

30 aprile 2026



# Fondazione d'investimento Swiss Life

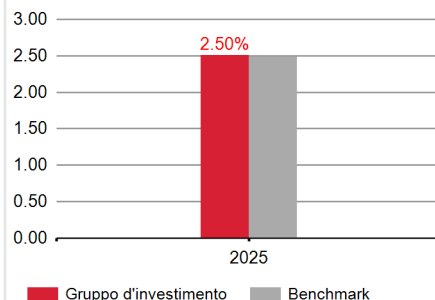
## Obbligazioni Global Imprese ex CHF Indicizzate SPM (CHF hedged)

Patrimonio netto (NAV) in mio. CHF: 32.59  
Valore d'inventario netto per diritto in CHF: 1,003.29

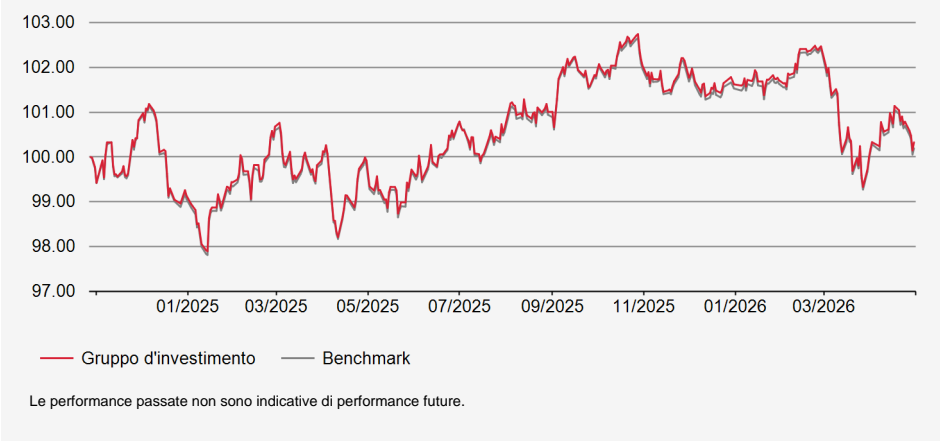
### Strategia d'investimento

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



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



### 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

### 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	-1.27%	0.33%	-1.36%	0.41%	-	-	-	0.22%
Benchmark	-1.31%	0.26%	-1.42%	0.38%	-	-	-	0.13%

### Dati statistici (annualizzati)

	1 anno	3 anni	5 anni	10 anni	Inizio
Volatilità Gruppo d'investimento (in %)	3.09	-	-	-	3.16
Volatilità del Benchmark (in %)	3.12	-	-	-	3.19
Tracking Error ex post (in %)	0.13	-	-	-	0.11
Information Ratio	0.21	-	-	-	0.74
Sharpe Ratio	0.13	-	-	-	0.01
Correlazione	1.00	-	-	-	1.00
Beta	0.99	-	-	-	0.99
Jensen alfa	0.03	-	-	-	0.09
Maximum Drawdown (in %)	-3.32	-	-	-	-3.32
Recovery Period (anni)	-	-	-	-	-

**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%  
**ex post al:** 30/09/2025 0.01%

**SPM-Tranche:** La tranche SPM è riservata sia agli investitori con un accordo speciale con Swiss Life Asset Management SA (SLAM CH) che ai clienti della gestione patrimoniale e ai clienti dei partner di cooperazione di SLAM CH (con accordo supplementare).  
**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 Global Imprese ex CHF Indicizzate SPM (CHF hedged)

### Struttura del portafoglio per settore

	Gruppo d'investimento	Benchmark
Industrial	51.41%	51.91%
Financial Institutions	38.28%	38.40%
Utilities	9.74%	9.69%
Liquidità	0.57%	-

### Principali debitori e rating

	Gruppo d'investimento	Benchmark	
JPMorgan Chase & Co	A+	1.46%	1.42%
Morgan Stanley	A+	1.45%	1.43%
Bank of America, New York	A+	1.32%	1.33%
Goldman Sachs Group Inc/The	A	1.25%	1.09%
Citigroup Inc	BBB+	0.98%	0.93%
Wells Fargo & Co	A	0.96%	0.94%
Amazon.com Inc	AA-	0.90%	0.78%
HSBC Holdings PLC	A-	0.86%	0.96%
AT&T Inc	BBB	0.82%	0.79%
Verizon Communications Inc	BBB+	0.79%	0.86%

### Struttura del portafoglio per scadenze

	Gruppo d'investimento	Benchmark
0-3 anni	22.48%	22.05%
3-5 anni	19.77%	21.25%
5-7 anni	14.75%	14.25%
7-10 anni	16.88%	16.35%
> 10 anni	26.13%	26.11%

### Durata e rendimento alla scadenza

	Gruppo d'investimento	Benchmark
Modified Duration	5.9	5.8
Rendimento alla scadenza teorica*	4.78%	4.71%

\* prima copertura del rischio di cambio

### Struttura del portafoglio per rating

	Gruppo d'investimento	Benchmark
AAA	0.68%	0.60%
AA	8.29%	8.39%
A	45.11%	44.89%
BBB	45.34%	46.02%
BB	-	0.10%
Liquidità	0.57%	-

### Struttura del portafoglio secondo il paese/regione

	Gruppo d'investimento	Benchmark
Stati Uniti	57.29%	56.83%
Regno Unito	6.68%	6.82%
Francia	6.21%	6.14%
Canada	5.01%	5.13%
Germania	4.97%	4.85%
Giappone	3.29%	3.36%
Australia	2.25%	2.29%
Spagna	1.95%	2.16%
Italia	1.67%	1.81%
Altri	10.10%	10.60%
Liquidità	0.57%	-