

28 febbraio 2023

Fondazione d'investimento Swiss Life Obbligazioni Global PM (CHF hedged)

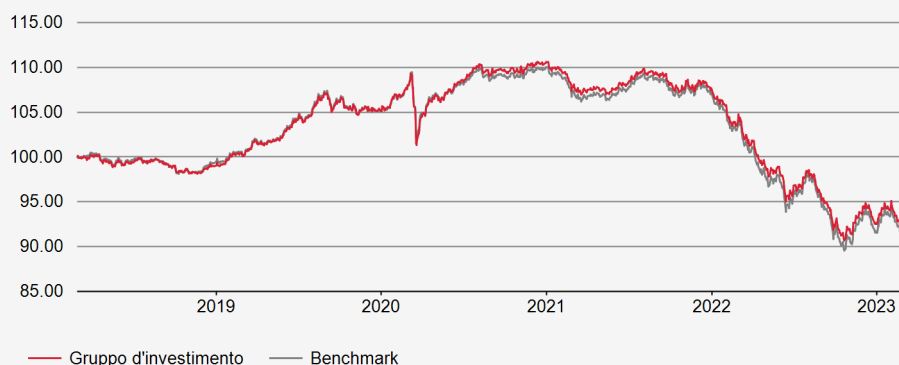


Patrimonio netto (NAV) in mio. CHF: 124.80
Valore d'inventario netto per diritto in CHF: 116.68

Strategia d'investimento

Investimenti in titoli di credito in valute estere di debitori domiciliati in Svizzera o all'estero (dal 1.1.2011 CHF hedged). Selezione attiva di titoli, gestione della duration e posizionamento della curva dei tassi d'interesse. Limitazione per debitore: 10% (eccezione: se rappresentati nel benchmark, max. 5%-punti in più della ponderazione del benchmark). Debitori esterni al benchmark: max. 10%. Rating medio: almeno A-. I rischi valutari vengono coperti al 90% almeno contro il franco. Realizzazione tramite Swiss Life iFunds (CH) Bond Global Aggregate (CHF hedged); fondi d'investimento di diritto svizzero della categoria "altri fondi per investimenti tradizionali".

Evoluzione del valore nella valuta di riferimento (base 100)



Le performance passate non sono indicative di performance future.

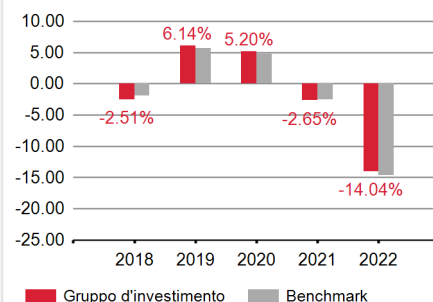
Performance nella valuta di riferimento

	PERFORMANCE CUMULATA				PERFORMANCE ANNUALIZZATA			
	YTD	1 MESE	3 MESI	1 ANNO	3 ANNI	5 ANNI	10 ANNI	INIZIO
GRUPPO D'INVESTIMENTO	-0.36%	-2.11%	-1.65%	-11.34%	-5.10%	-1.61%	0.11%	0.98%
BENCHMARK	0.11%	-2.01%	-1.52%	-11.44%	-5.32%	-1.73%	-0.03%	0.71%

Dati statistici (annualizzati)

	1 ANNO	3 ANNI	5 ANNI	10 ANNI	INIZIO
Volatilità Gruppo d'investimento (in %)	7.05	5.42	4.71	4.01	5.67
Volatilità del Benchmark (in %)	7.75	5.65	4.91	4.06	5.68
Tracking Error ex post (in %)	0.90	0.61	0.55	0.64	1.44
Information Ratio	0.11	0.36	0.21	0.23	0.19
Sharpe Ratio	-1.71	-0.89	-0.22	0.16	0.20
Correlazione	1.00	0.99	0.99	0.99	0.97
Beta	0.91	0.95	0.95	0.98	0.97
Jensen alfa	-0.98	-0.01	0.07	0.16	0.30

Performance



Informazioni sul prodotto

Numero di valore: 3026055
ISIN: CH0030260555
LEI: 254900F82G5L48XPDV74
Codice Bloomberg: SLOFGPM SW
Benchmark: BLOOMBERG GLO AGG EX SEC EX CNY HEDGED CHF
Moneta: CHF
Domicilio: Svizzera
Data di creazione: 31/05/2007
Prezzo di prima emissione: 100.00
Chiusura d'esercizio: 30.09
Emissione/Riscatto: giornalmente
Termine d'accettazione: 14.30
Commissione d'emissione/riscatto: nessuna
Prassi di distribuzione: Capitalizzazione
Asset Manager in base al Swiss Life Best Select Invest Plus@: Swiss Life Asset Management SA

Controllo asset manager: PPCmetrics supporta il controllo costante dell'asset manager e la valutazione dei risultati d'investimento.

Pubblicazioni di corsi: Bloomberg: ASSL
www.swisslife.ch/fondazioneinvestimento

Quote spese operative TER KGAST
ex ante: 0.15%
ex post al: 30/09/2022 0.15%

PM tranche: L'acquisto di questa tranche è possibile solo nell'ambito di un accordo speciale con Swiss Life Asset Management SA.

Benchmark: Il benchmark è stato modificato al 1° luglio 2012. Per informazioni relative al precedente benchmark potete rivolgervi alla Fondazione d'investimento Swiss Life.

Asset Manager: La selezione dei 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.

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 PM (CHF hedged)

Struttura del portafoglio per settore

	Gruppo d'investimento	Benchmark
STATI E SIMILI	51.57%	72.50%
FINANZA	22.86%	11.85%
CONSUMO NON CICLICO	7.97%	3.80%
SERVIZI DI PUBBLICA UTILITÀ	3.04%	2.57%
BENI INDUSTRIALI	2.84%	1.96%
COMUNICAZIONE	2.32%	2.01%
ISTITUTI LETTERE DI PEGNO	1.17%	0.00%
CONSUMO CICLICO	1.13%	1.60%
SUPERNAZIONALE	5.85%	-
ALTRI	1.84%	3.73%
LIQUIDITÀ	0.24%	-
COPERTURA DEL RISCHIO DI CAMBIO	-0.82%	-

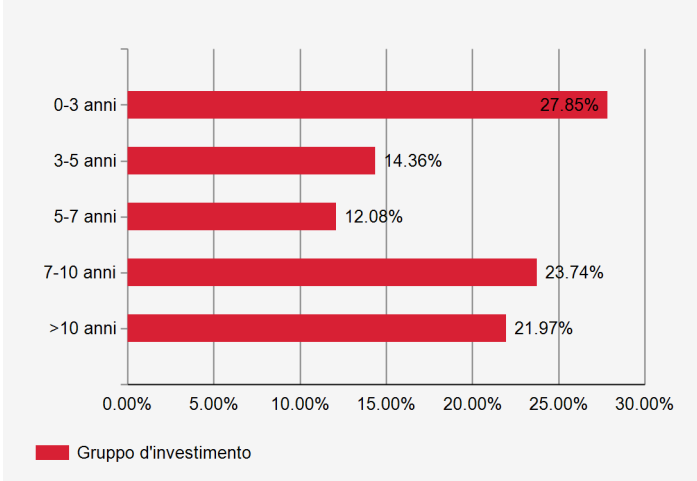
Principali debitori e rating

	Rating	Gruppo d'investimento
US Treasury N/B	AAA	20.69%
Giappone	A+	7.78%
Federal Republic of Germany	AAA	6.26%
Italia	BBB	2.74%
Kreditanstalt fuer Wiederaufbau	AAA	2.72%

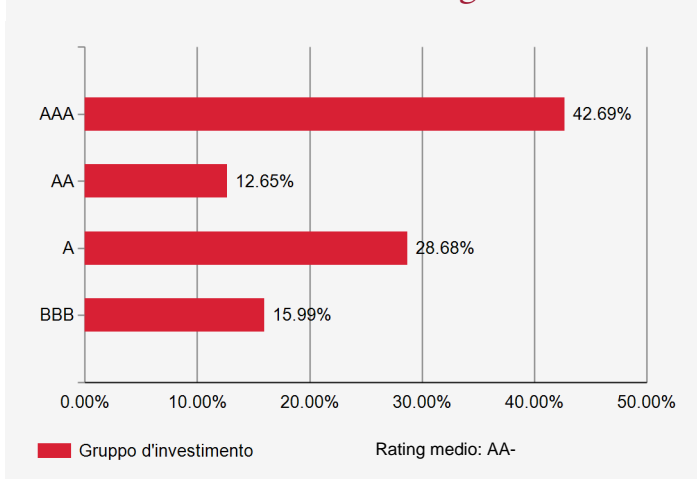
Ulteriori informazioni sui debitori

Numero di debitori	153
Quota di debitori senza benchmark	1.17%

Struttura della scadenza dei titoli



Investimenti secondo il rating



Durata e rendimento alla scadenza

	Gruppo d'investimento	Benchmark
Modified Duration	6.5	6.9
Rendimento alla scadenza teorica*	3.92%	3.80%

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

Struttura del portafoglio per valute e la duration

	Gruppo d'investimento		Benchmark	
	Peso	Duration	Peso	Duration
USD	41.70%	6.81	43.03%	6.27
EUR	29.17%	5.79	25.55%	6.49
JPY	8.28%	8.85	15.58%	9.14
GBP	6.53%	6.47	4.96%	8.69
Altri	14.32%	5.38	10.89%	6.61

Struttura del portafoglio secondo il paese/regione

	Gruppo d'investimento	Benchmark
STATI UNITI	39.33%	35.93%
GERMANIA	11.63%	5.60%
GIAPPONE	9.46%	16.34%
CANADA	6.61%	4.38%
REGNO UNITO	4.71%	5.38%
FRANCIA	4.28%	6.03%
ITALIA	3.50%	3.81%
REGIONE EUROPEA (EUR)	12.14%	8.96%
REGIONE EUROPEA (EX EUR)	4.37%	0.98%
GLOBALE	1.34%	0.39%
ALTRI	3.21%	12.18%
LIQUIDITÀ, COPERTURA	-0.58%	-