

30 giugno 2025

Fondazione d'investimento Swiss Life Obbligazioni Global Stati ex CHF Indicizzate PM (CHF hedged)

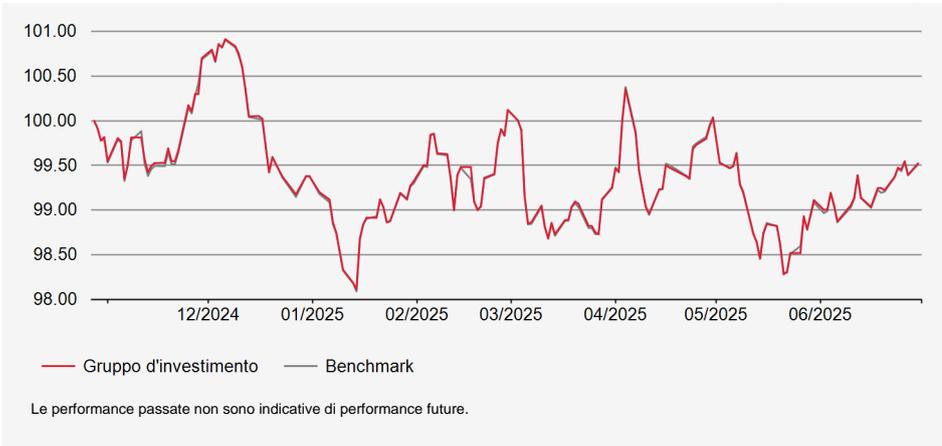


Patrimonio netto (NAV) in mio. CHF: 17.33
Valore d'inventario netto per diritto in CHF: 995.25

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 FTSE Non-CHF World Government Bond Index Total Return (CHF hedged). Realizzazione tramite Swiss Life Index Funds (CH) Bond Global Government 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.svkv-asir.ch) raccomanda di escludere.

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	0.15%	0.42%	0.28%	-	-	-	-	-
Benchmark	0.13%	0.43%	0.26%	-	-	-	-	-

Dati statistici (annualizzati)

	1 anno	3 anni	5 anni	10 anni	Inizio
Volatilità Gruppo d'investimento (in %)	-	-	-	-	2.89
Volatilità del Benchmark (in %)	-	-	-	-	2.91
Tracking Error ex post (in %)	-	-	-	-	0.08
Information Ratio	-	-	-	-	0.22
Sharpe Ratio	-	-	-	-	-0.37
Correlazione	-	-	-	-	1.00
Beta	-	-	-	-	0.99
Jensen alfa	-	-	-	-	0.01
Maximum Drawdown (in %)	-	-	-	-	-2.77
Recovery Period (anni)	-	-	-	-	-

Performance

Storia insufficiente di dati

Informazioni sul prodotto

Numero di valore: 137660509
ISIN: CH1376605098
LEI: 254900WRQBH1EKTFLX93
Codice Bloomberg: SLAIGSP SW
Benchmark: FTSE Non-CHF World Government Bond Index Total Return (hdg)
Valuta: CHF
Domicilio: Svizzera
Data di lancio: 28/10/2024
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.

Asset Manager in base al Swiss Life Best Select Invest Plus@:
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 Stati ex CHF Indicizzate PM (CHF hedged)

Struttura del portafoglio per settore

	Gruppo d'investimento	Benchmark
Treasury	101.25%	100.00%
Liquidità	-1.25%	-

Struttura del portafoglio per scadenze

	Gruppo d'investimento	Benchmark
0-3 anni	26.46%	27.88%
3-5 anni	20.38%	20.16%
5-7 anni	13.03%	12.61%
7-10 anni	14.14%	14.20%
> 10 anni	25.99%	25.15%

Durata e rendimento alla scadenza

	Gruppo d'investimento	Benchmark
Modified Duration	6.9	6.9
Rendimento alla scadenza teorica*	3.13%	3.19%

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

Struttura del portafoglio secondo il paese/regione

	Gruppo d'investimento	Benchmark
Stati Uniti	41.77%	40.91%
Cina	10.33%	10.24%
Giappone	9.84%	9.81%
Francia	6.75%	6.68%
Italia	6.40%	6.38%
Germania	5.41%	5.37%
Regno Unito	5.26%	5.17%
Spagna	4.22%	4.14%
Canada	1.76%	1.77%
Altri	9.53%	9.54%
Liquidità	-1.25%	-

Principali debitori e rating

	Gruppo d'investimento	Benchmark
United States of America	AA+	41.77%
People's Republic of China	A+	10.33%
Japan	A+	9.84%
French Republic	AA-	6.75%
Republic of Italy	BBB+	6.40%
Federal Republic of Germany	AAA	5.41%
United Kingdom of Great Britain and Northern Ireland	AA	5.26%
Kingdom of Spain	A	4.22%
Canada	AAA	1.76%
Kingdom of Belgium	AA	1.41%

Struttura del portafoglio per rating

	Gruppo d'investimento	Benchmark
AAA	10.67%	10.61%
AA	57.14%	56.13%
A	26.31%	26.14%
BBB	7.13%	7.11%
Liquidità	-1.25%	-