



Anlagestiftung Swiss Life Obligationen Global Unternehmen Short Term PM (CHF hedged)

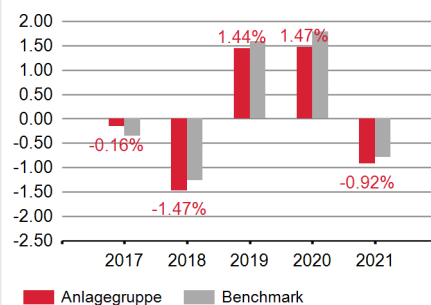
SwissLife

Nettovermögen (NAV) in Mio. CHF: 1'519.63
Nettovermögen pro Anspruch in CHF: 97.04

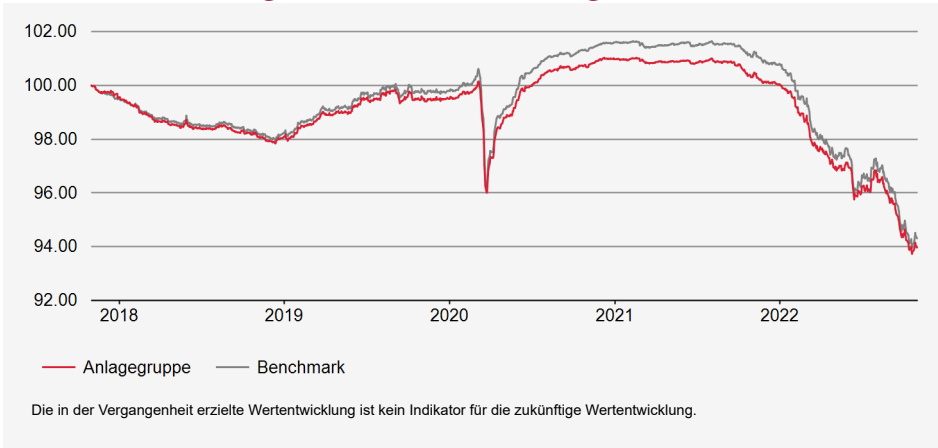
Anlagestrategie

Anlagen in auf Fremdwährungen lautende Forderungspapiere von Unternehmen inklusive Agencies und Supranationals mit einer kurzen Restlaufzeit (mehrheitlich unter 3 Jahren). 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 Short Term (CHF hedged); Anlagefonds schweizerischen Rechts der Kategorie "Übrige Fonds für traditionelle Anlagen".

Performance



Wertentwicklung in Referenzwährung (Basis 100)



Produktinformationen

Valorennummer: 22073695

ISIN: CH0220736950

LEI: 2549003DSGO0RN37K507

Bloomberg-Code: SWLOGPM SW

Benchmark: BLOOMBERG GLO AGG
CORP 1-3 YR IND HEDGED CHF

Währung: CHF

Domizil: Schweiz

Auflagedatum: 11/10/2013

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: 0.15%

ex post per: 30/09/2022 0.15%

Performance in Referenzwährung

	KUMULIERTE PERFORMANCE				ANNUALISIERTE PERFORMANCE			
	YTD	1 MONAT	3 MONATE	1 JAHR	3 JAHRE	5 JAHRE	10 JAHRE	AUFL.
ANLAGEGRUPPE	-6.07%	-0.41%	-2.96%	-6.31%	-1.92%	-1.24%	-	-0.33%
BENCHMARK	-6.43%	-0.36%	-3.03%	-6.68%	-1.89%	-1.16%	-	-0.41%

Statistische Angaben (annualisiert)

	1 JAHR	3 JAHRE	5 JAHRE	10 JAHRE	AUFL.
Volatilität Anlagegruppe (in %)	2.20	2.48	1.99	-	1.60
Volatilität Benchmark (in %)	-	2.65	2.11	-	1.64
Tracking Error ex post (in %)	0.30	0.24	0.20	-	0.32
Information Ratio	1.22	-0.12	-0.36	-	0.25
Sharpe Ratio	-2.76	-0.54	-0.28	-	0.18
Korrelation	1.00	1.00	1.00	-	0.98
Beta	0.91	0.94	0.94	-	0.96
Jensen-Alpha	-0.20	-0.11	-0.10	-	0.09
Maximum Drawdown (in %)	-6.71	-7.22	-7.22	-	-7.22
Recovery Period (Jahre)	-	-	-	-	-

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 Short Term PM (CHF hedged)

Portfoliostruktur nach Branchen

	Anlagegruppe	Benchmark
FINANZWESEN	56.50%	52.10%
BASISKONSUMGÜTER	17.00%	11.80%
NICHT-BASISKONSUMGÜTER	6.98%	8.81%
ENERGIE	4.08%	4.44%
TECHNOLOGIE	3.69%	3.85%
KOMMUNIKATION	3.16%	4.73%
GRUNDSTOFFE	2.98%	2.08%
VERSORGBETRIEBE	2.58%	5.83%
SUPRANATIONAL	0.83%	-
ANDERE	2.45%	6.36%
LIQUIDITÄT	1.12%	-
WÄHRUNGSABSICHERUNG	-1.38%	-

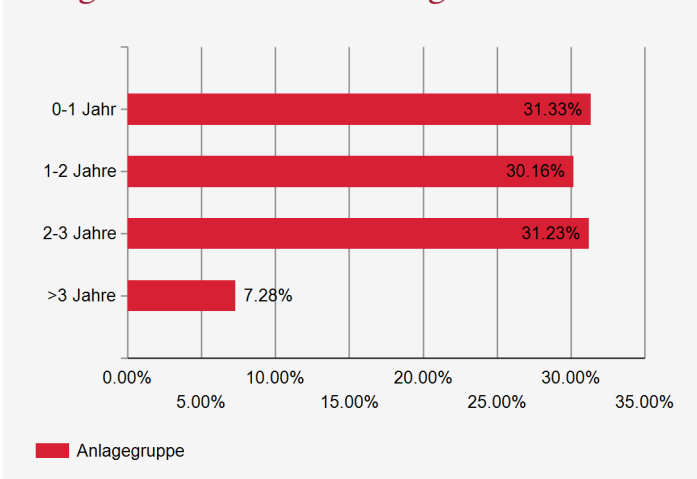
Grösste Schuldner und Rating

		Anlagegruppe
Bank of America, New York	A-	2.19%
Goldman Sachs Group Inc/The	BBB+	1.55%
Nestle SA	AA-	1.53%
Toronto-Dominion Bank/The	A	1.35%
Skandinaviska Enskilda Banken AB	A	1.34%

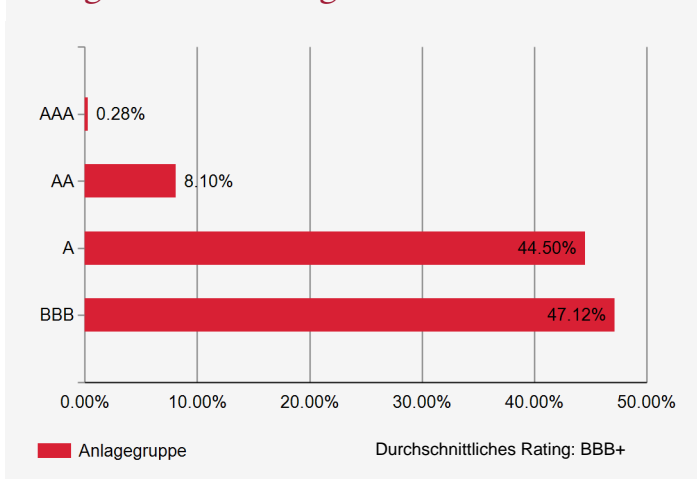
Weitere Angaben zu den Schuldnern

Anzahl Schuldner	180
Anteil Nicht-Benchmark-Schuldner	5.10%

Fälligkeitstruktur der Anlagen



Anlagen nach Rating



Duration und Rendite auf Verfall

	Anlagegruppe	Benchmark
Modified Duration*	1.6	1.9
Theoretische Rendite auf Verfall*	5.24%	5.06%

* Vor Währungsabsicherung, unter Berücksichtigung der Derivate

Portfolio nach Währungen und Duration

	Anlagegruppe		Benchmark	
	Gewichtung	Duration	Gewichtung	Duration
USD	62.42%	1.74	62.99%	2.05
EUR	31.45%	1.39	27.13%	2.37
GBP	3.66%	0.99	2.71%	2.22
CHF	2.48%	1.43	0.57%	1.78
Andere	-	-	6.60%	1.95

Portfoliostruktur nach Ländern/Regionen

	Anlagegruppe	Benchmark
VEREINIGTE STAATEN	38.81%	44.62%
VEREINIGTES KÖNIGREICH	10.27%	7.62%
FRANKREICH	6.84%	7.14%
JAPAN	6.40%	5.07%
KANADA	5.08%	7.21%
DEUTSCHLAND	4.51%	5.95%
SCHWEDEN	3.85%	1.02%
EUROPÄISCHE REGION (EUR)	10.68%	9.67%
EUROPÄISCHE REGION (EX EUR)	5.44%	3.29%
SCHWELLENLÄNDER ASIEN PAZIFIK	4.00%	2.68%
ANDERE	4.39%	5.72%
LIQUIDITÄT, ABSICHERUNG	-0.26%	-