

Anlagestiftung Swiss Life

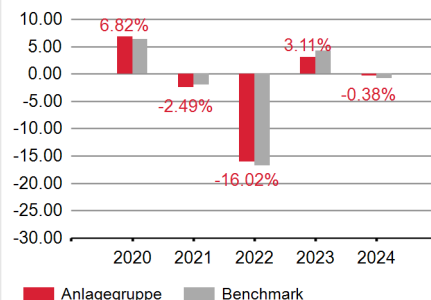
Obligationen Global Unternehmen (CHF hedged)

Nettovermögen (NAV) in Mio. CHF: 695.96
Nettovermögen pro Anspruch in CHF: 119.93

Anlagestrategie

Anlagen in Forderungspapiere von Unternehmen inklusive Agencies und Supranationals. 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 (CHF hedged); Anlagfonds schweizerischen Rechts der Kategorie "Übrige Fonds für traditionelle Anlagen".

Performance



Wertentwicklung in Referenzwährung (Basis 100)



Produktinformationen

Valorennummer: 11955702
ISIN: CH0119557020
LEI: 254900C3B00LU0UJ428
Bloomberg-Code: SWLGUNT SW
Benchmark: BLOOMBERG GLO AGG CORP IND 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: 0.50%

ex post per: 30/09/2024 0.53%

Performance in Referenzwährung

	Kumulierte Performance				Annualisierte Performance			
	YTD	1 Monat	3 Monate	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Aufl.
Anlagegruppe	0.71%	-0.76%	0.71%	0.93%	-2.38%	-1.23%	-0.34%	1.28%
Benchmark	0.78%	-0.74%	0.78%	0.89%	-2.23%	-1.01%	-0.22%	1.25%

Statistische Angaben (annualisiert)

	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Aufl.
Volatilität Anlagegruppe (in %)	4.50	6.93	6.33	5.45	5.16
Volatilität Benchmark (in %)	4.90	7.72	6.93	5.86	5.34
Tracking Error ex post (in %)	0.57	0.96	0.80	0.83	0.95
Information Ratio	0.07	-0.16	-0.27	-0.15	0.03
Sharpe Ratio	-0.01	-0.48	-0.24	-0.02	0.28
Korrelation	1.00	1.00	1.00	0.99	0.98
Beta	0.91	0.89	0.91	0.92	0.95
Jensen-Alpha	0.04	-0.49	-0.33	-0.12	0.10
Maximum Drawdown (in %)	-4.20	-13.79	-21.47	-21.47	-21.47
Recovery Period (Jahre)	-	-	-	-	-

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 Unternehmen (CHF hedged)

Portfoliostruktur nach Branchen

	Anlagegruppe	Benchmark
Finanzwesen	47.02%	39.01%
Basiskonsumgüter	14.96%	16.12%
Energie	8.26%	6.05%
Versorgungsbetriebe	7.93%	9.13%
Kommunikation	6.18%	7.62%
Industrial	5.88%	7.15%
Technologie	5.50%	4.82%
Nicht-Basiskonsumgüter	3.08%	7.34%
Andere	1.16%	2.76%
Liquidität	0.20%	-
Währungsabsicherung	-0.17%	-

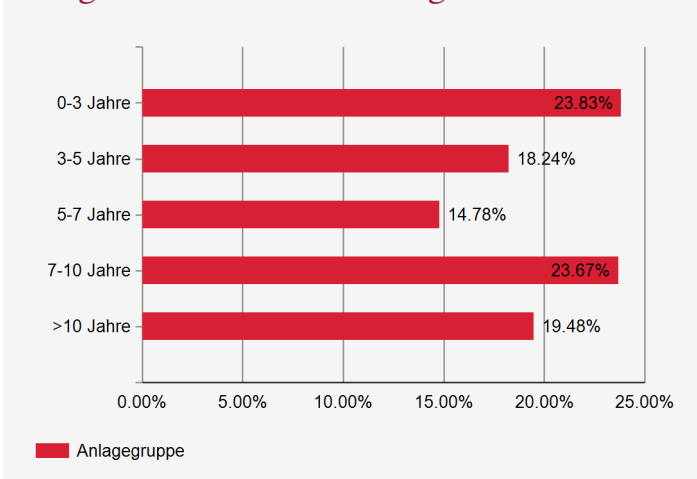
Grösste Schuldner und Rating

	Rating	Anlagegruppe
JPMorgan Chase & Co	A	2.68%
Groupe BPCE	BBB+	2.30%
Banco Santander SA, Madrid	A-	2.12%
Barclays Capital PLC, London	BBB-	2.07%
Berkshire Hathaway Inc	AA	1.82%

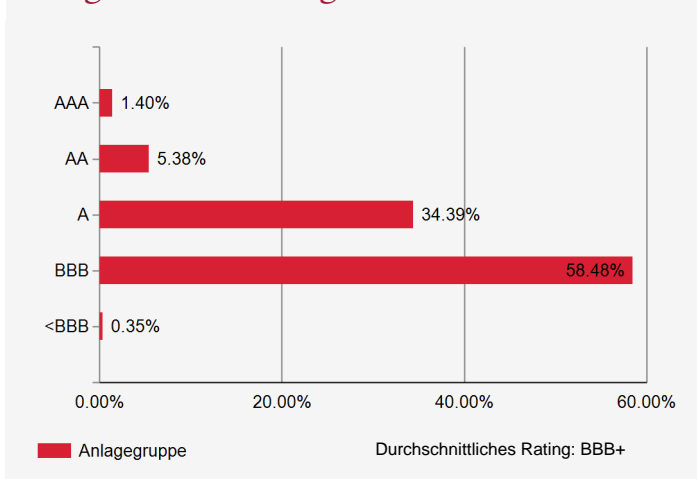
Weitere Angaben zu den Schuldnern

Anzahl Schuldner	221
Anteil Benchmarkfremde Schuldner	5.20%

Fälligkeitstruktur der Anlagen



Anlagen nach Rating



Duration und Rendite auf Verfall

	Anlagegruppe	Benchmark
Modified Duration*	6.2	5.9
Theoretische Rendite auf Verfall*	5.09%	5.04%

* Vor Währungsabsicherung, unter Berücksichtigung der Derivate

Portfolio nach Währungen und Duration

	Anlagegruppe		Benchmark	
	Gewichtung	Duration	Gewichtung	Duration
USD	63.29%	6.99	67.46%	6.44
EUR	26.17%	4.66	23.81%	4.31
CHF	3.56%	3.46	0.36%	4.11
JPY	3.44%	1.80	0.67%	3.86
Andere	3.54%	6.54	7.70%	5.42

Portfoliostruktur nach Ländern/Regionen

	Anlagegruppe	Benchmark
Vereinigte Staaten	45.93%	56.57%
Vereinigtes Königreich	9.71%	6.73%
Frankreich	7.99%	6.14%
Deutschland	5.05%	4.93%
Spanien	4.17%	2.21%
Schweiz	3.78%	1.27%
Australien	3.27%	2.24%
Europäische Region (EUR)	7.53%	5.49%
Asien-Pazifik-Raum	3.21%	3.24%
Schwellenländer Asien Pazifik	2.41%	1.54%
Andere	6.91%	9.64%
Liquidität, Absicherung	0.03%	-