

Anlagestiftung Swiss Life

Obligationen CHF Ausland PM

Nettovermögen (NAV) in Mio. CHF: 303.78
Nettovermögen pro Anspruch in CHF: 136.81

Anlagestrategie

Anlagen in auf CHF lautende Forderungspapiere von Schuldern, die vorwiegend im Ausland domiziliert sind. Aktive Titelselektion, Durationsteuerung und Zinskurvenpositionierung. Schuldnerbegrenzung: 10%. Forderungspapiere benchmarkfremder Schuldner: max. 20%. Durchschnittliche Ratingqualität: mindestens A. Umsetzung mittels Einsatz des Swiss Life iFunds (CH) Bond Swiss Francs Foreign (CHF); Anlagefonds schweizerischen Rechts der Kategorie "Übrige Fonds für traditionelle Anlagen".

Wertentwicklung in Referenzwährung (Basis 100)



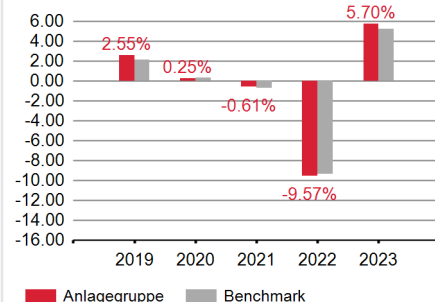
Performance in Referenzwährung

	Kumulierte Performance				Annualisierte Performance			
	YTD	1 Monat	3 Monate	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Aufl.
Anlagegruppe	3.99%	0.30%	1.26%	5.81%	-0.05%	-0.19%	0.51%	1.81%
Benchmark	3.76%	0.27%	1.23%	5.61%	-0.21%	-0.32%	0.37%	1.69%

Statistische Angaben (annualisiert)

	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Aufl.
Volatilität Anlagegruppe (in %)	1.94	3.90	4.46	3.40	3.46
Volatilität Benchmark (in %)	1.99	3.87	4.25	3.26	3.24
Tracking Error ex post (in %)	0.12	0.25	0.35	0.32	0.95
Information Ratio	1.71	0.62	0.37	0.43	0.14
Sharpe Ratio	2.17	-0.20	-0.08	0.23	0.51
Korrelation	1.00	1.00	1.00	1.00	0.96
Beta	0.98	1.00	1.05	1.04	1.03
Jensen-Alpha	0.30	0.16	0.15	0.11	0.08
Maximum Drawdown (in %)	-0.97	-12.02	-13.18	-13.71	-13.71
Recovery Period (Jahre)	0.15	-	-	-	-

Performance



Produktinformationen

Valorennummer: 3026054
ISIN: CH0030260548
LEI: 2549002XPEQH1AZYBW05
Bloomberg-Code: SLOCAPM SW
Benchmark: SBI Foreign AAA - BBB TR
Währung: CHF
Domizil: Schweiz
Aufledgedatum: 31/05/2007
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: 0.08%
ex post per: 30/09/2024 0.08%

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 CHF Ausland PM

Portfoliostruktur nach Branchen

	Anlagegruppe	Benchmark
Finanzwesen	65.28%	48.74%
Staatlich und staatsnah	7.63%	15.14%
Pfandbriefinstitute	6.49%	16.41%
Nicht-Basiskonsumgüter	4.15%	3.46%
Versorgungsbetriebe	3.71%	2.98%
Industrie	3.10%	5.27%
Basiskonsumgüter	2.80%	4.01%
Energie	1.06%	1.22%
Supranational	4.70%	-
Andere	1.42%	2.76%
Liquidität	-0.33%	-

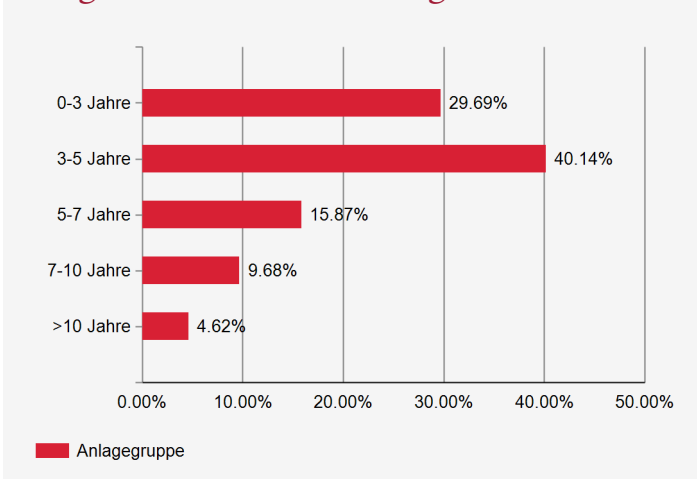
Grösste Schuldner und Rating

	Rating	Anlagegruppe
Banco Santander SA, Madrid	A+	4.37%
Müchener Hypothekenbank	AA	4.05%
Bank of Nova Scotia/The	AA	3.97%
Groupe BPCE	AA-	3.85%
Credit Agricole Group	AA-	3.29%

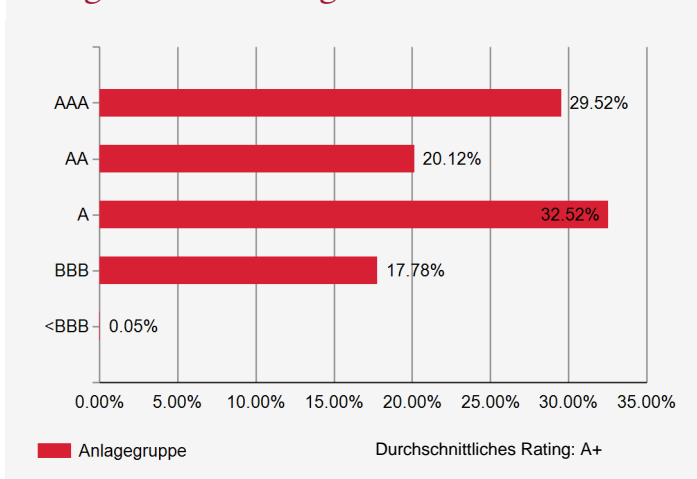
Weitere Angaben zu den Schuldnern

Anzahl Schuldner	115
Anteil Benchmarkfremde Schuldner	2.63%

Fälligkeitstruktur der Anlagen



Anlagen nach Rating



Duration und Rendite auf Verfall

	Anlagegruppe	Benchmark
Modified Duration*	4.2	4.2
Theoretische Rendite auf Verfall*	1.10%	1.00%

* Vor Währungsabsicherung, unter Berücksichtigung der Derivate

Portfoliostruktur nach Ländern/Regionen

	Anlagegruppe	Benchmark
Frankreich	16.18%	16.87%
Deutschland	15.59%	13.66%
Kanada	12.60%	12.00%
Vereinigte Staaten	9.89%	12.21%
Australien	6.05%	6.39%
Spanien	5.94%	4.62%
Vereinigtes Königreich	4.68%	4.43%
Europäische Region (Ex EUR)	8.48%	6.62%
Schwellenländer Asien Pazifik	5.43%	2.85%
Europäische Region (EUR)	5.42%	9.54%
Andere	10.07%	10.80%
Liquidität, Absicherung	-0.33%	-