

Anlagestiftung Swiss Life

Obligationen Global Aggregate PM (CHF hedged)

Nettovermögen (NAV) in Mio. CHF: 67.25
Nettovermögen pro Anspruch in CHF: 117.70

Anlagestrategie

Anlagen in Forderungspapiere von Schuldern mit Domizil im In- oder Ausland (seit 1.1.2011 CHF hedged). 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 Swiss Life iFunds (CH) Bond Global Aggregate (CHF hedged); Anlagefonds schweizerischen Rechts der Kategorie "Übrige Fonds für traditionelle Anlagen".

Wertentwicklung in Referenzwährung (Basis 100)



Performance in Referenzwährung

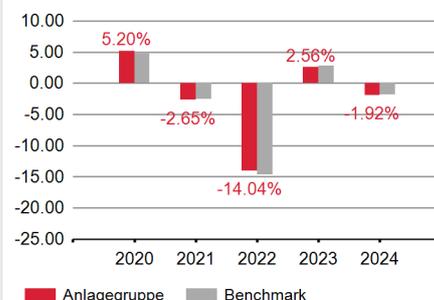
	Kumulierte Performance				Annualisierte Performance			
	YTD	1 Monat	3 Monate	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Aufl.
Anlagegruppe	-0.08%	-1.06%	-0.08%	-0.93%	-2.98%	-2.30%	-0.69%	0.92%
Benchmark	0.12%	-0.84%	0.12%	-0.53%	-2.92%	-2.46%	-0.78%	0.68%

Statistische Angaben (annualisiert)

	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Aufl.
Volatilität Anlagegruppe (in %)	4.53	5.88	5.13	4.30	5.59
Volatilität Benchmark (in %)	4.24	6.06	5.26	4.36	5.58
Tracking Error ex post (in %)	0.45	0.58	0.52	0.56	1.36
Information Ratio	-0.89	-0.11	0.30	0.14	0.17
Sharpe Ratio	-0.42	-0.67	-0.51	-0.10	0.16
Korrelation	1.00	1.00	1.00	0.99	0.97
Beta	1.07	0.97	0.97	0.98	0.97
Jensen-Alpha	-0.30	-0.19	0.08	0.07	0.25
Maximum Drawdown (in %)	-4.63	-12.61	-19.52	-19.52	-19.52
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, «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: 3026055
ISIN: CH0030260555
LEI: 254900F82G5L48XPDV74
Bloomberg-Code: SLOFGPM SW
Benchmark: BLOOMBERG GLO AGG EX SEC EX CNY HEDGED CHF
Währung: CHF
Domizil: Schweiz
Aufgatedatum: 31/05/2007
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

Betriebsaufwandquote TER KGAST

ex ante: 0.15%

ex post per: 30/09/2024 0.15%

Anlagestiftung Swiss Life

Obligationen Global Aggregate PM (CHF hedged)

Portfoliostruktur nach Branchen

	Anlagegruppe	Benchmark
Staatlich und staatsnah	45.93%	72.41%
Finanzwesen	21.57%	11.67%
Basiskonsumgüter	6.54%	3.97%
Nicht-Basiskonsumgüter	3.13%	1.76%
Kommunikation	2.84%	1.89%
Versorgungsbetriebe	2.84%	2.74%
Technologie	2.61%	1.15%
Energie	1.58%	1.69%
Supranational	7.18%	-
Andere	1.50%	2.71%
Liquidität	4.55%	-
Währungsabsicherung	-0.26%	-

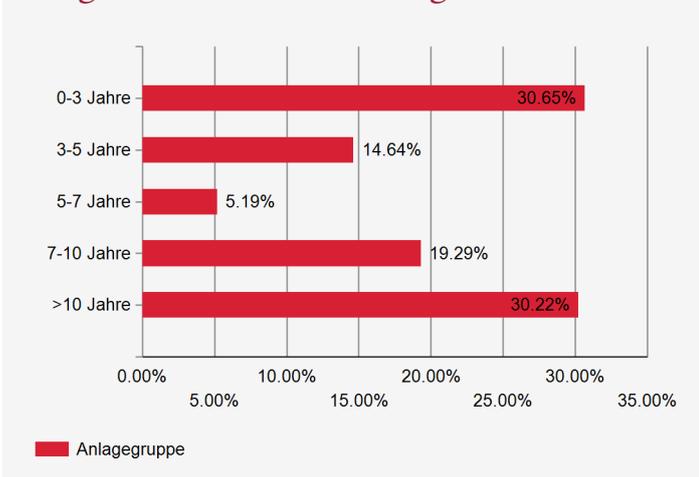
Grösste Schuldner und Rating

	Rating	Anlagegruppe
Japan	A+	16.64%
US Treasury N/B	AAA	7.73%
Italien	BBB	3.62%
European Union	AA+	3.39%
Corp Andina de Fomento	AA-	2.39%

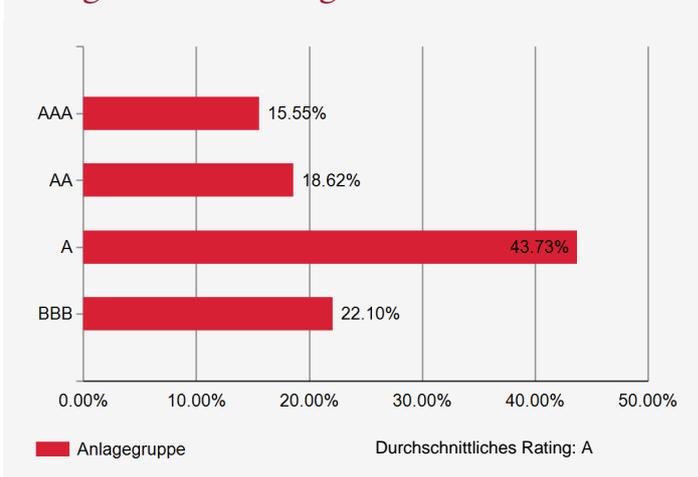
Weitere Angaben zu den Schuldnern

Anzahl Schuldner	122
Anteil Benchmarkfremde Schuldner	0.00%

Fälligkeitstruktur der Anlagen



Anlagen nach Rating



Duration und Rendite auf Verfall

	Anlagegruppe	Benchmark
Modified Duration*	7.0	6.6
Theoretische Rendite auf Verfall*	3.91%	3.85%

* Vor Währungsabsicherung, unter Berücksichtigung der Derivate

Portfoliostruktur nach Ländern/Regionen

	Anlagegruppe	Benchmark
Vereinigte Staaten	25.61%	38.52%
Japan	19.62%	12.87%
Kanada	7.63%	4.36%
Frankreich	6.59%	6.03%
Deutschland	5.12%	5.78%
Italien	5.05%	4.00%
Vereinigtes Königreich	4.99%	5.26%
Europäische Region (EUR)	10.99%	8.86%
Schwellenländer Lateinamerika	3.94%	0.04%
Europäische Region (Ex EUR)	3.11%	1.27%
Andere	3.08%	13.02%
Liquidität, Absicherung	4.29%	-