

Fondazione d'investimento Swiss Life

Obbligazioni Global Imprese (CHF hedged)

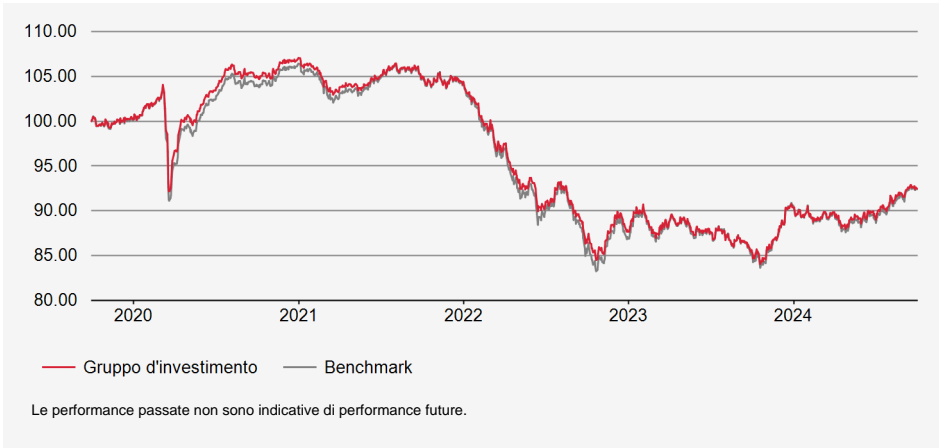


Patrimonio netto (NAV) in mio. CHF: 811.36
Valore d'inventario netto per diritto in CHF: 122.29

Strategia d'investimento

Investimenti in titoli di credito di imprese, incl. agenzie ed enti sovranazionali. Selezione attiva di titoli, gestione della duration e posizionamento della curva dei tassi d'interesse. Titoli di credito di debitori esterni al benchmark: max. 10%. Limitazioni per debitore: 10%. Rating medio: almeno BBB. I rischi valutari vengono coperti al 90% almeno contro il franco. Realizzazione tramite Swiss Life iFunds (CH) Bond Global Corporates (CHF hedged); fondo d'investimento di diritto svizzero della categoria "altri fondi per investimenti tradizionali".

Evoluzione del valore nella valuta di riferimento (base 100)



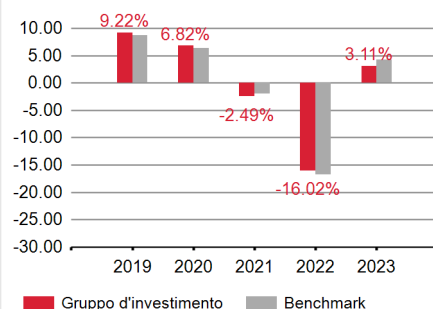
Performance nella valuta di riferimento

| | Performance cumulata True | | | | Performance annualizzata | | | |
|-----------------------|---------------------------|--------|--------|--------|--------------------------|--------|---------|--------|
| | YTD | 1 mese | 3 mesi | 1 anno | 3 anni | 5 anni | 10 anni | Inizio |
| Gruppo d'investimento | 2.30% | 0.98% | 3.46% | 8.00% | -4.07% | -1.55% | 0.16% | 1.47% |
| Benchmark | 2.01% | 1.22% | 3.81% | 8.31% | -4.05% | -1.56% | 0.30% | 1.44% |

Dati statistici (annualizzati)

| | 1 anno | 3 anni | 5 anni | 10 anni | Inizio |
|---|--------|--------|--------|---------|--------|
| Volatilità Gruppo d'investimento (in %) | 5.73 | 7.00 | 6.81 | 5.40 | 5.18 |
| Volatilità del Benchmark (in %) | 6.50 | 7.83 | 7.56 | 5.83 | 5.37 |
| Tracking Error ex post (in %) | 0.83 | 1.00 | 0.94 | 0.86 | 0.96 |
| Information Ratio | -0.38 | -0.02 | 0.01 | -0.15 | 0.02 |
| Sharpe Ratio | 1.08 | -0.69 | -0.25 | 0.09 | 0.32 |
| Correlazione | 1.00 | 1.00 | 1.00 | 0.99 | 0.98 |
| Beta | 0.88 | 0.89 | 0.90 | 0.92 | 0.95 |
| Jensen alfa | 0.51 | -0.54 | -0.16 | -0.08 | 0.11 |
| Maximum Drawdown (in %) | -3.05 | -20.25 | -21.47 | -21.47 | -21.47 |
| Recovery Period (anni) | 0.27 | - | - | - | - |

Performance



Informazioni sul prodotto

Numero di valore: 11955702
ISIN: CH0119557020
LEI: 254900C3B00LU0UJ428
Codice Bloomberg: SWLGUNT SW
Benchmark: BLOOMBERG GLO AGG CORP IND HEDGED CHF
Moneta: CHF
Domicilio: Svizzera
Data di creazione: 14/12/2010
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: 0.53%
ex post al: 30/09/2024 0.53%

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 logaritmicizzati mensili.
Tracking error ex ante: Il tracking error previsto per i prossimi 12 mesi corrisponde al Tracking error ex post degli ultimi 3 anni.

Fondazione d'investimento Swiss Life

Obbligazioni Global Imprese (CHF hedged)

Struttura del portafoglio per settore

| | Gruppo d'investimento | Benchmark |
|---------------------------------|-----------------------|-----------|
| Finanza | 46.83% | 38.35% |
| Consumo non ciclico | 13.75% | 16.36% |
| Energia | 7.44% | 6.00% |
| Servizi di pubblica utilità | 6.41% | 8.99% |
| Beni Industriali | 5.32% | 7.20% |
| Consumo ciclico | 5.09% | 7.61% |
| Comunicazione | 5.08% | 7.90% |
| Tecnologia | 4.98% | 4.64% |
| Altri | 2.00% | 2.95% |
| Liquidità | 2.54% | - |
| Copertura del rischio di cambio | 0.57% | - |

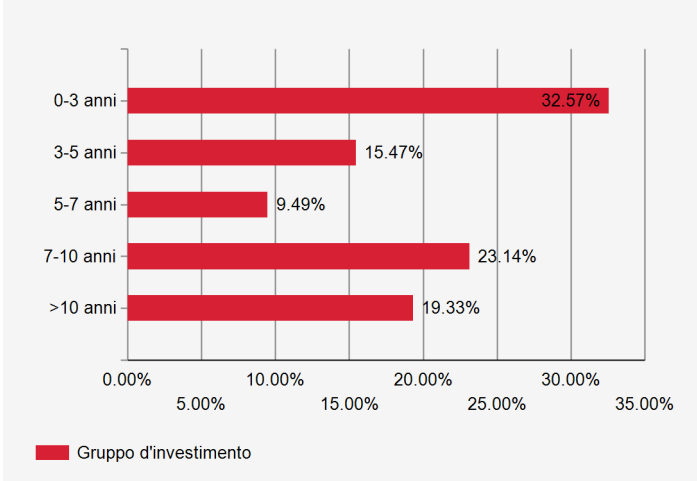
Principali debitori e rating

| | | Gruppo d'investimento |
|------------------------------|------|-----------------------|
| Porsche Automobil Holding SE | BBB | 2.26% |
| Banco Santander SA, Madrid | BBB+ | 2.26% |
| Groupe BPCE | BBB+ | 1.74% |
| Credit Agricole Group | BBB+ | 1.73% |
| Société Générale, Paris | BBB | 1.66% |

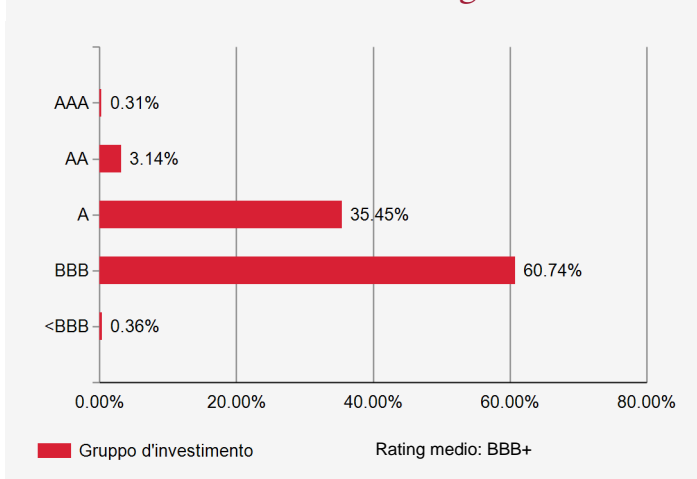
Ulteriori informazioni sui debitori

| | |
|-----------------------------------|-------|
| Numero di debitori | 231 |
| Quota di debitori senza benchmark | 3.11% |

Struttura della scadenza dei titoli



Investimenti secondo il rating



Durata e rendimento alla scadenza

| | Gruppo d'investimento | Benchmark |
|-----------------------------------|-----------------------|-----------|
| Modified Duration | 6.1 | 6.1 |
| Rendimento alla scadenza teorica* | 4.71% | 4.65% |

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

Struttura del portafoglio per valute e la duration

| | Gruppo d'investimento | | Benchmark | |
|-------|-----------------------|----------|-----------|----------|
| | Peso | Duration | Peso | Duration |
| USD | 56.90% | 7.88 | 67.08% | 6.74 |
| EUR | 28.77% | 3.60 | 23.88% | 4.44 |
| CHF | 5.81% | 2.18 | 0.37% | 4.39 |
| JPY | 2.48% | 2.04 | 0.70% | 4.16 |
| Altri | 6.03% | 4.29 | 7.97% | 5.64 |

Struttura del portafoglio secondo il paese/regione

| | Gruppo d'investimento | Benchmark |
|--------------------------|-----------------------|-----------|
| Stati Uniti | 37.40% | 56.23% |
| Regno Unito | 10.24% | 6.85% |
| Francia | 9.17% | 6.19% |
| Germania | 5.33% | 5.04% |
| Spagna | 4.30% | 2.20% |
| Giappone | 4.15% | 3.37% |
| Svizzera | 3.99% | 1.45% |
| Regione Europea (EUR) | 9.45% | 5.87% |
| Regione Asia e Pacifico | 3.23% | 2.21% |
| Regione Europea (Ex EUR) | 3.20% | 1.61% |
| Altri | 6.43% | 8.98% |
| Liquidità, copertura | 3.11% | - |