## Fondazione d'investimento Swiss Life Obbligazioni Global Imprese Short Term (CHF hedged)

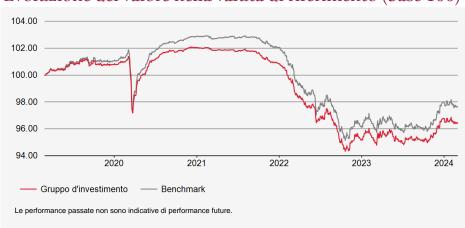


Patrimonio netto (NAV) in mio. CHF: 1,311.22 Valore d'inventario netto per diritto in CHF: 97.00

### Strategia d'investimento

Investimenti in titoli di credito di società (agenzie e supranational incluse) con una durata residua breve (prevalentemente meno di 3 anni). Selezione attiva di titoli, gestione della duration e posizionamento della curva dei tassi d'interesse. Limitazione per debitore: 10%. Titoli di credito di debitori esterni al benchmark: max. 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 Short Term (CHF hedged); Fondi d'investimento di diritto svizzero della categoria "altri fondi per investimenti tradizionali".

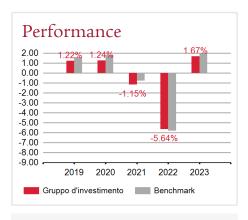
# Evoluzione del valore nella valuta di riferimento (base 100)



#### Performance nella valuta di riferimento

	Performance cumulata				Perfor	mance and	nualizzata	
	YTD	1 mese	3 mesi	1 anno	3 anni	5 anni	10 anni	Inizio
Gruppo d'investimento	-0.30%	-0.38%	0.51%	1.45%	-1.82%	-0.72%	-0.40%	-0.29%
Benchmark	-0.35%	-0.49%	0.63%	1.66%	-1.69%	-0.47%	-0.24%	-0.15%

Dati statistici	1 anno	3 anni	5 anni	10 anni	Inizio
(annualizzati)	i aiiio	Janin	3 aiiii	io aiiii	1111210
Volatilità Gruppo d'investimento (in %)	1.47	1.99	2.17	1.64	1.61
Volatilità del Benchmark (in %)	1.79	2.19	2.34	1.71	1.69
Tracking Error ex post (in %)	0.36	0.28	0.25	0.32	0.32
Information Ratio	-0.57	-0.45	-1.00	-0.50	-0.46
Sharpe Ratio	-0.08	-1.09	-0.28	-0.02	0.05
Correlazione	0.99	1.00	1.00	0.98	0.98
Beta	0.82	0.90	0.92	0.94	0.94
Jensen alfa	-0.19	-0.34	-0.28	-0.15	-0.13
Maximum Drawdown (in %)	-1.20	-7.50	-7.61	-8.08	-8.08
Recovery Period (anni)	0.40	-	-	-	



#### Informazioni sul prodotto

Numero di valore: 22073699 ISIN: CH0220736992

LEI: 2549003DSGOORN37K507 Codice Bloomberg: SWLOGNT SW Benchmark: BLOOMBERG GLO AGG CORP 1-3 YR IND HEDGED CHF

Moneta: CHF
Domicilio: Svizzera

Data di creazione: 11/10/2013 Prezzo di prima emissione: 100.00 Chiusura d'esercizio: 30.09 Emissione/Riscatto: giornalmente Termine d'accettazione: 14.30

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: 0.38%

ex post al: 30/09/2023 0.38%

## Fondazione d'investimento Swiss Life Obbligazioni Global Imprese Short Term (CHF hedged)



### Struttura del portafoglio per settore

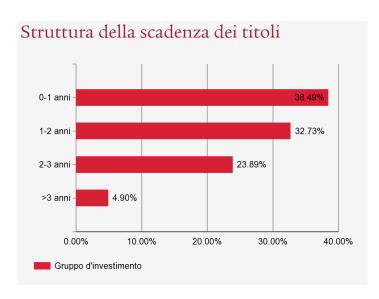
	Gruppo d'investimento	Benchmark
Finanza	56.01%	51.75%
Consumo non ciclico	14.95%	11.99%
Consumo ciclico	10.92%	9.68%
Energia	4.56%	4.27%
Beni Industriali	3.31%	6.07%
Servizi di pubblica utilità	2.89%	5.10%
Comunicazione	2.24%	5.04%
Tecnologia	1.56%	4.13%
Supernazionale	0.71%	-
Altri	1.95%	2.08%
Liquidità	0.91%	-
Copertura del rischio di cambio	-0.02%	-

### Principali debitori e rating

_	Grupp	oo d'investimento
UBS Group AG	А	2.71%
Banco Santander SA, Madrid	A-	2.54%
Porsche Automobil Holding SE	BBB+	1.89%
NatWest Group PLC	BBB+	1.79%
Société Générale, Paris	BBB	1.78%

#### Ulteriori informazioni sui debitori

Numero di debitori	155
Quota di debitori senza benchmark	6.66%





#### Durata e rendimento alla scadenza

	Gruppo d'investimento	Benchmark
Modified Duration	1.6	1.8
Rendimento alla scadenza teorica*	5.32%	4.87%

# Struttura del portafoglio per valute e la duration

	Gruppo d'inves	timento	Benchmark		
	Peso	Duration	Peso	Duration	
USD	56.62%	1.56	61.33%	1.90	
EUR	32.12%	1.64	29.14%	2.15	
CHF	8.20%	1.67	0.41%	1.96	
GBP	3.06%	1.88	3.64%	2.15	
Altri	-	-	5.58%	2.06	

# Struttura del portafoglio secondo il paese/regione

	Gruppo d'investimento	Benchmark
Stati Uniti	30.73%	44.55%
Regno Unito	9.47%	7.07%
Francia	9.10%	7.68%
Canada	8.45%	5.75%
Germania	6.15%	6.48%
Svizzera	5.80%	2.15%
Giappone	5.24%	4.83%
Regione Europea (EUR)	10.62%	10.62%
Regione Europea (Ex EUR)	5.92%	2.43%
Mercati Emergenti Asia Pacifico	3.99%	2.61%
Altri	3.65%	5.83%
Liquidità, copertura	0.90%	-