

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

Nettovermögen (NAV) in Mio. CHF: 1'312.18
Nettovermögen pro Anspruch in CHF: 97.24

Anlagestrategie

Anlagen in Forderungspapiere von Unternehmen inklusive Agencies und Supranationals mit einer kurzen Restlaufzeit (mehrheitlich unter 3 Jahren). Aktive Titelselektion, Durationsteuerung und Zinskurvenpositionierung. Schuldnerbegrenzung: 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 Short Term (CHF hedged); Anlagefonds schweizerischen Rechts der Kategorie "Übrige Fonds für traditionelle Anlagen".

Wertentwicklung in Referenzwährung (Basis 100)



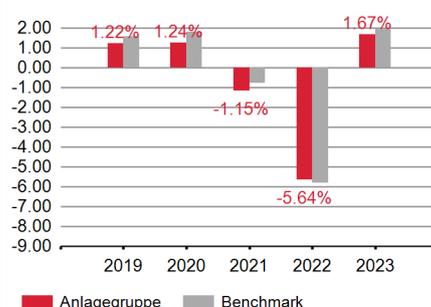
Performance in Referenzwährung

| | Kumulierte Performance | | | | Annualisierte Performance | | | |
|--------------|------------------------|---------|----------|--------|---------------------------|---------|----------|--------|
| | YTD | 1 Monat | 3 Monate | 1 Jahr | 3 Jahre | 5 Jahre | 10 Jahre | Aufl. |
| Anlagegruppe | -0.05% | 0.25% | -0.05% | 1.27% | -1.72% | -0.74% | -0.37% | -0.27% |
| Benchmark | -0.03% | 0.32% | -0.03% | 1.51% | -1.57% | -0.49% | -0.22% | -0.11% |

Statistische Angaben (annualisiert)

| | 1 Jahr | 3 Jahre | 5 Jahre | 10 Jahre | Aufl. |
|---------------------------------|--------|---------|---------|----------|-------|
| Volatilität Anlagegruppe (in %) | 1.44 | 2.00 | 2.17 | 1.64 | 1.61 |
| Volatilität Benchmark (in %) | 1.76 | 2.20 | 2.34 | 1.72 | 1.68 |
| Tracking Error ex post (in %) | 0.36 | 0.29 | 0.25 | 0.32 | 0.32 |
| Information Ratio | -0.65 | -0.52 | -1.02 | -0.49 | -0.48 |
| Sharpe Ratio | -0.25 | -1.06 | -0.31 | 0.00 | 0.05 |
| Korrelation | 0.99 | 1.00 | 1.00 | 0.98 | 0.98 |
| Beta | 0.81 | 0.90 | 0.92 | 0.94 | 0.94 |
| Jensen-Alpha | -0.26 | -0.35 | -0.29 | -0.15 | -0.14 |
| Maximum Drawdown (in %) | -1.20 | -7.45 | -7.61 | -8.08 | -8.08 |
| Recovery Period (Jahre) | 0.40 | - | - | - | - |

Performance



Produktinformationen

Valorennummer: 22073699

ISIN: CH0220736992

LEI: 2549003DSGO0RN37K507

Bloomberg-Code: SWLOGNT SW

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

Währung: CHF

Domizil: Schweiz

Auflagedatum: 11/10/2013

Erstausgabepreis: 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: 0.38%

ex post per: 30/09/2023 0.38%

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.

Portfoliostruktur nach Branchen

| | Anlagegruppe | Benchmark |
|------------------------|--------------|-----------|
| Finanzwesen | 57.67% | 51.70% |
| Basiskonsumgüter | 13.24% | 12.21% |
| Nicht-Basiskonsumgüter | 11.13% | 9.59% |
| Energie | 4.64% | 3.99% |
| Industrie | 3.33% | 6.05% |
| Versorgungsbetriebe | 2.59% | 5.10% |
| Kommunikation | 1.91% | 5.04% |
| Grundstoffe | 1.87% | 1.92% |
| Supranational | 0.73% | - |
| Andere | 2.02% | 4.50% |
| Liquidität | 1.12% | - |
| Währungsabsicherung | -0.26% | - |

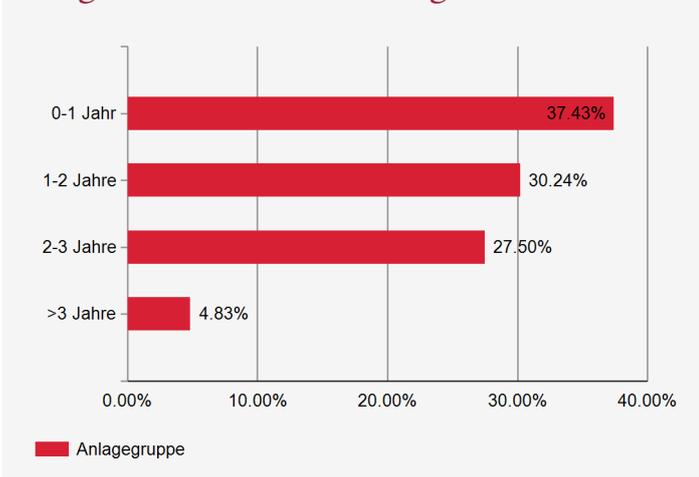
Grösste Schuldner und Rating

| | Rating | Anlagegruppe |
|------------------------------|--------|--------------|
| Banco Santander SA, Madrid | BBB+ | 2.89% |
| UBS Group AG | A | 2.77% |
| Porsche Automobil Holding SE | BBB | 2.33% |
| Barclays Capital PLC, London | BBB | 1.90% |
| Société Générale, Paris | BBB | 1.84% |

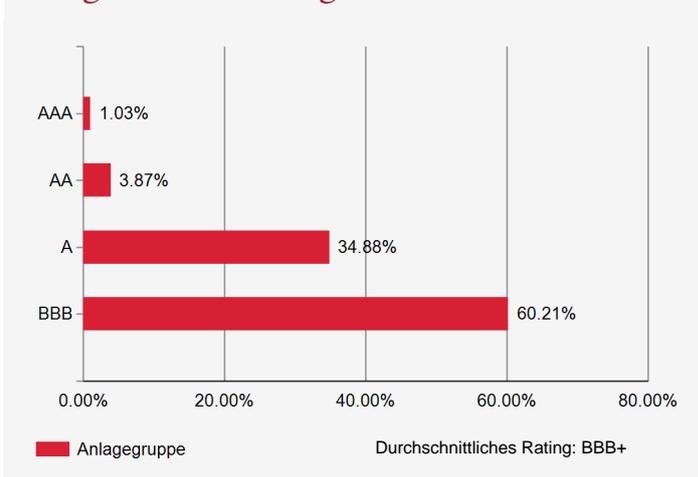
Weitere Angaben zu den Schuldnern

| | |
|----------------------------------|-------|
| Anzahl Schuldner | 152 |
| Anteil Benchmarkfremde Schuldner | 7.28% |

Fälligkeitstruktur der Anlagen



Anlagen nach Rating



Duration und Rendite auf Verfall

| | Anlagegruppe | Benchmark |
|-----------------------------------|--------------|-----------|
| Modified Duration* | 1.7 | 1.8 |
| Theoretische Rendite auf Verfall* | 5.38% | 4.73% |

* Vor Währungsabsicherung, unter Berücksichtigung der Derivate

Portfolio nach Währungen und Duration

| | Anlagegruppe | | Benchmark | |
|--------|--------------|----------|------------|----------|
| | Gewichtung | Duration | Gewichtung | Duration |
| USD | 55.59% | 1.70 | 61.14% | 1.90 |
| EUR | 31.34% | 1.67 | 29.29% | 2.05 |
| CHF | 8.83% | 1.49 | 0.44% | 2.01 |
| GBP | 3.68% | 1.83 | 3.66% | 2.12 |
| Andere | 0.56% | 1.88 | 5.57% | 2.04 |

Portfoliostruktur nach Ländern/Regionen

| | Anlagegruppe | Benchmark |
|-------------------------------|--------------|-----------|
| Vereinigte Staaten | 29.95% | 44.99% |
| Vereinigtes Königreich | 10.79% | 7.26% |
| Frankreich | 8.79% | 7.61% |
| Kanada | 8.23% | 5.58% |
| Deutschland | 6.21% | 6.46% |
| Schweiz | 5.90% | 2.09% |
| Japan | 4.46% | 4.69% |
| Europäische Region (EUR) | 12.06% | 10.64% |
| Europäische Region (Ex EUR) | 5.10% | 2.47% |
| Schwellenländer Asien Pazifik | 3.91% | 2.62% |
| Andere | 3.75% | 5.59% |
| Liquidität, Absicherung | 0.87% | - |