

30 giugno 2025

# Fondazione d'investimento Swiss Life

## Obbligazioni CHF AAA-BBB Indicizzate PM



**Patrimonio netto (NAV) in mio. CHF: 68.19**  
**Valore d'inventario netto per diritto in CHF: 1,007.49**

### 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 SBI® AAA-BBB Total Return. Realizzazione tramite Swiss Life Index Funds (CH) Bond Swiss Francs AAA-BBB; 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.

### 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	-0.53%	-1.06%	0.86%	-	-	-	-	-
Benchmark	-0.56%	-1.05%	0.83%	-	-	-	-	-

### Dati statistici (annualizzati)

	1 anno	3 anni	5 anni	10 anni	Inizio
Volatilità Gruppo d'investimento (in %)	-	-	-	-	3.16
Volatilità del Benchmark (in %)	-	-	-	-	3.12
Tracking Error ex post (in %)	-	-	-	-	0.05
Information Ratio	-	-	-	-	1.76
Sharpe Ratio	-	-	-	-	0.18
Correlazione	-	-	-	-	1.00
Beta	-	-	-	-	1.01
Jensen alfa	-	-	-	-	0.09
Maximum Drawdown (in %)	-	-	-	-	-3.47
Recovery Period (anni)	-	-	-	-	0.15

### Performance

Storia insufficiente di dati

### Informazioni sul prodotto

**Numero di valore:** 137660508  
**ISIN:** CH1376605080  
**LEI:** 254900HVSBMFQUTCBS55  
**Codice Bloomberg:** SLAICHP SW  
**Benchmark:** SBI® AAA-BBB Total Return  
**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:** 13.00  
**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](http://www.swisslife.ch/fondazioneinvestimento)

**Quote spese operative TER KGAST ex ante:** 0.01%

**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](http://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 CHF AAA-BBB Indicizzate PM

### Struttura del portafoglio per settore

	Gruppo d'investimento	Benchmark
Covered	34.37%	34.58%
Local Authority	18.46%	17.99%
Treasury	14.42%	14.46%
Financial Institutions	12.57%	12.35%
Industrial	11.24%	11.76%
Agency	4.82%	4.98%
Utilities	1.74%	1.84%
Supranational	1.73%	1.77%
Sovereign	0.27%	0.21%
ABS	-	0.06%
Liquidità	0.38%	-

### Principali debitori e rating

	Gruppo d'investimento	Benchmark
Pfandbriefbank schweizerischer Hypothekarinstitute AG	AAA	15.63%
Swiss Confederation	AAA	14.46%
Pfandbriefzentrale der schweizerischen Kantonalbanken AG	AAA	14.37%
Canton of Geneva Switzerland	AA	1.41%
City of Zurich Switzerland	AAA	1.29%
Zürcher Kantonalbank	AAA	1.24%
Luzerner Kantonalbank AG	AA	1.20%
Credit Agricole Group	AA-	1.16%
Nestle SA	AA	1.09%
UBS Group AG	AA+	0.90%

### Struttura del portafoglio per scadenze

	Gruppo d'investimento	Benchmark
0-3 anni	22.62%	24.23%
3-5 anni	22.04%	21.52%
5-7 anni	15.89%	15.70%
7-10 anni	16.20%	15.59%
> 10 anni	23.25%	22.96%

### Durata e rendimento alla scadenza

	Gruppo d'investimento	Benchmark
Modified Duration	7.2	7.1
Rendimento alla scadenza teorica*	0.68%	0.68%

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

### Struttura del portafoglio per rating

	Gruppo d'investimento	Benchmark
AAA	56.89%	57.54%
AA	18.88%	19.22%
A	16.11%	15.59%
BBB	7.76%	7.64%
Liquidità	0.38%	-

### Struttura del portafoglio secondo il paese/regione

	Gruppo d'investimento	Benchmark
Svizzera	77.54%	78.26%
Francia	3.16%	3.47%
Canada	2.60%	2.33%
Stati Uniti	2.59%	2.71%
Germania	2.54%	2.41%
Paesi Bassi	1.88%	1.95%
Australia	1.04%	1.02%
Regno Unito	1.03%	1.05%
Spagna	0.91%	0.70%
Altri	6.33%	6.09%
Liquidità	0.38%	-