

Fondazione d'investimento Swiss Life

LPP-Mix 75



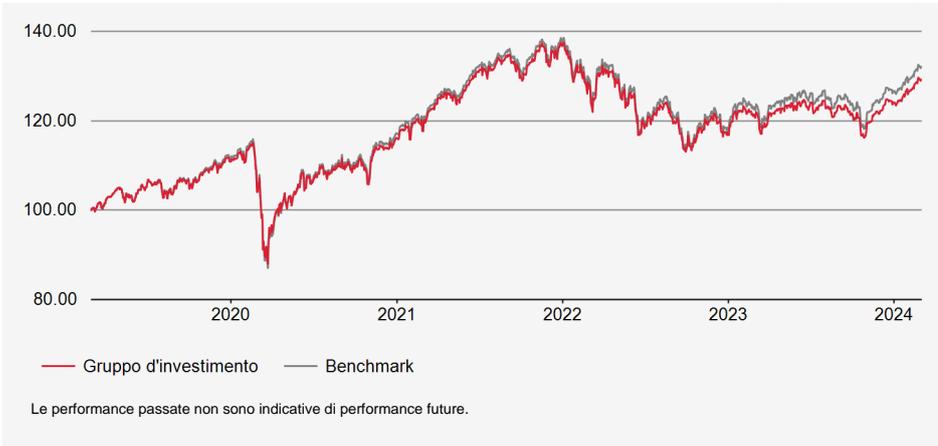
(superamento quota azionaria e in valuta estera secondo OPP 2)

Patrimonio netto (NAV) in mio. CHF: 204.99
Valore d'inventario netto per diritto in CHF: 131.95

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)



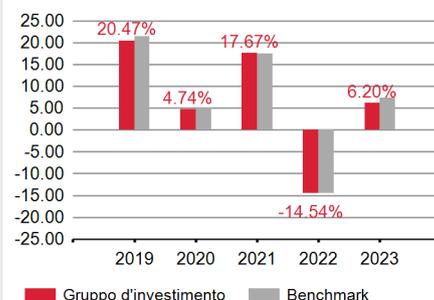
Performance nella valuta di riferimento

	Performance cumulata				Performance annualizzata			
	YTD	1 mese	3 mesi	1 anno	3 anni	5 anni	10 anni	Inizio
Gruppo d'investimento	4.17%	2.63%	6.21%	7.00%	3.16%	5.26%	-	5.34%
Benchmark	4.32%	2.75%	6.37%	7.89%	3.63%	5.72%	-	5.87%

Dati statistici (annualizzati)

	1 anno	3 anni	5 anni	10 anni	Inizio
Volatilità Gruppo d'investimento (in %)	6.74	10.02	10.48	-	10.80
Volatilità del Benchmark (in %)	6.93	10.41	10.99	-	11.28
Tracking Error ex post (in %)	0.30	0.71	0.86	-	0.85
Information Ratio	-2.93	-0.67	-0.53	-	-0.63
Sharpe Ratio	0.77	0.28	0.50	-	0.50
Correlazione	1.00	1.00	1.00	-	1.00
Beta	0.97	0.96	0.95	-	0.96
Jensen alfa	-0.71	-0.34	-0.18	-	-0.27
Maximum Drawdown (in %)	-6.81	-17.76	-23.54	-	-23.54
Recovery Period (anni)	0.13	-	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: 14.00
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: 0.64%
ex post al: 30/09/2023 0.64%

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	3.46%	2.00%	-
Ipoteche Svizzera	0.34%	-	-
Obbligazioni valute estere (CHF hedged)	11.63%	13.00%	-
Azioni Svizzera	37.46%	38.00%	-
Azioni Estero	36.01%	37.00%	-
Azioni Estero (CHF hedged)	2.05%	-	-
Immobili Svizzera	6.43%	5.00%	30.00%
Immobili estero (CHF hedged)	0.37%	-	10.00%
Investimenti alternativi (CHF hedged)	2.25%	5.00%	15.00%
Totale azioni (Svizzera ed Estero)	75.53%	75.00%	50.00%
Totale valute estere	36.01%	37.00%	30.00%

Maggiori posizioni azionarie

NESTLE SA-REG	5.95%
NOVARTIS AG-REG	4.60%
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	3.96%
MICROSOFT CORP.	2.65%
UBS GROUP AG-REG	1.87%
CIE FINANCIERE RICHEMONT-REG	1.84%
NVIDIA CORP	1.77%
ZURICH INSURANCE GROUP AG	1.67%
ABB LTD-REG	1.60%
ALPHABET INC	1.39%

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	62.69%
USD	24.48%
EUR	2.85%
JPY	2.43%
Altri	7.55%

Qualità degli investimenti a reddito fisso

Modified Duration	4.62
Rating medio	A-