

Anlagestiftung Swiss Life

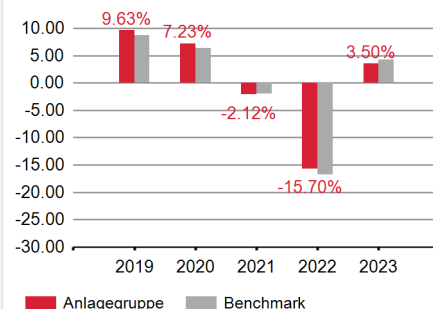
Obligationen Global Unternehmen PM (CHF hedged)

Nettovermögen (NAV) in Mio. CHF: 793.54
Nettovermögen pro Anspruch in CHF: 126.63

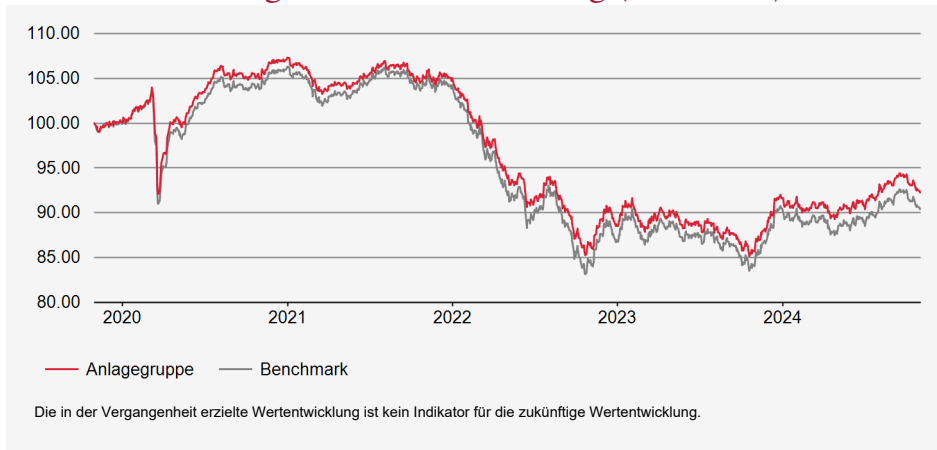
Anlagestrategie

Anlagen in Forderungspapiere von Unternehmen inklusive Agencies und Supranationals. Aktive Titelselektion, Durationsteuerung und Zinskurvenpositionierung. Schuldnerbegrenzung: 10%. Forderungspapiere benchmarkfremder 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".

Performance



Wertentwicklung in Referenzwährung (Basis 100)



Produktinformationen

Valorennummer: 11956108
ISIN: CH0119561089
LEI: 254900C3B00LU0UJ428
Bloomberg-Code: SWLGUPM SW
Benchmark: BLOOMBERG GLO AGG CORP IND HEDGED CHF
Währung: CHF
Domizil: Schweiz
Aufledgedatum: 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%

Performance in Referenzwährung

	Kumulierte Performance				Annualisierte Performance			
	YTD	1 Monat	3 Monate	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Aufl.
Anlagegruppe	0.68%	-1.86%	-0.12%	7.64%	-4.25%	-1.60%	0.28%	1.71%
Benchmark	-0.08%	-2.05%	-0.04%	7.55%	-4.65%	-2.00%	0.01%	1.28%

Statistische Angaben (annualisiert)

	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Aufl.
Volatilität Anlagegruppe (in %)	6.01	7.05	6.85	5.43	5.19
Volatilität Benchmark (in %)	6.77	7.89	7.61	5.86	5.38
Tracking Error ex post (in %)	0.84	1.01	0.95	0.87	0.96
Information Ratio	0.11	0.40	0.42	0.31	0.45
Sharpe Ratio	0.99	-0.72	-0.26	0.10	0.37
Korrelation	1.00	1.00	1.00	0.99	0.98
Beta	0.88	0.89	0.90	0.92	0.95
Jensen-Alpha	0.80	-0.19	0.17	0.29	0.51
Maximum Drawdown (in %)	-2.93	-19.66	-20.63	-20.63	-20.63
Recovery Period (Jahre)	0.22	-	-	-	-

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.

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.

Anlagestiftung Swiss Life

Obligationen Global Unternehmen PM (CHF hedged)

Portfoliostruktur nach Branchen

	Anlagegruppe	Benchmark
Finanzwesen	48.17%	38.39%
Basiskonsumgüter	12.58%	16.27%
Energie	7.39%	6.05%
Versorgungsbetriebe	6.31%	9.00%
Industrie	6.14%	7.17%
Kommunikation	5.57%	7.87%
Nicht-Basiskonsumgüter	4.86%	7.59%
Technologie	4.75%	4.76%
Andere	2.04%	2.89%
Liquidität	3.40%	-
Währungsabsicherung	-1.21%	-

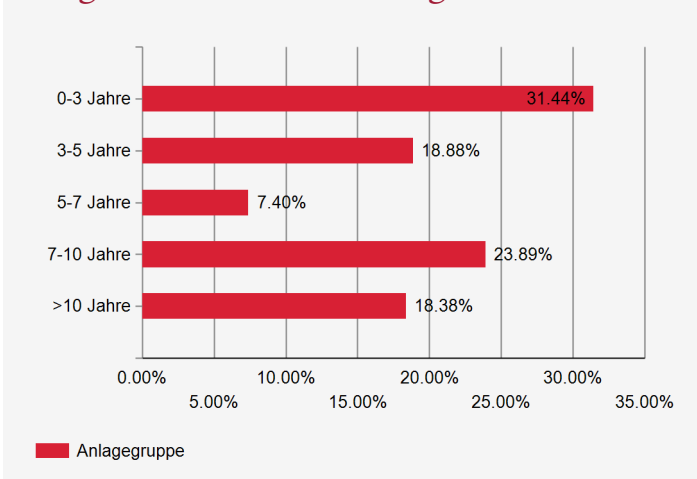
Grösste Schuldner und Rating

	Rating	Anlagegruppe
JPMorgan Chase & Co	A-	2.16%
Banco Santander SA, Madrid	BBB+	2.09%
Porsche Automobil Holding SE	BBB	2.08%
Groupe BPCE	BBB+	1.76%
Credit Agricole Group	BBB+	1.76%

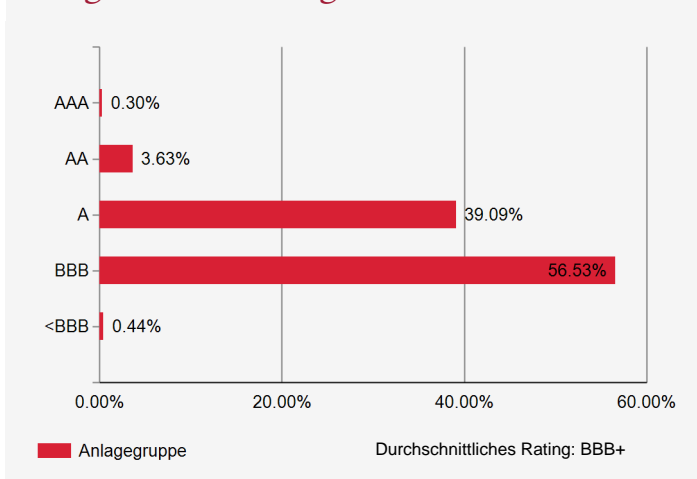
Weitere Angaben zu den Schuldnern

Anzahl Schuldner	229
Anteil Benchmarkfremde Schuldner	4.25%

Fälligkeitstruktur der Anlagen



Anlagen nach Rating



Duration und Rendite auf Verfall

	Anlagegruppe	Benchmark
Modified Duration*	6.1	6.0
Theoretische Rendite auf Verfall*	5.00%	4.96%

* Vor Währungsabsicherung, unter Berücksichtigung der Derivate

Portfolio nach Währungen und Duration

	Anlagegruppe		Benchmark	
	Gewichtung	Duration	Gewichtung	Duration
USD	55.40%	8.34	67.44%	6.58
EUR	29.54%	3.34	23.74%	4.44
CHF	5.76%	2.19	0.37%	4.34
JPY	3.01%	2.15	0.69%	4.08
Andere	6.28%	4.00	7.77%	5.60

Portfoliostruktur nach Ländern/Regionen

	Anlagegruppe	Benchmark
Vereinigte Staaten	37.86%	56.22%
Frankreich	9.64%	6.17%
Vereinigtes Königreich	9.22%	6.85%
Deutschland	5.21%	5.02%
Japan	4.54%	3.38%
Spanien	4.34%	2.24%
Schweiz	4.08%	1.49%
Europäische Region (EUR)	9.49%	5.81%
Asien-Pazifik-Raum	3.32%	2.24%
Europäische Region (Ex EUR)	3.12%	1.58%
Andere	7.00%	9.01%
Liquidität, Absicherung	2.19%	-