



# Anlagestiftung Swiss Life

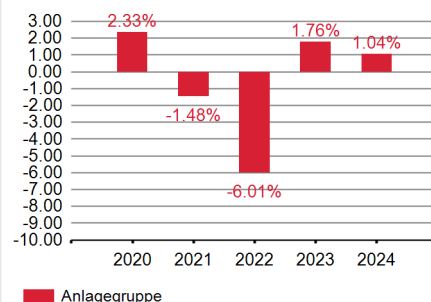
## Obligationen Emerging Markets Short Term (CHF hedged) SwissLife

**Nettovermögen (NAV) in Mio. CHF: 75.52**  
**Nettovermögen pro Anspruch in CHF: 96.64**

### Anlagestrategie

Anlagen in auf US Dollar oder auf andere Hartwährungen lautende Forderungspapiere von Unternehmen und Staaten aus Schwellenländern (Emerging Markets) inklusive Agencies und Supranationals mit einer kurzen Restlaufzeit (mehrheitlich unter 3 Jahren). Aktive Titelselektion, Durationsteuerung und Zinskurvenpositionierung. Schuldnerbegrenzung: 10%. Durchschnittliche Ratingqualität: mindestens BBB-. Fremdwährungsrisiken werden zu mindestens 90% gegen Schweizerfranken abgesichert. Umsetzung mittels Einsatz des Swiss Life Funds (LUX) Bond Emerging Markets Short Term CHF AM Cap; Anlagefonds nach luxemburgischem Recht.

### Performance



### Wertentwicklung in Referenzwährung (Basis 100)



### Produktinformationen

**Valorennummer:** 38013680  
**ISIN:** CH0380136801  
**LEI:** 254900EGYJLGZXIT6O90  
**Bloomberg-Code:** SLOSTCH SW  
**Währung:** CHF  
**Domizil:** Schweiz  
**Aufledgedatum:** 29/09/2017  
**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:** 0.55%

**ex post per:** 30/09/2024 0.57%

### Performance in Referenzwährung

	Kumulierte Performance				Annualisierte Performance			
	YTD	1 Monat	3 Monate	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Aufl.
Anlagegruppe	1.09%	0.08%	1.09%	1.99%	0.65%	0.15%	-	-0.45%

### Statistische Angaben (annualisiert)

	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Aufl.
Volatilität Anlagegruppe (in %)	1.77	2.17	2.36	-	2.25
Sharpe Ratio	0.56	-0.12	-0.06	-	-0.16
Maximum Drawdown (in %)	-1.44	-3.23	-8.82	-	-8.82
Recovery Period (Jahre)	-	1.59	-	-	-

**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 Emerging Markets Short Term (CHF hedged)

### Portfoliostruktur nach Branchen

	Anlagegruppe
Finanzwesen	35.24%
Staatlich und staatsnah	19.14%
Kommunikation	9.65%
Basiskonsumgüter	6.63%
Energie	5.41%
Nicht-Basiskonsumgüter	5.16%
Grundstoffe	4.87%
Versorgungsbetriebe	4.55%
Andere	7.30%
Liquidität	2.78%
Währungsabsicherung	-0.73%

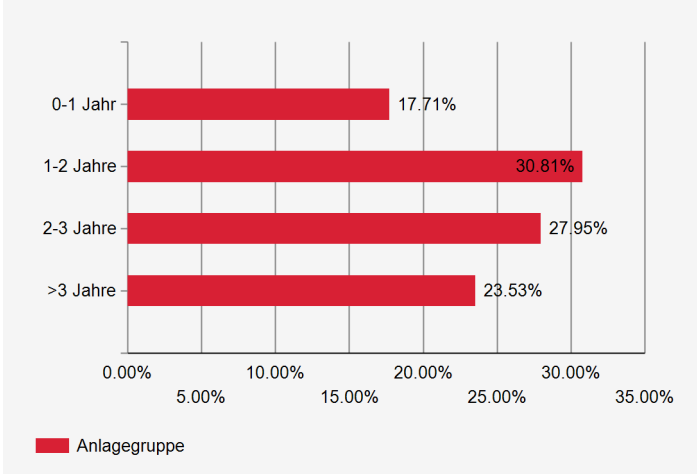
### Grösste Schuldner und Rating

		Anlagegruppe
HDFC Bank Ltd	BBB-	2.68%
Erste Group Bank AG	BBB+	2.47%
MCB Group Ltd	BBB-	2.23%
United Mexican States	BBB	2.05%
Republic of Indonesia	BBB	2.03%

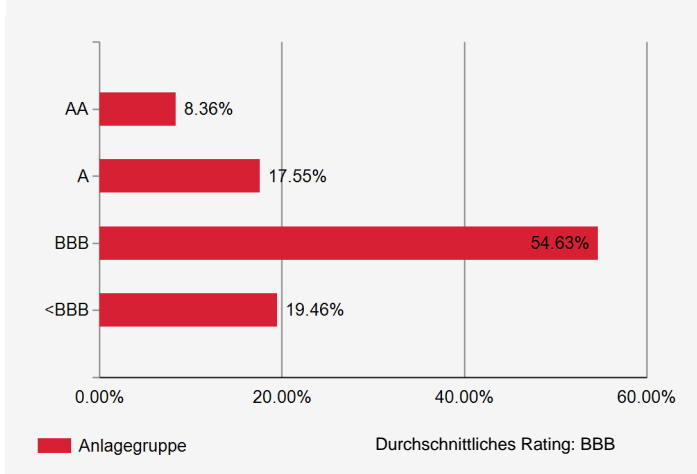
### Weitere Angaben zu den Schuldnern

Anzahl Schuldner	93
------------------	----

### Fälligkeitstruktur der Anlagen



### Anlagen nach Rating



### Duration und Rendite auf Verfall

	Anlagegruppe
Modified Duration*	2.1
Theoretische Rendite auf Verfall*	5.30%

\* Vor Währungsabsicherung, unter Berücksichtigung der Derivate

### Portfolio nach Währungen und Duration

	Anlagegruppe	
	Gewichtung	Duration
CHF	99.93%	0.12

### Portfoliostruktur nach Ländern/Regionen

	Anlagegruppe
Indien	9.42%
China	7.99%
Indonesien	7.25%
Vereinigte Arabische Emirate	5.45%
Mexiko	4.72%
Ungarn	4.51%
Malaysia	3.83%
Schwellenländer Asien Pazifik	14.33%
Schwellenländer Lateinamerika	12.59%
Schwellenländer im mittleren Osten	7.29%
Andere	20.57%
Liquidität, Absicherung	2.05%