

# Anlagestiftung Swiss Life

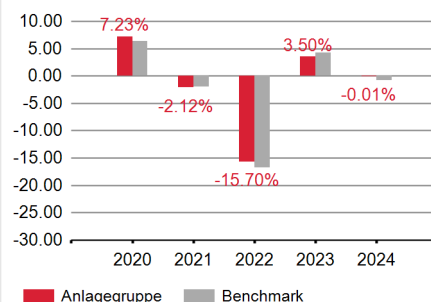
## Obligationen Global Unternehmen PM (CHF hedged)

**Nettovermögen (NAV) in Mio. CHF: 695.96**  
**Nettovermögen pro Anspruch in CHF: 126.77**

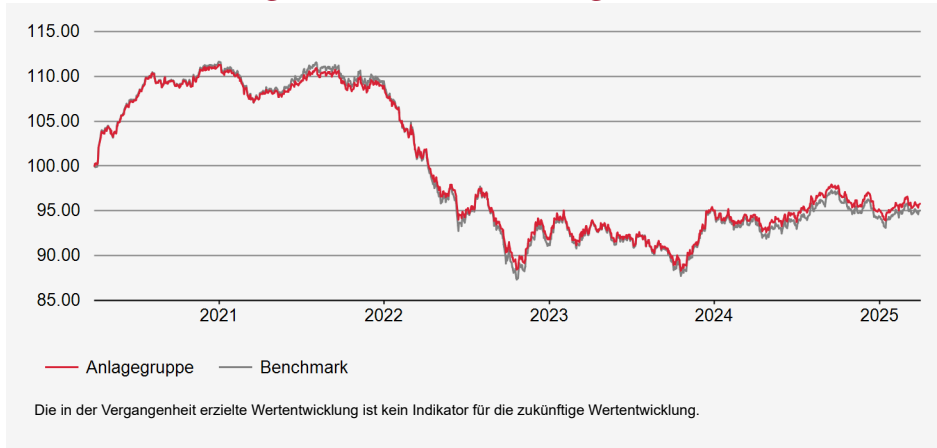
### Anlagestrategie

Anlagen in Forderungspapiere von Unternehmen inklusive Agencies und Supranationals. Aktive Titelselektion, Durationsteuerung und Zinskurvenpositionierung. Schuldnerebegrenzung: 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 (CHF hedged); Anlagenfonds schweizerischen Rechts der Kategorie "Übrige Fonds für traditionelle Anlagen".

### Performance



### Wertentwicklung in Referenzwährung (Basis 100)



### Produktinformationen

**Valorennummer:** 11956108  
**ISIN:** CH0119561089  
**LEI:** 254900C3B00LU0UJ428  
**Bloomberg-Code:** SWLGUPM SW  
**Benchmark:** BLOOMBERG GLO AGG CORP IND HEDGED CHF  
**Währung:** CHF  
**Domizil:** Schweiz  
**Aufliedatum:** 14/12/2010  
**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:** 0.15%

**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	0.80%	-0.73%	0.80%	1.31%	-2.01%	-0.85%	0.03%	1.67%
Benchmark	0.78%	-0.74%	0.78%	0.89%	-2.23%	-1.01%	-0.22%	1.25%

### Statistische Angaben (annualisiert)

	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Aufl.
Volatilität Anlagegruppe (in %)	4.49	6.92	6.32	5.45	5.15
Volatilität Benchmark (in %)	4.90	7.72	6.93	5.86	5.34
Tracking Error ex post (in %)	0.57	0.97	0.81	0.84	0.95
Information Ratio	0.73	0.22	0.19	0.30	0.44
Sharpe Ratio	0.07	-0.43	-0.18	0.05	0.36
Korrelation	1.00	1.00	1.00	0.99	0.98
Beta	0.91	0.89	0.91	0.92	0.95
Jensen-Alpha	0.41	-0.13	0.04	0.26	0.49
Maximum Drawdown (in %)	-4.08	-13.29	-20.63	-20.63	-20.63
Recovery Period (Jahre)	-	-	-	-	-

**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 PM (CHF hedged)

### Portfoliostruktur nach Branchen

	Anlagegruppe	Benchmark
Finanzwesen	47.02%	39.01%
Basiskonsumgüter	14.96%	16.12%
Energie	8.26%	6.05%
Versorgungsbetriebe	7.93%	9.13%
Kommunikation	6.18%	7.62%
Industrial	5.88%	7.15%
Technologie	5.50%	4.82%
Nicht-Basiskonsumgüter	3.08%	7.34%
Andere	1.16%	2.76%
Liquidität	0.20%	-
Währungsabsicherung	-0.17%	-

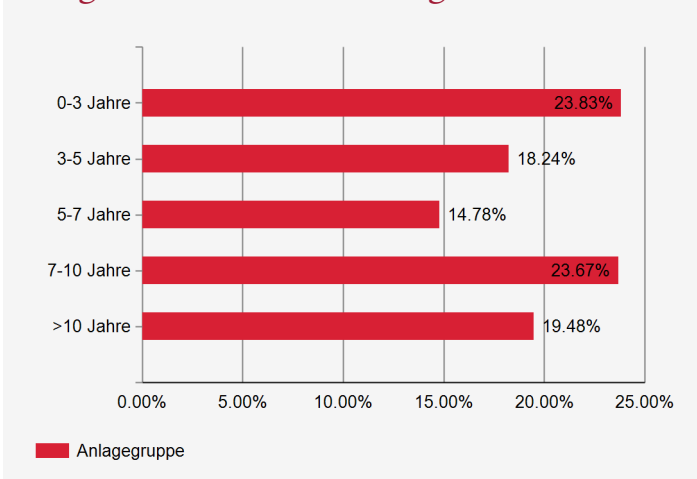
### Grösste Schuldner und Rating

	Rating	Anlagegruppe
JPMorgan Chase & Co	A	2.68%
Groupe BPCE	BBB+	2.30%
Banco Santander SA, Madrid	A-	2.12%
Barclays Capital PLC, London	BBB-	2.07%
Berkshire Hathaway Inc	AA	1.82%

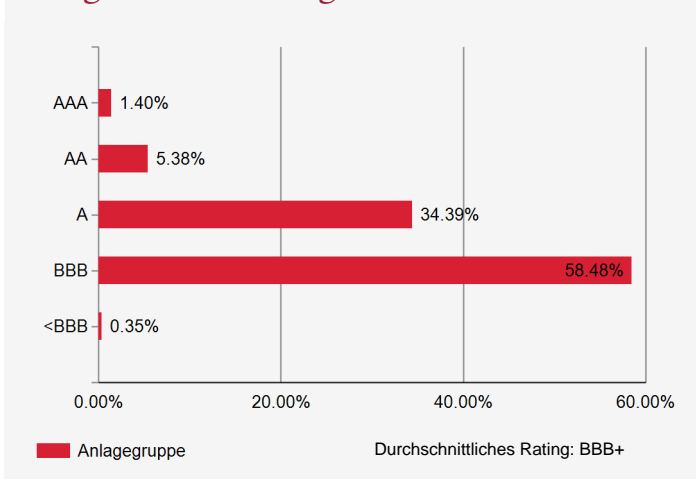
### Weitere Angaben zu den Schuldnern

Anzahl Schuldner	221
Anteil Benchmarkfremde Schuldner	5.20%

### Fälligkeitstruktur der Anlagen



### Anlagen nach Rating



### Duration und Rendite auf Verfall

	Anlagegruppe	Benchmark
Modified Duration*	6.2	5.9
Theoretische Rendite auf Verfall*	5.09%	5.04%

\* Vor Währungsabsicherung, unter Berücksichtigung der Derivate

### Portfolio nach Währungen und Duration

	Anlagegruppe		Benchmark	
	Gewichtung	Duration	Gewichtung	Duration
USD	63.29%	6.99	67.46%	6.44
EUR	26.17%	4.66	23.81%	4.31
CHF	3.56%	3.46	0.36%	4.11
JPY	3.44%	1.80	0.67%	3.86
Andere	3.54%	6.54	7.70%	5.42

### Portfoliostruktur nach Ländern/Regionen

	Anlagegruppe	Benchmark
Vereinigte Staaten	45.93%	56.57%
Vereinigtes Königreich	9.71%	6.73%
Frankreich	7.99%	6.14%
Deutschland	5.05%	4.93%
Spanien	4.17%	2.21%
Schweiz	3.78%	1.27%
Australien	3.27%	2.24%
Europäische Region (EUR)	7.53%	5.49%
Asien-Pazifik-Raum	3.21%	3.24%
Schwellenländer Asien Pazifik	2.41%	1.54%
Andere	6.91%	9.64%
Liquidität, Absicherung	0.03%	-