

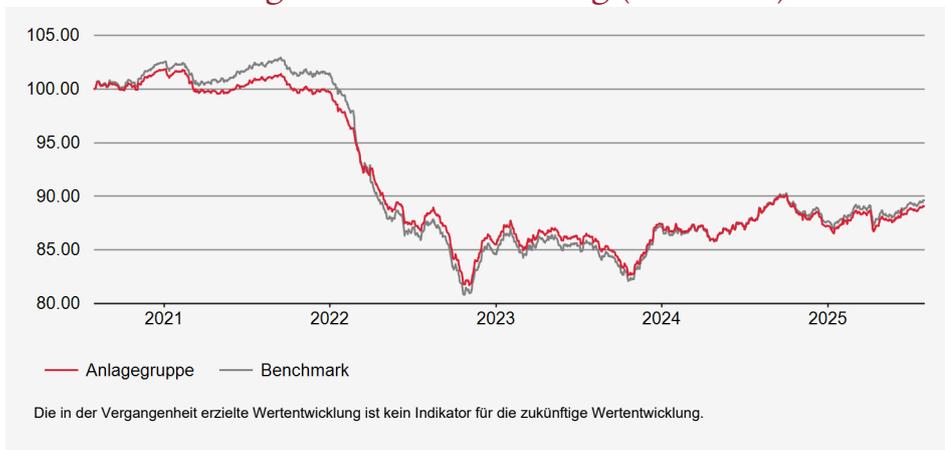
Anlagestiftung Swiss Life Obligationen Emerging Markets Unternehmen (CHF hedged)

Nettovermögen (NAV) in Mio. CHF: 354.14
Nettovermögen pro Anspruch in CHF: 93.62

Anlagestrategie

Anlagen in auf US Dollar oder auf andere Hartwährungen lautende Forderungspapiere von Unternehmen und Staaten, inklusive Agencies und Supranationals aus Schwellenländern (Emerging Markets). Aktive Titelselektion, Durationsteuerung und Zinskurvenpositionierung. Schuldnerbegrenzung: 10%. Forderungspapiere benchmarkfremder Schuldner: max.35%. Durchschnittliche Ratingqualität: mindestens BBB-. Fremdwährungsrisiken werden zu mindestens 90% gegen Schweizerfranken abgesichert. Umsetzung mittels Einsatz des Swiss Life Funds (LUX) Bond Emerging Markets Corporates CHF-hedged AM Cap; Anlagefonds nach luxemburgischem Recht.

Wertentwicklung in Referenzwährung (Basis 100)



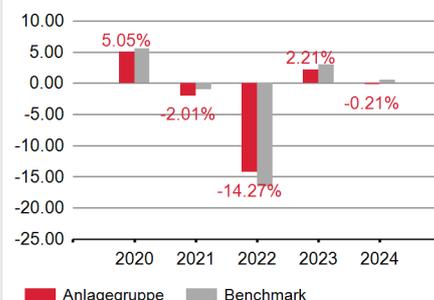
Performance in Referenzwährung

	Kumulierte Performance				Annualisierte Performance			
	YTD	1 Monat	3 Monate	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Aufl.
Anlagegruppe	2.10%	0.27%	1.10%	1.00%	0.33%	-2.29%	-	-0.84%
Benchmark	2.25%	0.29%	1.07%	1.60%	0.82%	-2.16%	-	-0.45%

Statistische Angaben (annualisiert)

	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Aufl.
Volatilität Anlagegruppe (in %)	3.28	5.39	5.01	-	5.38
Volatilität Benchmark (in %)	3.31	5.47	5.41	-	5.89
Tracking Error ex post (in %)	0.43	0.48	1.04	-	1.02
Information Ratio	-1.41	-1.02	-0.12	-	-0.38
Sharpe Ratio	0.13	-0.12	-0.53	-	-0.14
Korrelation	0.99	1.00	0.98	-	0.99
Beta	0.99	0.98	0.91	-	0.90
Jensen-Alpha	-0.58	-0.49	-0.35	-	-0.42
Maximum Drawdown (in %)	-3.97	-8.13	-19.77	-	-19.77
Recovery Period (Jahre)	-	1.78	-	-	-

Performance



Produktinformationen

Valorennummer: 36974875

ISIN: CH0369748758

LEI: 254900R4DORKK6JJUG51

Bloomberg-Code: SLOEMCH SW

Benchmark: JP Morgan CEMBI Broad Diversified IG Index (CHF Hedged)

Währung: CHF

Domizil: Schweiz

Aufliedatum: 29/09/2017

Erstausgabepreis: 100.00

Jahresabschluss: 30.09

Ausgabe/Rücknahme: Täglich

Annahmeschluss: 13.00 Uhr

Verwässerungsschutz:

Ausgabe- / Rücknahmekommission zugunsten der Anlagegruppe gemäss Konditionenübersicht.

Asset Management:

Swiss Life Asset Management AG

Überwachung Asset Manager:

Überwachung der Anlageresultate des eingesetzten Vermögensverwalters durch PPCmetrics

Kurspublikationen: Bloomberg: ASSL

www.swisslife.ch/anlagestiftung

Betriebsaufwandquote TER KGAST

ex ante: 0.78%

ex post per: 30/09/2024 0.82%

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.

Anlagestiftung Swiss Life

Obligationen Emerging Markets Unternehmen (CHF hedged)

Portfoliostruktur nach Branchen

	Anlagegruppe	Benchmark
Finanzwesen	32.47%	37.97%
Kommunikation	12.48%	8.53%
Versorgungsbetriebe	11.33%	10.82%
Basiskonsumgüter	10.49%	4.73%
Energie	9.46%	11.39%
Nicht-Basiskonsumgüter	4.95%	5.77%
Grundstoffe	4.86%	10.49%
Technologie	4.58%	4.86%
Supranational	1.25%	-
Andere	9.43%	5.43%
Liquidität	0.78%	-
Währungsabsicherung	-2.06%	-

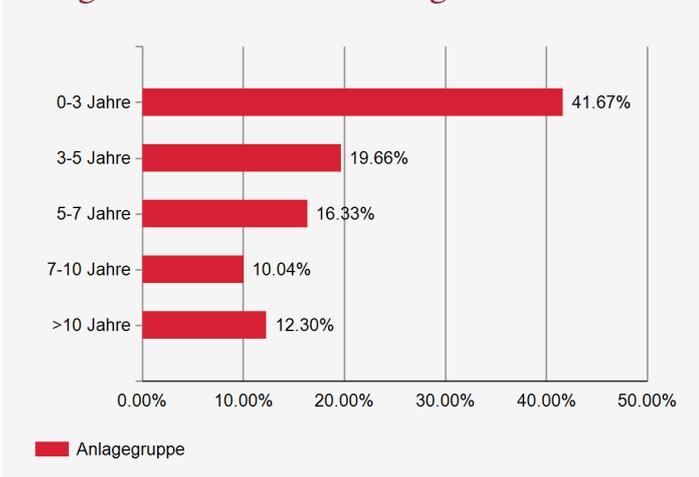
Grösste Schuldner und Rating

	Rating	Anlagegruppe
Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd	AA-	3.30%
US Treasury N/B	AA+	3.13%
Prosus NV	BBB	2.43%
OTP Bank Nyrt	BBB-	1.95%
Erste Group Bank AG	BBB+	1.87%

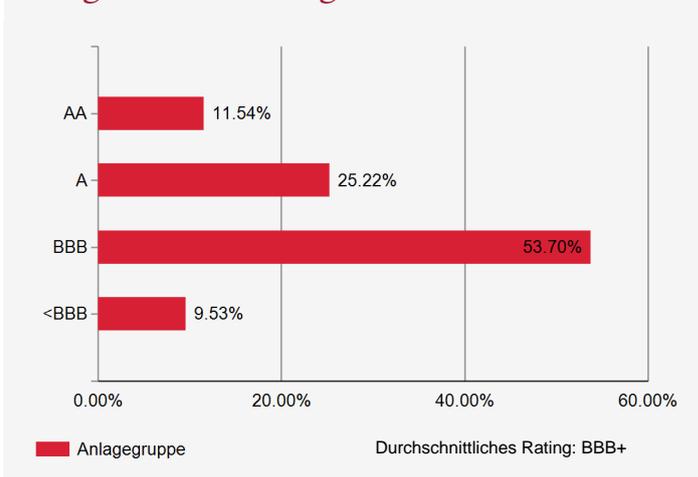
Weitere Angaben zu den Schuldnern

Anzahl Schuldner	144
Anteil Benchmarkfremde Schuldner	28.03%

Fälligkeitstruktur der Anlagen



Anlagen nach Rating



Duration und Rendite auf Verfall

	Anlagegruppe	Benchmark
Modified Duration	4.7	4.6
Theoretische Rendite auf Verfall*	5.18%	5.11%

* vor Währungsabsicherung

Portfoliostruktur nach Ländern/Regionen

	Anlagegruppe	Benchmark
China	7.79%	12.86%
Vereinigte Arabische Emirate	7.28%	5.94%
Südkorea	5.61%	7.52%
Indien	5.15%	3.98%
Singapur	4.98%	4.02%
Mexiko	4.95%	4.71%
Indonesien	4.49%	3.74%
Schwellenländer Asien Pazifik	13.79%	15.98%
Schwellenländer Lateinamerika	11.92%	8.45%
Schwellenländer im mittleren Osten	10.80%	15.78%
Andere	24.53%	17.02%
Liquidität, Absicherung	-1.28%	-