

Anlagestiftung Swiss Life

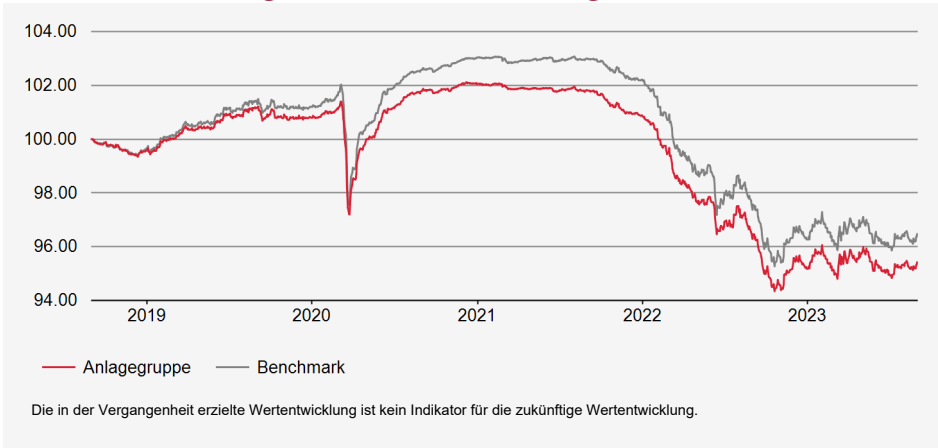
Obligationen Global Unternehmen Short Term (CHF hedged)

Nettovermögen (NAV) in Mio. CHF: 1'428.45
Nettovermögen pro Anspruch in CHF: 95.93

Anlagestrategie

Anlagen in auf Fremdwährungen lautende Forderungspapiere von Unternehmen inklusive Agencies und Supranationals mit einer kurzen Restlaufzeit (mehrheitlich unter 3 Jahren). Aktive Titelselektion, Durationsteuerung und Zinskurvenpositionierung. Schuldnerbegrenzung: 10%. Benchmarkfremde 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)



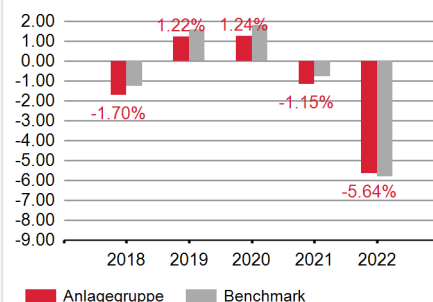
Performance in Referenzwährung

	KUMULIERTE PERFORMANCE				ANNUALISIERTE PERFORMANCE			
	YTD	1 MONAT	3 MONATE	1 JAHR	3 JAHRE	5 JAHRE	10 JAHRE	AUFL.
ANLAGEGRUPPE	0.25%	0.09%	-0.01%	-1.00%	-2.13%	-0.93%	-	-0.42%
BENCHMARK	0.21%	0.01%	0.01%	-1.03%	-2.02%	-0.71%	-	-0.29%

Statistische Angaben (annualisiert)

	1 JAHR	3 JAHRE	5 JAHRE	10 JAHRE	AUFL.
Volatilität Anlagegruppe (in %)	2.25	1.83	2.11	-	1.61
Volatilität Benchmark (in %)	2.41	1.99	2.25	-	1.66
Tracking Error ex post (in %)	0.25	0.24	0.22	-	0.31
Information Ratio	0.13	-0.44	-1.03	-	-0.41
Sharpe Ratio	-0.89	-1.13	-0.27	-	0.03
Korrelation	1.00	1.00	1.00	-	0.98
Beta	0.93	0.92	0.94	-	0.95
Jensen-Alpha	-0.12	-0.27	-0.25	-	-0.12
Maximum Drawdown (in %)	-2.19	-7.61	-7.61	-	-8.08
Recovery Period (Jahre)	-	-	-	-	-

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

Aufgatedatum: 11/10/2013

Ausgabepreis: 100.00

Jahresabschluss: 30.09

Ausgabe/Rücknahme: Täglich

Annaheschluss: 14.30 Uhr

Ausgabe-/Rücknahmekommission: Keine

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: 0.38%

ex post per: 30/09/2022 0.38%

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.

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	52.49%	51.65%
BASISKONSUMGÜTER	18.01%	12.54%
NICHT-BASISKONSUMGÜTER	8.66%	8.83%
ENERGIE	5.25%	4.25%
INDUSTRIE	4.52%	5.86%
TECHNOLOGIE	3.29%	4.15%
VERSORGUNGSBETRIEBE	2.64%	5.30%
KOMMUNIKATION	2.44%	5.19%
SUPRANATIONAL	0.85%	-
ANDERE	1.54%	2.23%
LIQUIDITÄT	0.77%	-
WÄHRUNGSABSICHERUNG	-0.46%	-

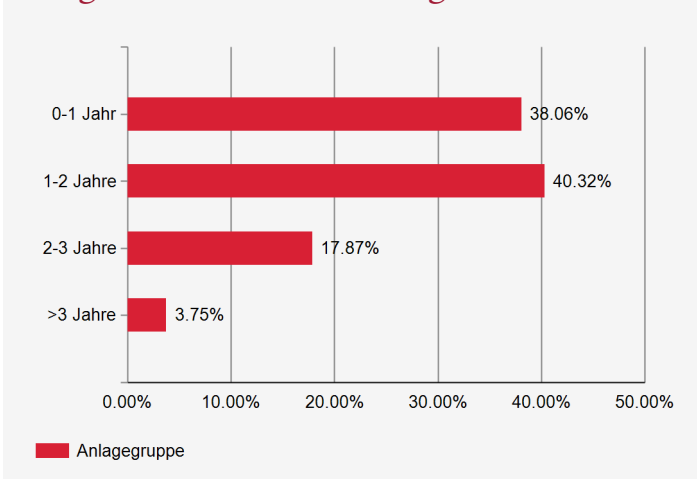
Grösste Schuldner und Rating

	Rating	Anlagegruppe
UBS Group AG	A	2.11%
Banco Santander SA, Madrid	A-	2.05%
Bank of America, New York	A-	2.00%
Swedbank AB	A-	1.83%
Nestle SA	AA-	1.54%

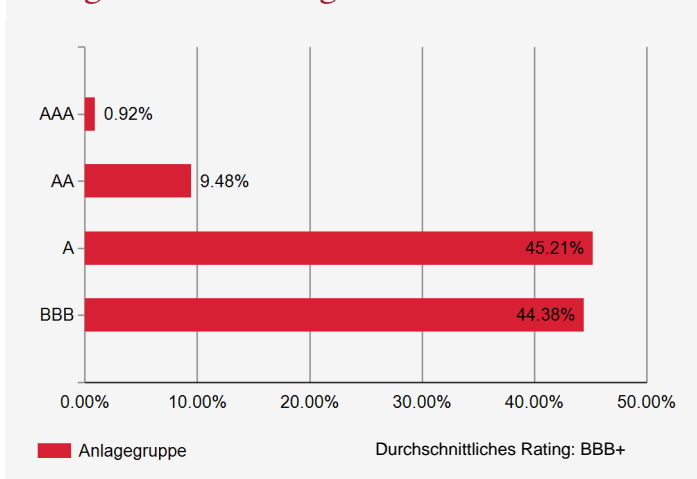
Weitere Angaben zu den Schuldnern

Anzahl Schuldner	179
Anteil Nicht-Benchmark-Schuldner	7.62%

Fälligkeitstruktur der Anlagen



Anlagen nach Rating



Duration und Rendite auf Verfall

	Anlagegruppe	Benchmark
Modified Duration*	1.7	1.8
Theoretische Rendite auf Verfall*	6.36%	5.28%

* Vor Währungsabsicherung, unter Berücksichtigung der Derivate

Portfolio nach Währungen und Duration

	Anlagegruppe		Benchmark	
	Gewichtung	Duration	Gewichtung	Duration
USD	60.35%	1.86	62.29%	2.00
EUR	31.88%	1.55	28.50%	2.35
CHF	5.35%	1.47	0.49%	1.69
GBP	2.41%	0.62	3.21%	2.11
Andere	-	-	5.52%	2.14

Portfoliostruktur nach Ländern/Regionen

	Anlagegruppe	Benchmark
VEREINIGTE STAATEN	39.66%	44.88%
KANADA	8.56%	5.88%
VEREINIGTES KÖNIGREICH	7.50%	7.30%
JAPAN	6.22%	5.07%
FRANKREICH	5.93%	7.67%
SCHWEDEN	4.94%	0.95%
DEUTSCHLAND	4.61%	6.04%
EUROPÄISCHE REGION (EUR)	8.86%	10.35%
EUROPÄISCHE REGION (EX EUR)	7.08%	3.38%
SCHWELLENLÄNDER ASIEN PAZIFIK	3.29%	2.61%
ANDERE	3.04%	5.88%
LIQUIDITÄT, ABSICHERUNG	0.30%	-