31 agosto 2024

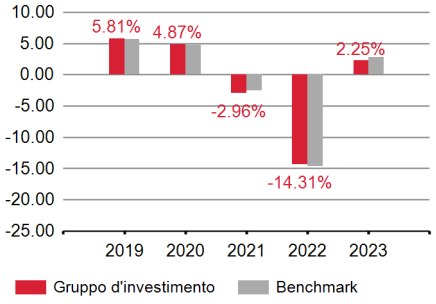
Fondazione d'investimento Swiss Life Obbligazioni Global (CHF hedged)

Patrimonio netto (NAV) in mio. CHF: 153.06
Valore d'inventario netto per diritto in CHF: 119.27

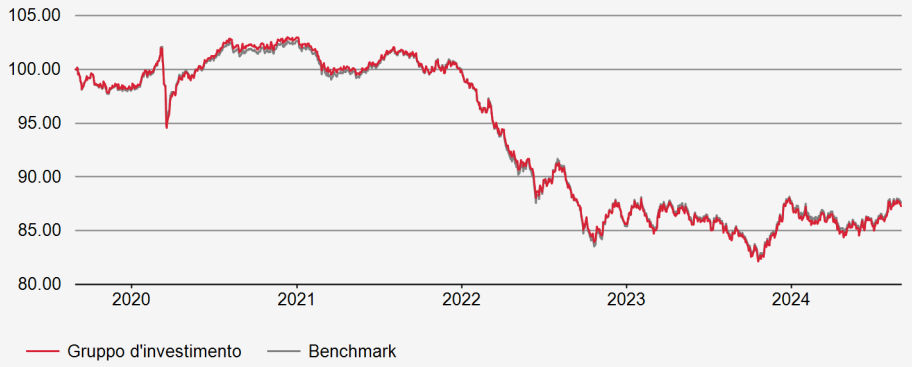
Strategia d'investimento

Investimenti in titoli di credito di debitori domiciliati in Svizzera o all'estero (dal 1.1.2011 CHF hedged). Selezione attiva di titoli, gestione della duration e posizionamento della curva dei tassi d'interesse. Limitazione per debitore: 10% (eccezione: se rappresentati nel benchmark, max. 5%-punti in più della ponderazione del benchmark). Titoli di credito di debitori esterni al benchmark: max. 10%. Rating medio: almeno A-. I rischi valutari vengono coperti al 90% almeno contro il franco. Realizzazione tramite Swiss Life iFunds (CH) Bond Global Aggregate (CHF hedged); fondi d'investimento di diritto svizzero della categoria "altri fondi per investimenti tradizionali".

Performance



Evoluzione del valore nella valuta di riferimento (base 100)



Le performance passate non sono indicative di performance future.

Performance nella valuta di riferimento

	Performance cumulata				Performance annualizzata			
	YTD	1 mese	3 mesi	1 anno	3 anni	5 anni	10 anni	Inizio
Gruppo d'investimento	-0.30%	0.60%	2.70%	2.32%	-4.90%	-2.68%	-0.48%	0.77%
Benchmark	-0.22%	0.74%	2.73%	2.54%	-4.75%	-2.61%	-0.32%	0.86%

Dati statistici (annualizzati)

	1 anno	3 anni	5 anni	10 anni	Inizio
Volatilità Gruppo d'investimento (in %)	6.05	5.84	5.22	4.26	5.41
Volatilità del Benchmark (in %)	5.94	6.10	5.36	4.34	5.57
Tracking Error ex post (in %)	0.28	0.58	0.51	0.56	1.41
Information Ratio	-0.79	-0.26	-0.14	-0.30	-0.06
Sharpe Ratio	0.13	-0.97	-0.54	-0.04	0.11
Correlazione	1.00	1.00	1.00	0.99	0.97
Beta	1.02	0.95	0.97	0.97	0.94
Jensen alfa	-0.24	-0.40	-0.15	-0.17	-0.05
Maximum Drawdown (in %)	-4.13	-19.16	-20.24	-20.24	-20.24
Recovery Period (anni)	-	-	-	-	-

Informazioni sul prodotto

Numero di valore: 1245479
ISIN: CH0012454796
LEI: 254900F82G5L48XPDV74
Codice Bloomberg: SWAOBFG SW
Benchmark: BLOOMBERG GLO AGG EX SEC EX CNY HEDGED CHF
Moneta: CHF
Domicilio: Svizzera
Data di creazione: 30/09/2001
Prezzo di prima emissione: 100.00
Chiusura d'esercizio: 30.09
Emissione/Riscatto: giornalmente
Termine d'accettazione: 13.00
Commissione d'emissione / riscatto: nessuna
Prassi di distribuzione: Capitalizzazione
Asset Manager in base al Swiss Life Best Select Invest Plus®: Swiss Life Asset Management SA
Controllo asset manager: PPCmetrics supporta il controllo costante dell'asset manager e la valutazione dei risultati d'investimento.
Pubblicazioni di corsi: Bloomberg: ASSL www.swisslife.ch/fondazionedinvestimento
Quote spese operative TER KGAST
ex ante: 0.46%
ex post al: 30/09/2023 0.46%

Benchmark: Il benchmark è stato modificato al 1° luglio 2012. Per informazioni relative al precedente benchmark potete rivolgervi alla Fondazione d'investimento Swiss Life.
Asset Manager: La selezione dei manager, il controllo permanente di questi ultimi e l'intero accompagnamento nel processo vengono effettuati da Swiss Life Asset Management SA in base a criteri oggettivi e alla migliore prassi istituzionale.
Quote spese operative TER KGAST: La quota spese operative TER KGAST copre tutti i costi, eccezione fatta per i costi di transazione e i tributi fiscali legati alla transazione.
Performance: Rendimento complessivo per un determinato periodo di osservazione, sulla base di tassi di rendimento ponderati per il periodo di riferimento.
Dati statistici: Le cifre salienti relative al rischio si basano su tassi di rendimento ponderati per il periodo di riferimento logaritmizzati mensili.
Tracking error ex ante: Il tracking error previsto per i prossimi 12 mesi corrisponde al Tracking error ex post degli ultimi 3 anni.

31 agosto 2024

Fondazione d'investimento Swiss Life Obbligazioni Global (CHF hedged)

Struttura del portafoglio per settore

	Gruppo d'investimento	Benchmark
Stati e simili	48.84%	72.48%
Finanza	18.93%	11.51%
Consumo non ciclico	6.64%	3.98%
Comunicazione	2.73%	1.94%
Consumo ciclico	2.34%	1.82%
Servizi di pubblica utilità	1.90%	2.70%
Tecnologia	1.44%	1.10%
Energia	1.35%	1.66%
Supernazionale	6.48%	-
Altri	1.90%	2.81%
Liquidità	6.74%	-
Copertura del rischio di cambio	0.72%	-

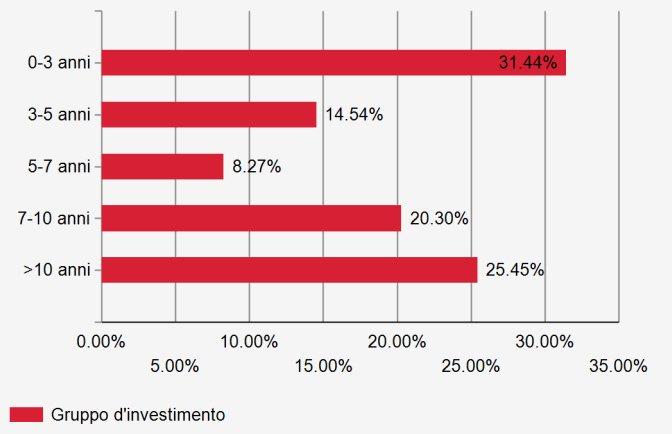
Principali debitori e rating

		Gruppo d'investimento
Giappone	A+	16.94%
US Treasury N/B	AAA	8.61%
Italia	BBB	5.28%
Regno di Spagna	A	2.47%
BNG Bank NV	AAA	1.92%

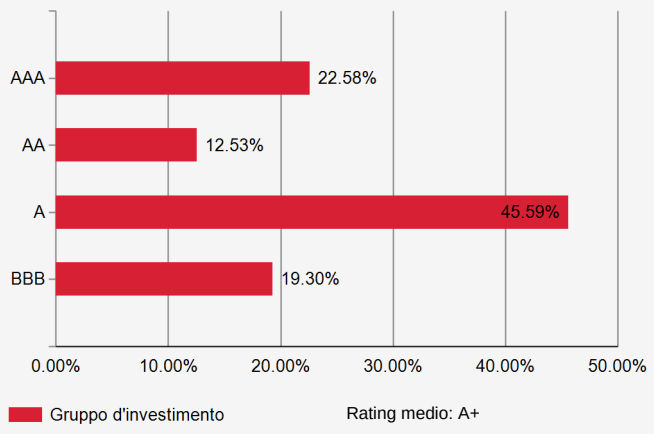
Ulteriori informazioni sui debitori

Numero di debitori	150
Quota di debitori senza benchmark	

Struttura della scadenza dei titoli



Investimenti secondo il rating



Durata e rendimento alla scadenza

	Gruppo d'investimento	Benchmark
Modified Duration	7.0	6.9
Rendimento alla scadenza teorica*	3.68%	3.54%

* prima copertura del rischio di cambio, prendendo in considerazione i derivati

Struttura del portafoglio secondo il paese/regione

	Gruppo d'investimento	Benchmark
Stati Uniti	24.46%	37.31%
Giappone	19.79%	13.65%
Canada	8.10%	4.37%
Italia	6.59%	4.01%
Germania	5.25%	5.89%
Francia	5.13%	6.17%
Regno Unito	3.69%	5.48%
Regione Europea (EUR)	10.97%	8.85%
Regione Europea (Ex EUR)	3.47%	1.59%
Mercati Emergenti in America	1.60%	0.04%
Altri	3.49%	12.64%
Liquidità, copertura	7.46%	-

Nota legale: La presente pubblicazione non rappresenta né un invito, né una raccomandazione ad acquistare o vendere strumenti d'investimento, ma funge meramente da veicolo informativo. È possibile richiedere gratuitamente tutti i documenti che costituiscono la base giuridica di un eventuale investimento presso la Fondazione d'investimento Swiss Life, c/o Swiss Life SA, casella postale 8022 Zurigo, telefono 043 547 71 11 e su www.swisslife.ch/anlagestiftung. La cerchia degli investitori è limitata alle istituzioni del secondo pilastro e del pilastro 3a, non-ché istituzioni esonerate dall'obbligo tributario, con sede in Svizzera e che secondo l'oggetto sociale perseguono la previdenza professionale e persone che gestiscono investimenti collettivi per queste istituzioni, sono sorvegliate dall'Autorità federale di vigilanza sui mercati finanziari FINMA e che investono presso la fondazione esclusivamente capitali per queste istituzioni. La performance precedente non rappresenta un indicatore né per l'evoluzione attuale, né per quella futura. L'utilizzo non implica alcuna affiliazione con o sponsorizzazione da parte di quest'ultimi. **Fonte:** Swiss Life Asset Managers. Tutti i diritti riservati.