

Fondazione d'investimento Swiss Life

LPP-Mix 35

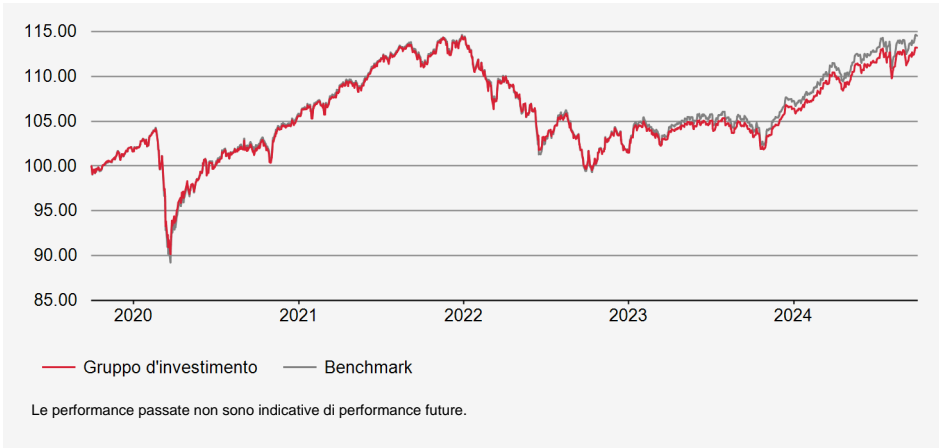


Patrimonio netto (NAV) in mio. CHF: 403.62
Valore d'inventario netto per diritto in CHF: 213.34

Strategia d'investimento

Investimenti in tutte le categorie d'investimento ammesse dalla LPP (quota di azioni strategica: 35%). Asset Allocation attiva. Limitazione per titoli di partecipazione: 45%, 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 15%.

Evoluzione del valore nella valuta di riferimento (base 100)



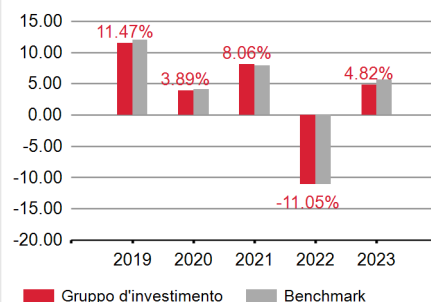
Performance nella valuta di riferimento

	Performance cumulata True				Performance annualizzata			
	YTD	1 mese	3 mesi	1 anno	3 anni	5 anni	10 anni	Inizio
Gruppo d'investimento	6.38%	0.25%	1.48%	8.88%	0.54%	2.51%	3.12%	3.35%
Benchmark	6.76%	0.42%	1.58%	9.49%	0.86%	2.75%	3.53%	3.89%

Dati statistici (annualizzati)

	1 anno	3 anni	5 anni	10 anni	Inizio
Volatilità Gruppo d'investimento (in %)	4.11	5.72	6.06	5.27	5.20
Volatilità del Benchmark (in %)	4.35	6.11	6.46	5.40	5.19
Tracking Error ex post (in %)	0.38	0.59	0.61	0.58	0.63
Information Ratio	-1.64	-0.55	-0.40	-0.71	-0.84
Sharpe Ratio	1.71	-0.03	0.38	0.64	0.59
Correlazione	1.00	1.00	1.00	0.99	0.99
Beta	0.94	0.93	0.94	0.97	0.99
Jensen alfa	-0.15	-0.31	-0.07	-0.30	-0.52
Maximum Drawdown (in %)	-2.93	-13.03	-13.41	-13.41	-21.36
Recovery Period (anni)	0.14	-	0.65	0.65	3.00

Performance



Informazioni sul prodotto

Numero di valore: 1245606
ISIN: CH0012456064
LEI: 254900SR5GM6HP44F130
Codice Bloomberg: SWABM35 SW
Benchmark: Customized
Moneta: CHF
Domicilio: Svizzera
Data di creazione: 30/09/2001
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
Quote spese operative TER KGAST
ex ante: 0.57%
ex post al: 30/09/2024 0.57%

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	3.26%	2.00%	-
Ipotecche Svizzera	0.60%	-	-
Obbligazioni CHF Svizzera	13.10%	14.00%	-
Obbligazioni CHF Estero	7.13%	7.00%	-
Obbligazioni valute estere (CHF hedged)	24.95%	24.00%	-
Azioni Svizzera	17.88%	18.00%	-
Azioni Estero	16.98%	17.00%	-
Azioni Estero (CHF hedged)	-	-	-
Immobili Svizzera	11.74%	11.00%	30.00%
Immobili estero (CHF hedged)	2.06%	2.00%	10.00%
Investimenti alternativi (CHF hedged)	2.29%	5.00%	15.00%
Totale azioni (Svizzera ed Estero)	34.87%	35.00%	50.00%
Totale valute estere	16.98%	17.00%	30.00%

Maggiori posizioni azionarie

NESTLE SA-REG	2.46%
NOVARTIS AG-REG	2.20%
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	2.10%
MICROSOFT CORP	1.00%
NVIDIA CORP	0.98%
UBS GROUP AG-REG	0.93%
ABB LTD-REG	0.87%
ZURICH INSURANCE GROUP AG	0.83%
CIE FINANCIERE RICHEMO-A REG	0.80%
ALPHABET INC	0.60%

Composizione del benchmark

1M SARON	2.00%
SBI Domestic AAA-BBB	14.00%
SBI Foreign AAA-BBB	7.00%
Bloomberg Gl. Agg. Treas. ex CH TR (CHF hedged)	3.50%
Bloomberg Gl. Agg. Corp. TR (CHF hedged)	7.50%
Bloomberg Gl. Agg. Corp. Short Term TR (CHF hedged)	8.00%
JP Morgan CEMBI Broad Div IG Index (CHF hedged)	5.00%
Swiss Performance Index	18.00%
MSCI World ex CH ESG Leaders, in CHF	13.60%
MSCI AC World Small Cap, in CHF	2.55%
MSCI Emerging Markets, in CHF	0.85%
KGAST Immo-Index	11.00%
SL REF (LUX) German Core Real Estate (CHF hedged)	2.00%
HFRX Global Hedge Funds (CHF hedged)	5.00%

Struttura del portafoglio secondo le valute

CHF	83.02%
USD	11.53%
EUR	1.26%
JPY	1.07%
Altri	3.12%

Qualità degli investimenti a reddito fisso

Modified Duration	5.68
Rating medio	A