

Fondazione d'investimento Swiss Life

LPP-Mix 45

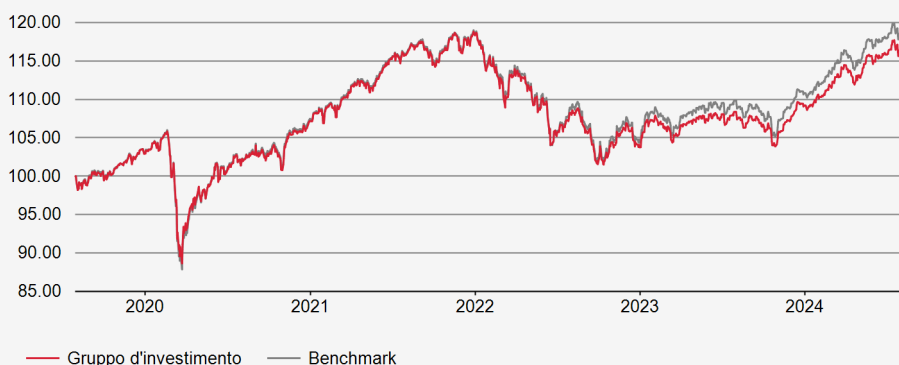


Patrimonio netto (NAV) in mio. CHF: 768.71
Valore d'inventario netto per diritto in CHF: 222.54

Strategia d'investimento

Investimenti in tutte le categorie d'investimento ammesse dalla LPP (quota di azioni strategica: 45%). Asset Allocation attiva. Limitazione per titoli di partecipazione: 50%, 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 20%.

Evoluzione del valore nella valuta di riferimento (base 100)



Le performance passate non sono indicative di performance future.

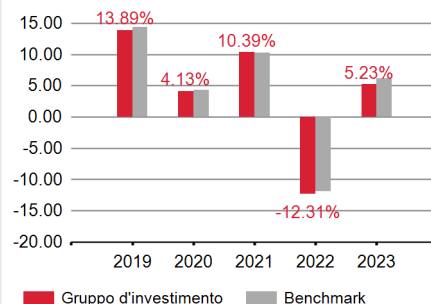
Performance nella valuta di riferimento

	Performance cumulata				Performance annualizzata			
	YTD	1 mese	3 mesi	1 anno	3 anni	5 anni	10 anni	Inizio
Gruppo d'investimento	7.13%	1.01%	3.66%	7.95%	0.36%	3.18%	3.82%	3.56%
Benchmark	7.50%	1.01%	3.77%	8.45%	0.92%	3.56%	4.35%	4.22%

Dati statistici (annualizzati)

	1 anno	3 anni	5 anni	10 anni	Inizio
Volatilità Gruppo d'investimento (in %)	5.43	6.87	7.20	6.43	6.46
Volatilità del Benchmark (in %)	5.61	7.19	7.52	6.49	6.44
Tracking Error ex post (in %)	0.31	0.55	0.57	0.58	0.67
Information Ratio	-1.65	-1.03	-0.67	-0.90	-0.97
Sharpe Ratio	1.12	-0.04	0.42	0.63	0.51
Correlazione	1.00	1.00	1.00	1.00	0.99
Beta	0.97	0.95	0.96	0.99	1.00
Jensen alfa	-0.27	-0.55	-0.22	-0.46	-0.65
Maximum Drawdown (in %)	-4.14	-14.55	-16.22	-16.22	-28.27
Recovery Period (anni)	0.11	-	0.67	0.67	3.76

Performance



Informazioni sul prodotto

Numero di valore: 1245607

ISIN: CH0012456072

LEI: 2549001XL79VZWJO5Q69

Codice Bloomberg: SWABM45 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: 0.59%

ex post al: 30/09/2023 0.60%

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	3.82%	2.00%	-
Ipotecche Svizzera	0.52%	-	-
Obbligazioni CHF Svizzera	10.86%	12.00%	-
Obbligazioni CHF Estero	4.81%	5.00%	-
Obbligazioni valute estere (CHF hedged)	20.72%	20.00%	-
Azioni Svizzera	23.32%	23.00%	-
Azioni Estero	21.80%	22.00%	-
Azioni Estero (CHF hedged)	-	-	-
Immobili Svizzera	10.27%	9.00%	30.00%
Immobili estero (CHF hedged)	1.63%	2.00%	10.00%
Investimenti alternativi (CHF hedged)	2.25%	5.00%	15.00%
Totale azioni (Svizzera ed Estero)	45.12%	45.00%	50.00%
Totale valute estere	21.80%	22.00%	30.00%

Maggiori posizioni azionarie

NESTLE SA-REG	3.34%
NOVARTIS AG-REG	2.88%
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	2.87%
MICROSOFT CORP	1.47%
NVIDIA CORP	1.45%
UBS GROUP AG-REG	1.23%
ABB LTD-REG	1.11%
CIE FINANCIERE RICHEMO-A REG	1.03%
ZURICH INSURANCE GROUP AG	1.01%
ALPHABET INC	0.94%

Composizione del benchmark

1M SARON	2.00%
SBI Domestic AAA-BBB	12.00%
SBI Foreign AAA-BBB	5.00%
Bloomberg Gl. Agg. Treas. ex CH TR (CHF hedged)	2.50%
Bloomberg Gl. Agg. Corp. TR (CHF hedged)	6.50%
Bloomberg Gl. Agg. Corp. Short Term TR (CHF hedged)	7.00%
JP Morgan CEMBI Broad Div IG Index (CHF hedged)	4.00%
Swiss Performance Index	23.00%
MSCI World ex CH ESG Leaders, in CHF	17.60%
MSCI AC World Small Cap, in CHF	3.30%
MSCI Emerging Markets, in CHF	1.10%
KGAST Immo-Index	9.00%
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	78.20%
USD	15.04%
EUR	1.57%
JPY	1.37%
Altri	3.82%

Qualità degli investimenti a reddito fisso

Modified Duration	5.79
Rating medio	A