



# Anlagestiftung Swiss Life Obligationen Global Unternehmen Short Term PM (CHF hedged)

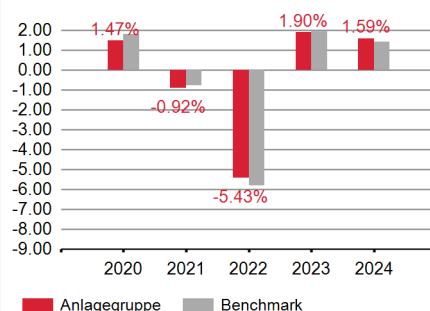
SwissLife

**Nettovermögen (NAV) in Mio. CHF: 1'851.38**  
**Nettovermögen pro Anspruch in CHF: 101.69**

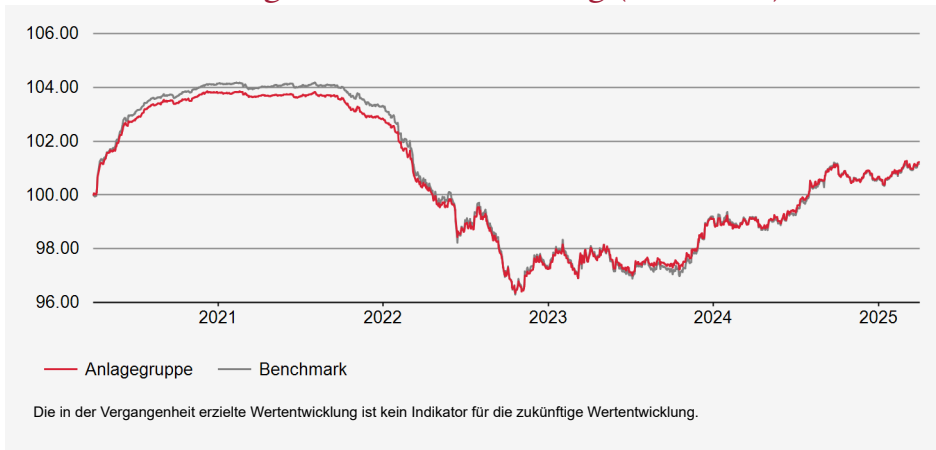
## Anlagestrategie

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".

## Performance



## Wertentwicklung in Referenzwährung (Basis 100)



## Produktinformationen

**Valorennummer:** 22073695

**ISIN:** CH0220736950

**LEI:** 2549003DSGO0RN37K507

**Bloomberg-Code:** SWLOGPM SW

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

**Währung:** CHF

**Domizil:** Schweiz

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

**Betriebsaufwandquote TER KGAST**

**ex ante:** 0.14%

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

## Performance in Referenzwährung

	Kumulierte Performance				Annualisierte Performance			
	YTD	1 Monat	3 Monate	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Aufl.
Anlagegruppe	0.54%	-0.02%	0.54%	2.13%	0.26%	0.24%	-0.10%	0.15%
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	1.90	1.68	1.59
Volatilität Benchmark (in %)	1.41	2.21	2.05	1.77	1.67
Tracking Error ex post (in %)	0.24	0.29	0.26	0.32	0.31
Information Ratio	0.51	0.28	0.05	0.12	0.25
Sharpe Ratio	0.86	-0.33	-0.02	0.09	0.24
Korrelation	0.99	0.99	0.99	0.98	0.98
Beta	0.92	0.91	0.91	0.94	0.94
Jensen-Alpha	0.21	0.01	0.01	0.05	0.10
Maximum Drawdown (in %)	-0.75	-4.07	-7.22	-7.22	-7.22
Recovery Period (Jahre)	0.12	1.79	-	-	-

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

**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.

# Anlagestiftung Swiss Life Obligationen Global Unternehmen Short Term PM (CHF hedged)

## 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%	-

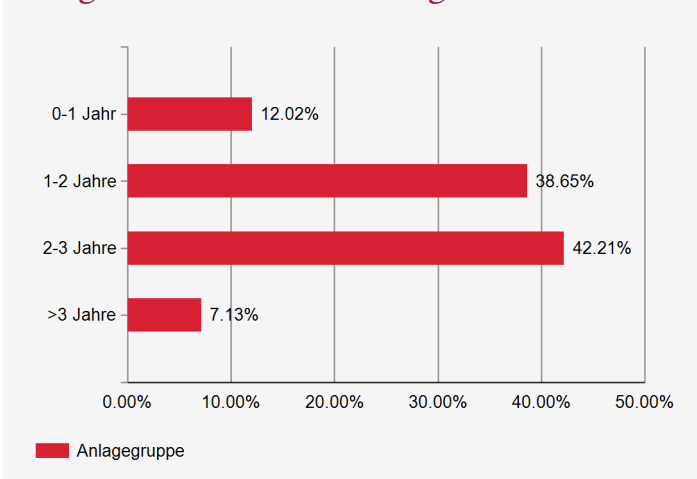
## Grösste Schuldner und Rating

	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%

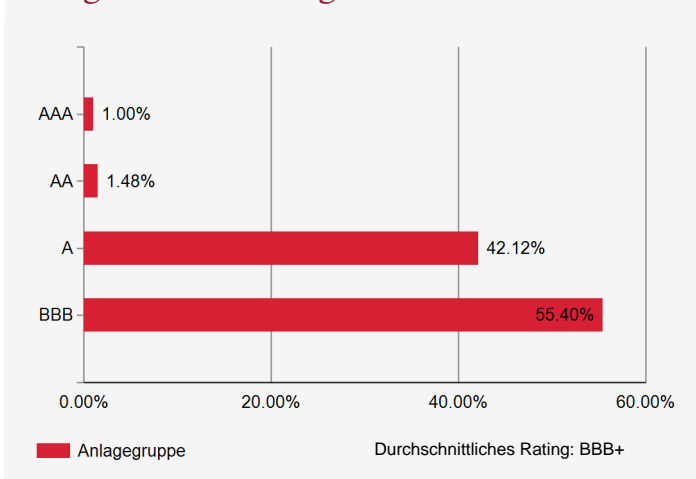
## Weitere Angaben zu den Schuldnern

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%	-