

30 aprile 2025

Fondazione d'investimento Swiss Life

LPP-Mix Index 35



Patrimonio netto (NAV) in mio. CHF: 12.04
Valore d'inventario netto per diritto in CHF: 1,001.18

Strategia d'investimento

Il gruppo d'investimento viene gestito con un approccio indicizzato; la quota azionaria strategica ammonta al 35%. Il gruppo d'investimento investe indirettamente, tramite investimenti collettivi indicizzati, a livello globale in azioni, in obbligazioni societarie e titoli di Stato nonché in immobili svizzeri, e si contraddistingue per un'ampia diversificazione.

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	-0.79%	-0.65%	-2.41%	-	-	-	-	-
Benchmark	-0.70%	-0.61%	-2.30%	-	-	-	-	-

Dati statistici (annualizzati)

	1 anno	3 anni	5 anni	10 anni	Inizio
Volatilità Gruppo d'investimento (in %)	-	-	-	-	5.40
Volatilità del Benchmark (in %)	-	-	-	-	5.38
Tracking Error ex post (in %)	-	-	-	-	0.12
Information Ratio	-	-	-	-	-0.38
Sharpe Ratio	-	-	-	-	-0.06
Correlazione	-	-	-	-	1.00
Beta	-	-	-	-	1.00
Jensen alfa	-	-	-	-	-0.05
Maximum Drawdown (in %)	-	-	-	-	-6.49
Recovery Period (anni)	-	-	-	-	-

Performance

Storia insufficiente di dati

Informazioni sul prodotto

Numero di valore: 137660522
ISIN: CH1376605221
LEI: 254900GF0BJD6RE4WJ66
Codice Bloomberg: SLAI35S SW
Benchmark: Customized
Valuta: CHF
Domicilio: Svizzera
Data di lancio: 28/10/2024
Prezzo di prima emissione: 1000.00
Chiusura d'esercizio: 30.09
Emissione/Riscatto: giornalmente
Termine d'accettazione: 12.00
Protezione contro la diluizione: Commissione di emissione / riscatto a favore del gruppo d'investimento secondo la panoramica delle condizioni.

Politica di distribuzione: Capitalizzazione

Asset Management: Asset allocation strategica e rebalancing basato su regole da parte di Swiss Life Asset Management SA

Gruppi d'investimento puri impiegati: Gruppi d'investimento indicizzati della Fondazione d'investimento Swiss Life

Consulenza esterna: Monitoraggio dei risultati d'investimento dei gruppi d'investimento impiegati da parte di PPCmetrics

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

Quote spese operative TER KGAST ex ante: 0.35%

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.

Protezione contro la diluizione: Panoramica delle condizioni: www.swisslife.ch/fondazioneinvestimento, «Documenti giuridici» (modifiche possibili in qualsiasi momento senza preavviso).

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	0.02%	-	-
Obbligazioni CHF	23.12%	23.00%	-
Obbligazioni valute estere (CHF hedged)	36.00%	35.00%	-
Azioni Svizzera	12.49%	12.50%	-
Azioni Estero	9.11%	10.00%	-
Azioni Estero (CHF hedged)	12.33%	12.50%	-
Immobili Svizzera	6.94%	7.00%	30.00%
Totale azioni (Svizzera ed Estero)	33.92%	-	50.00%
Totale valute estere	9.11%	-	30.00%

Maggiori posizioni

NESTLE SA-REG	1.81%
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	1.49%
NOVARTIS AG-REG	1.45%
APPLE INC	0.81%
MICROSOFT CORP	0.71%
NVIDIA CORP	0.68%
ZURICH INSURANCE GROUP AG	0.67%
UBS GROUP AG-REG	0.62%
CIE FINANCIERE RICHEMO-A REG	0.61%
ABB LTD-REG	0.54%

Composizione del benchmark

SBI® AAA-BBB Total Return	23.00%
FTSE Non-CHF World Government Bond Index TR (CHF hedged)	17.50%
Bloomberg Global Aggregate Corporate ex CHF TR (CHF hedged)	17.50%
SPI® Total Return	12.50%
MSCI World ex Switzerland Net Return	5.00%
MSCI World ex Switzerland Net Return (CHF hedged)	12.50%
MSCI World ex Switzerland Small Cap Net Return	2.50%
MSCI Emerging Markets Net Return	2.50%
SXI Real Estate® Funds Broad Total Return	7.00%

Struttura del portafoglio secondo le valute

CHF	90.89%
USD	4.75%
EUR	0.58%
JPY	0.58%
Altri	3.21%

Qualità degli investimenti a reddito fisso

Modified Duration	6.68
Rating medio	A+