

Anlagestiftung Swiss Life Obligationen Global Unternehmen Short Term PM (CHF hedged)



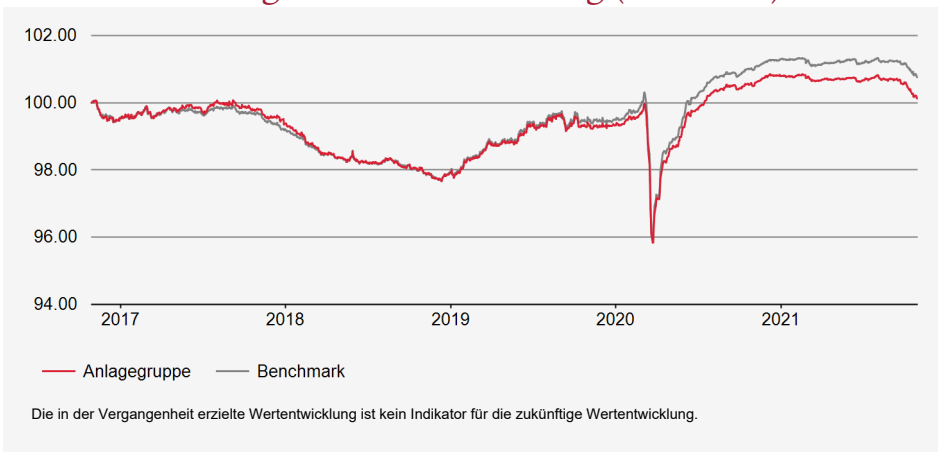
SwissLife

Nettovermögen (NAV) in Mio. CHF: 1'381.18
Nettovermögen pro Anspruch in CHF: 103.58

Anlagestrategie

Anlagen in auf Fremdwährungen lautende Forderungspapiere von Unternehmen inklusive Agencies und Supranationals mit einer kurzen Restlaufzeit (mehrheitlich unter 3 Jahren). Aktive Titelselektion, Durationsteuerung und Zinskurvenpositionierung. Schuldnerbegrenzung: 10%. Benchmarkfremde 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 Short Term (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	-0.66%	-0.43%	-0.66%	-0.38%	0.73%	0.02%	-	0.44%
BENCHMARK	-0.53%	-0.38%	-0.54%	-0.22%	0.94%	0.15%	-	0.39%

Statistische Angaben (annualisiert)

	1 JAHR	3 JAHRE	5 JAHRE	10 JAHRE	AUFL.
Volatilität Anlagegruppe (in %)	0.59	1.99	1.60	-	1.37
Volatilität Benchmark (in %)	0.54	2.07	1.66	-	1.36
Tracking Error ex post (in %)	0.13	0.15	0.16	-	0.32
Information Ratio	-1.18	-1.41	-0.80	-	0.14
Sharpe Ratio	0.39	0.73	0.49	-	0.79
Korrelation	0.98	1.00	1.00	-	0.97
Beta	1.06	0.96	0.96	-	0.97
Jensen-Alpha	-0.18	-0.15	-0.09	-	0.07
Maximum Drawdown (in %)	-0.72	-4.13	-4.22	-	-4.53
Recovery Period (Jahre)	-	0.31	0.33	-	0.38

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.

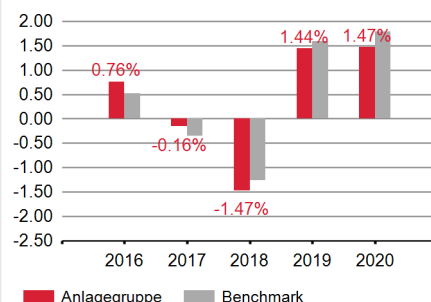
Betriebsaufwandquote TER KGAST: Die Betriebsaufwandquote TER KGAST deckt sämtliche Kosten mit Ausnahme der Transaktionskosten und der transaktionsbezogenen steuerlichen Abgaben ab.

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: 22073695

ISIN: CH0220736950

LEI: 2549003DSGO0RN37K507

Bloomberg-Code: SWLOGPM SW

Benchmark: BLOOMBERG GLO AGG
CORP 1-3 YR IND HEDGED CHF

Währung: CHF

Domizil: Schweiz

Aufgagedatum: 11/10/2013

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

Betriebsaufwandquote TER KGAST

ex ante: 0.15%

ex post per: 30/09/2021 0.15%

Anlagestiftung Swiss Life Obligationen Global Unternehmen Short Term PM (CHF hedged)

Portfoliostruktur nach Branchen

	Anlagegruppe	Benchmark
FINANZWESEN	55.01%	50.17%
BASISKONSUMGÜTER	13.07%	11.02%
NICHT-BASISKONSUMGÜTER	6.87%	9.23%
ENERGIE	4.78%	5.01%
VERSORGBETRIEBE	3.74%	5.31%
TECHNOLOGIE	3.51%	4.74%
GRUNDSTOFFE	3.32%	2.76%
KOMMUNIKATION	3.00%	4.84%
SUPRANATIONAL	0.73%	-
ANDERE	2.04%	6.94%
LIQUIDITÄT	2.76%	-
WÄHRUNGSABSICHERUNG	1.16%	-

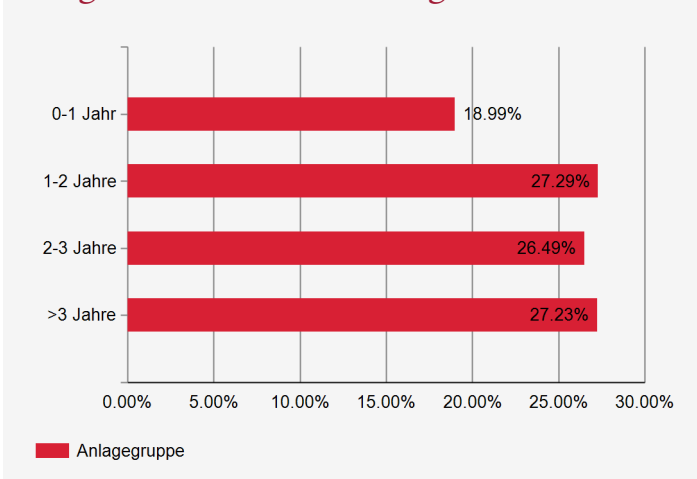
Grösste Schuldner und Rating

	Rating	Anlagegruppe
Bank of America Corp	BBB+	2.41%
Credit Suisse Group AG	A-	1.53%
Mizuho Financial Group Inc	A-	1.49%
Natwest Group PLC	BBB+	1.48%
Societe Generale SA	BBB	1.43%

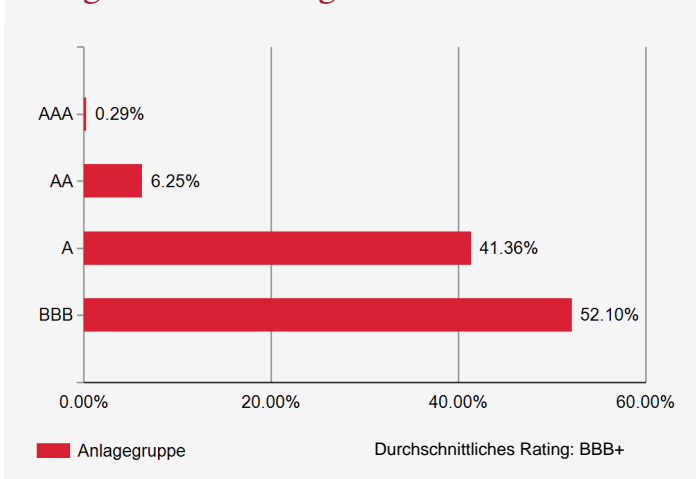
Weitere Angaben zu den Schuldnern

Anzahl Schuldner	182
Anteil Nicht-Benchmark-Schuldner	8.02%

Fälligkeitstruktur der Anlagen



Anlagen nach Rating



Duration und Rendite auf Verfall

	Anlagegruppe	Benchmark
Modified Duration*	1.6	1.8
Theoretische Rendite auf Verfall*	1.03%	0.92%

* Vor Währungsabsicherung, unter Berücksichtigung der Derivate

Portfolio nach Währungen und Duration

	Anlagegruppe		Benchmark	
	Gewichtung	Duration	Gewichtung	Duration
USD	49.68%	1.90	58.74%	1.81
EUR	38.49%	1.37	30.16%	1.89
GBP	6.48%	1.62	2.98%	1.98
CHF	5.34%	1.28	0.81%	1.90
Andere	-	-	7.31%	1.93

Portfoliostruktur nach Ländern/Regionen

	Anlagegruppe	Benchmark
VEREINIGTE STAATEN	27.41%	42.00%
VEREINIGTES KÖNIGREICH	11.12%	9.19%
JAPAN	6.72%	4.26%
FRANKREICH	6.47%	8.01%
DEUTSCHLAND	6.15%	6.60%
CHINA	5.20%	1.50%
SCHWEIZ	4.85%	2.11%
EUROPÄISCHE REGION (EUR)	12.07%	10.14%
EUROPÄISCHE REGION (EX EUR)	7.63%	4.10%
ASIEN-PAZIFIK-RAUM	2.42%	2.36%
ANDERE	6.03%	9.72%
LIQUIDITÄT, ABSICHERUNG	3.92%	-