

Fondazione d'investimento Swiss Life

LPP-Mix 15

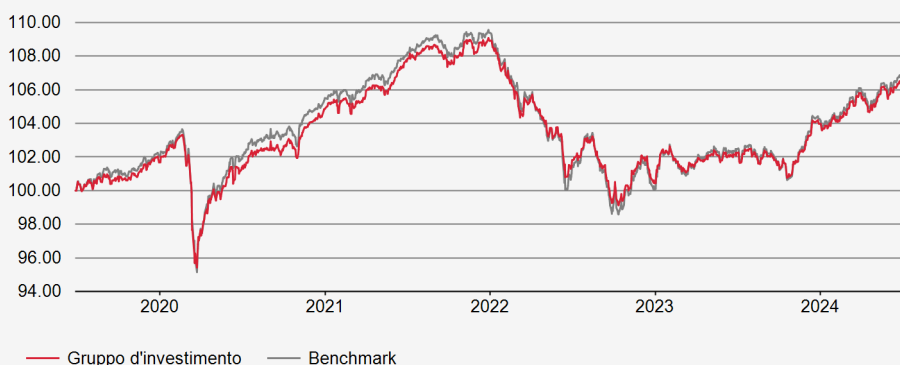


Patrimonio netto (NAV) in mio. CHF: 229.81
Valore d'inventario netto per diritto in CHF: 173.17

Strategia d'investimento

Investimenti in tutte le categorie d'investimento ammesse dalla LPP (quota di azioni strategica: 15%). Asset Allocation attiva. Limitazione per titoli di partecipazione: 20%, limitazione per valute estere: 30% Rating medio delle obbligazioni: almeno BBB+. Realizzazione tramite investimenti collettivi dedicati a singole classi di attivi. Riserve di perequazione raccomandate: oltre il 6,5%.

Evoluzione del valore nella valuta di riferimento (base 100)



Le performance passate non sono indicative di performance future.

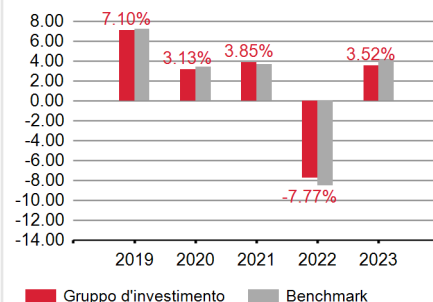
Performance nella valuta di riferimento

	Performance cumulata				Performance annualizzata			
	YTD	1 mese	3 mesi	1 anno	3 anni	5 anni	10 anni	Inizio
Gruppo d'investimento	2.30%	0.69%	0.54%	4.02%	-0.41%	1.24%	2.04%	2.65%
Benchmark	2.40%	0.76%	0.63%	4.18%	-0.41%	1.32%	2.20%	2.95%

Dati statistici (annualizzati)

	1 anno	3 anni	5 anni	10 anni	Inizio
Volatilità Gruppo d'investimento (in %)	2.69	3.57	3.74	3.07	2.83
Volatilità del Benchmark (in %)	3.11	4.08	4.09	3.22	2.88
Tracking Error ex post (in %)	0.48	0.64	0.57	0.53	0.57
Information Ratio	-0.31	0.01	-0.13	-0.30	-0.51
Sharpe Ratio	0.87	-0.27	0.32	0.76	0.88
Correlazione	1.00	0.99	0.99	0.99	0.98
Beta	0.86	0.87	0.91	0.94	0.97
Jensen alfa	0.20	-0.12	0.04	-0.02	-0.21
Maximum Drawdown (in %)	-1.68	-9.12	-9.12	-9.12	-9.12
Recovery Period (anni)	0.11	-	-	-	-

Performance



Informazioni sul prodotto

Numero di valore: 1564965

ISIN: CH0015649657

LEI: 254900RW4KJYAQTH6Y97

Codice Bloomberg: SWABM15 SW

Benchmark: Customized

Moneta: CHF

Domicilio: Svizzera

Data di creazione: 30/06/2003

Prezzo di prima emissione: 100.00

Chiusura d'esercizio: 30.09

Emissione/Riscatto: giornalmente

Termine d'accettazione: 14.00

Commissione d'emissione / riscatto: nessuna

Prassi di distribuzione: Capitalizzazione

Asset Manager:

Asset allocation tattica

Swiss Life Asset Management SA

Gruppi d'investimento puri impiegati

Diversi in base al

Swiss Life Best Select Invest Plus®

Consulenza esterna:

PPCmetrics fornisce i seguenti servizi all'interno dei gruppi d'investimento puri: consulenza sulla struttura idonea del mandato, supporto nella selezione di asset manager adeguati nonché supporto nel controllo costante dell'asset manager e valutazione dei risultati d'investimento.

Pubblicazioni di corsi: Bloomberg: ASSL
www.swisslife.ch/fondazioneinvestimento

Quote spese operative TER KGAST

ex ante: 0.57%

ex post al: 30/09/2023 0.59%

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.

Commissione: Rimangono riservate le disposizioni divergenti nei regolamenti sulle commissioni di fondazioni di libero passaggio e fondazioni di previdenza 3a.

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.

Struttura del portafoglio per gruppo d'investimento

	Gruppo d'investimento	Benchmark	max. OPP2
Liquidità	3.98%	2.00%	-
Ipoteche Svizzera	11.99%	13.00%	-
Obbligazioni CHF Svizzera	11.63%	13.00%	-
Obbligazioni CHF Estero	5.74%	6.00%	-
Obbligazioni valute estere (CHF hedged)	27.91%	28.00%	-
Azioni Svizzera	8.03%	8.00%	-
Azioni Estero	7.05%	7.00%	-
Azioni Estero (CHF hedged)	-	-	-
Immobili Svizzera	17.91%	15.00%	30.00%
Immobili estero (CHF hedged)	3.50%	3.00%	10.00%
Investimenti alternativi (CHF hedged)	2.28%	5.00%	15.00%
Totale azioni (Svizzera ed Estero)	15.07%	15.00%	50.00%
Totale valute estere	7.05%	7.00%	30.00%

Maggiori posizioni azionarie

NESTLE SA-REG	1.21%
NOVARTIS AG-REG	0.99%
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	0.88%
MICROSOFT CORP	0.52%
NVIDIA CORP	0.50%
UBS GROUP AG-REG	0.43%
ABB LTD-REG	0.40%
CIE FINANCIERE RICHEMO-A REG	0.38%
ZURICH INSURANCE GROUP AG	0.35%
ALPHABET INC	0.33%

Composizione del benchmark

1M SARON	2.00%
SBI Domestic AAA-A 1-3Y	13.00%
SBI Domestic AAA-BBB	13.00%
SBI Foreign AAA-BBB	6.00%
Bloomberg Gl. Agg. Treas. ex CH TR (CHF hedged)	5.00%
Bloomberg Gl. Agg. Corp. TR (CHF hedged)	12.00%
Bloomberg Gl. Agg. Corp. Short Term TR (CHF hedged)	7.00%
JP Morgan CEMBI Broad Div IG Index (CHF hedged)	4.00%
Swiss Performance Index	8.00%
MSCI World ex CH ESG Leaders, in CHF	5.60%
MSCI AC World Small Cap, in CHF	1.05%
MSCI Emerging Markets, in CHF	0.35%
KGAST Immo-Index	15.00%
SL REF (LUX) German Core Real Estate (CHF hedged)	3.00%
HFRX Global Hedge Funds (CHF hedged)	5.00%

Struttura del portafoglio secondo le valute

CHF	90.58%
USD	4.86%
EUR	0.52%
JPY	0.43%
Altri	3.62%

Qualità degli investimenti a reddito fisso

Modified Duration	4.64
Rating medio	A+