

Anlagestiftung Swiss Life Obligationen CHF Ausland

Nettovermögen (NAV) in Mio. CHF: 479.47
Nettovermögen pro Anspruch in CHF: 153.46

Anlagestrategie

Anlagen in auf CHF lautende Forderungspapiere von Schuldern, die vorwiegend im Ausland domiziliert sind. Aktive Titelselektion, Durationsteuerung und Zinskurvenpositionierung. Schuldnerbegrenzung: 10%. Forderungspapiere benchmarkfremder Schuldner: max. 20%. Durchschnittliche Ratingqualität: mindestens A. Umsetzung mittels Einsatz des Swiss Life iFunds (CH) Bond Swiss Francs Foreign (CHF); Anlagefonds schweizerischen Rechts der Kategorie "Übrige Fonds für traditionelle Anlagen".

Wertentwicklung in Referenzwährung (Basis 100)



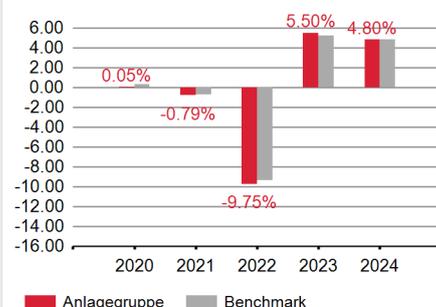
Performance in Referenzwährung

	Kumulierte Performance				Annualisierte Performance			
	YTD	1 Monat	3 Monate	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Aufl.
Anlagegruppe	0.79%	0.33%	0.46%	2.97%	2.66%	0.17%	0.26%	1.81%
Benchmark	0.62%	0.26%	0.37%	2.94%	2.58%	0.17%	0.32%	1.93%

Statistische Angaben (annualisiert)

	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Aufl.
Volatilität Anlagegruppe (in %)	1.45	2.87	3.15	3.39	3.17
Volatilität Benchmark (in %)	1.47	2.85	3.13	3.25	3.02
Tracking Error ex post (in %)	0.14	0.19	0.21	0.28	0.84
Information Ratio	0.25	0.48	-0.02	-0.22	-0.13
Sharpe Ratio	1.63	0.57	-0.05	0.14	0.50
Korrelation	0.99	1.00	1.00	1.00	0.96
Beta	0.98	1.01	1.00	1.04	1.01
Jensen-Alpha	0.08	0.08	0.00	-0.08	-0.14
Maximum Drawdown (in %)	-1.60	-4.86	-12.77	-14.23	-14.23
Recovery Period (Jahre)	0.13	0.89	-	-	-

Performance



Produktinformationen

Valorennummer: 1245477
ISIN: CH0012454770
LEI: 2549002XPEQH1AZYBW05
Bloomberg-Code: SWAOBAU SW
Benchmark: SBI Foreign AAA - BBB TR
Währung: CHF
Domizil: Schweiz
Aufgatedatum: 30/09/2001
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: 0.26%
ex post per: 30/09/2024 0.27%

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.

Portfoliostruktur nach Branchen

	Anlagegruppe	Benchmark
Finanzwesen	63.09%	47.51%
Staatlich und staatsnah	8.22%	17.18%
Pfandbriefinstitute	5.66%	12.92%
Nicht-Basiskonsumgüter	4.85%	4.34%
Basiskonsumgüter	4.12%	5.01%
Versorgungsbetriebe	3.86%	3.62%
Industrial	2.82%	5.38%
Grundstoffe	1.27%	0.84%
Supranational	4.87%	-
Andere	1.30%	3.20%
Liquidität	-0.05%	-

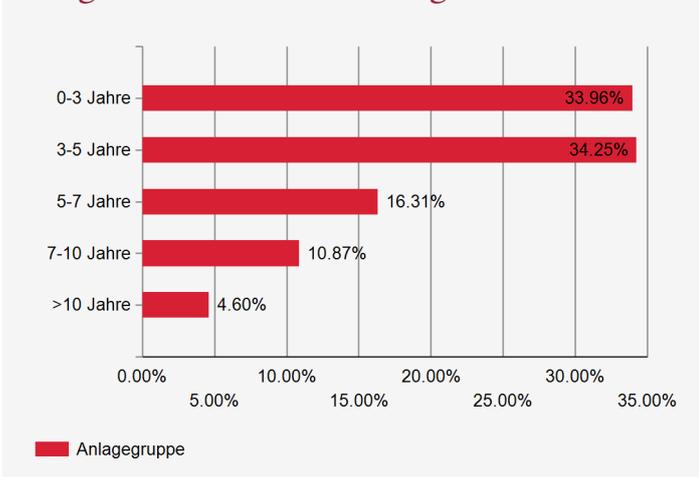
Grösste Schuldner und Rating

	Rating	Anlagegruppe
Banco Santander SA, Madrid	A	4.44%
Credit Agricole Group	A+	3.43%
Groupe BPCE	AA	3.40%
Bank of Nova Scotia/The	A+	3.24%
Müchener Hypothekenbank	AA	2.83%

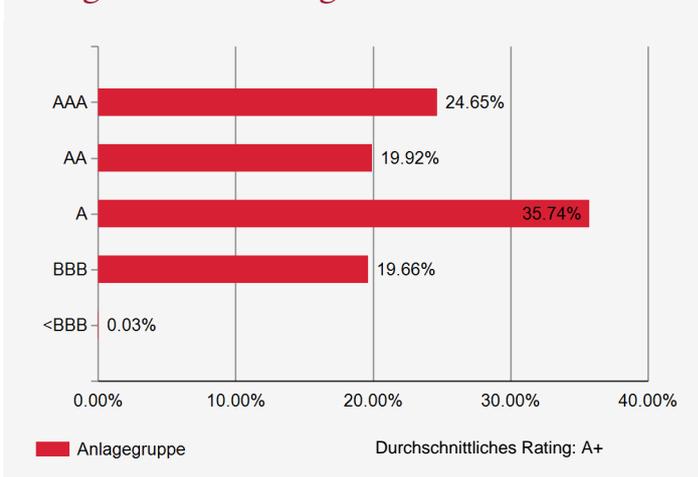
Weitere Angaben zu den Schuldnern

Anzahl Schuldner	139
Anteil Benchmarkfremde Schuldner	2.88%

Fälligkeitstruktur der Anlagen



Anlagen nach Rating



Duration und Rendite auf Verfall

	Anlagegruppe	Benchmark
Modified Duration	4.5	4.3
Theoretische Rendite auf Verfall*	0.80%	0.69%

* vor Währungsabsicherung

Portfoliostruktur nach Ländern/Regionen

	Anlagegruppe	Benchmark
Frankreich	14.87%	16.06%
Deutschland	14.22%	14.14%
Kanada	13.02%	11.61%
Vereinigte Staaten	12.39%	13.70%
Spanien	6.02%	4.52%
Australien	5.84%	6.04%
Vereinigtes Königreich	4.96%	3.99%
Europäische Region (Ex EUR)	7.12%	5.56%
Europäische Region (EUR)	5.81%	11.67%
Schwellenländer Lateinamerika	5.77%	3.59%
Andere	10.03%	9.12%
Liquidität, Absicherung	-0.05%	-