

31 marzo 2025

Fondazione d'investimento Swiss Life Senior Secured Loans (CHF hedged)

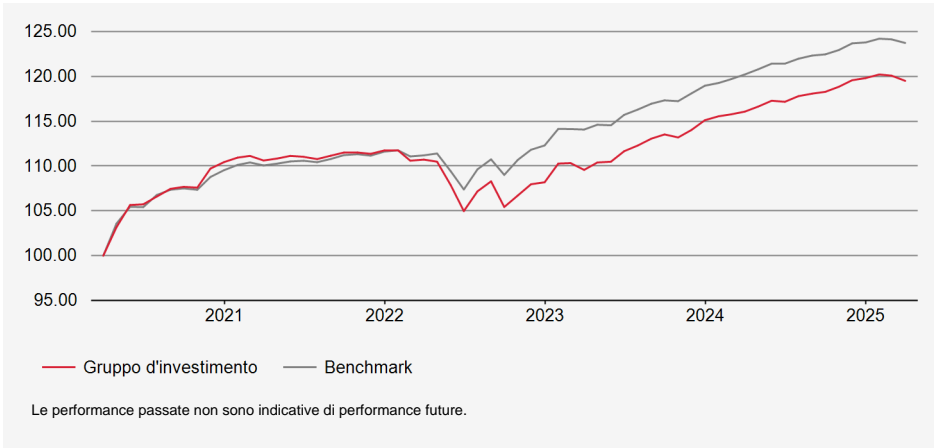


Patrimonio netto (NAV) in mio. CHF: 161.58
Valore d'inventario netto per diritto in CHF: 107.37

Strategia d'investimento

Il gruppo d'investimento mira a rendimenti stabili e elevati con una volatilità dei prezzi minima e una duration dei tassi di interesse bassa. Il gruppo d'investimento investe principalmente in prestiti garantiti Senior Secured Loans da società dei paesi sviluppati. Almeno l'85% sarà investito in Senior Secured Loans garantiti. Limitazioni per debitore per singola impresa: 5%. Al massimo il 25% è investito nello stesso settore industriale. I rischi valutari vengono coperti al 90% almeno contro il franco. Realizzazione tramite du Swiss Life Loan Fund (LUX) S.A., SICAV-SIF Senior Secured Loans V AM-Shares (CHF hedged); fondo d'investimento di diritto lussemburghese.

Evoluzione del valore nella valuta di riferimento (base 100)



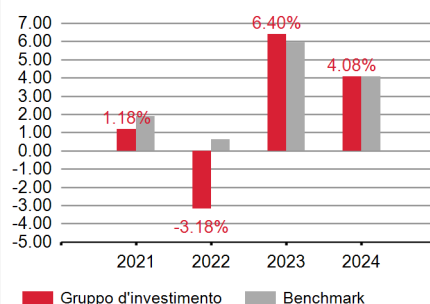
Performance nella valuta di riferimento

	Performance cumulata				Performance annualizzata			
	YTD	1 mese	3 mesi	1 anno	3 anni	5 anni	10 anni	Inizio
Gruppo d'investimento	-0.26%	-0.48%	-0.26%	2.95%	2.57%	3.62%	-	1.39%
Benchmark	-0.05%	-0.32%	-0.05%	2.92%	3.62%	4.35%	-	2.15%

Dati statistici (annualizzati)

	1 anno	3 anni	5 anni	10 anni	Inizio
Volatilità Gruppo d'investimento (in %)	1.15	3.58	3.40	-	5.36
Volatilità del Benchmark (in %)	0.96	2.78	2.83	-	4.99
Tracking Error ex post (in %)	0.29	1.05	0.98	-	0.97
Information Ratio	0.12	-1.00	-0.74	-	-0.79
Sharpe Ratio	1.67	0.45	0.96	-	0.21
Correlazione	0.98	0.97	0.97	-	0.98
Beta	1.19	1.25	1.16	-	1.06
Jensen alfa	-0.33	-1.73	-1.36	-	-0.88
Maximum Drawdown (in %)	-0.59	-5.19	-6.07	-	-10.15
Recovery Period (anni)	-	1.00	1.08	-	1.50

Performance



Informazioni sul prodotto

Numero di valore: 51215713
ISIN: CH0512157139
LEI: 254900TFN2RL5B1QJ986
Codice Bloomberg: SWSSLCH SW
Benchmark: JPM Lev Loans Upper Tier (80% US + 20% EU) CHFh
Valuta: CHF
Domicilio: Svizzera
Data di lancio: 31/01/2020
Prezzo di prima emissione: 100.00
Chiusura d'esercizio: 30.09
Emissione/Riscatto: mensile
Termine d'accettazione: 13.00
Sottoscrizione: Ultimo -2
Riscatti: Ultimo -5

Commissione d'emissione / riscatto: nessuna

Politica 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: 0.60%

ex post al: 30/09/2024 0.61%

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.
Termine di accettazione: Ultimo = ultimo giorno lavorativo bancario del mese
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 Senior Secured Loans (CHF hedged)

Struttura del portafoglio per settore

	Gruppo d'investimento	Benchmark
Servizi	16.55%	9.37%
Salute	9.11%	7.66%
Tecnologia	8.41%	8.53%
Giochi/Tempo libero	7.73%	11.50%
Finanza	7.12%	5.86%
Chimica	6.48%	5.30%
Cavo e Satellite	5.16%	2.31%
Automobile	4.81%	3.72%
Alimentazione e Bevande	4.64%	5.20%
Industrie	4.33%	8.11%
Altri	23.61%	32.44%
Liquidità	2.05%	-

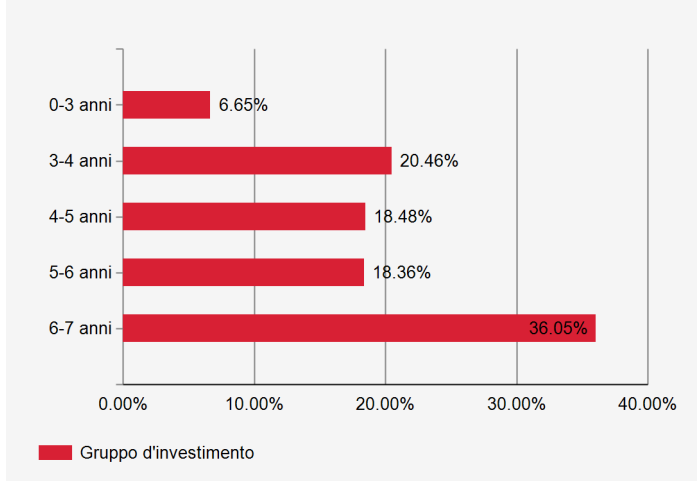
Principali debitori e rating

	Gruppo d'investimento	Benchmark
Quikrete	1.58%	BB-
Belron	1.52%	BB-
Action	1.50%	BB
Asurion	1.43%	B+
Entain	1.40%	BB-

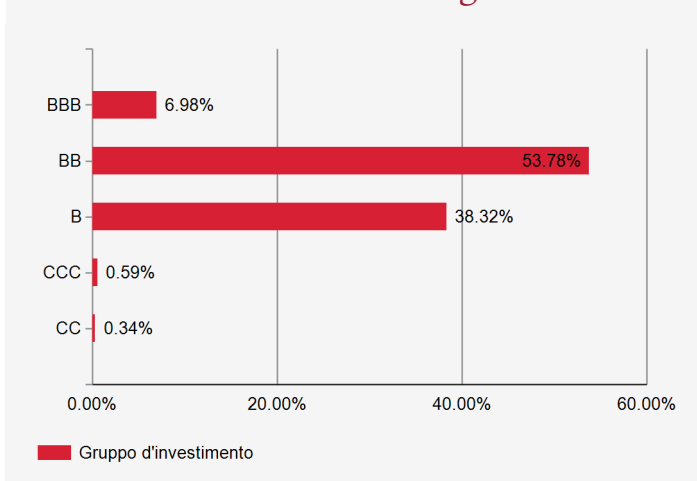
Ulteriori informazioni sui debitori

Numero di debitori	244
--------------------	-----

Struttura della scadenza dei titoli



Investimenti secondo il rating



Struttura del portafoglio per valute e rendimento (senza liquidità)

	Gruppo d'investimento		Benchmark	
	Peso	Rendimento	Peso	Rendimento
USD	67.96%	7.81%	80.00%	7.46%
EUR	32.04%	5.85%	20.00%	5.65%
Media	-	7.18%	-	7.09%

Struttura del portafoglio secondo il paese/regione

	Gruppo d'investimento	Benchmark
Stati Uniti	58.69%	84.56%
Regno Unito	9.98%	4.76%
Paesi Bassi	6.31%	1.76%
Lussemburgo	4.26%	0.61%
Germania	3.56%	0.56%
Belgio	3.08%	1.60%
Francia	2.53%	-
Svizzera	2.08%	0.33%
Spagna	1.68%	1.45%
Canada	1.46%	1.72%
Altri	4.32%	2.65%
Liquidità	2.05%	-