

30 aprile 2023

Fondazione d'investimento Swiss Life LPP-Mix 15

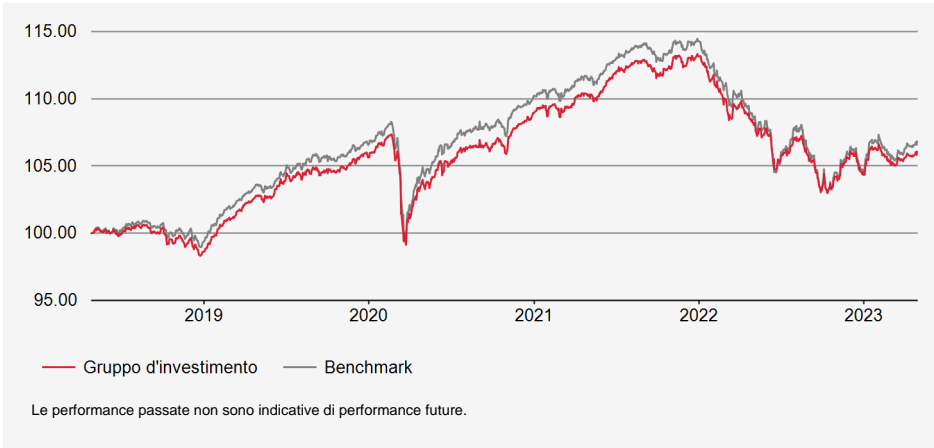


Patrimonio netto (NAV) in mio. CHF: 234.00
Valore d'inventario netto per diritto in CHF: 166.23

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)



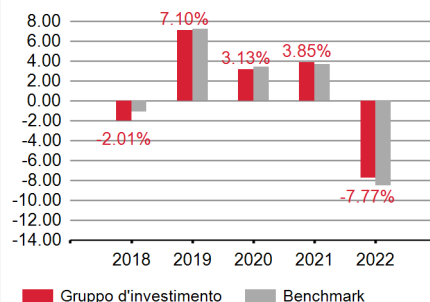
Performance nella valuta di riferimento

	PERFORMANCE CUMULATA				PERFORMANCE ANNUALIZZATA			
	YTD	1 MESE	3 MESI	1 ANNO	3 ANNI	5 ANNI	10 ANNI	INIZIO
GRUPPO D'INVESTIMENTO	1.66%	0.47%	-0.10%	-2.00%	0.75%	1.18%	2.04%	2.59%
BENCHMARK	2.18%	0.55%	0.09%	-1.66%	0.68%	1.32%	2.19%	2.90%

Dati statistici (annualizzati)

	1 ANNO	3 ANNI	5 ANNI	10 ANNI	INIZIO
Volatilità Gruppo d'investimento (in %)	4.85	3.65	3.74	3.06	2.86
Volatilità del Benchmark (in %)	5.66	4.04	4.02	3.15	2.89
Tracking Error ex post (in %)	0.92	0.62	0.56	0.52	0.58
Information Ratio	-0.37	0.10	-0.25	-0.29	-0.51
Sharpe Ratio	-0.49	0.29	0.45	0.83	0.88
Correlazione	1.00	0.99	0.99	0.99	0.98
Beta	0.85	0.90	0.92	0.96	0.97
Jensen alfa	-0.64	0.17	0.00	-0.04	-0.23
Maximum Drawdown (in %)	-4.85	-9.12	-9.12	-9.12	-9.12
Recovery Period (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: 30/09/2022 0.60%

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	3.76%	2.00%	-
Ipotecche Svizzera	11.34%	13.00%	-
Obbligazioni CHF Svizzera	11.85%	13.00%	-
Obbligazioni CHF Estero	5.33%	6.00%	-
Obbligazioni valute estere (CHF hedged)	29.83%	28.00%	-
Azioni Svizzera	8.10%	8.00%	-
Azioni Estero	4.79%	7.00%	-
Azioni Estero (CHF hedged)	1.26%	-	-
Immobili Svizzera	17.69%	15.00%	30.00%
Immobili estero (CHF hedged)	3.74%	3.00%	10.00%
Investimenti alternativi (CHF hedged)	2.32%	5.00%	15.00%
Totale azioni (Svizzera ed Estero)	14.15%	15.00%	50.00%
Totale valute estere	4.79%	7.00%	30.00%

Struttura del portafoglio secondo le valute

CHF	95.21%
USD	3.34%
EUR	0.60%
JPY	0.29%
ALTRI	0.57%

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%

Qualità degli investimenti a reddito fisso

Modified Duration	4.28
Rating medio	A+