31 marzo 2024

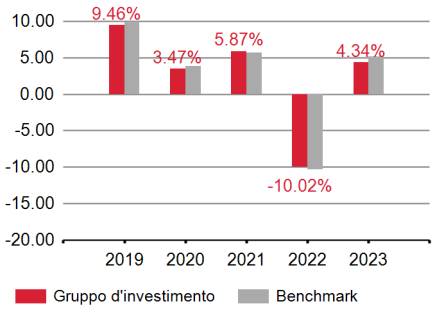
Fondazione d'investimento Swiss Life LPP-Mix 25

Patrimonio netto (NAV) in mio. CHF: 734.44
Valore d'inventario netto per diritto in CHF: 195.53

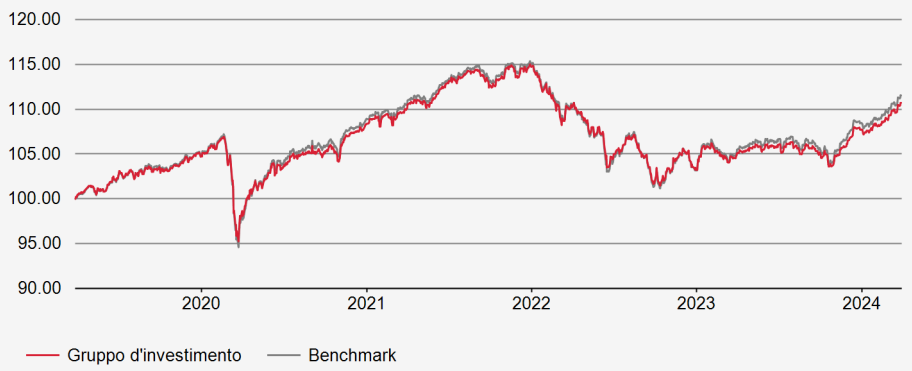
Strategia d'investimento

Investimenti in tutte le categorie d'investimento ammesse dalla LPP (quota di azioni strategica: 25%). Asset Allocation attiva. Limitazione per titoli di partecipazione: 35%, 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 10%.

Performance



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	2.78%	1.62%	2.78%	5.37%	0.19%	2.01%	2.72%	3.02%
Benchmark	2.83%	1.63%	2.83%	5.73%	0.28%	2.18%	3.03%	3.51%

Dati statistici (annualizzati)

	1 anno	3 anni	5 anni	10 anni	Inizio
Volatilità Gruppo d'investimento (in %)	3.34	4.89	5.12	4.29	4.12
Volatilità del Benchmark (in %)	3.64	5.27	5.47	4.42	4.12
Tracking Error ex post (in %)	0.40	0.59	0.56	0.52	0.58
Information Ratio	-0.91	-0.16	-0.30	-0.58	-0.82
Sharpe Ratio	1.08	-0.04	0.40	0.71	0.68
Correlazione	1.00	1.00	1.00	0.99	0.99
Beta	0.91	0.92	0.93	0.96	0.99
Jensen alfa	0.00	-0.10	-0.01	-0.18	-0.46
Maximum Drawdown (in %)	-2.56	-11.75	-11.75	-11.75	-14.16
Recovery Period (anni)	0.11	-	-	-	0.98

Informazioni sul prodotto

Numero di valore: 1245601
ISIN: CH0012456015
LEI: 5493000KUC3Z24U77V93
Codice Bloomberg: SWABM25 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: 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/fondazionedinvestimento
Quote spese operative TER KGAST
ex ante: 0.56%
ex post al: 30/09/2023 0.58%

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 logaritmizzati mensili.
Tracking error ex ante: Il tracking error previsto per i prossimi 12 mesi corrisponde al Tracking error ex post degli ultimi 3 anni.

31 marzo 2024

Fondazione d'investimento Swiss Life LPP-Mix 25

SwissLife

Struttura del portafoglio per gruppo d'investimento

	Gruppo d'investimento	Benchmark	max. OPP2
Liquidità	2.95%	2.00%	-
Ipoteche Svizzera	0.84%	-	-
Obbligazioni CHF Svizzera	15.81%	16.00%	-
Obbligazioni CHF Estero	8.83%	9.00%	-
Obbligazioni valute estere (CHF hedged)	24.45%	28.00%	-
Azioni Svizzera	12.66%	13.00%	-
Azioni Estero	12.61%	12.00%	-
Azioni Estero (CHF hedged)	0.66%	-	-
Immobili Svizzera	15.71%	13.00%	30.00%
Immobili estero (CHF hedged)	3.17%	2.00%	10.00%
Investimenti alternativi (CHF hedged)	2.32%	5.00%	15.00%
Totale azioni (Svizzera ed Estero)	25.93%	25.00%	50.00%
Totale valute estere	12.61%	12.00%	30.00%

Maggiori posizioni azionarie

NESTLE SA-REG	2.05%
NOVARTIS AG-REG	1.43%
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	1.29%
MICROSOFT CORP.	0.91%
UBS GROUP AG-REG	0.72%
NVIDIA CORP	0.69%
CIE FINANCIERE RICHEMONT-REG	0.59%
ZURICH INSURANCE GROUP AG	0.57%
ABB LTD-REG	0.54%
ALPHABET INC	0.52%

Composizione del benchmark

1M SARON	2.00%
SBI Domestic AAA-BBB	16.00%
SBI Foreign AAA-BBB	9.00%
Bloomberg Gl. Agg. Treas. ex CH TR (CHF hedged)	4.00%
Bloomberg Gl. Agg. Corp. TR (CHF hedged)	9.00%
Bloomberg Gl. Agg. Corp. Short Term TR (CHF hedged)	9.00%
JP Morgan CEMBI Broad Div IG Index (CHF hedged)	6.00%
Swiss Performance Index	13.00%
MSCI World ex CH ESG Leaders, in CHF	9.60%
MSCI AC World Small Cap, in CHF	1.80%
MSCI Emerging Markets, in CHF	0.60%
KGAST Immo-Index	13.00%
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	85.71%
USD	8.60%
EUR	0.99%
JPY	0.84%
Altri	3.85%

Qualità degli investimenti a reddito fisso

Modified Duration	5.64
Rating medio	A

Nota legale: La presente pubblicazione non rappresenta né un invito, né una raccomandazione ad acquistare o vendere strumenti d'investimento, ma funge meramente da veicolo informativo. È possibile richiedere gratuitamente tutti i documenti che costituiscono la base giuridica di un eventuale investimento presso la Fondazione d'investimento Swiss Life, c/o Swiss Life SA, casella postale 8022 Zurigo, telefono 043 547 71 11 e su www.swisslife.ch/anlagestiftung. La cerchia degli investitori è limitata alle istituzioni del secondo pilastro e del pilastro 3a, non-ché istituzioni esonerate dall'obbligo tributario, con sede in Svizzera e che secondo l'oggetto sociale perseguono la previdenza professionale e persone che gestiscono investimenti collettivi per queste istituzioni, sono sorvegliate dall'Autorità federale di vigilanza sui mercati finanziari FINMA e che investono presso la fondazione esclusivamente capitali per queste istituzioni. La performance precedente non rappresenta un indicatore né per l'evoluzione attuale, né per quella futura. L'utilizzo non implica alcuna affiliazione con o sponsorizzazione da parte di quest'ultimi. **Fonte:** Swiss Life Asset Managers. Tutti i diritti riservati.