

# Anlagestiftung Swiss Life

## Obligationen Global Staaten+ (CHF hedged)

**Nettovermögen (NAV) in Mio. CHF: 577.00**  
**Nettovermögen pro Anspruch in CHF: 121.49**

### Anlagestrategie

Anlagen in auf Fremdwährungen lautende 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). Benchmarkfremde 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	-3.45%	-0.65%	-2.11%	-3.25%	1.44%	0.10%	1.60%	1.80%
BENCHMARK	-3.12%	-0.35%	-1.86%	-3.00%	1.82%	0.26%	1.72%	1.80%

### Statistische Angaben (annualisiert)

	1 JAHR	3 JAHRE	5 JAHRE	10 JAHRE	AUFL.
Volatilität Anlagegruppe (in %)	2.79	3.04	2.68	2.89	2.96
Volatilität Benchmark (in %)	2.82	3.15	2.80	2.82	2.85
Tracking Error ex post (in %)	0.41	0.62	0.52	0.67	0.72
Information Ratio	-0.61	-0.61	-0.30	-0.18	0.01
Sharpe Ratio	-0.97	0.71	0.32	0.73	0.76
Korrelation	0.99	0.98	0.98	0.97	0.97
Beta	0.98	0.95	0.94	0.99	1.00
Jensen-Alpha	-0.30	-0.24	-0.09	-0.10	0.00
Maximum Drawdown (in %)	-3.72	-4.82	-4.82	-6.37	-6.37
Recovery Period (Jahre)	-	-	-	0.82	0.82

**Benchmark:** Bis 30.06.12 60% Citigroup WGBI, ex CH (CHF hedged).

**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.

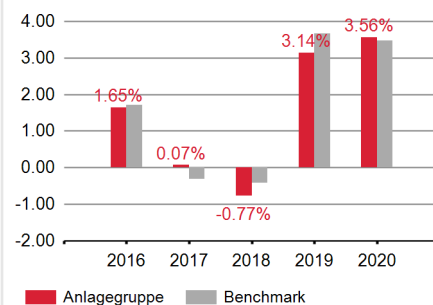
**Betriebsaufwandquote TER KGAST:** Die Betriebsaufwandquote TER KGAST deckt sämtliche Kosten mit Ausnahme der Transaktionskosten und der transaktionsbezogenen steuerlichen Abgaben ab.

**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.

### Performance



### Produktinformationen

**Valorennummer:** 11955694

**ISIN:** CH0119556949

**LEI:** 254900H7WEVS3K9ANR90

**Bloomberg-Code:** SWLGSTP SW

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

**Währung:** CHF

**Domizil:** Schweiz

**Aufgatedatum:** 14/12/2010

**Ausgabepreis:** 100.00

**Jahresabschluss:** 30.09

**Ausgabe/Rücknahme:** Täglich

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

**Betriebsaufwandquote TER KGAST**

**ex ante:** 0.42%

**ex post per:** 30/09/2021 0.42%

# Anlagestiftung Swiss Life

## Obligationen Global Staaten+ (CHF hedged)

### Portfoliostruktur nach Branchen

	Anlagegruppe	Benchmark
STAATLICH UND STAATSNAH	85.52%	100.00%
FINANZWESEN	3.80%	-
NICHT-BASISKONSUMGÜTER	0.47%	-
GRUNDSTOFFE	0.31%	-
INDUSTRIE	0.13%	-
SUPRANATIONAL	4.70%	-
LIQUIDITÄT	3.45%	-
WÄHRUNGSABSICHERUNG	1.62%	-

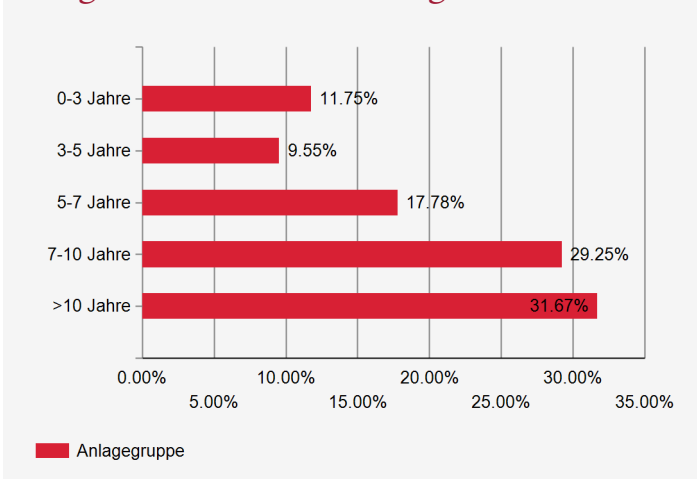
### Grösste Schuldner und Rating

	Rating	Anlagegruppe
US Treasury N/B	AA+	25.63%
Japan	A+	19.31%
Italien	BBB-	7.31%
Vereinigtes Königreich	AA-	4.29%
People's Republic of China	A+	4.14%

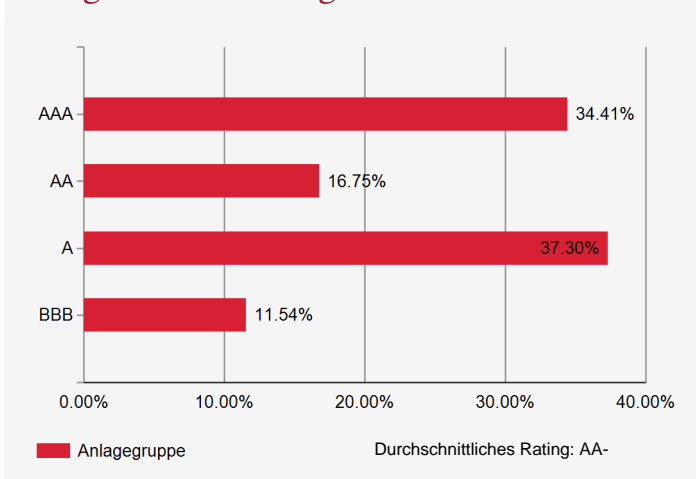
### Weitere Angaben zu den Schuldnern

Anzahl Schuldner	75
Anteil Nicht-Benchmark-Schuldner	1.61%

### Fälligkeitstruktur der Anlagen



### Anlagen nach Rating



### Duration und Rendite auf Verfall

	Anlagegruppe	Benchmark
Modified Duration*	7.9	8.5
Theoretische Rendite auf Verfall*	0.91%	1.11%

\* Vor Währungsabsicherung, unter Berücksichtigung der Derivate

### Portfolio nach Währungen und Duration

	Anlagegruppe		Benchmark	
	Gewichtung	Duration	Gewichtung	Duration
USD	30.15%	6.49	28.38%	6.96
EUR	28.89%	6.87	24.90%	8.60
JPY	20.32%	11.12	23.08%	9.74
GBP	8.97%	9.80	6.84%	13.01
Andere	11.67%	6.35	16.79%	7.21

### Portfoliostruktur nach Ländern/Regionen

	Anlagegruppe	Benchmark
VEREINIGTE STAATEN	25.72%	28.67%
JAPAN	20.40%	23.31%
ITALIEN	7.31%	5.55%
VEREINIGTES KÖNIGREICH	4.86%	6.91%
CHINA	4.56%	6.52%
KANADA	4.48%	1.80%
DEUTSCHLAND	4.48%	4.48%
EUROPÄISCHE REGION (EUR)	15.14%	14.71%
SCHWELLENLÄNDER LATEINAMERIKA	1.95%	0.09%
ASIEN-PAZIFIK-RAUM	1.60%	1.60%
ANDERE	4.42%	6.37%
LIQUIDITÄT, ABSICHERUNG	5.07%	-