

30 giugno 2025



Fondazione d'investimento Swiss Life

Obbligazioni Global Aggregate ex CHF Indicizzate PM (CHF SwissLife hedged)

Patrimonio netto (NAV) in mio. CHF: 13.24
Valore d'inventario netto per diritto in CHF: 1,004.41

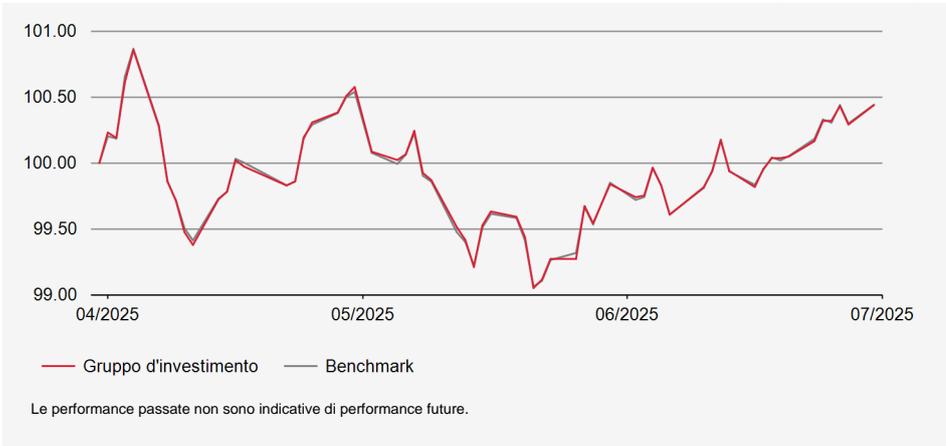
Strategia d'investimento

Il gruppo d'investimento viene gestito con un approccio indicizzato e si contraddistingue per l'ampia diversificazione e il tracking error minimo. L'obiettivo d'investimento consiste nel replicare al meglio il benchmark Bloomberg Global Aggregate ex CHF Total Return (CHF hedged). Realizzazione tramite Swiss Life Index Funds (CH) Bond Global Aggregate ex CHF (CHF hedged); fondo d'investimento contrattuale di diritto svizzero del tipo "altri fondi per investimenti tradizionali". Non viene effettuato securities lending e non vengono effettuati investimenti in titoli che l'Associazione svizzera per gli investimenti responsabili (www.svvk-asir.ch) raccomanda di escludere.

Performance

Storia insufficiente di dati

Evoluzione del valore nella valuta di riferimento (base 100)



Informazioni sul prodotto

Numero di valore: 142759586
ISIN: CH1427595868
LEI: 2549009Q08QRLB0BEL51
Codice Bloomberg: SLAIGAP SW
Benchmark: BLOOMBERG GLO AGG EX CHF TR IND HEDGED CHF
Valuta: CHF
Domicilio: Svizzera
Data di lancio: 31/03/2025
Prezzo di prima emissione: 1000.00
Chiusura d'esercizio: 30.09
Emissione/Riscatto: giornalmente
Termine d'accettazione: 14:00 (G-1)
Protezione contro la diluizione: Commissione di emissione / riscatto a favore del gruppo d'investimento secondo la panoramica delle condizioni.

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	-	0.60%	0.44%	-	-	-	-	-
Benchmark	-	0.59%	0.44%	-	-	-	-	-

Dati statistici (annualizzati)

	1 anno	3 anni	5 anni	10 anni	Inizio
Volatilità Gruppo d'investimento (in %)	-	-	-	-	2.18
Volatilità del Benchmark (in %)	-	-	-	-	2.06
Tracking Error ex post (in %)	-	-	-	-	0.12
Information Ratio	-	-	-	-	-0.07
Sharpe Ratio	-	-	-	-	0.52
Correlazione	-	-	-	-	1.00
Beta	-	-	-	-	1.05
Jensen alfa	-	-	-	-	-0.07
Maximum Drawdown (in %)	-	-	-	-	-1.79
Recovery Period (anni)	-	-	-	-	-

Asset management: Swiss Life Asset Management SA
Consulenza esterna: PPCmetrics fornisce i seguenti servizi: consulenza sulla struttura idonea del mandato, supporto nella selezione di asset manager adeguati nonché supporto nel controllo costante dell'asset manager e valutazione dei risultati d'investimento.
Pubblicazioni di corsi: Bloomberg: ASSL
www.swisslife.ch/fondazioneinvestimento
Quote spese operative TER KGAST ex ante: 0.02%

PM tranche: L'acquisto di questa tranche è possibile solo nell'ambito di un accordo speciale con Swiss Life Asset Management SA.
Asset Manager: La selezione del 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/fondazioneinvestimento, «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 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 Aggregate ex CHF Indicizzate PM (CHF hedged)

Struttura del portafoglio per settore

	Gruppo d'investimento	Benchmark
Treasury	55.23%	54.07%
MBS Pass-Through	10.77%	10.02%
Industrial	9.46%	9.42%
Financial Institutions	8.04%	7.20%
Agency	7.44%	8.01%
Local Authority	2.85%	3.03%
Supranational	2.28%	2.63%
Utilities	1.94%	1.68%
Covered	1.66%	1.95%
Sovereign	1.33%	1.19%
ABS	-	0.20%
CMBS	-	0.63%
Liquidità	-1.00%	-

Principali debitori e rating

	Gruppo d'investimento	Benchmark
United States of America	AA+	29.32%
Japan	A+	9.23%
People's Republic of China	A+	6.79%
United Kingdom of Great Britain and Northern Ireland	AA-	3.11%
Republic of Italy	BBB	2.83%
French Republic	AA-	2.77%
Federal Republic of Germany	AAA	2.56%
China Development Bank	A+	2.34%
Kingdom of Spain	A-	1.94%
Republic of Korea	AA	1.13%

Struttura del portafoglio per scadenze

	Gruppo d'investimento	Benchmark
0-3 anni	21.87%	23.81%
3-5 anni	18.93%	18.76%
5-7 anni	12.83%	12.20%
7-10 anni	14.08%	13.84%
> 10 anni	32.29%	31.40%

Durata e rendimento alla scadenza

	Gruppo d'investimento	Benchmark
Modified Duration	6.4	6.4
Rendimento alla scadenza teorica*	3.40%	3.50%

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

Struttura del portafoglio per rating

	Gruppo d'investimento	Benchmark
AAA	11.13%	11.76%
AA	43.20%	42.54%
A	32.08%	31.32%
BBB	14.55%	14.35%
BB	0.02%	0.04%
B	-	-
NR	-	0.00%
Liquidità	-1.00%	-

Struttura del portafoglio secondo il paese/regione

	Gruppo d'investimento	Benchmark
Stati Uniti	41.89%	40.37%
Cina	9.86%	9.75%
Giappone	9.46%	9.64%
Francia	5.24%	5.31%
Germania	4.95%	4.49%
Regno Unito	4.21%	4.33%
Canada	4.02%	3.51%
Italia	3.14%	3.26%
Paesi Bassi	2.25%	1.89%
Altri	15.97%	17.45%
Liquidità	-1.00%	-