

30 aprile 2026

Fondazione d'investimento Swiss Life Obbligazioni Emerging Markets Imprese SPM (CHF hedged)

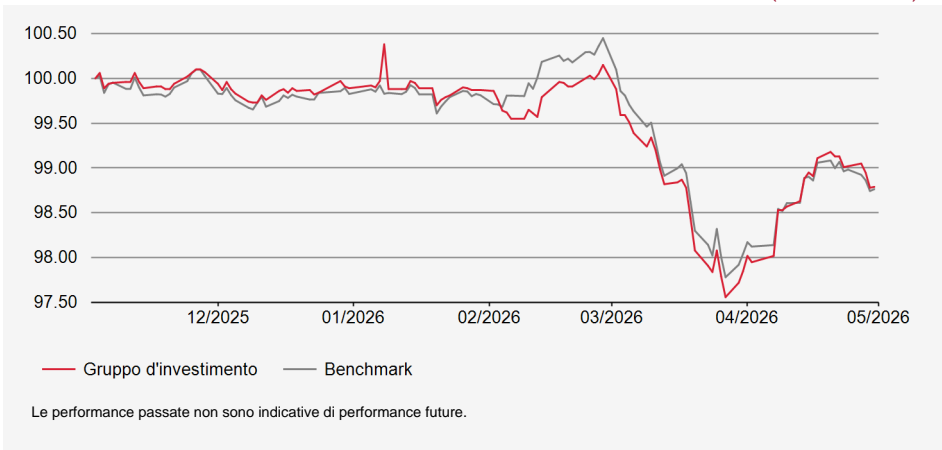


Patrimonio netto (NAV) in mio. CHF: 360.40
Valore d'inventario netto per diritto in CHF: 98.79

Strategia d'investimento

Investimenti in titoli di credito in dollari statunitensi o altre valute forti di imprese e Stati, inclusi organismi sovranazionali e agenzie, di Paesi di recente industrializzazione (Emerging Markets). Selezione attiva dei titoli, gestione della duration e posizionamento lungo la curva dei tassi. Limitazione per debitore: 10%. Titoli di credito di debitori esterni al benchmark: max. 35%. Qualità media di rating: almeno BBB-. I rischi di valuta vengono coperti almeno al 90% rispetto al franco svizzero. Attuazione con l'impiego di Swiss Life Funds (LUX) Bond Emerging Markets Corporates CHF-hedged AM Cap; fondo d'investimento di diritto lussemburghese.

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	-1.10%	0.96%	-1.08%	-	-	-	-	-
Benchmark	-1.06%	0.74%	-1.05%	-	-	-	-	-

Dati statistici (annualizzati)

	1 anno	3 anni	5 anni	10 anni	Inizio
Volatilità Gruppo d'investimento (in %)	-	-	-	-	3.85
Volatilità del Benchmark (in %)	-	-	-	-	3.98
Tracking Error ex post (in %)	-	-	-	-	0.67
Information Ratio	-	-	-	-	-0.03
Sharpe Ratio	-	-	-	-	-0.62
Correlazione	-	-	-	-	0.99
Beta	-	-	-	-	0.95
Jensen alfa	-	-	-	-	-0.06
Maximum Drawdown (in %)	-	-	-	-	-2.81
Recovery Period (anni)	-	-	-	-	-

Performance

Storia insufficiente di dati

Informazioni sul prodotto

Numero di valore: 148323397
ISIN: CH1483233974
LEI: 254900R4DORKK6JJUG51
Codice Bloomberg: SLOEUCS SW
Benchmark: JP Morgan CEMBI Broad Diversified IG Index (CHF Hedged)
Valuta: CHF
Domicilio: Svizzera
Data di lancio: 03/11/2025
Prezzo di prima emissione: 100.00
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
Controllo asset manager: Monitoraggio dei risultati d'investimento del gestore patrimoniale impiegato da parte di PPCmetrics
Pubblicazioni di corsi: Bloomberg: ASSL
www.swisslife.ch/fondazioneinvestimento

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 Emerging Markets Imprese SPM (CHF hedged)

Struttura del portafoglio per settore

	Gruppo d'investimento	Benchmark
Finanza	34.16%	41.15%
Comunicazione	14.39%	7.83%
Servizi di pubblica utilità	10.46%	9.56%
Energia	9.14%	9.69%
Consumo non ciclico	8.17%	4.90%
Consumo ciclico	6.00%	5.15%
Materiali di base	5.34%	12.22%
Tecnologia	3.43%	4.06%
Supernazionale	1.19%	-
Altri	6.19%	5.44%
Liquidità	1.42%	-
Copertura del rischio di cambio	0.10%	-

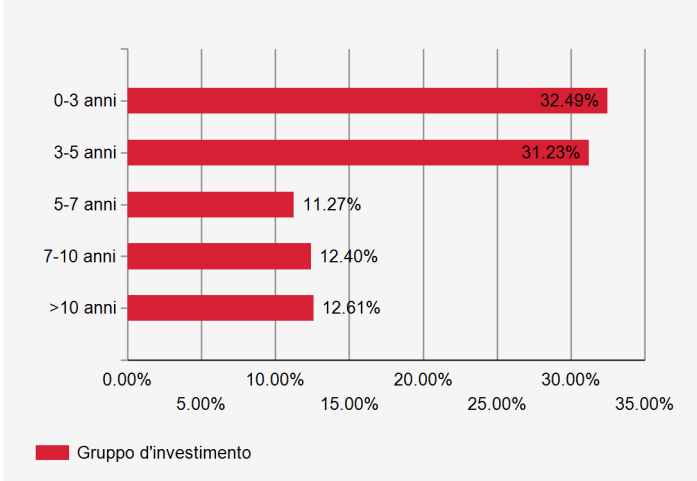
Principali debitori e rating

	Gruppo d'investimento	Benchmark
Erste Group Bank AG	3.72%	BBB+
Prosus NV	2.45%	BBB
Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd	2.09%	AA-
Genting Bhd	2.06%	BBB-
Petroliam Nasional Bhd	1.70%	BBB+

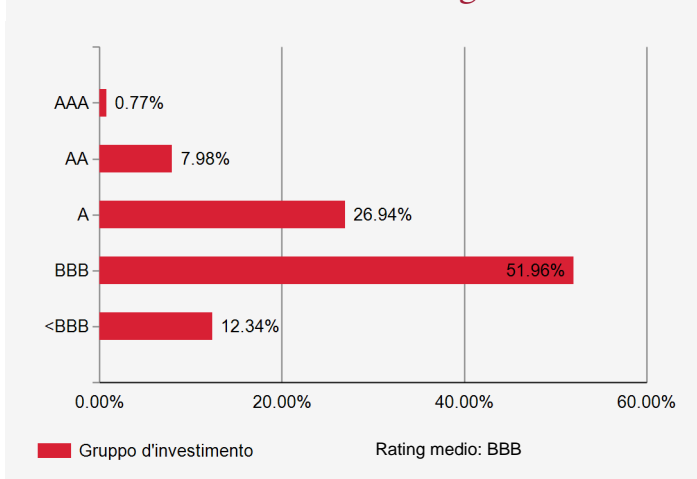
Ulteriori informazioni sui debitori

Numero di debitori	148
Quota di debitori senza benchmark	30.64%

Struttura della scadenza dei titoli



Investimenti secondo il rating



Durata e rendimento alla scadenza

	Gruppo d'investimento	Benchmark
Modified Duration	4.9	4.5
Rendimento alla scadenza teorica*	5.40%	5.05%

* prima copertura del rischio di cambio

Struttura del portafoglio secondo il paese/regione

	Gruppo d'investimento	Benchmark
Cina	7.89%	12.58%
Emirati Arabi Uniti	7.32%	5.84%
Messico	5.49%	4.20%
Singapore	5.46%	3.56%
Corea del Sud	5.16%	7.09%
Malesia	4.65%	2.11%
Arabia Saudita	4.02%	6.45%
Mercati Emergenti Asia Pacifico	16.01%	19.43%
Mercati Emergenti in America	12.78%	8.41%
Mercati Emergenti Medio Oriente	8.85%	11.35%
Altri	20.86%	18.99%
Liquidità, copertura	1.52%	-