategorie "Übrige Fonds für traditionelle Anlagen".

### Wertentwicklung in Referenzwährung (Basis 100)



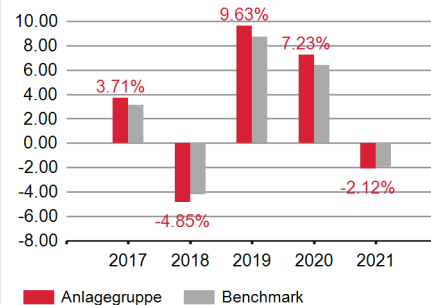
### Performance in Referenzwährung

	KUMULIERTE PERFORMANCE				ANNUALISIERTE PERFORMANCE			
	YTD	1 MONAT	3 MONATE	1 JAHR	3 JAHRE	5 JAHRE	10 JAHRE	AUFL.
ANLAGEGRUPPE	-17.73%	-0.93%	-8.01%	-17.81%	-4.75%	-2.02%	0.32%	1.44%
BENCHMARK	-18.97%	-0.87%	-8.80%	-19.06%	-5.47%	-2.50%	-0.05%	0.92%

### Statistische Angaben (annualisiert)

	1 JAHR	3 JAHRE	5 JAHRE	10 JAHRE	AUFL.
Volatilität Anlagegruppe (in %)	7.11	7.28	6.10	5.04	5.05
Volatilität Benchmark (in %)	-	8.00	6.58	5.25	5.11
Tracking Error ex post (in %)	1.03	0.93	0.83	0.87	0.96
Information Ratio	1.22	0.78	0.57	0.42	0.54
Sharpe Ratio	-2.70	-0.59	-0.22	0.17	0.38
Korrelation	1.00	1.00	0.99	0.99	0.98
Beta	0.89	0.91	0.92	0.95	0.97
Jensen-Alpha	-0.74	0.27	0.33	0.39	0.56
Maximum Drawdown (in %)	-19.55	-20.52	-20.52	-20.52	-20.52
Recovery Period (Jahre)	-	-	-	-	-

### Performance



### Produktinformationen

**Valorennummer:** 11956108

**ISIN:** CH0119561089

**LEI:** 254900C3B00LU0UJ428

**Bloomberg-Code:** SWLGUPM SW

**Benchmark:** BLOOMBERG GLO AGG  
CORP IND HEDGED CHF

**Währung:** CHF

**Domizil:** Schweiz

**Aufgagedatum:** 14/12/2010

**Ausgabepreis:** 100.00

**Jahresabschluss:** 30.09

**Ausgabe/Rücknahme:** Täglich

**Annaheschluss:** 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](http://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.

**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 Unternehmen PM (CHF hedged)

### Portfoliostruktur nach Branchen

	Anlagegruppe	Benchmark
FINANZWESEN	44.31%	39.49%
BASISKONSUMGÜTER	19.28%	15.58%
VERSORGUNGSBETRIEBE	7.69%	8.40%
INDUSTRIE	6.96%	7.07%
NICHT-BASISKONSUMGÜTER	6.31%	6.97%
ENERGIE	6.10%	5.88%
KOMMUNIKATION	3.80%	8.36%
TECHNOLOGIE	3.38%	5.15%
ANDERE	0.98%	3.13%
LIQUIDITÄT	1.41%	-
WÄHRUNGSABSICHERUNG	-0.22%	-

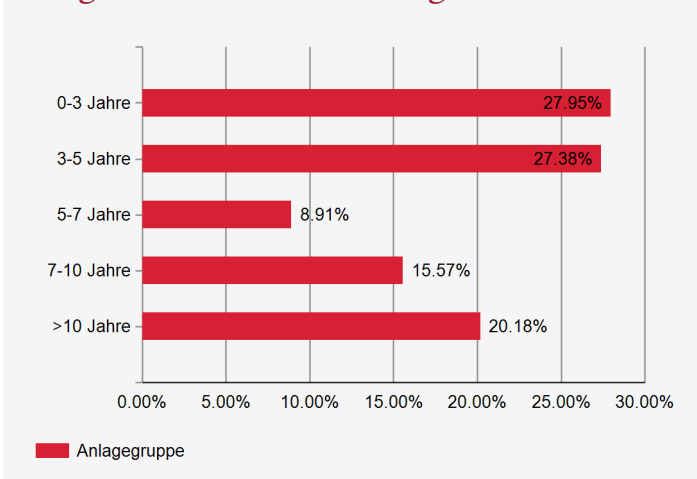
### Grösste Schuldner und Rating

		Anlagegruppe
British American Tobacco PLC	BBB	2.17%
Hyundai Motor Co	BBB+	1.98%
JPMorgan Chase & Co	A-	1.96%
Banco Santander SA, Madrid	BBB	1.94%
Blackstone Inc	BBB	1.86%

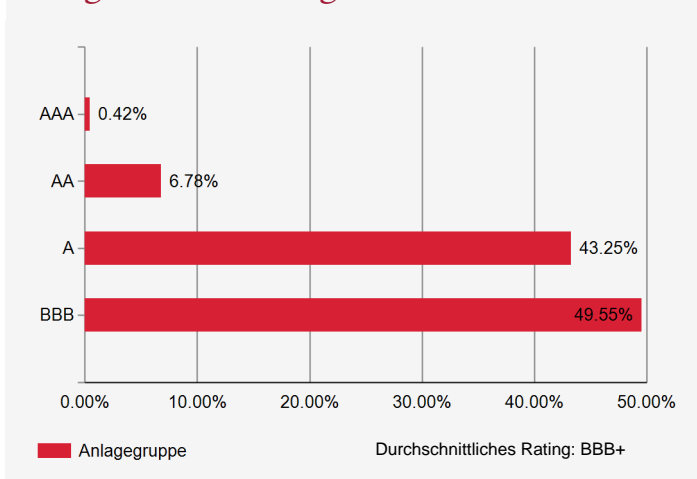
### Weitere Angaben zu den Schuldnern

Anzahl Schuldner	190
Anteil Nicht-Benchmark-Schuldner	3.90%

### Fälligkeitstruktur der Anlagen



### Anlagen nach Rating



### Duration und Rendite auf Verfall

	Anlagegruppe	Benchmark
Modified Duration*	5.8	6.1
Theoretische Rendite auf Verfall*	5.64%	5.65%

\* Vor Währungsabsicherung, unter Berücksichtigung der Derivate

### Portfolio nach Währungen und Duration

	Anlagegruppe		Benchmark	
	Gewichtung	Duration	Gewichtung	Duration
USD	67.09%	6.74	68.81%	6.75
EUR	25.92%	4.01	22.18%	5.05
GBP	3.89%	3.23	3.96%	6.94
JPY	0.33%	2.44	0.79%	4.51
Andere	2.77%	2.10	4.30%	5.30

### Portfoliostruktur nach Ländern/Regionen

	Anlagegruppe	Benchmark
VEREINIGTE STAATEN	42.05%	55.43%
VEREINIGTES KÖNIGREICH	7.54%	7.24%
FRANKREICH	7.13%	6.02%
JAPAN	6.52%	3.49%
DEUTSCHLAND	4.08%	4.42%
KANADA	3.85%	5.44%
SPANIEN	3.38%	1.98%
EUROPÄISCHE REGION (EUR)	8.92%	5.74%
EUROPÄISCHE REGION (EX EUR)	8.68%	2.95%
SCHWELLENLÄNDER ASIEN PAZIFIK	4.10%	1.08%
ANDERE	2.57%	6.22%
LIQUIDITÄT, ABSICHERUNG	1.19%	-