

Swiss Franc Bonds Optimized

già Obbligazioni Svizzera

29.10.2021

Il 17 maggio 2019 il gruppo di investimento BAP Obbligazioni Estero CHF è stato incorporato da quello BAP Obbligazioni Svizzera. Nel caso del restante gruppo di investimento Obbligazioni Svizzera è avvenuto allo stesso tempo un nuovo orientamento della strategia di investimento inclusa una modifica al nome in Swiss Franc Bonds Optimized.

Politica d'investimento

Il gruppo d'investimento "Swiss Franc Bonds Optimized" investe in tutto il mondo in obbligazioni denominate in CHF con rating investment grade (al momento dell'acquisto dell'investimento) e con la migliore liquidità di mercato possibile. Nella scelta dei debitori il portfolio manager si attengono al principio di una ripartizione ottimizzata dei rischi per il portafoglio. L'allocazione della durata del portafoglio risulta da un'ottimizzazione del roll return e in linea generale la composizione e la durata media del portafoglio si orientano al benchmark. I rischi di duration e i rischi di credito e di settore vengono gestiti in modo controllato.

Gestione

Gestore
"Swiss Franc Bonds Optimized"



Philippe Oster

Cédric Willi

Dati relativi alla performance e al rischio

Performance	Gruppo di investimento (al netto dei costi)	Benchmark secondo le direttive di investimento (costi excl.)
Anno in corso (YTD)	-2.47%	-2.45%
Ultimi 12 mesi	-1.98%	-2.07%
Ultimi 3 anni (p.a.)	0.87%	1.00%
Ultimi 5 anni (p.a.)	-0.18%	0.02%
Ultimi 10 anni (p.a.)	1.24%	1.47%

Dati relativi al rischio (base: ultimi 3 anni)

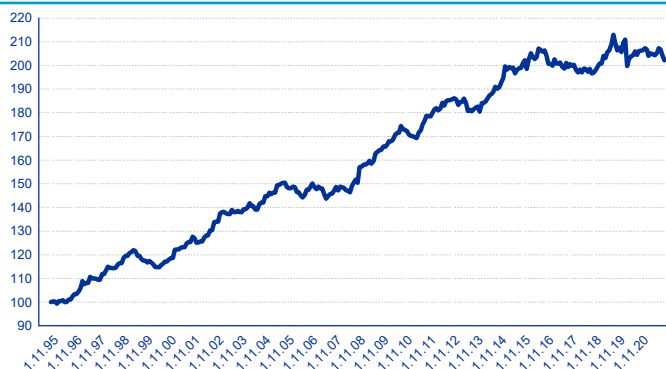
Rendimento alla scadenza	0.42%	0.16%
Duration (modified)	7.45	7.47
Tracking error	0.43%	

Valutazione attuale (in CHF)

NAV per quota 1'486.10

Benchmark secondo le direttive di investimento

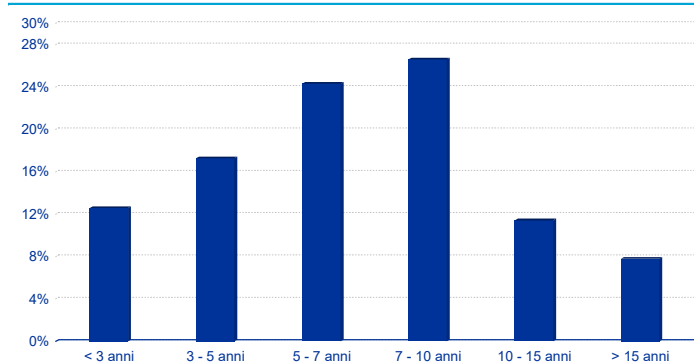
Swiss Bond Index Total AAA-BBB



Struttura rating

AAA	41.2%
AA	17.8%
A	22.5%
BBB	16.8%
BB	0.7%
not rated	1.1%

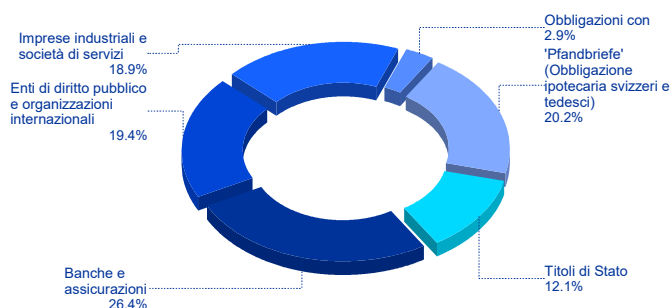
Struttura delle scadenze



Le 10 posizioni più importanti (in %)

Swiss Confederation Government Bond, 1.50%, 30/04/42	CHF	1.6%
Swiss Confederation Government Bond, 0.50%, 27/06/32	CHF	1.3%
Swiss Confederation Government Bond, 4.00%, 06/01/49	CHF	1.3%
Bank of Nova Scotia/The, 0.30%, 03/04/28	CHF	1.2%
Swiss Confederation Government Bond, 2.25%, 22/06/31	CHF	1.2%
Swiss Confederation Government Bond, 1.25%, 27/06/37	CHF	1.0%
Baloise Holding AG, 0.00%, 25/09/26	CHF	1.0%
Luzerner Kantonalbank AG, 0.00%, 07/08/28	CHF	1.0%
Walliser Kantonalbank, 0.00%, 14/02/29	CHF	0.9%
Swiss Confederation Government Bond, 0.50%, 27/05/30	CHF	0.9%

Struttura dei debitori



Swiss Franc Bonds Optimized

già Obbligazioni Svizzera

29.10.2021

Il 17 maggio 2019 il gruppo di investimento BAP Obbligazioni Estero CHF è stato incorporato da quello BAP Obbligazioni Svizzera. Nel caso del restante gruppo di investimento Obbligazioni Svizzera è avvenuto allo stesso tempo un nuovo orientamento della strategia di investimento inclusa una modifica al nome in Swiss Franc Bonds Optimized.

Ulteriori informazioni

Patrimonio d'investimento: CHF 328'234'728
 Amministr. del patrimonio: Baloise Asset Management AG
 Revisori: Ernst & Young AG, Basel
 Domicilio: Svizzera
 Lancio:² 01.11.1995
 Banca depositaria: Credit Suisse (Schweiz) AG, Zürich

Distribuzione del profitto: capitalizzazione
 ISIN: CH0008356542
 Numero di valore: 835654
 TER: 0.21% p.a.
 Chiusura giornaliera delle sottoscrizioni: 12:00 h

Per contattarci

sito Internet: www.baloise-anlagestiftung.ch
 e-mail: anlagestiftung@baloise.ch
 Pubblica. quotazione: Telekurs, KGAST, NZZ, Bloomberg: BAPOBLS SW
 Spese di emissione e di riscatto (rimarranno nel capitale investito): attualmente nessuno

2/2

Responsible Investment Policy

Il fondo è soggetto alla Responsible Investment (RI) Policy secondo le disposizioni di Baloise Group. La politica RI può essere consultata al seguente link:

<https://www.baloise-asset-management.com/it/ch/chi-siamo/investire-responsabilmente.html>

Strategie di investimento responsabile

Esclusione 
 Integrazione ESG 
 Impegno 

Criteri di esclusione

Produttori di armi controverse
 Elenco secondo SVVK-ASIR
 Emittenti con fatturato da attività con il carbone > 10%
 Rating ESG < B (secondo MSCI Inc.)
 Emittenti con fatturato da olio & gas non convenzionale > 10%.
 Emittenti con alti stranded assets e gestione insufficiente dei rischi climatici

Portafoglio








Signatory of:



Importante nota legale

Il presente documento serve unicamente a scopi informativi e non rappresenta né un'offerta né un invito all'acquisto o alla vendita di diritti di gruppi d'investimento, né deve essere inteso come un invito ad effettuare un'offerta per la stipula di un contratto su servizi relativi a titoli o servizi accessori. Le cifre relative alla performance sono valori storici e non forniscono alcuna indicazione sull'evoluzione futura dei valori. La performance rappresentata non prende in considerazione eventuali commissioni e spese previste al momento della sottoscrizione e del riscatto di quote. Le commissioni e le spese vanno ad influenzare negativamente la performance. Ad ogni investimento sono connessi rischi, in particolare in relazione alle oscillazioni del valore e del reddito. Nonostante la procedura accurata, i dati potrebbero essere riportati in modo incompleto o inesatto. Non ci si assume nessuna responsabilità per la correttezza, la completezza o l'aggiornamento delle informazioni contenute nel presente documento. La cerchia degli investitori è limitata a quegli istituti di previdenza del 2° pilastro e del pilastro 3a, esentati dalle imposte e domiciliati in Svizzera. Diritti su gruppi di investimento della Fondazione d'investimento della Basilese per la previdenza per il personale non possono essere offerti né venduti al di fuori della Svizzera. Presso la Fondazione d'investimento della Basilese per la previdenza per il personale, Aeschengraben 21, CH-4002 Basilea è possibile richiedere gratuitamente statuti e regolamenti, direttive di investimento, regolamento tariffario nonché rapporti annuali e semestrali. Questo documento è una traduzione a scopo informativo. Solo il testo in tedesco è vincolante.

"SIX Swiss Exchange AG ("SIX Swiss Exchange") is the source of Swiss Bond Index Total AAA-BBB and the data comprised therein. SIX Swiss Exchange has not been involved in any way in the creation of any reported information and does not give any warranty and excludes any liability whatsoever (whether in negligence or otherwise) - including without limitation for the accuracy, adequateness, correctness, completeness, timeliness, and fitness for any purpose - with respect to any reported information or in relation to any errors, omissions or interruptions in the Swiss Performance Index or its data. Any dissemination or further distribution of any such information pertaining to SIX Swiss Exchange is prohibited."