

# Anlagestiftung Swiss Life

## Obligationen Global Staaten+ PM (CHF hedged)

**Nettovermögen (NAV) in Mio. CHF: 787.23**  
**Nettovermögen pro Anspruch in CHF: 109.14**

### 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

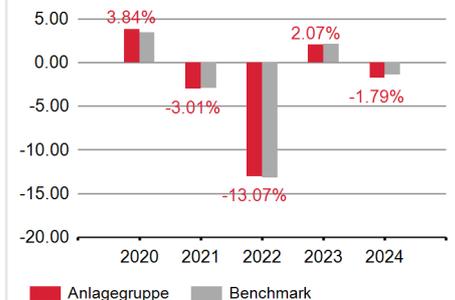
	Kumulierte Performance				Annualisierte Performance			
	YTD	1 Monat	3 Monate	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Aufl.
Anlagegruppe	-0.29%	-0.93%	-0.29%	-1.06%	-3.04%	-2.99%	-1.05%	0.61%
Benchmark	-0.21%	-0.82%	-0.21%	-0.66%	-2.90%	-3.14%	-1.02%	0.41%

### Statistische Angaben (annualisiert)

	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Aufl.
Volatilität Anlagegruppe (in %)	4.03	5.01	4.32	3.69	3.59
Volatilität Benchmark (in %)	3.68	5.05	4.35	3.77	3.53
Tracking Error ex post (in %)	0.42	0.56	0.53	0.59	0.69
Information Ratio	-0.96	-0.25	0.28	-0.05	0.29
Sharpe Ratio	-0.51	-0.80	-0.77	-0.22	0.22
Korrelation	1.00	0.99	0.99	0.99	0.98
Beta	1.09	0.99	0.99	0.97	1.00
Jensen-Alpha	-0.25	-0.20	0.10	-0.06	0.20
Maximum Drawdown (in %)	-4.31	-12.12	-18.93	-19.23	-19.23
Recovery Period (Jahre)	-	-	-	-	-

**PM-Tranche:** Der Erwerb dieser Tranche ist nur im Rahmen einer speziellen Vereinbarung mit Swiss Life Asset Management AG möglich.  
**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](http://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.

### Performance



### Produktinformationen

**Valorennummer:** 11956107

**ISIN:** CH0119561071

**LEI:** 254900H7WEVS3K9ANR90

**Bloomberg-Code:** SWLGS PM SW

**Benchmark:** BLOOMBERG GLOBAL AGG TREAS EX CHF TR HEDGED CHF

**Währung:** CHF

**Domizil:** Schweiz

**Aufliedatum:** 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](http://www.swisslife.ch/anlagestiftung)

**Betriebsaufwandquote TER KGAST**

**ex ante:** 0.15%

**ex post per:** 30/09/2024 0.15%

# Anlagestiftung Swiss Life

## Obligationen Global Staaten+ PM (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%	-

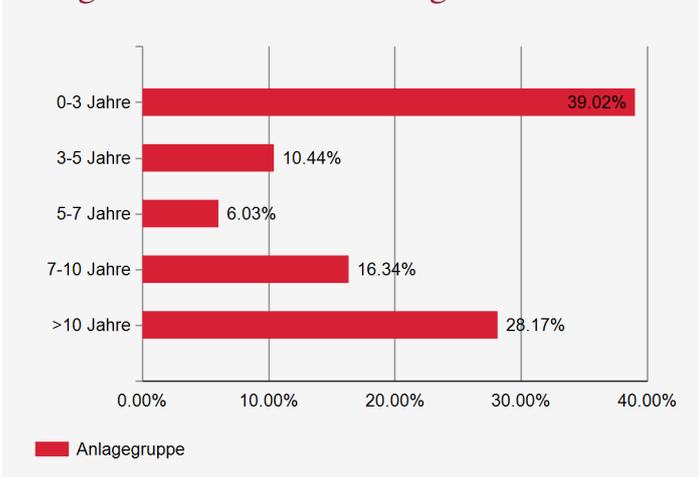
### Grösste Schuldner und Rating

	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%

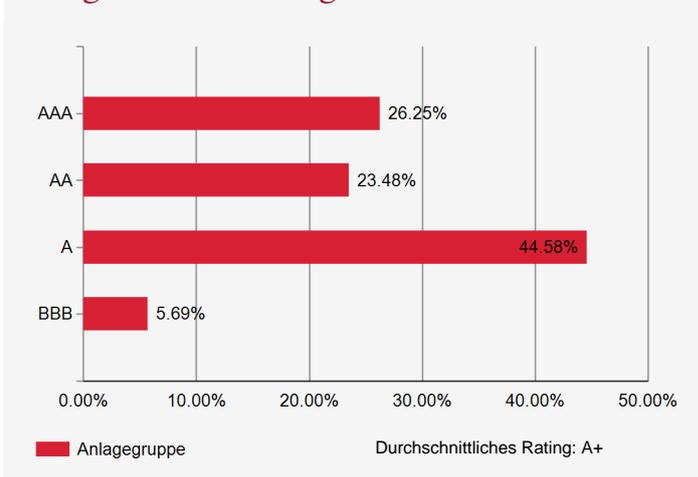
### Weitere Angaben zu den Schuldnern

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%	-