

28 febbraio 2023

Fondazione d'investimento Swiss Life Ipoteche Svizzera ESG PM

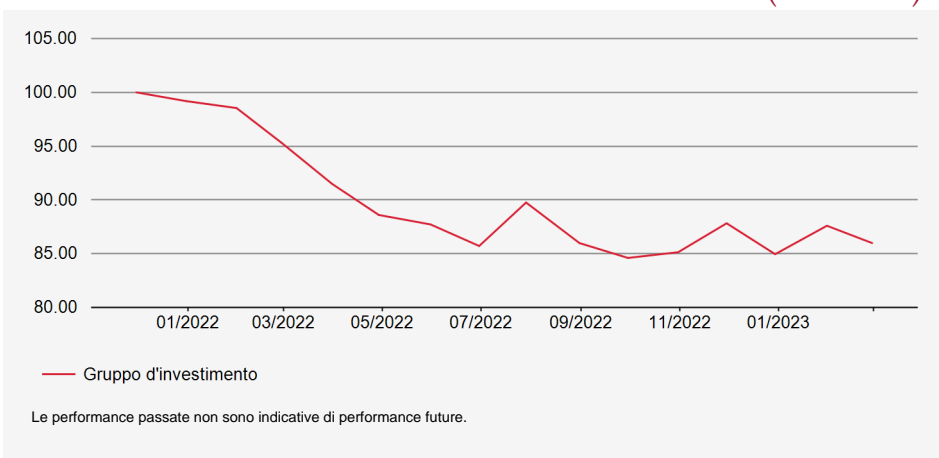


Patrimonio netto (NAV) in mio. CHF: 194.98
Valore d'inventario netto per diritto in CHF: 87.60

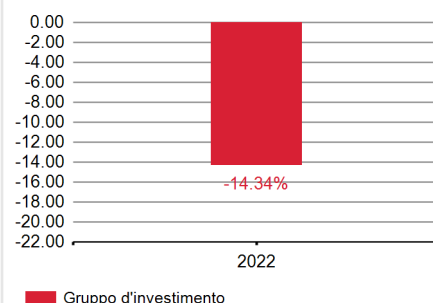
Strategia d'investimento

Investimenti in ipoteche svizzere sostenibili: almeno l'85% previa deduzione di eventuali attività liquide. Duration target di 8. Attuazione con l'impiego del segmento patrimoniale "Swiss Life ESG Mortgage Fund" del fondo Swiss Life Mortgage Fund, un fondo a ombrello contrattuale di diritto svizzero.

Evoluzione del valore nella valuta di riferimento (base 100)



Performance



Informazioni sul prodotto

Numero di valore: 112778775

ISIN: CH1127787757

LEI: 254900V4K2D79T13EF45

Codice Bloomberg: SLHSEPM SW

Moneta: CHF

Domicilio: Svizzera

Data di creazione: 30/11/2021

Prezzo di prima emissione: 100.00

Chiusura d'esercizio: 30.9

Emissione/Riscatto: mensile

Commissione d'emissione/riscatto: nessuna

Prassi di distribuzione: Capitalizzazione

Asset Manager:

Swiss Life Asset Management SA

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

Quote spese operative TER KGAST

ex ante: 0.35%

ex post al: 30/09/2022 0.35%

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	3.11%	-1.84%	-2.09%	-9.76%	-	-	-	-10.70%

Dati statistici

Durata residua media (anni)	9.16
Modified Duration (excl. ipoteche a termine)*	7.52
Modified Duration (incl. ipoteche a termine)*	8.13
Rendimento lordo alla scadenza	2.49%
Anticipo medio	59%
Numero ipoteche	407
Differenza di rendimento rispetto ai titoli di Stato svizzeri	1.08%

*incl. liquidità

PM tranche: L'acquisto di questa tranche è possibile solo nell'ambito di un accordo speciale con Swiss Life Asset Management SA.

Emissione: Mensile, nel rispetto di un periodo di sottoscrizione di un mese.

Riscatto: Mensile, nel rispetto di un termine di disdetta di sei mesi. Il primo riscatto di diritti è possibile al 30 gennaio 2024, osservando il termine di preavviso di sei mesi.

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.

Struttura patrimoniale

IPOTECHE	95.63%
OBBLIGAZIONI	2.79%
LIQUIDITÀ	1.59%
DERIVATI	0.00%

Distribuzione in base all'ammontare dell'anticipo

<40%	10.24%
40 - 50%	13.25%
50 - 60%	9.98%
60 - 70%	56.49%
>70%	10.04%

Tipo di oggetti messi in pegno

CASE UNIFAMILIARE	30.85%
PROPRIETÀ PER PIANI	50.47%
CASE PLURIFAMILIARI	10.83%
IMMOBILI A USO COMMERCIALE	7.84%

Tipi d'ipoteca

Ipotecche a tasso fisso	97.98%
Ipotecche Saron	1.92%
Ipotecche a tasso variabile	0.11%

Ipotecche con pagamenti scoperti di ben 90 giorni

Anticipo medio	-
Numero debitori ipotecari	-
Relativo Valore globale delle ipotecche con pagamenti scoperti	-

Ripartizione geografica degli immobili

ZURIGO	26.58%
ESPACE MITTELLAND	11.68%
SVIZZERA CENTRALE	11.03%
SVIZZERA NORDOCCIDENTALE	5.39%
SVIZZERA ORIENTALE	2.04%
TICINO	1.15%
REGIONE DEL LEMANO	42.14%

Struttura alla scadenza delle ipotecche

1-3 ANNI	8.67%
3-5 ANNI	15.87%
5-7 ANNI	11.87%
7-10 ANNI	31.02%
10-15 ANNI	18.32%
>15 ANNI	14.24%

Distribuzione ESG

MINERGIE	65.90%
CECE	32.62%
THPE	1.48%
Nessuna etichetta/certificato	-