

30 giugno 2025



Fondazione d'investimento Swiss Life

Obbligazioni Global Imprese ex CHF Indicizzate PM (CHF hedged)

SwissLife

Patrimonio netto (NAV) in mio. CHF: 17.38
Valore d'inventario netto per diritto in CHF: 1,007.22

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 Corporate ex CHF (CHF hedged). Realizzazione tramite Swiss Life Index Funds (CH) Bond Global Corporate 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)



Le performance passate non sono indicative di performance future.

Informazioni sul prodotto

Numero di valore: 137660510
ISIN: CH1376605106
LEI: 254900M7W666VL12J929
Codice Bloomberg: SLAIGUP SW
Benchmark: Bloomberg Global Aggregate Corporate ex CHF Total Return (CHF hedged)
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%

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	1.60%	1.01%	0.80%	-	-	-	-	-
Benchmark	1.65%	1.02%	0.85%	-	-	-	-	-

Dati statistici (annualizzati)

	1 anno	3 anni	5 anni	10 anni	Inizio
Volatilità Gruppo d'investimento (in %)	-	-	-	-	3.28
Volatilità del Benchmark (in %)	-	-	-	-	3.32
Tracking Error ex post (in %)	-	-	-	-	0.11
Information Ratio	-	-	-	-	0.32
Sharpe Ratio	-	-	-	-	0.16
Correlazione	-	-	-	-	1.00
Beta	-	-	-	-	0.99
Jensen alfa	-	-	-	-	0.05
Maximum Drawdown (in %)	-	-	-	-	-3.24
Recovery Period (anni)	-	-	-	-	-

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 Imprese ex CHF Indicizzate PM (CHF hedged)

Struttura del portafoglio per settore

	Gruppo d'investimento	Benchmark
Industrial	52.10%	51.50%
Financial Institutions	39.98%	39.34%
Utilities	8.86%	9.16%
ABS	-	0.01%
Liquidità	-0.93%	-

Principali debitori e rating

	Gruppo d'investimento	Benchmark
Bank of America, New York	A+	1.51%
JPMorgan Chase & Co	A+	1.51%
Goldman Sachs Group Inc/The	A	1.44%
Morgan Stanley	A+	1.36%
Nestle SA	AA-	1.29%
Cooperatieve Rabobank UA	A-	1.10%
HSBC Holdings PLC	A-	1.01%
Citigroup Inc	BBB+	0.99%
Wells Fargo & Co	A	0.99%
Takeda Pharmaceutical Co Ltd	BBB+	0.97%

Struttura del portafoglio per scadenze

	Gruppo d'investimento	Benchmark
0-3 anni	22.30%	23.11%
3-5 anni	21.56%	21.21%
5-7 anni	14.65%	13.90%
7-10 anni	15.62%	15.71%
> 10 anni	25.87%	26.07%

Durata e rendimento alla scadenza

	Gruppo d'investimento	Benchmark
Modified Duration	5.9	5.9
Rendimento alla scadenza teorica*	4.36%	4.45%

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

Struttura del portafoglio per rating

	Gruppo d'investimento	Benchmark
AAA	0.60%	0.71%
AA	9.44%	7.90%
A	48.18%	44.01%
BBB	42.65%	47.19%
BB	0.05%	0.19%
Liquidità	-0.93%	-

Struttura del portafoglio secondo il paese/regione

	Gruppo d'investimento	Benchmark
Stati Uniti	56.99%	56.29%
Paesi Bassi	6.45%	5.25%
Regno Unito	6.33%	6.45%
Francia	6.23%	6.48%
Canada	5.03%	5.10%
Giappone	3.66%	2.34%
Germania	2.06%	2.47%
Lussemburgo	2.00%	1.33%
Australia	1.75%	1.90%
Altri	10.42%	12.40%
Liquidità	-0.93%	-