# Swisscanto (LU) Bond Fund - Swisscanto (LU) Bond Fund Committed COCO ATH EUR

# Categoria Morningstar™

Category\_EUCA000922

#### **Benchmark Morningstar**

Markit iBoxx EUR Corp Subordinated TR

#### **Benchmark Dichiarato**

ICE BofA Contingent Captl TR HUSD

# Morningstar Rating™

\*\*\*

## **Obiettivo d'Investimento Dichiarato**

Il fondo mira a conseguire nel lungo periodo un rendimento congruo in CHF, investendo in tutto il mondo in obbligazioni ad alto rendimento. Per gli investimenti in valuta estera è prevista la copertura del rischio di cambio con il CHF.Il comparto COCO investe prevalentemente (almeno il 51% del suo patrimonio complessivo) in titoli di credito di istituti finanziari, nello specifico Contingent Convertible Capital bond, che possono essere trasformati in capitale proprio (azioni) in base alle prescrizioni previste per il capitale proprio, nonché in obbligazioni subordinate.

| Misure di Rischio            | )           |                               |      |
|------------------------------|-------------|-------------------------------|------|
| 3Y Alpha                     | -0,27       | 3Y Sharpe Ratio               | 0,94 |
| 3Y Beta                      | 1,47        | 3Y Std Dev                    | 7,96 |
| 3Y R-Squared                 | 42,62       | 3Y Risk                       | Alto |
| 3Y Info Ratio                | 0,34        | 5Y Risk                       | +Med |
| 3Y Tracking Error            | 6,26        | 10Y Risk                      | +Med |
| Basati su Markit iBoxx EUR ( | Corp Suboro | linated TR (dove applicabile) |      |

#### Rendimenti 126 113 100 87 2020 2021 2025-09 2022 2023 2024 9,50 Fondo 0.59 2,48 -8,88 6,88 6,28 • Benchmark e 2,74 0,66 9,86 7,56 4,21 Indici 2,74 2,14 -12,108,49 9,15 4,23 Categoria

| Rend. Cumulati %                 | Fondo | Bmk  | Cat  | Rendimenti    | Q1    | Q2    | Q3    | Q4    |
|----------------------------------|-------|------|------|---------------|-------|-------|-------|-------|
| 3-Mesi                           | 2,39  | 1,60 | 1,72 | Trimestrali % |       |       |       |       |
| 6-Mesi                           | 7,01  | 4,28 | 5,08 | 2025          | 0,97  | 2,49  | 2,71  | -     |
| 1-Anno                           | 6,65  | 5,58 | 6,03 | 2024          | 3,15  | 0,74  | 3,94  | 1,37  |
| 3-Anni Ann.ti                    | 10,37 | 8,90 | 9,74 | 2023          | -6,94 | 4,18  | 1,14  | 9,00  |
| 5-Anni Ann.ti                    | 4,16  | 2,06 | 2,76 | 2022          | -3,82 | -7,86 | -5,24 | 8,50  |
| 10-Anni Ann.ti                   | 4,13  | 3,26 | 3,45 | 2021          | 0,99  | 2,04  | -0,01 | -0,55 |
| Rendimenti aggiornati al 17/10/2 | 2025  |      |      |               |       |       |       |       |

### Portafoglio 30/06/2025





Fixed Income Sector Weightings %

|                       | ronao |
|-----------------------|-------|
| Duration Effettiva    | 3,86  |
| Maturity effettiva    | 4,46  |
| Qualità Credito Media | BB    |
|                       |       |
|                       |       |

Fondo

| Credit Quality % | Fond | Credit Quality % | Fond  |
|------------------|------|------------------|-------|
|                  | 0    |                  | 0     |
| AAA              | 0,00 | BBB              | 35,50 |
| AA               | 0,00 | BB               | 55,67 |
| A                | 3,69 | В                | 3,31  |
|                  |      | Below B          | 0,00  |
|                  |      | Not Rated        | 1,83  |

| Titoli principali                         |     |       |
|-------------------------------------------|-----|-------|
| Nome Sett                                 | ore | %     |
| Banco Bilbao Vizcaya                      | _   | 2,28  |
| Banco de Sabadell SA 6.5%                 | _   | 2,21  |
| Axa SA 5.75%                              | _   | 1,77  |
| Banco Santander, S.A. 0%                  | -   | 1,72  |
| NatWest Group PLC 5.125%                  | -   | 1,72  |
| Barclays PLC 8.5%                         | _   | 1,57  |
| Barclays PLC 8.375%                       | _   | 1,56  |
| Deutsche Bank AG 7.125%                   | _   | 1,55  |
| Belfius Bank SA/NV 6.125%                 | _   | 1,53  |
| ABN AMRO Bank N.V. 4.75%                  | -   | 1,52  |
| % Primi 10 Titoli sul Patrimonio          |     | 17,42 |
| Numero Complessivo di Titoli Azionari     |     | 0     |
| Numero Complessivo di Titoli Obbligaziona | ri  | 140   |

| <b>₩</b> Governativo                                             | 0,43                            |
|------------------------------------------------------------------|---------------------------------|
| Societario                                                       | 98,40                           |
| ★ Cartolarizzazioni                                              | 0,00                            |
| Enti Locali                                                      | 0,00                            |
| 🚅 Liquidità ed equivalenti                                       | 1,36                            |
| ■ Derivati                                                       | -0,20                           |
| Coupon Range %                                                   | Fondo                           |
|                                                                  |                                 |
| 0 coupon                                                         | 0,00                            |
| 0 coupon<br>Da 0 a 4 cedole                                      | 0,00<br>9,91                    |
| •                                                                |                                 |
| Da 0 a 4 cedole                                                  | 9,91                            |
| Da 0 a 4 cedole<br>Da 4 a 6 cedole                               | 9,91<br>31,56                   |
| Da 0 a 4 cedole<br>Da 4 a 6 cedole<br>Da 6 a 8 cedole            | 9,91<br>31,56<br>46,95          |
| Da 0 a 4 cedole Da 4 a 6 cedole Da 6 a 8 cedole Da 8 a 10 cedole | 9,91<br>31,56<br>46,95<br>11,59 |

| Scadenze % | Fondo |
|------------|-------|
| da 1 a 3   | 0,00  |
| da 3 a 5   | 0,00  |
| da 5 a 7   | 0,00  |
| da 7 a 10  | 1,04  |
| da 10 a 15 | 0,00  |
| da 15 a 20 | 0,53  |
| da 20 a 30 | 96,93 |
| oltre 30   | 1,51  |
|            |       |
|            |       |
|            |       |
|            |       |
|            |       |
|            |       |
|            |       |

# Anagrafica

| Società di Gestione    | Swisscanto Asset         |
|------------------------|--------------------------|
|                        | Management International |
|                        | S.A.                     |
| Telefono               | +352 27 84 35 92         |
| Web                    | www.swisscanto.lu        |
| Data di Partenza       | 31/05/2011               |
| Nome del Gestore       | Daniel Björk             |
| Data Inizio Gestione   | 01/10/2012               |
| NAV (17/10/2025)       | EUR 204,44               |
| Patrimonio Netto (MIn) | 437,39 CHF               |
| (30/06/2025)           |                          |

| Patrimonio Classe (MIn) | 7,61 EUR     |
|-------------------------|--------------|
| (17/10/2025)            |              |
| Domicilio               | LUSSEMBURGO  |
| Valuta del Fondo        | EUR          |
| UCITS                   | Si           |
| Inc/Acc                 | Acc          |
| ISIN                    | LU0599119707 |
|                         |              |

| Investimento Min. Ingresso   | 10.000 EUR |
|------------------------------|------------|
| Investimento Min. Successivo | 1 EUR      |
| T.E.R.                       | 1,60%      |
| Spese correnti               | 1,61%      |
| Commissione di incentivo     | -          |