

# Fondazione d'investimento Swiss Life

## LPP-Mix 15

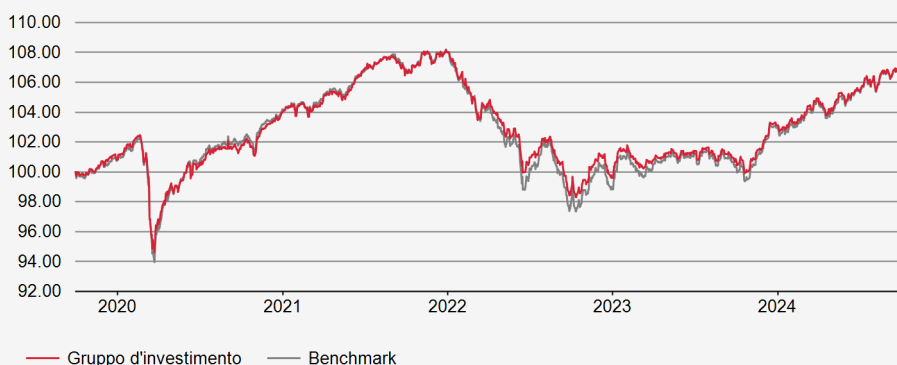


**Patrimonio netto (NAV) in mio. CHF: 229.47**  
**Valore d'inventario netto per diritto in CHF: 176.11**

### 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.

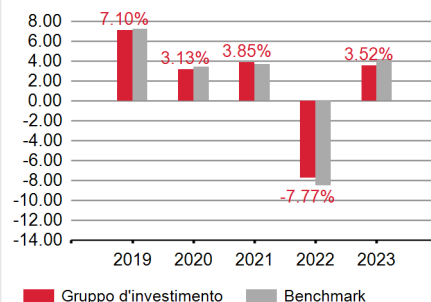
### Performance nella valuta di riferimento

	Performance cumulata True				Performance annualizzata			
	YTD	1 mese	3 mesi	1 anno	3 anni	5 anni	10 anni	Inizio
Gruppo d'investimento	4.03%	0.40%	1.70%	6.35%	0.16%	1.41%	2.07%	2.70%
Benchmark	4.15%	0.51%	1.72%	6.74%	0.13%	1.41%	2.24%	3.00%

### Dati statistici (annualizzati)

	1 anno	3 anni	5 anni	10 anni	Inizio
Volatilità Gruppo d'investimento (in %)	2.43	3.57	3.75	3.07	2.82
Volatilità del Benchmark (in %)	2.78	4.08	4.10	3.21	2.87
Tracking Error ex post (in %)	0.46	0.65	0.56	0.52	0.57
Information Ratio	-0.85	0.04	0.01	-0.33	-0.51
Sharpe Ratio	1.92	-0.15	0.33	0.76	0.89
Correlazione	0.99	0.99	0.99	0.99	0.98
Beta	0.87	0.87	0.91	0.94	0.97
Jensen alfa	0.31	-0.05	0.12	-0.03	-0.20
Maximum Drawdown (in %)	-1.09	-9.12	-9.12	-9.12	-9.12
Recovery Period (anni)	0.07	-	-	-	-

### 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:** 12.00

**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:** 30/09/2024 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	2.03%	2.00%	-
Ipoteche Svizzera	12.15%	13.00%	-
Obbligazioni CHF Svizzera	11.08%	13.00%	-
Obbligazioni CHF Estero	5.70%	6.00%	-
Obbligazioni valute estere (CHF hedged)	30.20%	28.00%	-
Azioni Svizzera	8.08%	8.00%	-
Azioni Estero	6.97%	7.00%	-
Azioni Estero (CHF hedged)	-	-	-
Immobili Svizzera	18.08%	15.00%	30.00%
Immobili estero (CHF hedged)	3.39%	3.00%	10.00%
Investimenti alternativi (CHF hedged)	2.33%	5.00%	15.00%
Totale azioni (Svizzera ed Estero)	15.04%	15.00%	50.00%
Totale valute estere	6.97%	7.00%	30.00%

## Maggiori posizioni azionarie

NESTLE SA-REG	1.11%
NOVARTIS AG-REG	0.99%
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	0.95%
UBS GROUP AG-REG	0.42%
MICROSOFT CORP	0.41%
NVIDIA CORP	0.40%
ABB LTD-REG	0.39%
ZURICH INSURANCE GROUP AG	0.37%
CIE FINANCIERE RICHEMO-A REG	0.36%
ALPHABET INC	0.25%

## 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	93.04%
USD	4.73%
EUR	0.52%
JPY	0.44%
Altri	1.28%

## Qualità degli investimenti a reddito fisso

Modified Duration	4.72
Rating medio	A+