

Fondazione d'investimento Swiss Life

LPP-Mix 75

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



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.

Informazioni sul prodotto

Numero di valore	43583002
ISIN	CH0435830028
LEI	2549007M15RG5X8NMB06
Bloomberg Ticker	SWABM75 SW
Benchmark	customized
Moneta	CHF
Data di lancio	31.10.2018
Prezzo di prima emissione	100.00
Chiusura d'esercizio	30.09.
Emissione/Riscatto	giornalmente
Termine di accettazione	14.00

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

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

Quote spese operative TER_{KGAST} **

- ex ante	0.65%
- ex post all 30.09.2019	0.65%

Comm. d'emissione/riscatto *** nessuna

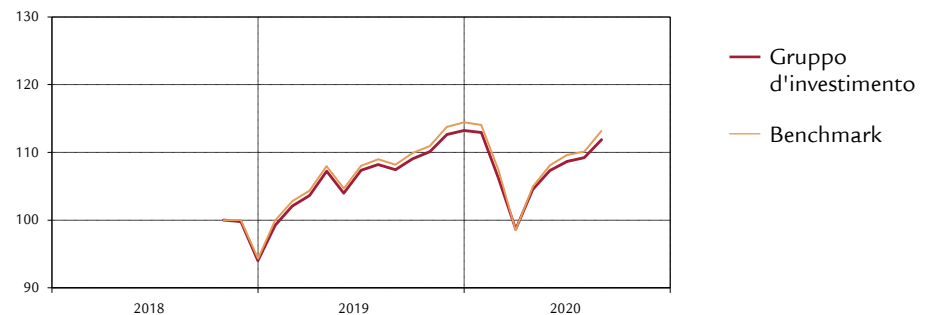
Prassi di distribuzione accumulazione

* 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

** La quota spese operative TER_{KGAST} copre tutti i costi, eccezione fatta per i costi di transazione e i tributi fiscali legati alla transazione

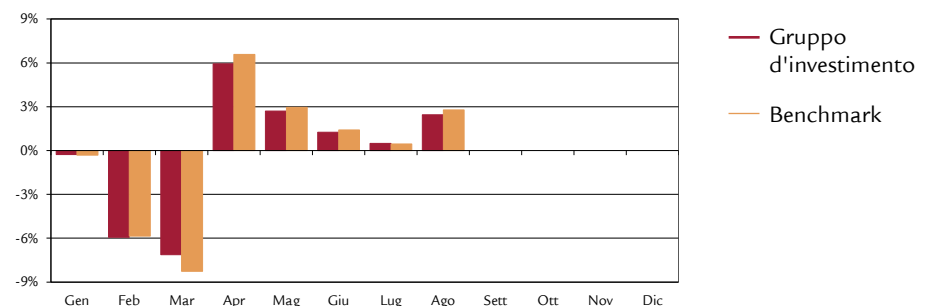
*** Rimangono riservate le disposizioni divergenti nei regolamenti sulle commissioni di fondazioni di libero passaggio e fondazioni di previdenza 3a

Evoluzione del valore indicizzata e performance



Performance	1M	3M	1A	3A p.a.	5A p.a.	p.a. dal 31.10.18
Gruppo d'investimento (in %)	2.44	4.24	4.12			6.32
Benchmark (in %)	2.78	4.69	4.63			6.99
	YTD	2019	2018	2017	2016	2015
Gruppo d'investimento (in %)	-1.20	20.47				
Benchmark (in %)	-1.09	21.29				

Performance mensile



Dati statistici (annualizzati)

	1A	3A	5A	dal 31.10.18
Volatilità Gruppo d'investimento (in %)	12.49			11.86
Volatilità Benchmark (in %)	13.72			12.59
Tracking Error ex post (in %)	1.47			1.11
Tracking Error ex ante (in %)	0.60			
Information Ratio	-0.34			-0.60
Sharpe Ratio	0.38			0.58
Correlazione	1.00			1.00
Beta	0.91			0.94
Jensen-Alpha	-0.01			-0.18
Maximum Drawdown (in %)	-23.54			-23.54
Recovery Period (anni)	-			-

Cifre salienti (in CHF)

	31.12.2019	31.08.2020
Patrimonio in milioni CHF	11.9	27.2
Valore d'inventario netto per quota in CHF	113.25	111.89

31 agosto 2020

Fondazione d'investimento Swiss Life LPP-Mix 75

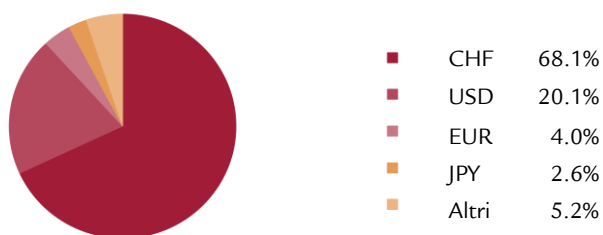
(superamento quota azionaria e in valuta estera secondo OPP 2)



Struttura del portafoglio per gruppo d'investimento

	Gruppo d'investimento	Benchmark	max. OPP2
Liquidità	1.7%	2%	
Obbligazioni valute estere (CHF hedged)	13.5%	13%	
Azioni Svizzera	41.8%	38%	
Azioni Estero	31.9%	37%	
Azioni Estero (CHF hedged)	3.0%	0%	
Immobili Svizzera	6.0%	5%	30%
Investimenti alternativi (CHF hedged)	2.1%	5%	15%
Totale	100.0%	100%	
<hr/>			
Totale azioni (Svizzera ed Estero)	76.7%	75%	50%
Totale valute estere	31.9%	37%	30%

Struttura del portafoglio secondo le valute



Composizione del benchmark

Citigroup CHF 1 M Euro Depo	2%
BB* Gl. Agg. Treas. ex CH TR (CHF hedged)	2%
BB* Gl. Agg. Corp. TR (CHF hedged)	4%
BB* Gl. Agg. Corp. Short Term TR (CHF hedged)	4%
JP Morgan CEMBI Broad Diversified IG (CHF hedged)	3%
Swiss Performance Index	38%
MSCI World ex CH, in CHF	29.6%
MSCI AC World Small Cap, in CHF	5.55%
MSCI Emerging Markets, in CHF	1.85%
KGAST Immo-Index	5%
HFRX Global Hedge Funds (CHF hedged)	5%
Totale	100%

* Bloomberg Barclays

Qualità degli investimenti a reddito fisso

Duration modificata	5.19
Rating media	A

Disclaimer

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, 8022 Zurigo, telefono 043 284 79 79. 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 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. I dati relativi alla performance non prendono in considerazione le commissioni e le spese riscosse al momento dell'emissione e del riscatto delle quote.