

Anlagestiftung Swiss Life Obligationen CHF Ausland

Nettovermögen (NAV) in Mio. CHF: 425.03
Nettovermögen pro Anspruch in CHF: 151.70

Anlagestrategie

Anlagen in auf CHF lautende Forderungspapiere von Schuldern, die vorwiegend im Ausland domiziliert sind. Aktive Titelselektion, Durationsteuerung und Zinskurvenpositionierung. Schuldnerbegrenzung: 10%. Forderungspapiere benchmarkfremder Schuldner: max. 20%. Durchschnittliche Ratingqualität: mindestens A. Umsetzung mittels Einsatz des Swiss Life iFunds (CH) Bond Swiss Francs Foreign (CHF); Anlagefonds schweizerischen Rechts der Kategorie "Übrige Fonds für traditionelle Anlagen".

Wertentwicklung in Referenzwährung (Basis 100)



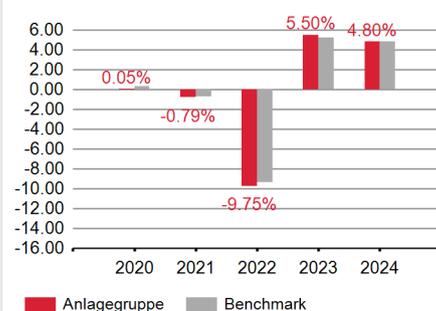
Performance in Referenzwährung

	Kumulierte Performance				Annualisierte Performance			
	YTD	1 Monat	3 Monate	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Aufl.
Anlagegruppe	-0.37%	-0.10%	-0.37%	3.72%	1.75%	0.75%	0.14%	1.79%
Benchmark	-0.43%	-0.10%	-0.43%	3.72%	1.71%	0.72%	0.23%	1.91%

Statistische Angaben (annualisiert)

	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Aufl.
Volatilität Anlagegruppe (in %)	2.04	3.26	3.30	3.37	3.18
Volatilität Benchmark (in %)	2.11	3.25	3.26	3.24	3.04
Tracking Error ex post (in %)	0.14	0.19	0.22	0.28	0.84
Information Ratio	-0.03	0.22	0.11	-0.32	-0.13
Sharpe Ratio	1.31	0.25	0.14	0.12	0.49
Korrelation	1.00	1.00	1.00	1.00	0.96
Beta	0.96	1.00	1.01	1.04	1.01
Jensen-Alpha	0.09	0.04	0.02	-0.11	-0.14
Maximum Drawdown (in %)	-1.60	-6.57	-12.77	-14.23	-14.23
Recovery Period (Jahre)	-	1.14	-	-	-

Performance



Produktinformationen

Valorennummer: 1245477
ISIN: CH0012454770
LEI: 2549002XPEQH1AZYBW05
Bloomberg-Code: SWAOBAU SW
Benchmark: SBI Foreign AAA - BBB TR
Währung: CHF
Domizil: Schweiz
Aufgatedatum: 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

Betriebsaufwandquote TER KGAST

ex ante: 0.26%

ex post per: 30/09/2024 0.27%

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.

Portfoliostruktur nach Branchen

	Anlagegruppe	Benchmark
Finanzwesen	64.57%	48.24%
Staatlich und staatsnah	7.58%	16.60%
Pfandbriefinstitute	5.43%	14.24%
Nicht-Basiskonsumgüter	4.60%	4.64%
Versorgungsbetriebe	3.83%	3.13%
Basiskonsumgüter	3.55%	3.93%
Industrial	3.14%	5.40%
Kommunikation	-	1.54%
Supranational	4.52%	-
Andere	1.52%	2.29%
Liquidität	1.25%	-

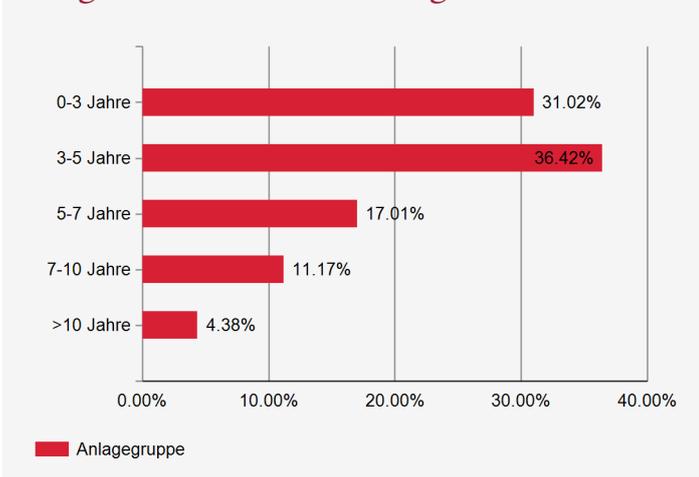
Grösste Schuldner und Rating

	Rating	Anlagegruppe
Banco Santander SA, Madrid	A	4.66%
Groupe BPCE	AA	3.82%
Müchener Hypothekenbank	AA	3.53%
Bank of Nova Scotia/The	AA-	3.21%
Credit Agricole Group	AA-	3.09%

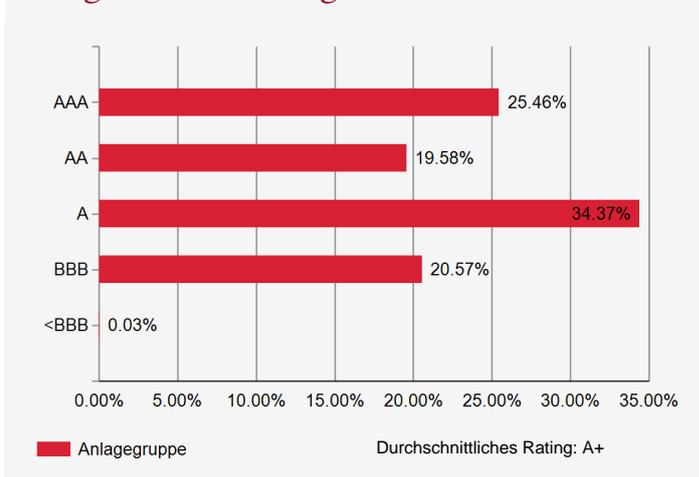
Weitere Angaben zu den Schuldnern

Anzahl Schuldner	125
Anteil Benchmarkfremde Schuldner	2.20%

Fälligkeitstruktur der Anlagen



Anlagen nach Rating



Duration und Rendite auf Verfall

	Anlagegruppe	Benchmark
Modified Duration*	4.3	4.3
Theoretische Rendite auf Verfall*	1.09%	0.97%

* Vor Währungsabsicherung, unter Berücksichtigung der Derivate

Portfoliostruktur nach Ländern/Regionen

	Anlagegruppe	Benchmark
Frankreich	15.51%	16.63%
Deutschland	14.46%	14.11%
Kanada	11.95%	11.64%
Vereinigte Staaten	11.00%	12.42%
Spanien	6.41%	4.79%
Australien	6.06%	5.87%
Vereinigtes Königreich	5.28%	3.73%
Europäische Region (Ex EUR)	6.53%	6.28%
Schwellenländer Lateinamerika	5.66%	3.68%
Europäische Region (EUR)	5.49%	12.18%
Andere	10.41%	8.66%
Liquidität, Absicherung	1.25%	-