

30 aprile 2026

# Fondazione d'investimento Swiss Life

## Obbligazioni CHF AAA-BBB Indicizzate SPM

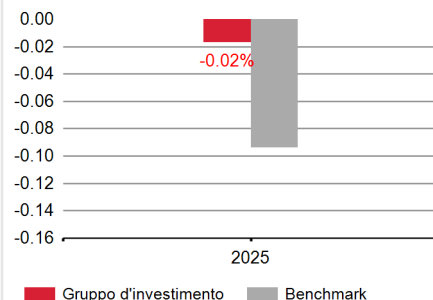


**Patrimonio netto (NAV) in mio. CHF: 107.70**  
**Valore d'inventario netto per diritto in CHF: 1,012.88**

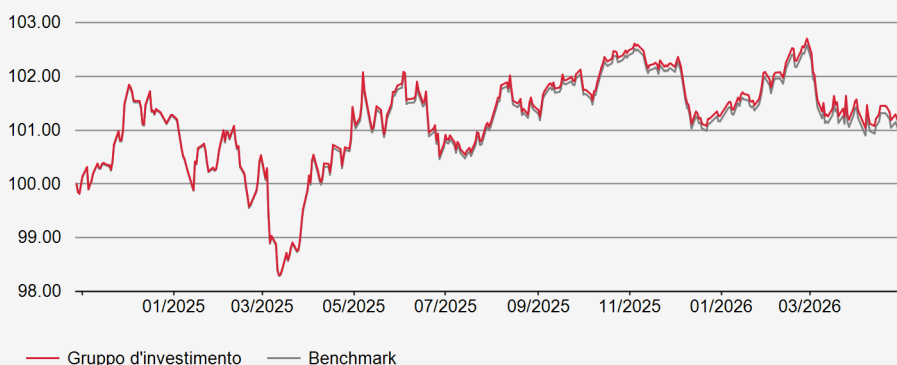
### Strategia d'investimento

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.svkv-asir.ch) raccomanda di escludere.

### Performance



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



Le performance passate non sono indicative di performance future.

### 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: ASLL  
[www.swisslife.ch/fondazioneinvestimento](http://www.swisslife.ch/fondazioneinvestimento)

**Quote spese operative TER KGAST**

**ex ante:** 0.00%

**ex post al:** 30/09/2025 0.00%

### 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	0.02%	-0.24%	-0.78%	-0.14%	-	-	-	0.85%
Benchmark	-0.01%	-0.25%	-0.81%	-0.22%	-	-	-	0.76%

### Dati statistici (annualizzati)

	1 anno	3 anni	5 anni	10 anni	Inizio
Volatilità Gruppo d'investimento (in %)	2.43	-	-	-	2.68
Volatilità del Benchmark (in %)	2.42	-	-	-	2.66
Tracking Error ex post (in %)	0.03	-	-	-	0.03
Information Ratio	2.96	-	-	-	2.57
Sharpe Ratio	-0.05	-	-	-	0.24
Correlazione	1.00	-	-	-	1.00
Beta	1.00	-	-	-	1.01
Jensen alfa	0.08	-	-	-	0.09
Maximum Drawdown (in %)	-1.62	-	-	-	-3.47
Recovery Period (anni)	-	-	-	-	0.15

**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 CHF AAA-BBB Indicizzate SPM

### Struttura del portafoglio per settore

	Gruppo d'investimento	Benchmark
Covered	34.04%	34.29%
Local Authority	18.58%	18.57%
Treasury	14.51%	14.52%
Industrial	12.20%	12.18%
Financial Institutions	11.08%	11.16%
Agency	5.10%	5.09%
Supranational	1.96%	1.97%
Utilities	1.83%	1.72%
Sovereign	0.48%	0.49%
Liquidità	0.21%	-

### Principali debitori e rating

	Gruppo d'investimento	Benchmark
Pfandbriefbank schweizerischer Hypothekarinstitute AG	AAA	15.60%
Swiss Confederation	AAA	14.54%
Pfandbriefzentrale der schweizerischen Kantonalbanken AG	AAA	14.46%
Canton of Geneva Switzerland	AA	1.28%
Luzerner Kantonalbank AG	AA-	1.24%
City of Zurich Switzerland	AAA	1.19%
Zürcher Kantonalbank	AAA	1.12%
Credit Agricole Group	AA-	1.01%
Nestle SA	AA	0.97%
Canton of Zurich	AAA	0.77%

### Struttura del portafoglio per scadenze

	Gruppo d'investimento	Benchmark
0-3 anni	22.48%	23.49%
3-5 anni	20.63%	20.57%
5-7 anni	17.12%	16.88%
7-10 anni	17.40%	16.74%
> 10 anni	22.37%	22.32%

### Durata e rendimento alla scadenza

	Gruppo d'investimento	Benchmark
Modified Duration	7.1	7.1
Rendimento alla scadenza teorica*	0.78%	0.78%

\* prima copertura del rischio di cambio

### Struttura del portafoglio per rating

	Gruppo d'investimento	Benchmark
AAA	57.72%	57.84%
AA	18.76%	19.34%
A	15.82%	15.81%
BBB	7.29%	7.01%
NR	0.19%	-
Liquidità	0.21%	-

### Struttura del portafoglio secondo il paese/regione

	Gruppo d'investimento	Benchmark
Svizzera	74.51%	74.74%
Stati Uniti	5.60%	5.61%
Francia	3.73%	3.69%
Germania	3.29%	3.24%
Canada	2.51%	2.57%
supernazionale	1.82%	1.82%
Australia	1.19%	1.16%
Austria	0.93%	0.94%
Spagna	0.91%	0.84%
Altri	5.30%	5.41%
Liquidità	0.21%	-