

Fondazione d'investimento Swiss Life

Obbligazioni Emerging Markets Imprese (CHF hedged)

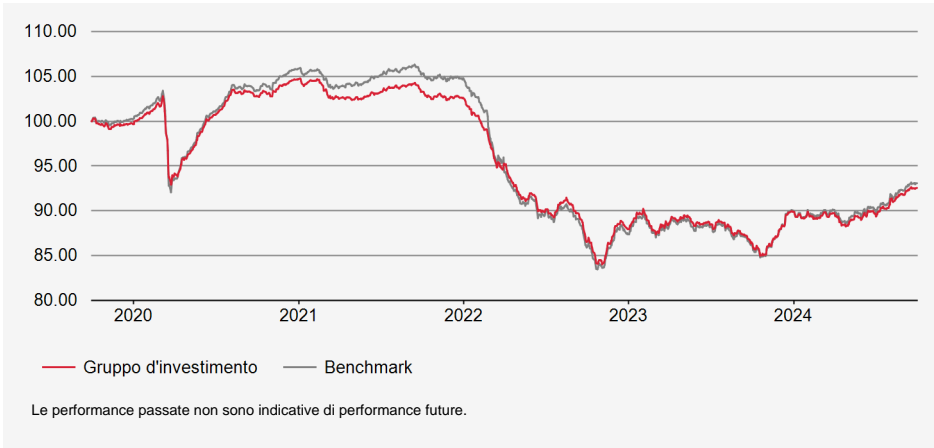


Patrimonio netto (NAV) in mio. CHF: 352.54
Valore d'inventario netto per diritto in CHF: 94.60

Strategia d'investimento

Investimenti in titoli di credito in dollari statunitensi o altre valute forti di imprese e Stati, inclusi organismi sovranazionali e agenzie, di Paesi di recente industrializzazione (Emerging Markets). Selezione attiva dei titoli, gestione della duration e posizionamento lungo la curva dei tassi. Limitazione per debitore: 10%. Titoli di credito di debitori esterni al benchmark: max. 35%. Qualità media di rating: almeno BBB-. I rischi di valuta vengono coperti almeno al 90% rispetto al franco svizzero. Attuazione con l'impiego di Swiss Life Funds (LUX) Bond Emerging Markets Corporates CHF-hedged AM Cap; fondo d'investimento di diritto lussemburghese.

Evoluzione del valore nella valuta di riferimento (base 100)



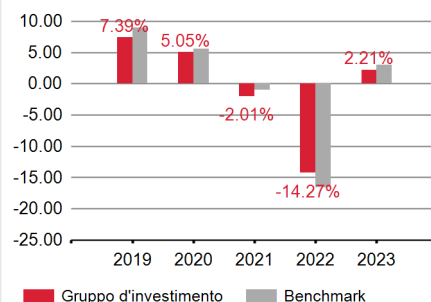
Performance nella valuta di riferimento

| | Performance cumulata True | | | | Performance annualizzata | | | |
|-----------------------|---------------------------|--------|--------|--------|--------------------------|--------|---------|--------|
| | YTD | 1 mese | 3 mesi | 1 anno | 3 anni | 5 anni | 10 anni | Inizio |
| Gruppo d'investimento | 2.96% | 0.84% | 3.22% | 7.03% | -3.58% | -1.53% | - | -0.79% |
| Benchmark | 3.38% | 0.89% | 3.30% | 7.89% | -4.00% | -1.42% | - | -0.43% |

Dati statistici (annualizzati)

| | 1 anno | 3 anni | 5 anni | 10 anni | Inizio |
|---|--------|--------|--------|---------|--------|
| Volatilità Gruppo d'investimento (in %) | 4.86 | 6.11 | 6.39 | - | 5.59 |
| Volatilità del Benchmark (in %) | 4.98 | 6.62 | 7.06 | - | 6.14 |
| Tracking Error ex post (in %) | 0.43 | 1.28 | 1.22 | - | 1.07 |
| Information Ratio | -2.01 | 0.33 | -0.09 | - | -0.34 |
| Sharpe Ratio | 1.09 | -0.71 | -0.27 | - | -0.12 |
| Correlazione | 1.00 | 0.98 | 0.99 | - | 0.99 |
| Beta | 0.97 | 0.91 | 0.89 | - | 0.90 |
| Jensen alfa | -0.69 | -0.02 | -0.28 | - | -0.39 |
| Maximum Drawdown (in %) | -1.86 | -18.64 | -19.77 | - | -19.77 |
| Recovery Period (anni) | 0.14 | - | - | - | - |

Performance



Informazioni sul prodotto

Numero di valore: 36974875
ISIN: CH0369748758
LEI: 254900R4DORKK6JJUG51
Codice Bloomberg: SLOEMCH SW
Benchmark: JP Morgan CEMBI Broad Diversified IG Index (CHF Hedged)
Moneta: CHF
Domicilio: Svizzera
Data di creazione: 29/09/2017
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/fondazioneinvestimento

Quote spese operative TER KGAST
ex ante: 0.82%
ex post al: 30/09/2024 0.82%

Fondazione d'investimento Swiss Life

Obbligazioni Emerging Markets Imprese (CHF hedged)

Struttura del portafoglio per settore

| | Gruppo d'investimento | Benchmark |
|---------------------------------|-----------------------|-----------|
| Finanza | 31.93% | 36.41% |
| Comunicazione | 12.02% | 9.03% |
| Servizi di pubblica utilità | 10.70% | 10.48% |
| Energia | 9.55% | 11.44% |
| Consumo non ciclico | 8.86% | 4.84% |
| Beni Industriali | 6.65% | 4.08% |
| Tecnologia | 5.47% | 5.27% |
| Materiali di base | 4.50% | 11.22% |
| Supernazionale | 1.66% | - |
| Altri | 8.01% | 7.24% |
| Liquidità | 0.57% | - |
| Copertura del rischio di cambio | 0.07% | - |

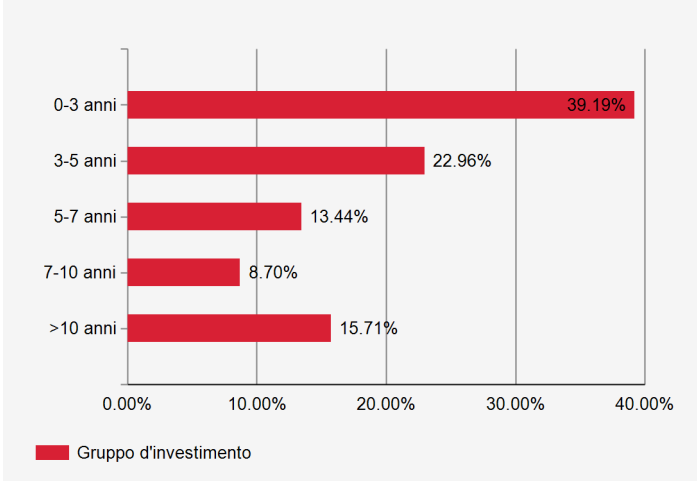
Principali debitori e rating

| | | Gruppo d'investimento |
|---|------|-----------------------|
| Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd | AA- | 3.53% |
| US Treasury N/B | AAA | 3.31% |
| Prosus NV | BBB | 2.32% |
| OTP Bank Nyrt | BBB- | 1.81% |
| HDFC Bank Ltd | BBB- | 1.77% |

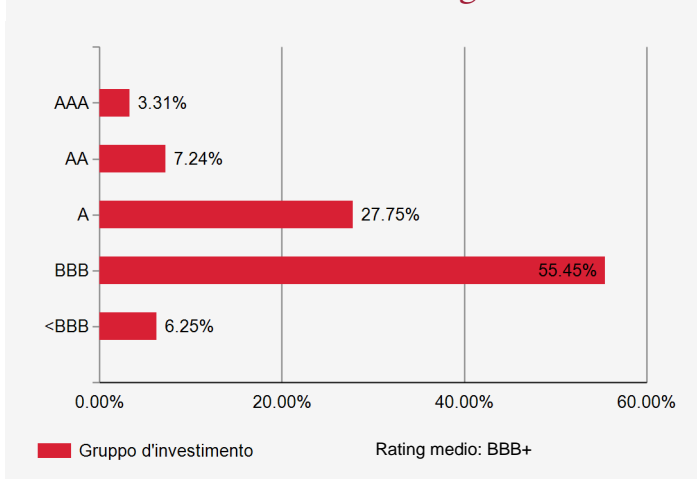
Ulteriori informazioni sui debitori

| | |
|-----------------------------------|--------|
| Numero di debitori | 149 |
| Quota di debitori senza benchmark | 23.05% |

Struttura della scadenza dei titoli



Investimenti secondo il rating



Durata e rendimento alla scadenza

| | Gruppo d'investimento | Benchmark |
|-----------------------------------|-----------------------|-----------|
| Modified Duration | 5.2 | 4.8 |
| Rendimento alla scadenza teorica* | 5.78% | 5.19% |

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

Struttura del portafoglio secondo il paese/regione

| | Gruppo d'investimento | Benchmark |
|---------------------------------|-----------------------|-----------|
| Cina | 9.52% | 13.52% |
| Corea del Sud | 6.91% | 7.63% |
| Emirati Arabi Uniti | 6.66% | 5.72% |
| India | 5.92% | 4.03% |
| Messico | 5.03% | 4.85% |
| Qatar | 4.64% | 5.56% |
| Singapore | 4.59% | 3.93% |
| Mercati Emergenti Asia Pacifico | 18.84% | 19.75% |
| Mercati Emergenti in America | 12.30% | 8.20% |
| Mercati Emergenti Medio Oriente | 5.80% | 10.07% |
| Altri | 19.14% | 16.75% |
| Liquidità, copertura | 0.64% | - |