

30 settembre 2024

Fondazione d'investimento Swiss Life LPP-Mix 75



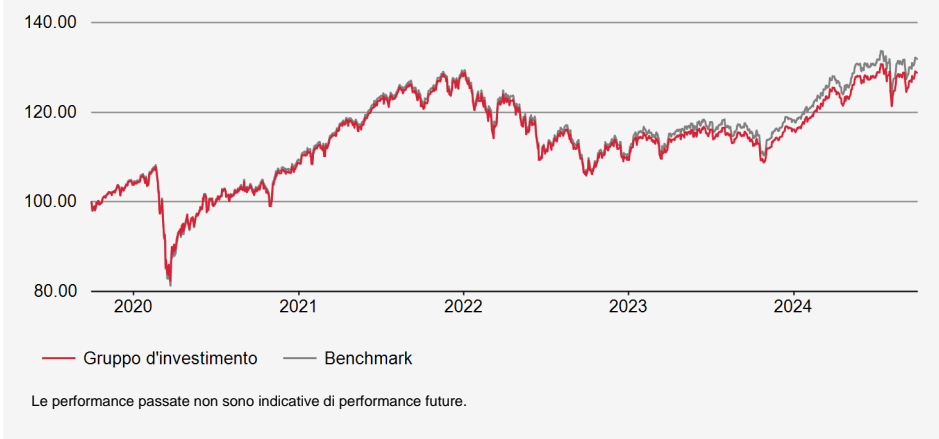
(superamento quota azionaria e in valuta estera secondo OPP 2)

Patrimonio netto (NAV) in mio. CHF: 286.50
Valore d'inventario netto per diritto in CHF: 140.48

Strategia d'investimento

Investimenti in tutte le categorie d'investimento ammesse dalla LPP (quota di azioni strategica: 75%). Asset Allocation attiva. Limitazione per titoli di partecipazione: 85%. Limitazione per valute estere: 50%. Rating medio delle obbligazioni: almeno BBB. Realizzazione tramite investimenti collettivi puri. A seguito della maggiore quota azionaria e in valuta estera, questo gruppo d'investimento comporta un rischio più elevato rispetto un LPP-Mix con quota azionaria del 50% e quota in valuta estera del 30% al massimo.

Evoluzione del valore nella valuta di riferimento (base 100)



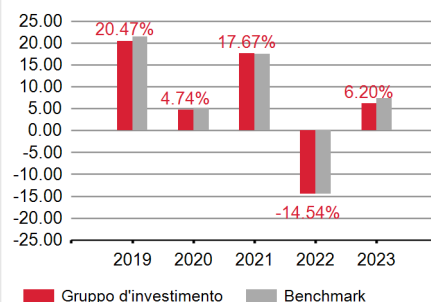
Performance nella valuta di riferimento

	Performance cumulata True				Performance annualizzata			
	YTD	1 mese	3 mesi	1 anno	3 anni	5 anni	10 anni	Inizio
Gruppo d'investimento	10.90%	0.01%	0.88%	13.09%	1.91%	5.19%	-	5.91%
Benchmark	11.54%	0.16%	1.07%	14.00%	2.47%	5.68%	-	6.47%

Dati statistici (annualizzati)

	1 anno	3 anni	5 anni	10 anni	Inizio
Volatilità Gruppo d'investimento (in %)	7.75	9.59	10.40	-	10.44
Volatilità del Benchmark (in %)	7.92	10.05	10.92	-	10.89
Tracking Error ex post (in %)	0.29	0.70	0.86	-	0.80
Information Ratio	-3.17	-0.81	-0.57	-	-0.69
Sharpe Ratio	1.40	0.12	0.47	-	0.55
Correlazione	1.00	1.00	1.00	-	1.00
Beta	0.98	0.95	0.95	-	0.96
Jensen alfa	-0.63	-0.48	-0.22	-	-0.28
Maximum Drawdown (in %)	-7.18	-17.76	-23.54	-	-23.54
Recovery Period (anni)	-	1.76	0.74	-	0.74

Performance



Informazioni sul prodotto

Numero di valore: 43583002
ISIN: CH0435830028
LEI: 2549007MI5RG5X8NMB06
Codice Bloomberg: SWABM75 SW
Benchmark: Customized
Moneta: CHF
Domicilio: Svizzera
Data di creazione: 31/10/2018
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: 0.62%
ex post al: 30/09/2024 0.61%

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.

Fondazione d'investimento Swiss Life

LPP-Mix 75

(superamento quota azionaria e in valuta estera secondo OPP 2)

Struttura del portafoglio per gruppo d'investimento

	Gruppo d'investimento	Benchmark	max. OPP2
Liquidità	3.80%	2.00%	-
Ipoteche Svizzera	0.24%	-	-
Obbligazioni valute estere (CHF hedged)	15.11%	13.00%	-
Azioni Svizzera	36.89%	38.00%	-
Azioni Estero	36.95%	37.00%	-
Azioni Estero (CHF hedged)	-	-	-
Immobili Svizzera	4.74%	5.00%	30.00%
Immobili estero (CHF hedged)	0.25%	-	10.00%
Investimenti alternativi (CHF hedged)	2.01%	5.00%	15.00%
Totale azioni (Svizzera ed Estero)	73.84%	75.00%	50.00%
Totale valute estere	36.95%	37.00%	30.00%

Maggiori posizioni azionarie

NESTLE SA-REG	5.08%
NOVARTIS AG-REG	4.54%
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	4.34%
MICROSOFT CORP	2.17%
NVIDIA CORP	2.14%
UBS GROUP AG-REG	1.92%
ABB LTD-REG	1.79%
ZURICH INSURANCE GROUP AG	1.70%
CIE FINANCIERE RICHEMO-A REG	1.64%
ALPHABET INC	1.30%

Composizione del benchmark

1M SARON	2.00%
Bloomberg Gl. Agg. Treas. ex CH TR (CHF hedged)	2.00%
Bloomberg Gl. Agg. Corp. TR (CHF hedged)	4.00%
Bloomberg Gl. Agg. Corp. Short Term TR (CHF hedged)	4.00%
JP Morgan CEMBI Broad Div IG Index (CHF hedged)	3.00%
Swiss Performance Index	38.00%
MSCI World ex CH ESG Leaders, in CHF	29.60%
MSCI AC World Small Cap, in CHF	5.55%
MSCI Emerging Markets, in CHF	1.85%
KGAST Immo-Index	5.00%
HFRX Global Hedge Funds (CHF hedged)	5.00%

Struttura del portafoglio secondo le valute

CHF	63.05%
USD	25.08%
EUR	2.74%
JPY	2.34%
Altri	6.80%

Qualità degli investimenti a reddito fisso

Modified Duration	4.57
Rating medio	A-