

# Fondazione d'investimento Swiss Life

## LPP-Mix 15

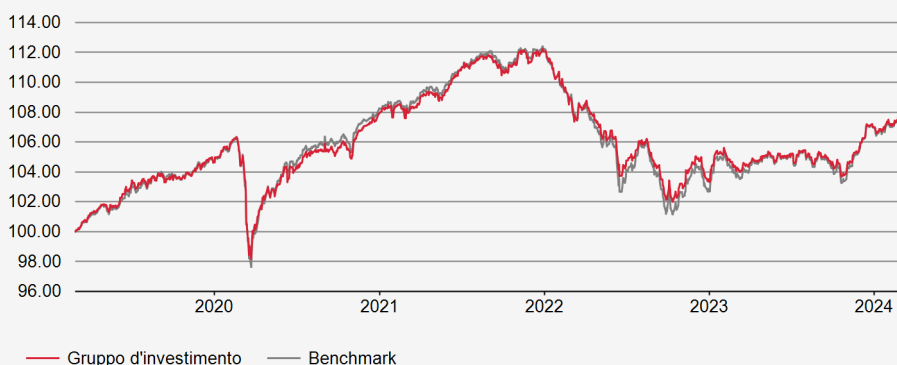


**Patrimonio netto (NAV) in mio. CHF: 227.18**  
**Valore d'inventario netto per diritto in CHF: 170.30**

### 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.

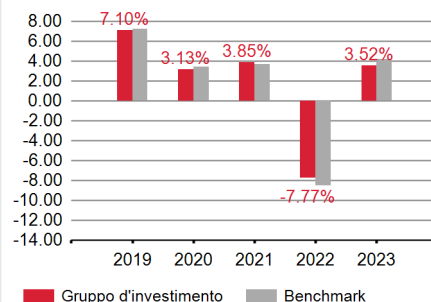
### Performance nella valuta di riferimento

	Performance cumulata				Performance annualizzata			
	YTD	1 mese	3 mesi	1 anno	3 anni	5 anni	10 anni	Inizio
Gruppo d'investimento	0.60%	0.31%	1.87%	3.29%	0.01%	1.48%	2.08%	2.61%
Benchmark	0.59%	0.40%	1.95%	3.69%	-0.09%	1.48%	2.21%	2.91%

### Dati statistici (annualizzati)

	1 anno	3 anni	5 anni	10 anni	Inizio
Volatilità Gruppo d'investimento (in %)	2.27	3.58	3.74	3.05	2.84
Volatilità del Benchmark (in %)	2.71	4.05	4.08	3.19	2.89
Tracking Error ex post (in %)	0.53	0.66	0.58	0.53	0.58
Information Ratio	-0.76	0.15	0.01	-0.26	-0.50
Sharpe Ratio	0.74	-0.09	0.42	0.80	0.87
Correlazione	0.99	0.99	0.99	0.99	0.98
Beta	0.83	0.88	0.91	0.95	0.97
Jensen alfa	-0.04	0.05	0.14	0.00	-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](http://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	2.09%	2.00%	-
Ipoteche Svizzera	12.02%	13.00%	-
Obbligazioni CHF Svizzera	13.10%	13.00%	-
Obbligazioni CHF Estero	6.01%	6.00%	-
Obbligazioni valute estere (CHF hedged)	27.83%	28.00%	-
Azioni Svizzera	7.92%	8.00%	-
Azioni Estero	6.91%	7.00%	-
Azioni Estero (CHF hedged)	0.29%	-	-
Immobili Svizzera	17.96%	15.00%	30.00%
Immobili estero (CHF hedged)	3.57%	3.00%	10.00%
Investimenti alternativi (CHF hedged)	2.30%	5.00%	15.00%
Totale azioni (Svizzera ed Estero)	15.12%	15.00%	50.00%
Totale valute estere	6.91%	7.00%	30.00%

### Maggiori posizioni azionarie

NESTLE SA-REG	1.26%
NOVARTIS AG-REG	0.97%
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	0.84%
MICROSOFT CORP.	0.51%
UBS GROUP AG-REG	0.40%
CIE FINANCIERE RICHEMONT-REG	0.39%
ZURICH INSURANCE GROUP AG	0.35%
NVIDIA CORP	0.34%
ABB LTD-REG	0.34%
ALPHABET INC	0.27%

### 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	92.11%
USD	4.70%
EUR	0.55%
JPY	0.47%
Altri	2.18%

### Qualità degli investimenti a reddito fisso

Modified Duration	4.44
Rating medio	A+