



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

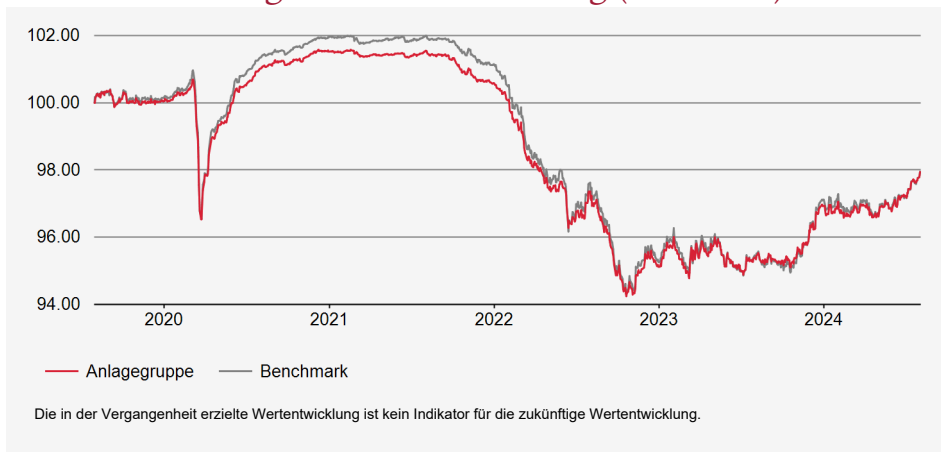
SwissLife

Nettovermögen (NAV) in Mio. CHF: 1'298.53
Nettovermögen pro Anspruch in CHF: 100.60

Anlagestrategie

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

Wertentwicklung in Referenzwährung (Basis 100)



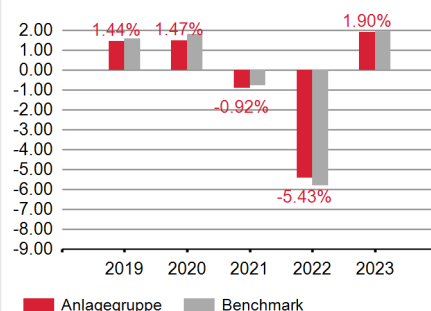
Performance in Referenzwährung

	Kumulierte Performance				Annualisierte Performance			
	YTD	1 Monat	3 Monate	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Aufl.
Anlagegruppe	1.04%	0.74%	1.37%	2.67%	-1.19%	-0.41%	-0.11%	0.06%
Benchmark	0.86%	0.77%	1.38%	2.61%	-1.33%	-0.41%	-0.18%	-0.03%

Statistische Angaben (annualisiert)

	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Aufl.
Volatilität Anlagegruppe (in %)	1.42	2.09	2.21	1.66	1.61
Volatilität Benchmark (in %)	1.75	2.29	2.37	1.74	1.69
Tracking Error ex post (in %)	0.38	0.31	0.27	0.32	0.32
Information Ratio	0.16	0.47	-0.01	0.22	0.26
Sharpe Ratio	0.75	-0.86	-0.22	0.13	0.22
Korrelation	0.99	0.99	1.00	0.98	0.98
Beta	0.81	0.90	0.92	0.93	0.94
Jensen-Alpha	0.26	-0.05	-0.04	0.08	0.10
Maximum Drawdown (in %)	-0.49	-7.19	-7.22	-7.22	-7.22
Recovery Period (Jahre)	0.25	-	-	-	-

Performance



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

Erstausgabepreis: 100.00

Jahresabschluss: 30.09

Ausgabe/Rücknahme: Täglich

Annahmeschluss: 13.00 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 Anlagersresultate.

Kurspublikationen: Bloomberg: ASSL
www.swisslife.ch/anlagestiftung

Betriebsaufwandquote TER KGAST

ex ante: 0.15%

ex post per: 30/09/2023 0.15%

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	54.55%	51.41%
Basiskonsumgüter	14.22%	12.14%
Nicht-Basiskonsumgüter	8.26%	9.77%
Energie	5.19%	4.02%
Technologie	3.66%	4.19%
Industrie	3.51%	5.96%
Versorgungsbetriebe	2.89%	5.20%
Grundstoffe	2.12%	2.05%
Andere	2.60%	5.28%
Liquidität	1.17%	-
Währungsabsicherung	1.83%	-

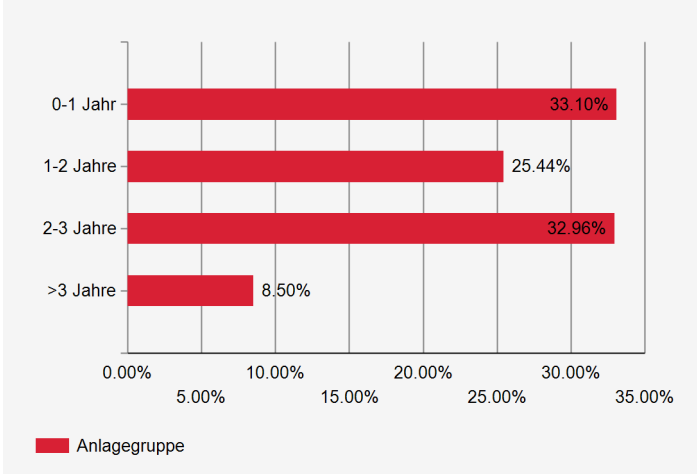
Grösste Schuldner und Rating

	Rating	Anlagegruppe
Banco Santander SA, Madrid	A-	3.14%
UBS Group AG	A+	2.50%
Morgan Stanley NE US	A	2.19%
Broadcom Inc	BBB-	2.19%
Société Générale, Paris	BBB	2.16%

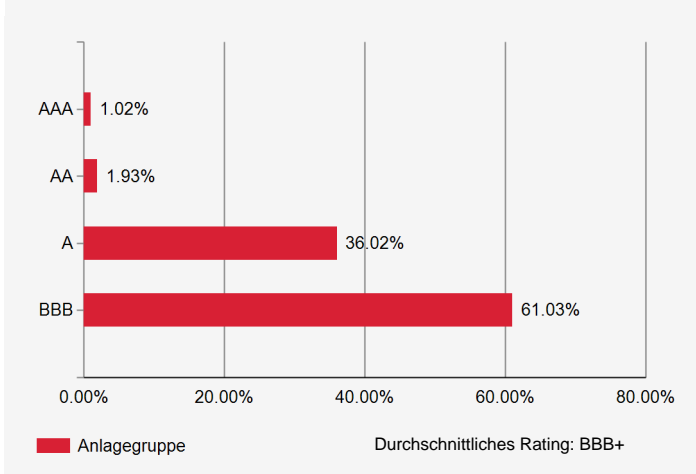
Weitere Angaben zu den Schuldnern

Anzahl Schuldner	143
Anteil Benchmarkfremde Schuldner	7.29%

Fälligkeitstruktur der Anlagen



Anlagen nach Rating



Duration und Rendite auf Verfall

	Anlagegruppe	Benchmark
Modified Duration*	1.9	1.8
Theoretische Rendite auf Verfall*	4.21%	4.49%

* Vor Währungsabsicherung, unter Berücksichtigung der Derivate

Portfolio nach Währungen und Duration

	Anlagegruppe		Benchmark	
	Gewichtung	Duration	Gewichtung	Duration
USD	62.65%	1.85	60.59%	1.93
EUR	23.79%	1.88	29.51%	2.05
CHF	9.05%	1.93	0.46%	2.06
GBP	3.39%	1.64	3.80%	1.93
Andere	1.12%	2.21	5.65%	2.09

Portfoliostruktur nach Ländern/Regionen

	Anlagegruppe	Benchmark
Vereinigte Staaten	33.52%	46.28%
Vereinigtes Königreich	10.19%	6.77%
Frankreich	8.77%	7.44%
Schweiz	7.33%	2.05%
Kanada	7.29%	5.66%
Deutschland	5.58%	6.18%
Spanien	5.38%	3.25%
Europäische Region (EUR)	7.75%	6.93%
Schwellenländer Asien Pazifik	3.48%	2.45%
Asien-Pazifik-Raum	2.99%	4.66%
Andere	4.70%	8.31%
Liquidität, Absicherung	3.01%	-