

# Anlagestiftung Swiss Life

## Obligationen Global Unternehmen Short Term (CHF hedged)

Nettovermögen (NAV) in Mio. CHF: 1'851.38  
Nettovermögen pro Anspruch in CHF: 99.09

### Anlagestrategie

Anlagen in Forderungspapiere von Unternehmen inklusive Agencies und Supranationals mit einer kurzen Restlaufzeit (mehrheitlich unter 3 Jahren). 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 Short Term (CHF hedged); Anlagefonds schweizerischen Rechts der Kategorie "Übrige Fonds für traditionelle Anlagen".

### Wertentwicklung in Referenzwährung (Basis 100)



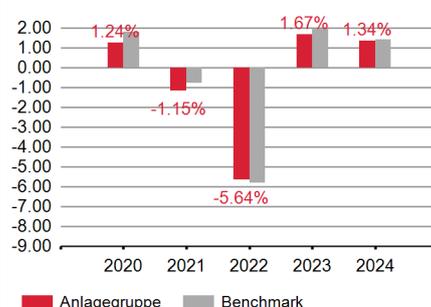
### Performance in Referenzwährung

	Kumulierte Performance				Annualisierte Performance			
	YTD	1 Monat	3 Monate	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Aufl.
Anlagegruppe	0.51%	-0.04%	0.51%	1.90%	0.03%	0.02%	-0.33%	-0.08%
Benchmark	0.53%	0.01%	0.53%	2.01%	0.18%	0.23%	-0.14%	0.07%

### Statistische Angaben (annualisiert)

	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Aufl.
Volatilität Anlagegruppe (in %)	1.31	2.02	1.89	1.68	1.59
Volatilität Benchmark (in %)	1.41	2.21	2.05	1.77	1.67
Tracking Error ex post (in %)	0.25	0.29	0.26	0.31	0.31
Information Ratio	-0.42	-0.51	-0.82	-0.60	-0.48
Sharpe Ratio	0.69	-0.44	-0.14	-0.04	0.10
Korrelation	0.99	0.99	0.99	0.98	0.98
Beta	0.92	0.90	0.91	0.94	0.94
Jensen-Alpha	-0.02	-0.22	-0.22	-0.18	-0.13
Maximum Drawdown (in %)	-0.82	-4.19	-7.61	-8.08	-8.08
Recovery Period (Jahre)	0.13	1.92	-	-	-

### Performance



### Produktinformationen

Valorennummer: 22073699

ISIN: CH0220736992

LEI: 2549003DSGO0RN37K507

Bloomberg-Code: SWLOGNT SW

Benchmark: BLOOMBERG GLO AGG CORP 1-3 YR IND HEDGED CHF

Währung: CHF

Domizil: Schweiz

Aufliedatum: 11/10/2013

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: 0.35%

ex post per: 30/09/2024 0.37%

**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	59.06%	52.21%
Basiskonsumgüter	10.46%	11.72%
Nicht-Basiskonsumgüter	9.13%	9.51%
Kommunikation	5.57%	4.98%
Industrial	4.59%	6.03%
Technologie	3.17%	4.14%
Energie	2.87%	3.87%
Versorgungsbetriebe	2.44%	5.44%
Andere	1.06%	2.10%
Liquidität	1.53%	-
Währungsabsicherung	0.13%	-

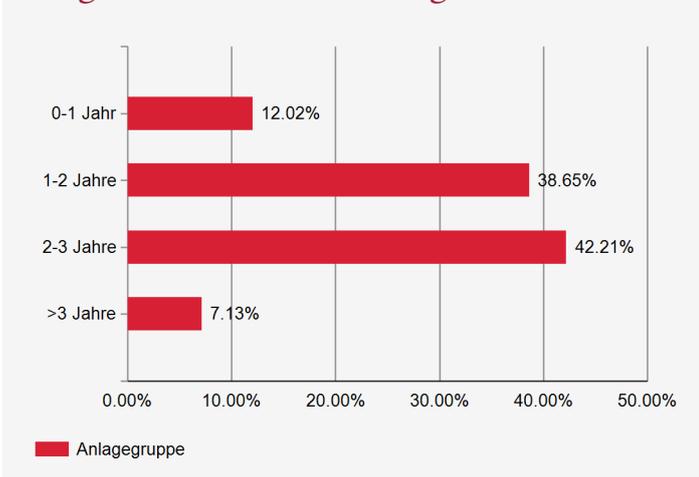
### Grösste Schuldner und Rating

	Rating	Anlagegruppe
Banco Santander SA, Madrid	A-	3.09%
Canadian Imperial Bank of Commerce	A-	2.79%
Barclays Capital PLC, London	BBB	2.74%
Citigroup Inc	BBB+	2.49%
Wells Fargo & Co	BBB+	2.41%

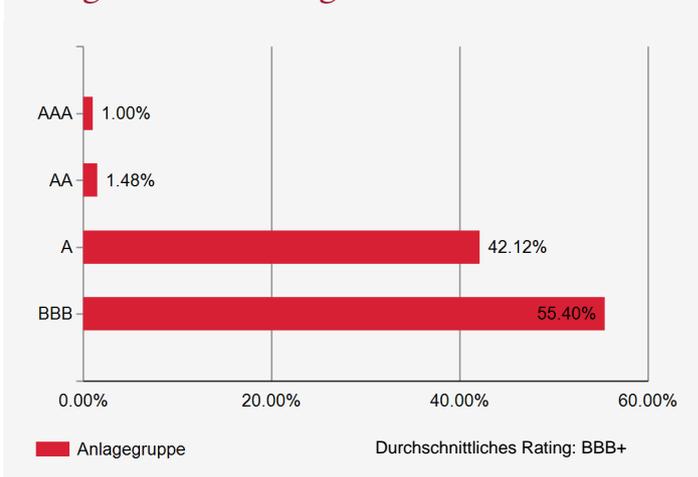
### Weitere Angaben zu den Schuldnern

Anzahl Schuldner	140
Anteil Benchmarkfremde Schuldner	4.45%

### Fälligkeitstruktur der Anlagen



### Anlagen nach Rating



### Duration und Rendite auf Verfall

	Anlagegruppe	Benchmark
Modified Duration*	2.0	1.8
Theoretische Rendite auf Verfall*	3.93%	3.95%

\* Vor Währungsabsicherung, unter Berücksichtigung der Derivate

### Portfolio nach Währungen und Duration

	Anlagegruppe		Benchmark	
	Gewichtung	Duration	Gewichtung	Duration
USD	68.39%	1.67	59.81%	1.81
EUR	28.01%	2.15	29.92%	1.82
GBP	3.92%	1.48	3.75%	1.80
JPY	1.78%	2.11	1.17%	1.90
Andere	-2.10%	-5.49	5.34%	1.89

### Portfoliostruktur nach Ländern/Regionen

	Anlagegruppe	Benchmark
Vereinigte Staaten	36.23%	45.50%
Frankreich	9.35%	7.31%
Vereinigtes Königreich	8.76%	6.64%
Kanada	7.14%	6.31%
Japan	6.40%	4.55%
Schweiz	6.14%	1.77%
Deutschland	5.91%	6.50%
Europäische Region (EUR)	9.38%	9.54%
Schwellenländer Asien Pazifik	4.46%	2.40%
Asien-Pazifik-Raum	1.70%	3.12%
Andere	2.87%	6.37%
Liquidität, Absicherung	1.66%	-