

# Anlagestiftung Swiss Life

## Obligationen Global Aggregate (CHF hedged)

**Nettovermögen (NAV) in Mio. CHF: 67.25**  
**Nettovermögen pro Anspruch in CHF: 116.78**

### Anlagestrategie

Anlagen in Forderungspapiere von Schuldern mit Domizil im In- oder Ausland (seit 1.1.2011 CHF hedged). Aktive Titelselektion, Durationsteuerung und Zinskurvenpositionierung. Schuldnerbegrenzung: 10% (Ausnahme: sofern in der Benchmark vertreten, max. 5%-Punkte mehr als Benchmarkgewichtung). Forderungspapiere benchmarkfremder Schuldner: max.10%. Durchschnittliche Ratingqualität: mindestens A-. Fremdwährungsrisiken werden zu mindestens 90% gegen Schweizerfranken abgesichert. Umsetzung mittels Einsatz Swiss Life iFunds (CH) Bond Global Aggregate (CHF hedged); Anlagefonds schweizerischen Rechts der Kategorie "Übrige Fonds für traditionelle Anlagen".

### Wertentwicklung in Referenzwährung (Basis 100)



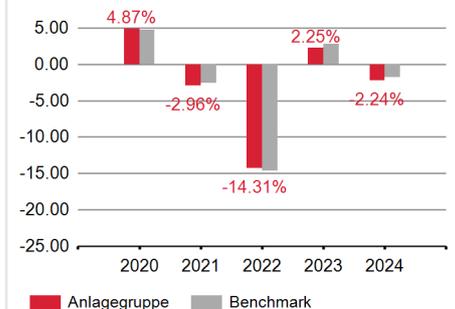
### Performance in Referenzwährung

	Kumulierte Performance				Annualisierte Performance			
	YTD	1 Monat	3 Monate	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Aufl.
Anlagegruppe	-0.15%	-1.08%	-0.15%	-1.24%	-3.28%	-2.60%	-1.00%	0.66%
Benchmark	0.12%	-0.84%	0.12%	-0.53%	-2.92%	-2.46%	-0.78%	0.78%

### Statistische Angaben (annualisiert)

	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Aufl.
Volatilität Anlagegruppe (in %)	4.54	5.88	5.14	4.30	5.38
Volatilität Benchmark (in %)	4.24	6.06	5.26	4.36	5.53
Tracking Error ex post (in %)	0.46	0.58	0.52	0.57	1.39
Information Ratio	-1.56	-0.62	-0.28	-0.40	-0.07
Sharpe Ratio	-0.49	-0.72	-0.57	-0.17	0.08
Korrelation	1.00	1.00	1.00	0.99	0.97
Beta	1.07	0.97	0.97	0.98	0.94
Jensen-Alpha	-0.61	-0.49	-0.22	-0.24	-0.08
Maximum Drawdown (in %)	-4.73	-13.03	-20.24	-20.24	-20.24
Recovery Period (Jahre)	-	-	-	-	-

### Performance



### Produktinformationen

**Valorennummer:** 1245479  
**ISIN:** CH0012454796  
**LEI:** 254900F82G5L48XPDV74  
**Bloomberg-Code:** SWAOBFG SW  
**Benchmark:** BLOOMBERG GLO AGG EX SEC EX CNY HEDGED CHF  
**Währung:** CHF  
**Domizil:** Schweiz  
**Aufledgedatum:** 30/09/2001  
**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](http://www.swisslife.ch/anlagestiftung)

**Betriebsaufwandquote TER KGAST**

**ex ante:** 0.44%

**ex post per:** 30/09/2024 0.46%

**Benchmark:** Die Benchmark wurde per 1. Juli 2012 gewechselt. Für Informationen betreffend die frühere Benchmark wenden Sie sich bitte an die Anlagestiftung Swiss Life.

**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](http://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 Global Aggregate (CHF hedged)

### Portfoliostruktur nach Branchen

	Anlagegruppe	Benchmark
Staatlich und staatsnah	45.93%	72.41%
Finanzwesen	21.57%	11.67%
Basiskonsumgüter	6.54%	3.97%
Nicht-Basiskonsumgüter	3.13%	1.76%
Kommunikation	2.84%	1.89%
Versorgungsbetriebe	2.84%	2.74%
Technologie	2.61%	1.15%
Energie	1.58%	1.69%
Supranational	7.18%	-
Andere	1.50%	2.71%
Liquidität	4.55%	-
Währungsabsicherung	-0.26%	-

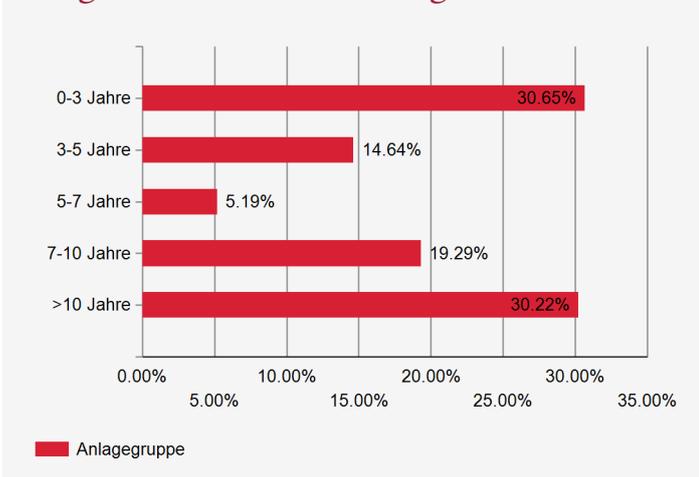
### Grösste Schuldner und Rating

	Rating	Anlagegruppe
Japan	A+	16.64%
US Treasury N/B	AAA	7.73%
Italien	BBB	3.62%
European Union	AA+	3.39%
Corp Andina de Fomento	AA-	2.39%

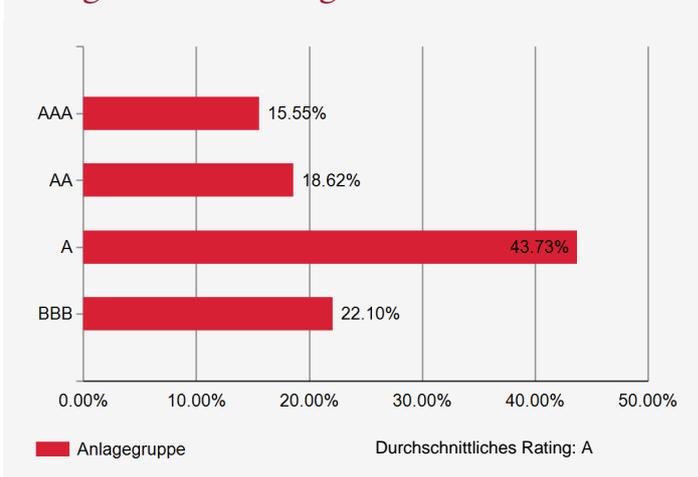
### Weitere Angaben zu den Schuldnern

Anzahl Schuldner	122
Anteil Benchmarkfremde Schuldner	0.00%

### Fälligkeitstruktur der Anlagen



### Anlagen nach Rating



### Duration und Rendite auf Verfall

	Anlagegruppe	Benchmark
Modified Duration*	7.0	6.6
Theoretische Rendite auf Verfall*	3.91%	3.85%

\* Vor Währungsabsicherung, unter Berücksichtigung der Derivate

### Portfoliostruktur nach Ländern/Regionen

	Anlagegruppe	Benchmark
Vereinigte Staaten	25.61%	38.52%
Japan	19.62%	12.87%
Kanada	7.63%	4.36%
Frankreich	6.59%	6.03%
Deutschland	5.12%	5.78%
Italien	5.05%	4.00%
Vereinigtes Königreich	4.99%	5.26%
Europäische Region (EUR)	10.99%	8.86%
Schwellenländer Lateinamerika	3.94%	0.04%
Europäische Region (Ex EUR)	3.11%	1.27%
Andere	3.08%	13.02%
Liquidität, Absicherung	4.29%	-