

# Anlagestiftung Swiss Life

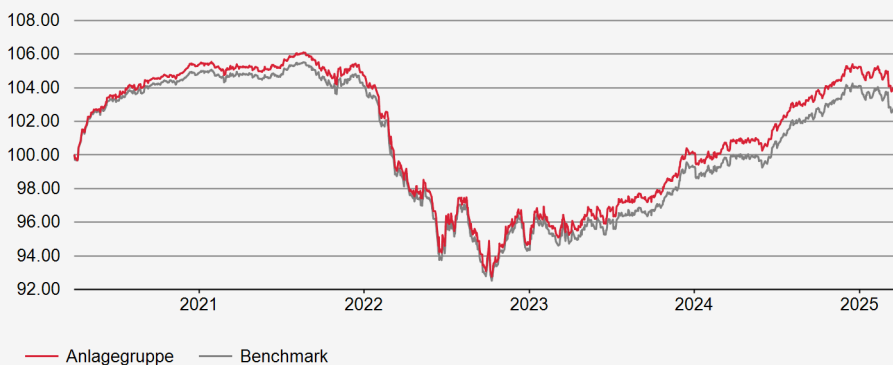
## Obligationen CHF Ausland PM

**Nettovermögen (NAV) in Mio. CHF: 425.03**  
**Nettovermögen pro Anspruch in CHF: 137.88**

### 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)



Die in der Vergangenheit erzielte Wertentwicklung ist kein Indikator für die zukünftige Wertentwicklung.

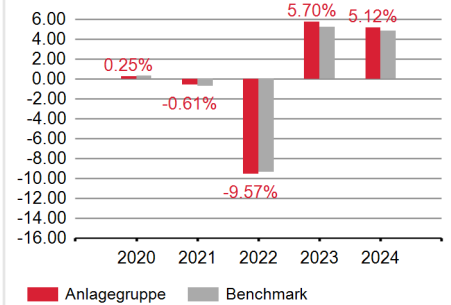
### Performance in Referenzwährung

	Kumulierte Performance				Annualisierte Performance			
	YTD	1 Monat	3 Monate	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Aufl.
Anlagegruppe	-0.30%	-0.08%	-0.30%	4.04%	1.99%	0.97%	0.34%	1.82%
Benchmark	-0.43%	-0.10%	-0.43%	3.72%	1.71%	0.72%	0.23%	1.68%

### Statistische Angaben (annualisiert)

	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	10 Jahre	Aufl.
Volatilität Anlagegruppe (in %)	2.06	3.26	3.30	3.38	3.43
Volatilität Benchmark (in %)	2.11	3.25	3.26	3.24	3.21
Tracking Error ex post (in %)	0.11	0.18	0.22	0.28	0.94
Information Ratio	2.83	1.59	1.14	0.41	0.14
Sharpe Ratio	1.45	0.32	0.20	0.18	0.52
Korrelation	1.00	1.00	1.00	1.00	0.96
Beta	0.97	1.00	1.01	1.04	1.03
Jensen-Alpha	0.40	0.28	0.24	0.10	0.08
Maximum Drawdown (in %)	-1.54	-6.48	-12.57	-13.71	-13.71
Recovery Period (Jahre)	-	1.14	-	-	-

### Performance



### Produktinformationen

**Valorennummer:** 3026054  
**ISIN:** CH0030260548  
**LEI:** 2549002XPEQH1AZYBW05  
**Bloomberg-Code:** SLOCAPM SW  
**Benchmark:** SBI Foreign AAA - BBB TR  
**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](http://www.swisslife.ch/anlagestiftung)

**Betriebsaufwandquote TER KGAST ex ante:** 0.08%

**ex post per:** 30/09/2024 0.08%

**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.

### Portfoliostruktur nach Branchen

	Anlagegruppe	Benchmark
Finanzwesen	64.57%	48.24%
Staatlich und staatsnah	7.58%	16.60%
Pfandbriefinstitute	5.43%	14.24%
Nicht-Basiskonsumgüter	4.60%	4.64%
Versorgungsbetriebe	3.83%	3.13%
Basiskonsumgüter	3.55%	3.93%
Industrial	3.14%	5.40%
Kommunikation	-	1.54%
Supranational	4.52%	-
Andere	1.52%	2.29%
Liquidität	1.25%	-

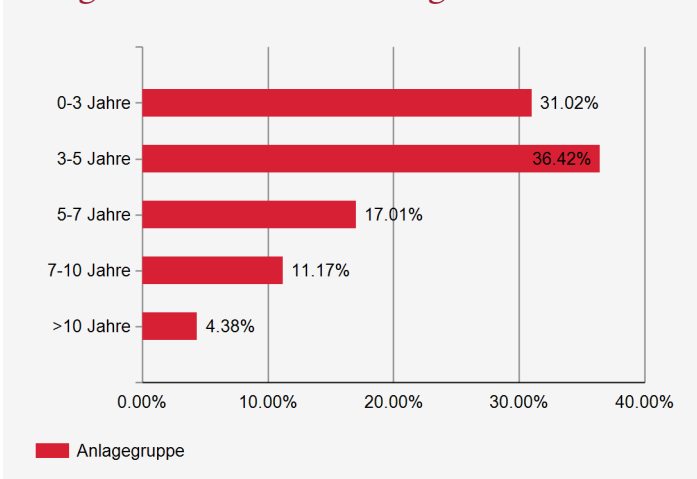
### Grösste Schuldner und Rating

	Rating	Anlagegruppe
Banco Santander SA, Madrid	A	4.66%
Groupe BPCE	AA	3.82%
Müchener Hypothekenbank	AA	3.53%
Bank of Nova Scotia/The	AA-	3.21%
Credit Agricole Group	AA-	3.09%

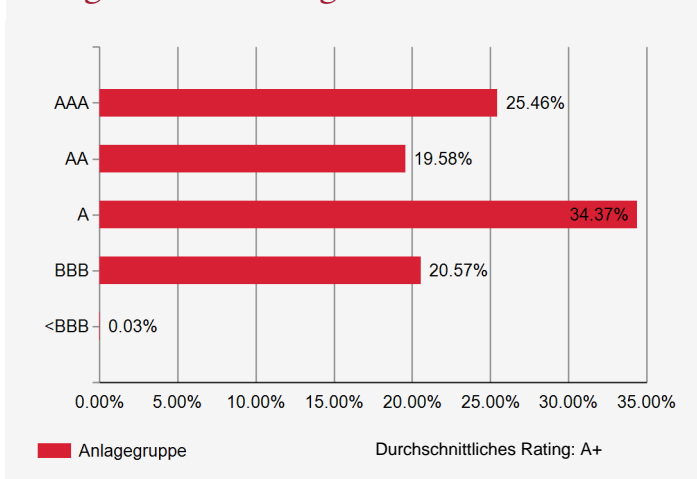
### Weitere Angaben zu den Schuldnern

Anzahl Schuldner	125
Anteil Benchmarkfremde Schuldner	2.20%

### Fälligkeitstruktur der Anlagen



### Anlagen nach Rating



### Duration und Rendite auf Verfall

	Anlagegruppe	Benchmark
Modified Duration*	4.3	4.3
Theoretische Rendite auf Verfall*	1.09%	0.97%

\* Vor Währungsabsicherung, unter Berücksichtigung der Derivate

### Portfoliostruktur nach Ländern/Regionen

	Anlagegruppe	Benchmark
Frankreich	15.51%	16.63%
Deutschland	14.46%	14.11%
Kanada	11.95%	11.64%
Vereinigte Staaten	11.00%	12.42%
Spanien	6.41%	4.79%
Australien	6.06%	5.87%
Vereinigtes Königreich	5.28%	3.73%
Europäische Region (Ex EUR)	6.53%	6.28%
Schwellenländer Lateinamerika	5.66%	3.68%
Europäische Region (EUR)	5.49%	12.18%
Andere	10.41%	8.66%
Liquidität, Absicherung	1.25%	-