

Anlagestiftung Swiss Life

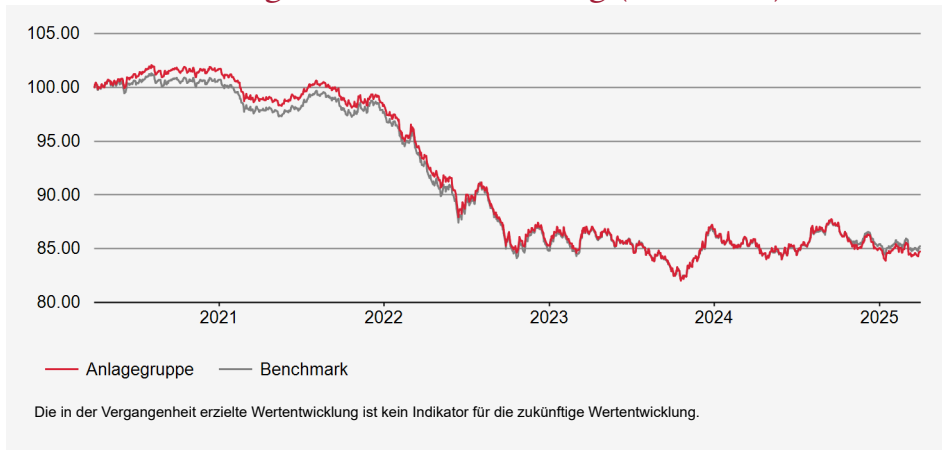
Obligationen Global Staaten+ (CHF hedged)

Nettovermögen (NAV) in Mio. CHF: 787.23
Nettovermögen pro Anspruch in CHF: 104.85

Anlagestrategie

Anlagen in Forderungspapiere von Staaten und staatsnahen Institutionen. 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 des Swiss Life iFunds (CH) Bond Global Government+ (CHF hedged); Anlagefonds schweizerischen Rechts der Kategorie "Übrige Fonds für traditionelle Anlagen".

Wertentwicklung in Referenzwährung (Basis 100)



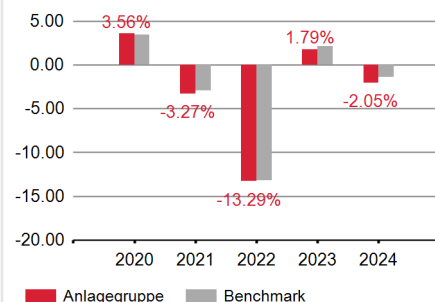
Performance in Referenzwährung

| | Kumulierte Performance | | | | Annualisierte Performance | | | |
|--------------|------------------------|---------|----------|--------|---------------------------|---------|----------|-------|
| | YTD | 1 Monat | 3 Monate | 1 Jahr | 3 Jahre | 5 Jahre | 10 Jahre | Aufl. |
| Anlagegruppe | -0.35% | -0.95% | -0.35% | -1.33% | -3.30% | -3.25% | -1.32% | 0.33% |
| Benchmark | -0.21% | -0.82% | -0.21% | -0.66% | -2.90% | -3.14% | -1.02% | 0.41% |

Statistische Angaben (annualisiert)

| | 1 Jahr | 3 Jahre | 5 Jahre | 10 Jahre | Aufl. |
|---------------------------------|--------|---------|---------|----------|--------|
| Volatilität Anlagegruppe (in %) | 4.04 | 5.02 | 4.32 | 3.69 | 3.59 |
| Volatilität Benchmark (in %) | 3.68 | 5.05 | 4.35 | 3.77 | 3.53 |
| Tracking Error ex post (in %) | 0.44 | 0.57 | 0.54 | 0.59 | 0.69 |
| Information Ratio | -1.53 | -0.70 | -0.21 | -0.50 | -0.12 |
| Sharpe Ratio | -0.57 | -0.85 | -0.83 | -0.29 | 0.14 |
| Korrelation | 1.00 | 0.99 | 0.99 | 0.99 | 0.98 |
| Beta | 1.10 | 0.99 | 0.99 | 0.97 | 1.00 |
| Jensen-Alpha | -0.51 | -0.45 | -0.16 | -0.32 | -0.08 |
| Maximum Drawdown (in %) | -4.39 | -12.48 | -19.62 | -20.00 | -20.00 |
| Recovery Period (Jahre) | - | - | - | - | - |

Performance



Produktinformationen

Valorennummer: 11955694
ISIN: CH0119556949
LEI: 254900H7WEVS3K9ANR90
Bloomberg-Code: SWLGSTP SW
Benchmark: BLOOMBERG GLOBAL AGG TREAS EX CHF TR HEDGED CHF
Währung: CHF
Domizil: Schweiz
Aufledgedatum: 14/12/2010
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

Betriebsaufwandquote TER KGAST

ex ante: 0.40%

ex post per: 30/09/2024 0.42%

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, «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 Staaten+ (CHF hedged)

Portfoliostruktur nach Branchen

| | Anlagegruppe | Benchmark |
|-------------------------|--------------|-----------|
| Staatlich und staatsnah | 77.06% | 100.00% |
| Finanzwesen | 6.57% | - |
| Pfandbriefinstitute | 2.75% | - |
| Supranational | 4.29% | - |
| Liquidität | 9.89% | - |
| Währungsabsicherung | -0.55% | - |

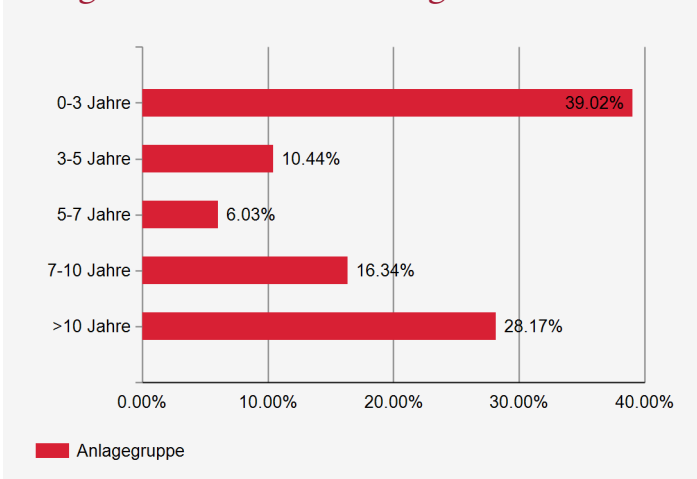
Grösste Schuldner und Rating

| | Rating | Anlagegruppe |
|----------------------------|--------|--------------|
| Japan | A+ | 20.13% |
| US Treasury N/B | AAA | 14.82% |
| Vereinigtes Königreich | AA- | 6.17% |
| People's Republic of China | A+ | 6.13% |
| Italien | BBB- | 5.27% |

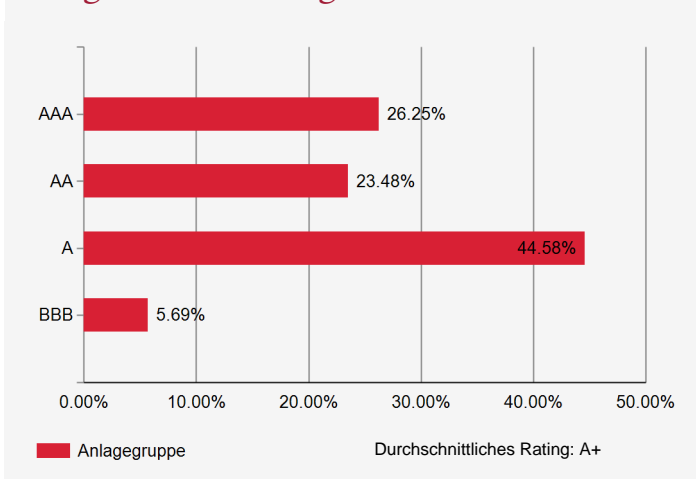
Weitere Angaben zu den Schuldnern

| | |
|----------------------------------|-------|
| Anzahl Schuldner | 61 |
| Anteil Benchmarkfremde Schuldner | 2.53% |

Fälligkeitstruktur der Anlagen



Anlagen nach Rating



Duration und Rendite auf Verfall

| | Anlagegruppe | Benchmark |
|-----------------------------------|--------------|-----------|
| Modified Duration* | 7.2 | 7.1 |
| Theoretische Rendite auf Verfall* | 3.30% | 3.30% |

* Vor Währungsabsicherung, unter Berücksichtigung der Derivate

Portfolio nach Währungen und Duration

| | Anlagegruppe | | Benchmark | |
|--------|--------------|----------|------------|----------|
| | Gewichtung | Duration | Gewichtung | Duration |
| JPY | 25.64% | 8.17 | 16.87% | 8.68 |
| EUR | 23.11% | 11.40 | 22.61% | 6.92 |
| USD | 23.04% | 13.71 | 35.18% | 5.80 |
| Andere | 28.21% | 8.36 | 25.33% | 7.46 |

Portfoliostruktur nach Ländern/Regionen

| | Anlagegruppe | Benchmark |
|-------------------------------|--------------|-----------|
| Japan | 22.10% | 16.87% |
| Vereinigte Staaten | 16.13% | 35.18% |
| Vereinigtes Königreich | 6.70% | 5.23% |
| China | 6.66% | 9.88% |
| Italien | 5.72% | 5.01% |
| Frankreich | 5.54% | 5.34% |
| Spanien | 3.84% | 3.26% |
| Europäische Region (EUR) | 11.22% | 7.87% |
| Schwellenländer Lateinamerika | 3.85% | 0.12% |
| Europäische Region (Ex EUR) | 3.61% | 0.43% |
| Andere | 5.30% | 10.81% |
| Liquidität, Absicherung | 9.33% | - |