

# Anlagestiftung Swiss Life

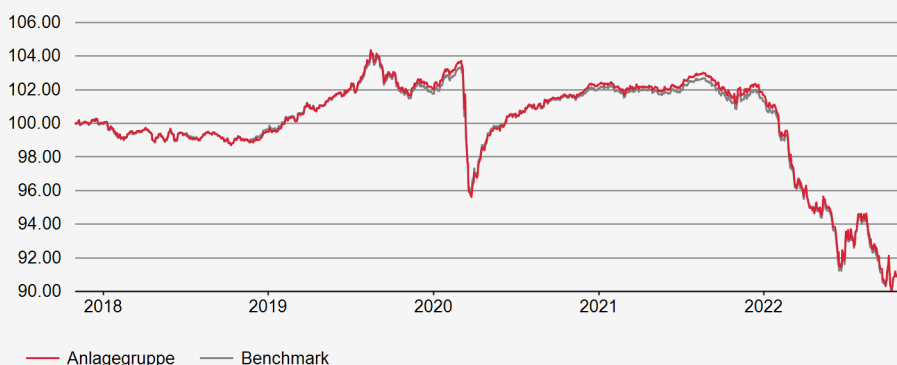
## Obligationen CHF Ausland PM

**Nettovermögen (NAV) in Mio. CHF: 316.65**  
**Nettovermögen pro Anspruch in CHF: 124.28**

### Anlagestrategie

Anlagen in auf CHF lautende Forderungspapiere von Schuldern, die vorwiegend im Ausland domiziliert sind. Aktive Titelselektion, Durationsteuerung und Zinskurvenpositionierung. Schuldnerbegrenzung: 10%. Benchmarkfremde 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)



Die in der Vergangenheit erzielte Wertentwicklung ist kein Indikator für die zukünftige Wertentwicklung.

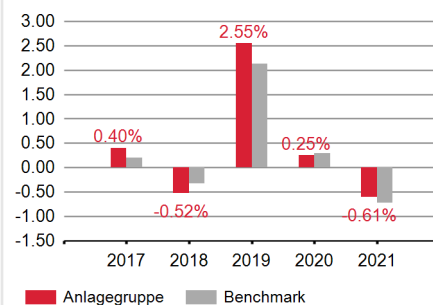
### Performance in Referenzwährung

	KUMULIERTE PERFORMANCE				ANNUALISIERTE PERFORMANCE			
	YTD	1 MONAT	3 MONATE	1 JAHR	3 JAHRE	5 JAHRE	10 JAHRE	AUFL.
<b>ANLAGEGRUPPE</b>	-9.70%	0.78%	-2.94%	-9.30%	-3.46%	-1.69%	0.04%	1.42%
<b>BENCHMARK</b>	-9.48%	0.72%	-2.88%	-9.08%	-3.44%	-1.71%	-0.10%	1.32%

### Statistische Angaben (annualisiert)

	1 JAHR	3 JAHRE	5 JAHRE	10 JAHRE	AUFL.
Volatilität Anlagegruppe (in %)	4.70	5.19	4.22	3.27	3.55
Volatilität Benchmark (in %)	-	4.89	4.00	3.12	3.31
Tracking Error ex post (in %)	0.38	0.43	0.35	0.37	1.01
Information Ratio	-0.57	-0.04	0.05	0.38	0.10
Sharpe Ratio	-1.98	-0.57	-0.24	0.19	0.44
Korrelation	1.00	1.00	1.00	0.99	0.96
Beta	1.00	1.06	1.05	1.04	1.03
Jensen-Alpha	-0.23	0.15	0.07	0.12	0.05
Maximum Drawdown (in %)	-12.02	-13.18	-13.71	-13.71	-13.71
Recovery Period (Jahre)	-	-	-	-	-

### Performance



### Produktinformationen

**Valorennummer:** 3026054  
**ISIN:** CH0030260548  
**LEI:** 2549002XPEQH1AZYBW05  
**Bloomberg-Code:** SLOCAPM SW  
**Benchmark:** SBI Foreign AAA - BBB TR  
**Währung:** CHF  
**Domizil:** Schweiz  
**Aufgagedatum:** 31/05/2007  
**Ausgabepreis:** 100.00  
**Jahresabschluss:** 30.09  
**Ausgabe/Rücknahme:** Täglich  
**Annahmeschluss:** 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:** 0.08%  
**ex post per:** 30/09/2022 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.

**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.

### Portfoliostruktur nach Branchen

	Anlagegruppe	Benchmark
FINANZWESEN	59.93%	48.81%
PFANDBRIEFINSTITUTE	10.54%	12.29%
STAATLICH UND STAATSNÄH	4.74%	17.22%
ENERGIE	3.61%	3.20%
BASISKONSUMGÜTER	3.31%	4.57%
KOMMUNIKATION	3.10%	2.78%
INDUSTRIE	2.25%	5.23%
VERSORGBETRIEBE	1.88%	1.98%
SUPRANATIONAL	7.27%	-
ANDERE	2.37%	3.91%
LIQUIDITÄT	0.98%	-

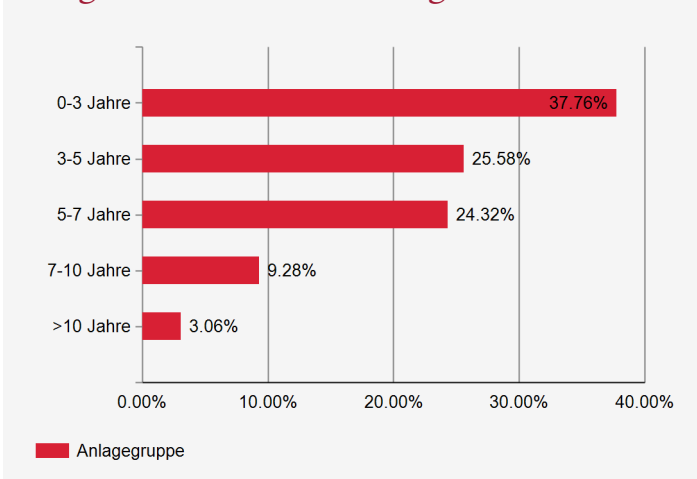
### Grösste Schuldner und Rating

	Rating	Anlagegruppe
Müchener Hypothekenbank	AA-	3.75%
Credit Agricole Group	AA-	3.32%
Pfandbriefbank	AAA	2.90%
Pfandbriefzentrale	AAA	2.65%
Commonwealth Bank of Australia	AA	2.57%

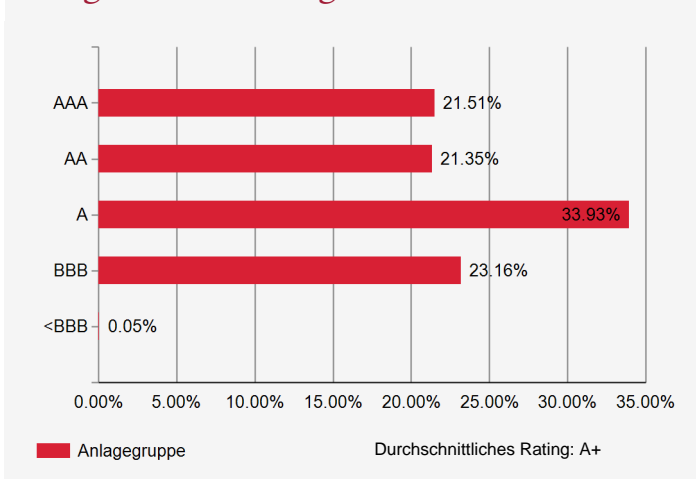
### Weitere Angaben zu den Schuldnern

Anzahl Schuldner	121
Anteil Nicht-Benchmark-Schuldner	9.65%

### Fälligkeitstruktur der Anlagen



### Anlagen nach Rating



### Duration und Rendite auf Verfall

	Anlagegruppe	Benchmark
Modified Duration*	4.4	4.3
Theoretische Rendite auf Verfall*	2.41%	2.24%

\* Vor Währungsabsicherung, unter Berücksichtigung der Derivate

### Portfoliostruktur nach Ländern/Regionen

	Anlagegruppe	Benchmark
VEREINIGTE STAATEN	16.87%	16.04%
FRANKREICH	13.19%	14.54%
DEUTSCHLAND	9.30%	11.56%
AUSTRALIEN	7.83%	8.06%
KANADA	7.81%	9.15%
SCHWEIZ	7.40%	0.54%
VEREINIGTES KÖNIGREICH	6.35%	4.82%
EUROPÄISCHE REGION (EUR)	8.11%	17.02%
SCHWELLENLÄNDER LATEINAMERIKA	6.78%	5.71%
SCHWELLENLÄNDER IM MITTLEREN OSTEN	4.98%	2.01%
ANDERE	10.41%	10.55%
LIQUIDITÄT, ABSICHERUNG	0.98%	-