

Fondazione d'investimento Swiss Life

Obbligazioni CHF Svizzera

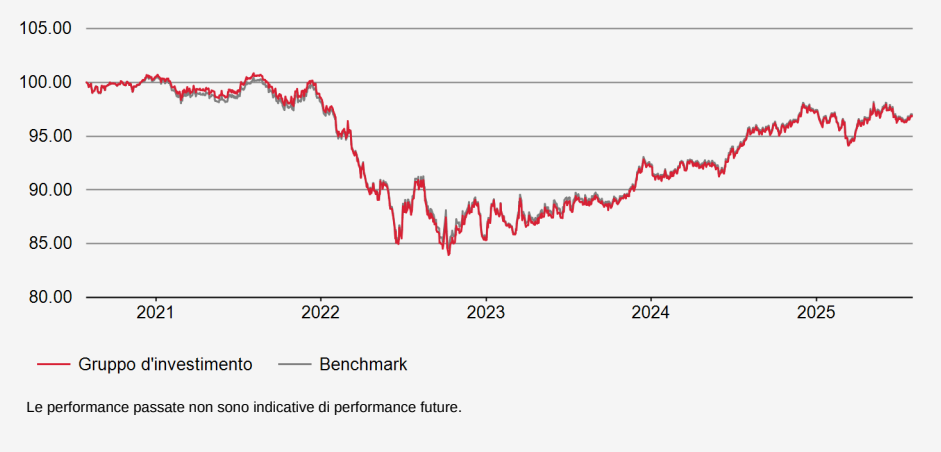


Patrimonio netto (NAV) in mio. CHF: 1,033.80
Valore d'inventario netto per diritto in CHF: 169.01

Strategia d'investimento

Investimenti in titoli di credito in CHF di debitori prevalentemente domiciliati in Svizzera. Selezione attiva di titoli, gestione della duration e posizionamento della curva dei tassi d'interesse. Limitazione per debitore: 10% (eccezioni: fino al 25% in ogni istituto di credito fondiario, Confederazione Svizzera senza limitazione). Debitori esterni all'indice di riferimento: max. 10%. Rating medio: almeno A+. Realizzazione tramite Swiss Life iFunds (CH) Bond Swiss Francs Domestic (CHF); fondo d'investimento di diritto svizzero della categoria "altri fondi per investimenti tradizionali".

Evoluzione del valore nella valuta di riferimento (base 100)



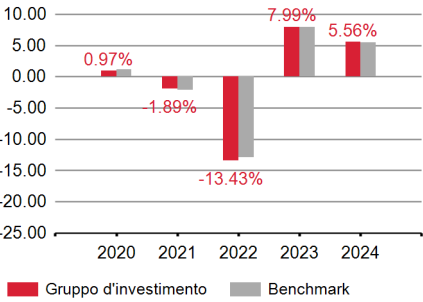
Performance nella valuta di riferimento

	Performance cumulata				Performance annualizzata			
	YTD	1 mese	3 mesi	1 anno	3 anni	5 anni	10 anni	Inizio
Gruppo d'investimento	-0.42%	0.40%	-0.47%	1.91%	2.20%	-0.63%	0.21%	2.23%
Benchmark	-0.41%	0.40%	-0.50%	1.87%	2.14%	-0.60%	0.30%	2.30%

Dati statistici (annualizzati)

	1 anno	3 anni	5 anni	10 anni	Inizio
Volatilità Gruppo d'investimento (in %)	3.05	4.82	5.01	4.70	3.79
Volatilità del Benchmark (in %)	3.12	4.70	4.89	4.56	3.76
Tracking Error ex post (in %)	0.10	0.39	0.35	0.36	0.43
Information Ratio	0.32	0.15	-0.09	-0.23	-0.16
Sharpe Ratio	0.43	0.25	-0.19	0.09	0.52
Correlazione	1.00	1.00	1.00	1.00	0.99
Beta	0.98	1.02	1.02	1.03	1.00
Jensen alfa	0.06	0.03	-0.01	-0.10	-0.08
Maximum Drawdown (in %)	-3.88	-7.65	-16.75	-19.71	-19.71
Recovery Period (anni)	0.15	1.14	-	-	-

Performance



Informazioni sul prodotto

Numero di valore: 1239071
ISIN: CH0012390719
LEI: 254900M0YGKYAE29FA28
Codice Bloomberg: SWAOBIN SW
Benchmark: SIX SBI Dom AAA-BBB TR CHF
Valuta: CHF
Domicilio: Svizzera
Data di lancio: 30/09/2001
Prezzo di prima emissione: 100.00
Chiusura d'esercizio: 30.09
Emissione/Riscatto: giornalmente
Termine d'accettazione: 13.00
Protezione contro la diluizione: Commissione di emissione / riscatto a favore del gruppo d'investimento secondo la panoramica delle condizioni.
Asset Management: Swiss Life Asset Management SA
Controllo asset manager: Monitoraggio dei risultati d'investimento del gestore patrimoniale impiegato da parte di PPCmetrics
Pubblicazioni di corsi: Bloomberg: ASSL
www.swisslife.ch/fondazionedinvestimento
Quote spese operative TER KGAST
ex ante: 0.26%
ex post al: 30/09/2024 0.27%

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.
Protezione contro la diluizione: Panoramica delle condizioni: www.swisslife.ch/fondazionedinvestimento, «Documenti giuridici» (modifiche possibili in qualsiasi momento senza preavviso).
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.

Fondazione d'investimento Swiss Life

Obbligazioni CHF Svizzera

Struttura del portafoglio per settore

	Gruppo d'investimento	Benchmark
Instituti lettere di pegno	35.95%	39.91%
Finanza	27.50%	16.63%
Stati e simili	19.62%	28.50%
Consumo non ciclico	6.98%	7.23%
Industrial	4.14%	3.15%
Servizi di pubblica utilità	3.88%	2.27%
Consumo ciclico	1.06%	0.36%
Comunicazione	0.39%	0.91%
Altri	0.31%	1.05%
Liquidità	0.17%	-

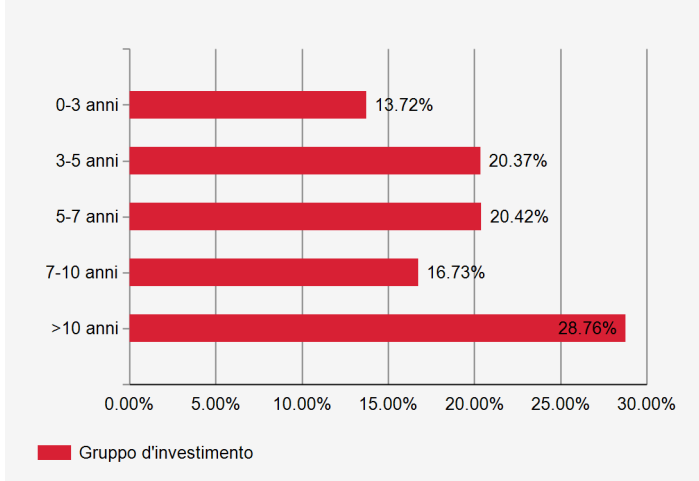
Principali debitori e rating

		Gruppo d'investimento
Pfandbriefbank	AAA	18.45%
Pfandbriefzentrale	AAA	17.41%
Confederazione	AAA	13.16%
Banca cantonale di Zurigo	AA+	2.41%
UBS Group AG	AA-	2.09%

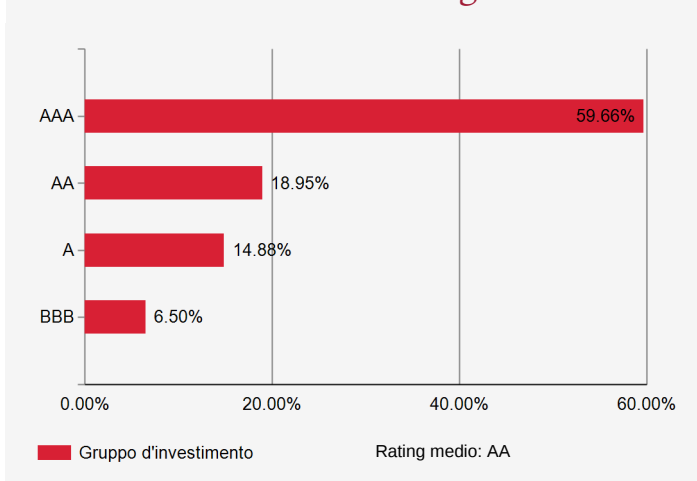
Ulteriori informazioni sui debitori

Numero di debitori	126
Quota di debitori senza benchmark	0.00%

Struttura della scadenza dei titoli



Investimenti secondo il rating



Durata e rendimento alla scadenza

	Gruppo d'investimento	Benchmark
Modified Duration	8.0	7.9
Rendimento alla scadenza teorica*	0.73%	0.63%

* prima copertura del rischio di cambio