

Fondazione d'investimento Swiss Life

LPP-Mix 15

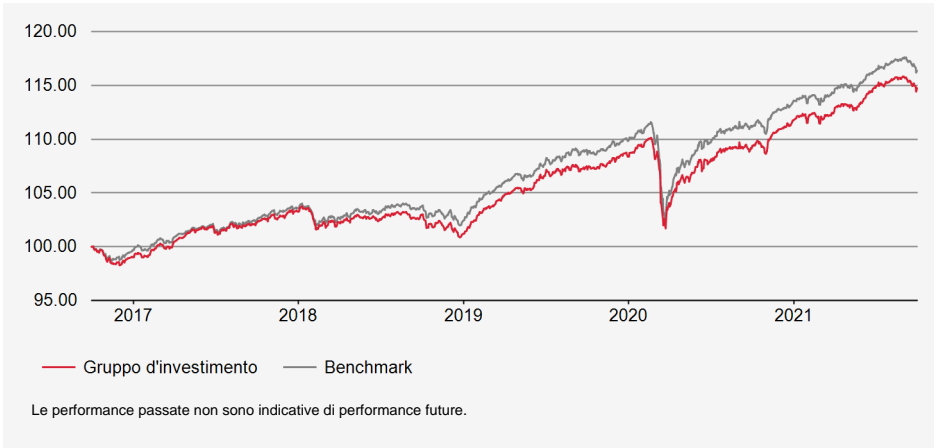


Patrimonio netto (NAV) in mio. CHF: 222.77
Valore d'inventario netto per diritto in CHF: 175.27

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)



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	2.66%	-0.88%	-0.02%	5.02%	3.67%	2.79%	3.73%	3.12%
BENCHMARK	2.42%	-0.98%	-0.02%	4.68%	3.89%	3.07%	3.85%	3.47%

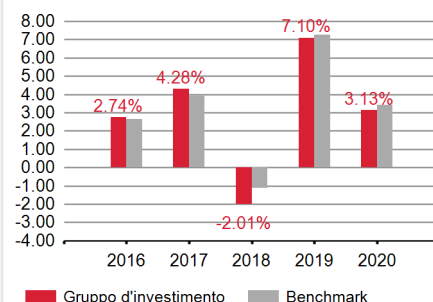
Dati statistici (annualizzati)

	1 ANNO	3 ANNI	5 ANNI	10 ANNI	INIZIO
Volatilità Gruppo d'investimento (in %)	2.80	3.59	2.97	2.60	2.67
Volatilità del Benchmark (in %)	2.75	3.66	2.98	2.51	2.61
Tracking Error ex post (in %)	0.34	0.43	0.44	0.45	0.56
Information Ratio	1.00	-0.50	-0.64	-0.26	-0.63
Sharpe Ratio	1.97	1.21	1.18	1.60	1.13
Correlazione	0.99	0.99	0.99	0.98	0.98
Beta	1.01	0.97	0.99	1.02	1.00
Jensen alfa	0.28	-0.09	-0.24	-0.22	-0.36
Maximum Drawdown (in %)	-1.22	-7.63	-7.63	-7.63	-7.63
Recovery Period (anni)	-	0.64	0.64	0.64	0.64

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.

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: 30/09/2021 0.60%

Struttura del portafoglio per gruppo d'investimento

	Gruppo d'investimento	Benchmark	max. OPP2
Liquidità	1.50%	2.00%	-
Ipotecche Svizzera	9.71%	13.00%	-
Obbligazioni CHF Svizzera	9.64%	13.00%	-
Obbligazioni CHF Estero	4.03%	6.00%	-
Obbligazioni valute estere (CHF hedged)	32.47%	28.00%	-
Azioni Svizzera	8.65%	8.00%	-
Azioni Estero	6.85%	7.00%	-
Azioni Estero (CHF hedged)	2.77%	-	-
Immobili Svizzera	19.19%	15.00%	30.00%
Immobili estero (CHF hedged)	3.04%	3.00%	10.00%
Investimenti alternativi (CHF hedged)	2.16%	5.00%	15.00%
Totale azioni (Svizzera ed Estero)	18.27%	15.00%	50.00%
Totale valute estere	6.85%	7.00%	30.00%

Struttura del portafoglio secondo le valute

CHF	93.15%
USD	4.88%
EUR	0.76%
JPY	0.46%
ALTRI	0.76%

Composizione del benchmark

CITIGROUP CHF 1 M EURO DEPO	2.00%
CSF IPOTECHE SVIZZERA	13.00%
SBI DOMESTIC AAA-BBB	13.00%
SBI FOREIGN AAA-BBB	6.00%
BB* GL. AGG. TREAS. EX CH TR (CHF HEDGED)	5.00%
BB* GL. AGG. CORP. TR (CHF HEDGED)	12.00%
BB* 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, 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%

* Bloomberg Barclays

Qualità degli investimenti a reddito fisso

Modified Duration	4.71
Rating medio	A