

Fondazione d'investimento Swiss Life

LPP-Mix 15

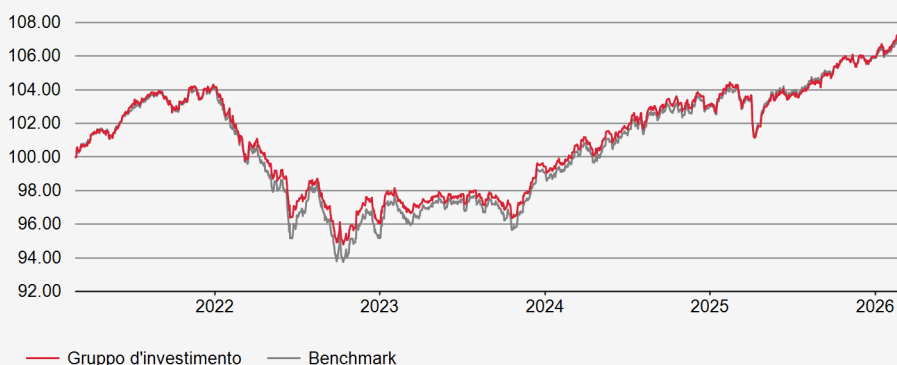


Patrimonio netto (NAV) in mio. CHF: 202.53
Valore d'inventario netto per diritto in CHF: 183.16

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.

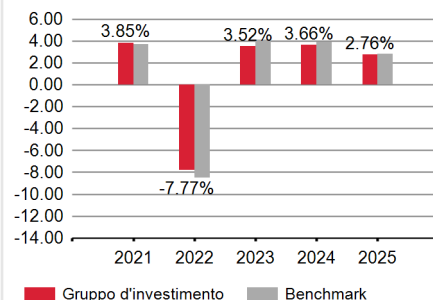
Performance nella valuta di riferimento

	Performance cumulata				Performance annualizzata			
	YTD	1 mese	3 mesi	1 anno	3 anni	5 anni	10 anni	Inizio
Gruppo d'investimento	1.57%	1.17%	1.46%	3.15%	3.57%	1.47%	2.23%	2.70%
Benchmark	1.26%	0.92%	1.15%	2.96%	3.69%	1.41%	2.26%	2.98%

Dati statistici (annualizzati)

	1 anno	3 anni	5 anni	10 anni	Inizio
Volatilità Gruppo d'investimento (in %)	1.95	2.12	3.09	3.00	2.78
Volatilità del Benchmark (in %)	1.68	2.22	3.40	0.00	0.00
Tracking Error ex post (in %)	0.49	0.45	0.57	0.00	0.00
Information Ratio	0.39	-0.28	0.11	0.00	0.00
Sharpe Ratio	1.57	1.23	0.34	0.80	0.91
Correlazione	0.97	0.98	0.99	0.00	0.00
Beta	1.13	0.94	0.90	0.00	0.00
Jensen alfa	-0.18	0.05	0.16	2.42	2.55
Maximum Drawdown (in %)	-3.03	-3.17	-9.12	-9.12	-9.12
Recovery Period (anni)	0.33	0.34	2.34	2.34	2.34

Performance



Informazioni sul prodotto

Numero di valore: 1564965
ISIN: CH0015649657
LEI: 254900RW4KJYAQTH6Y97
Codice Bloomberg: SWABM15 SW
Benchmark: Customized
Valuta: CHF
Domicilio: Svizzera
Data di lancio: 30/06/2003
Prezzo di prima emissione: 100.00
Chiusura d'esercizio: 30.09
Emissione/Riscatto: giornalmente
Termine d'accettazione: 12:00
Protezione contro la diluizione: Commissione di emissione / riscatto a favore del gruppo d'investimento secondo la panoramica delle condizioni.

Asset Management: Asset allocation strategica e tattica da parte di Swiss Life Asset Management SA
Gruppi d'investimento puri impiegati: Diversi secondo l'approccio Swiss Life Best Select Invest Plus®

Consulenza esterna: Monitoraggio dei risultati d'investimento dei gruppi d'investimento impiegati nonché consulenza sull'adeguata struttura del mandato e nella selezione di asset manager adeguati da parte di PPCmetrics

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

Quote spese operative TER KGAST

ex ante: 0.47%

ex post al: 30/09/2025 0.54%

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.

Protezione contro la diluizione: Panoramica delle condizioni: www.swisslife.ch/fondazioneinvestimento, «Documenti giuridici» (modifiche possibili in qualsiasi momento senza preavviso).

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	2.77%	4.00%	-
Ipoteche Svizzera	7.11%	7.00%	-
Obbligazioni CHF Svizzera	24.95%	28.00%	-
Obbligazioni valute estere (CHF hedged)	25.15%	27.00%	-
Azioni Svizzera	9.02%	7.00%	-
Azioni Estero	5.21%	4.00%	-
Azioni Estero (CHF hedged)	4.29%	4.00%	-
Immobili Svizzera	18.10%	15.00%	30.00%
Immobili estero (CHF hedged)	1.12%	1.00%	10.00%
Investimenti alternativi (CHF hedged)	2.28%	3.00%	15.00%
Infrastrutture	-	-	-
Totale azioni (Svizzera ed Estero)	18.52%	15.00%	50.00%
Totale valute estere	5.21%	7.00%	30.00%

Maggiori posizioni azionarie

ROCHE HOLDING AG-GENUSSSCHEIN	1.27%
NOVARTIS AG-REG	1.26%
NESTLE SA-REG	1.07%
ABB LTD-REG	0.56%
UBS GROUP AG-REG	0.46%
ZURICH INSURANCE GROUP AG	0.42%
CIE FINANCIERE RICHEMO-A REG	0.42%
NVIDIA CORP	0.35%
APPLE INC	0.31%
MICROSOFT CORP	0.22%

Composizione del benchmark

1M SARON	4.00%
SBI Domestic AAA-A 1-3Y Total Return	7.00%
SBI AAA-BBB Total Return	28.00%
Bloomberg Gl. Agg. Treas. ex CH (CHF hedged)	17.00%
Bloomberg Gl. Agg. Corp. (CHF hedged)	4.00%
Bloomberg Gl. Agg. Corp. Short Term (CHF hedged)	4.00%
JP Morgan CEMBI Broad Diversified IG Index (CHF hedged)	2.00%
SPI® Total Return	7.00%
MSCI World ex Switzerland Net Return	4.00%
MSCI World ex Switzerland Net Return (CHF hedged)	4.00%
KGAST Immo-Index	15.00%
SL REF (LUX) ESG German Core Real Estate (CHF hedged)	0.75%
Fondation de placement Swiss Life Immobili Europa Industria e Logistica ESG (EUR), CHF hedged	0.25%
HFRX Global Hedge Funds (CHF hedged)	3.00%
Fondation de placement Swiss Life Infrastruttura globale ESG (EUR)	-

Struttura del portafoglio secondo le valute

CHF	94.79%
USD	2.78%
JPY	0.72%
EUR	0.65%
Altri	1.05%

Qualità degli investimenti a reddito fisso

Modified Duration	5.85
Rating medio	AA-