



Fondazione d'investimento Swiss Life

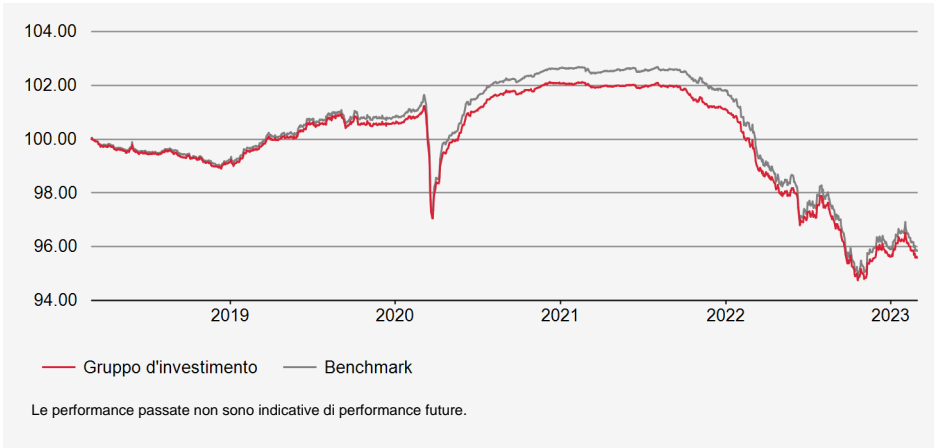
Obbligazioni Global Imprese Short Term PM (CHF hedged) SwissLife

Patrimonio netto (NAV) in mio. CHF: 1,407.02
Valore d'inventario netto per diritto in CHF: 97.65

Strategia d'investimento

Investimenti in titoli di credito espressi in valute estere di società (agenzie e supranational incluse) con una durata residua breve (prevalentemente meno di 3 anni). Selezione attiva di titoli, gestione della duration e posizionamento della curva dei tassi d'interesse. Limitazione per debitore: 10%. Debitori esterni al benchmark: max. 10%. Rating medio: almeno BBB. I rischi valutari vengono coperti al 90% almeno contro il franco. Realizzazione tramite Swiss Life iFunds (CH) Bond Global Corporates Short Term (CHF hedged); Fondi d'investimento di diritto svizzero della categoria "altri fondi per investimenti tradizionali".

Evoluzione del valore nella valuta di riferimento (base 100)



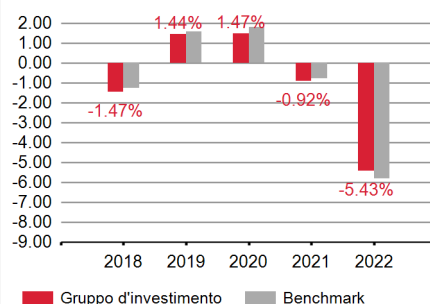
Performance nella valuta di riferimento

	PERFORMANCE CUMULATA				PERFORMANCE ANNUALIZZATA			
	YTD	1 MESE	3 MESI	1 ANNO	3 ANNI	5 ANNI	10 ANNI	INIZIO
GRUPPO D'INVESTIMENTO	-0.05%	-0.71%	-0.25%	-4.24%	-1.82%	-0.90%	-	-0.25%
BENCHMARK	-0.07%	-0.80%	-0.30%	-4.52%	-1.85%	-0.85%	-	-0.34%

Dati statistici (annualizzati)

	1 ANNO	3 ANNI	5 ANNI	10 ANNI	INIZIO
Volatilità Gruppo d'investimento (in %)	2.81	2.60	2.08	-	1.63
Volatilità del Benchmark (in %)	3.04	2.77	2.21	-	1.68
Tracking Error ex post (in %)	0.30	0.24	0.20	-	0.32
Information Ratio	0.95	0.12	-0.26	-	0.26
Sharpe Ratio	-1.55	-0.54	-0.15	-	0.20
Correlazione	1.00	1.00	1.00	-	0.98
Beta	0.92	0.94	0.94	-	0.95
Jensen alfa	-0.08	-0.06	-0.07	-	0.09

Performance



Informazioni sul prodotto

Numero di valore: 22073695
ISIN: CH0220736950
LEI: 2549003DSGO0RN37K507
Codice Bloomberg: SWLOGPM SW
Benchmark: BLOOMBERG GLO AGG CORP 1-3 YR IND HEDGED CHF
Moneta: CHF
Domicilio: Svizzera
Data di creazione: 11/10/2013
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%

Fondazione d'investimento Swiss Life

Obbligazioni Global Imprese Short Term PM (CHF hedged)

Struttura del portafoglio per settore

	Gruppo d'investimento	Benchmark
FINANZA	55.26%	52.98%
CONSUMO NON CICLICO	18.90%	11.66%
CONSUMO CICLICO	7.78%	8.53%
ENERGIA	4.79%	4.30%
MATERIALI DI BASE	3.27%	2.14%
SERVIZI DI PUBBLICA UTILITÀ	2.93%	5.49%
BENI INDUSTRIALI	2.69%	5.90%
TECNOLOGIA	2.57%	3.86%
SUPERNAZIONALE	0.89%	-
ALTRI	2.53%	5.14%
LIQUIDITÀ	-0.17%	-
COPERTURA DEL RISCHIO DI CAMBIO	-1.42%	-

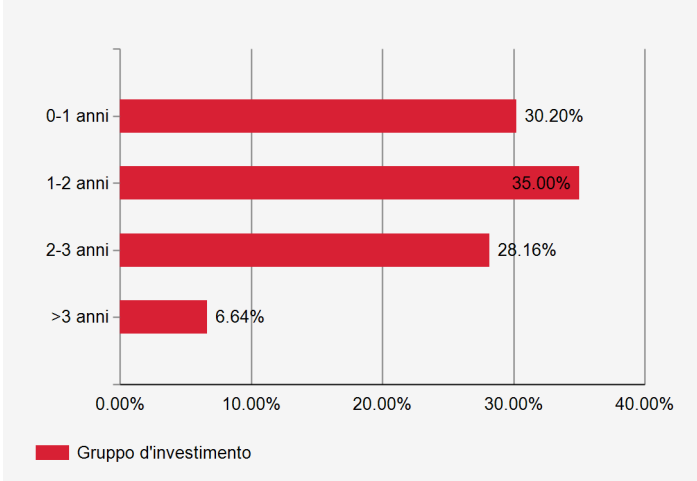
Principali debitori e rating

	Gruppo d'investimento	
Bank of America, New York	A-	2.09%
Nestle SA	AA-	1.61%
Skandinaviska Enskilda Banken AB	A	1.44%
Toronto-Dominion Bank/The	A	1.43%
Banco Santander SA, Madrid	BBB+	1.41%

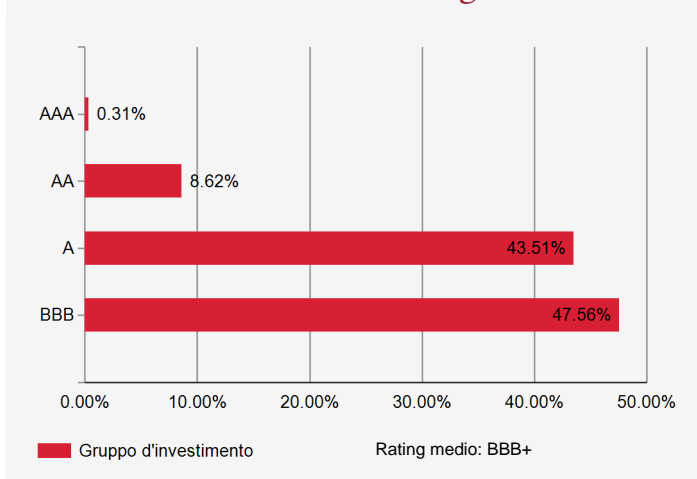
Ulteriori informazioni sui debitori

Numero di debitori	178
Quota di debitori senza benchmark	5.77%

Struttura della scadenza dei titoli



Investimenti secondo il rating



Durata e rendimento alla scadenza

	Gruppo d'investimento	Benchmark
Modified Duration	1.8	1.8
Rendimento alla scadenza teorica*	5.60%	5.09%

* 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	60.97%	1.83	62.58%	1.98
EUR	33.55%	1.65	27.86%	2.15
GBP	2.75%	1.01	2.87%	1.99
CHF	2.73%	1.56	0.54%	1.76
Altri	-	-	6.14%	1.88

Struttura del portafoglio secondo il paese/regione

	Gruppo d'investimento	Benchmark
STATI UNITI	40.22%	44.45%
REGNO UNITO	9.07%	7.55%
GIAPPONE	6.58%	5.10%
FRANCIA	6.27%	7.29%
CANADA	5.00%	6.91%
GERMANIA	4.91%	5.60%
SVEZIA	4.46%	0.99%
REGIONE EUROPEA (EUR)	10.91%	10.01%
REGIONE EUROPEA (EX EUR)	6.36%	3.39%
MERCATI EMERGENTI ASIA PACIFICO	3.84%	2.45%
ALTRI	3.98%	6.27%
LIQUIDITÀ, COPERTURA	-1.60%	-