

30 aprile 2026

Fondazione d'investimento Swiss Life

Obbligazioni CHF AAA-BBB ESG Indicizzate SPM

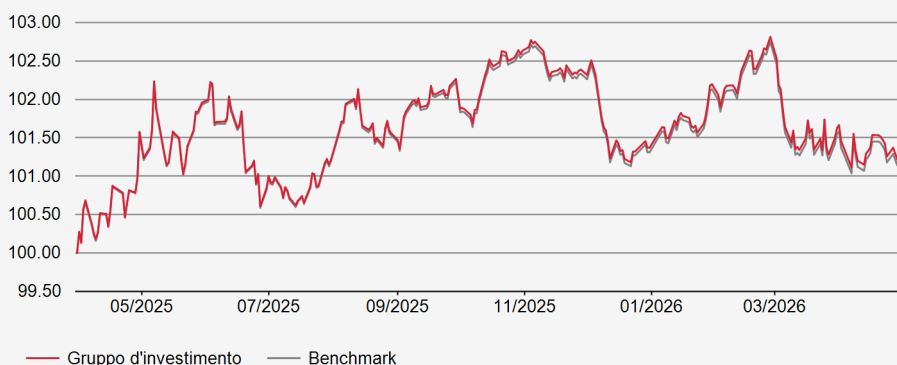


Patrimonio netto (NAV) in mio. CHF: 2.99
Valore d'inventario netto per diritto in CHF: 1,013.69

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® ESG AAA-BBB Total Return. Realizzazione tramite Swiss Life Index Funds (CH) Bond Responsible 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.

Evoluzione del valore nella valuta di riferimento (base 100)



Le performance passate non sono indicative di performance future.

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	0.00%	-0.25%	-0.81%	-0.20%	-	-	-	1.26%
Benchmark	-0.02%	-0.26%	-0.82%	-0.28%	-	-	-	1.19%

Dati statistici (annualizzati)

	1 anno	3 anni	5 anni	10 anni	Inizio
Volatilità Gruppo d'investimento (in %)	2.48	-	-	-	2.71
Volatilità del Benchmark (in %)	2.47	-	-	-	2.81
Tracking Error ex post (in %)	0.03	-	-	-	0.03
Information Ratio	2.67	-	-	-	2.76
Sharpe Ratio	-0.08	-	-	-	0.43
Correlazione	1.00	-	-	-	1.00
Beta	1.00	-	-	-	1.00
Jensen alfa	0.07	-	-	-	0.07
Maximum Drawdown (in %)	-1.65	-	-	-	-1.65
Recovery Period (anni)	-	-	-	-	-

Performance

Storia insufficiente di dati

Informazioni sul prodotto

Numero di valore: 142759585
ISIN: CH1427595850
LEI: 2549007FEM7DLVNXSM63
Codice Bloomberg: SLAICRP SW
Benchmark: SBI® ESG AAA-BBB Total Return
Valuta: CHF
Domicilio: Svizzera

Data di lancio: 31/03/2025
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 management: 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: 0.01%

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, «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 ESG Indicizzate SPM

Struttura del portafoglio per settore

	Gruppo d'investimento	Benchmark
Covered	35.97%	36.19%
Local Authority	19.43%	19.30%
Treasury	15.40%	15.38%
Financial Institutions	11.34%	11.14%
Industrial	9.02%	9.19%
Agency	4.61%	5.02%
Supranational	2.07%	2.09%
Utilities	1.25%	1.18%
Sovereign	0.61%	0.52%
Liquidità	0.29%	-

Principali debitori e rating

	Gruppo d'investimento	Benchmark
Pfandbriefbank schweizerischer Hypothekarinstitute AG	AAA	16.35%
Swiss Confederation	AAA	15.45%
Pfandbriefzentrale der schweizerischen Kantonalbanken AG	AAA	15.41%
Canton of Geneva Switzerland	AA	1.43%
Credit Agricole Group	AA-	1.31%
Zürcher Kantonalbank	AA+	1.28%
Luzerner Kantonalbank AG	AA-	1.25%
City of Zurich Switzerland	AAA	1.14%
UBS Group AG	AA	0.82%
Canton of Zurich	AAA	0.73%

Struttura del portafoglio per scadenze

	Gruppo d'investimento	Benchmark
0-3 anni	21.05%	22.46%
3-5 anni	20.02%	20.34%
5-7 anni	17.94%	16.92%
7-10 anni	17.29%	17.06%
> 10 anni	23.69%	23.22%

Durata e rendimento alla scadenza

	Gruppo d'investimento	Benchmark
Modified Duration	7.3	7.2
Rendimento alla scadenza teorica*	0.78%	0.77%

* prima copertura del rischio di cambio

Struttura del portafoglio per rating

	Gruppo d'investimento	Benchmark
AAA	60.51%	60.98%
AA	18.71%	18.49%
A	14.31%	14.52%
BBB	6.11%	6.00%
NR	0.08%	-
Liquidità	0.29%	-

Struttura del portafoglio secondo il paese/regione

	Gruppo d'investimento	Benchmark
Svizzera	77.79%	77.99%
Francia	3.39%	3.50%
Stati Uniti	3.11%	3.21%
Germania	2.88%	2.82%
Canada	2.34%	2.50%
supernazionale	1.89%	1.92%
Australia	1.24%	1.17%
Austria	1.23%	0.99%
Regno Unito	0.91%	0.73%
Altri	4.94%	5.16%
Liquidità	0.29%	-