

Anlagestiftung Swiss Life

Obligationen CHF Inland PM

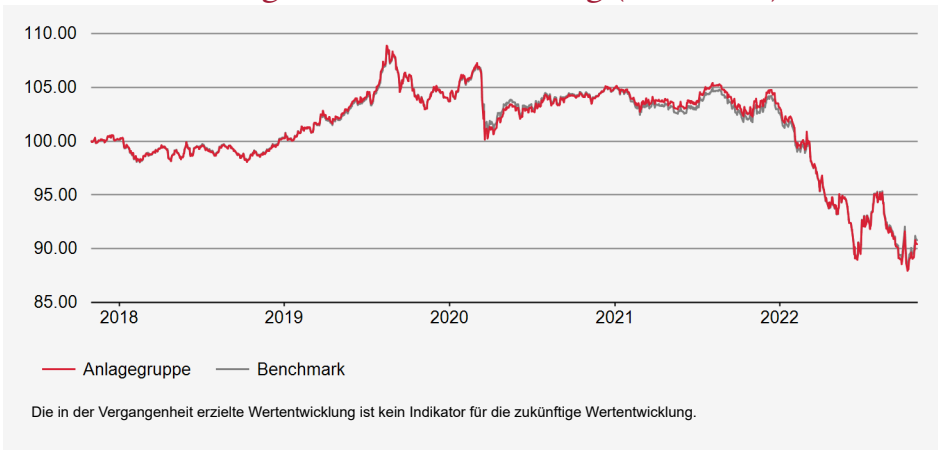


Nettovermögen (NAV) in Mio. CHF: 537.24
Nettovermögen pro Anspruch in CHF: 132.07

Anlagestrategie

Anlagen in auf CHF lautende Forderungspapiere von Schuldern mit Domizil in der Schweiz. Aktive Titelselektion, Durationsteuerung und Zinskurvenpositionierung. Schuldnerbegrenzung: 10% (Ausnahmen: Pfandbriefinstitute 25%, Bund ohne Begrenzung). Benchmarkfremde Schuldner: max. 10%. Durchschnittliche Ratingqualität: mindestens A+. Umsetzung mittels Einsatz des Swiss Life iFunds (CH) Bond Swiss Francs Domestic (CHF); Anlagefonds schweizerischen Rechts der Kategorie "Übrige Fonds für traditionelle Anlagen".

Wertentwicklung in Referenzwährung (Basis 100)



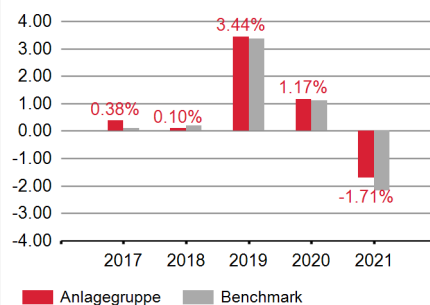
Performance in Referenzwährung

	KUMULIERTE PERFORMANCE				ANNUALISIERTE PERFORMANCE			
	YTD	1 MONAT	3 MONATE	1 JAHR	3 JAHRE	5 JAHRE	10 JAHRE	AUFL.
ANLAGEGRUPPE	-12.32%	0.74%	-4.86%	-11.71%	-4.57%	-1.99%	0.00%	1.82%
BENCHMARK	-11.50%	0.67%	-4.53%	-10.88%	-4.45%	-1.91%	-0.09%	1.69%

Statistische Angaben (annualisiert)

	1 JAHR	3 JAHRE	5 JAHRE	10 JAHRE	AUFL.
Volatilität Anlagegruppe (in %)	7.33	6.16	5.34	4.44	3.99
Volatilität Benchmark (in %)	-	5.82	5.10	4.30	3.94
Tracking Error ex post (in %)	0.35	0.48	0.39	0.35	0.43
Information Ratio	-2.41	-0.24	-0.21	0.25	0.29
Sharpe Ratio	-1.64	-0.66	-0.25	0.13	0.49
Korrelation	1.00	1.00	1.00	1.00	0.99
Beta	1.03	1.06	1.05	1.03	1.01
Jensen-Alpha	-0.51	0.10	-0.02	0.07	0.11
Maximum Drawdown (in %)	-16.04	-17.99	-19.21	-19.21	-19.21
Recovery Period (Jahre)	-	-	-	-	-

Performance



Produktinformationen

Valorennummer: 3026053
ISIN: CH0030260530
LEI: 254900M0YGKYAE29FA28
Bloomberg-Code: SLOCIPM SW
Benchmark: SBI Domestic AAA - BBB TR
Währung: CHF
Domizil: Schweiz
Aufgedatum: 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
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.

Anlagestiftung Swiss Life Obligationen CHF Inland PM

Portfoliostruktur nach Branchen

	Anlagegruppe	Benchmark
PFANDBRIEFINSTITUTE	31.68%	39.01%
STAATLICH UND STAATSNAH	24.12%	30.76%
FINANZWESEN	21.89%	16.38%
BASISKONSUMGÜTER	7.13%	5.29%
VERSORGBETRIEBE	5.72%	2.90%
INDUSTRIE	4.76%	2.87%
NICHT-BASISKONSUMGÜTER	1.22%	0.43%
GRUNDSTOFFE	0.88%	0.92%
SUPRANATIONAL	0.25%	-
ANDERE	0.50%	1.44%
LIQUIDITÄT	1.86%	-

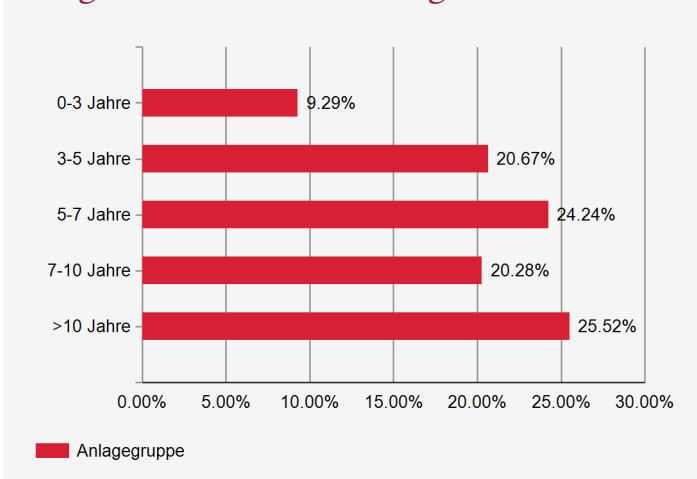
Grösste Schuldner und Rating

		Anlagegruppe
Pfandbriefbank	AAA	16.29%
Pfandbriefzentrale	AAA	14.99%
Eidgenossenschaft	AAA	14.13%
Zürcher Kantonalbank	AAA	2.81%
Kanton Genf	AA-	1.65%

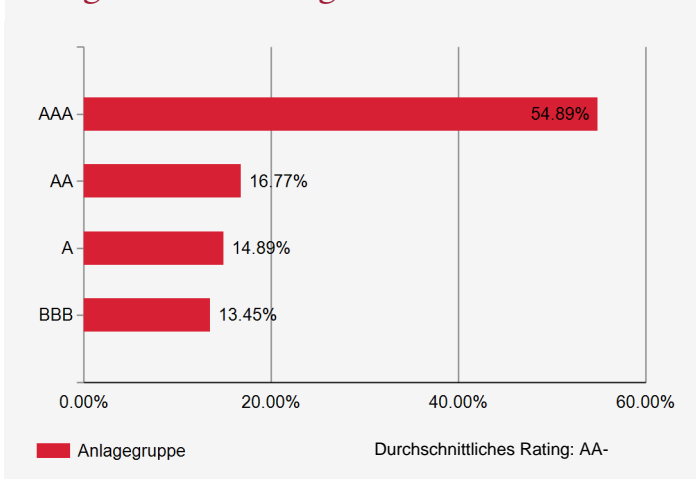
Weitere Angaben zu den Schuldnern

Anzahl Schuldner	117
Anteil Nicht-Benchmark-Schuldner	1.58%

Fälligkeitstruktur der Anlagen



Anlagen nach Rating



Duration und Rendite auf Verfall

	Anlagegruppe	Benchmark
Modified Duration*	7.8	7.6
Theoretische Rendite auf Verfall*	1.91%	1.72%

* Vor Währungsabsicherung, unter Berücksichtigung der Derivate