

30 giugno 2024

Fondazione d'investimento Swiss Life LPP-Mix 35

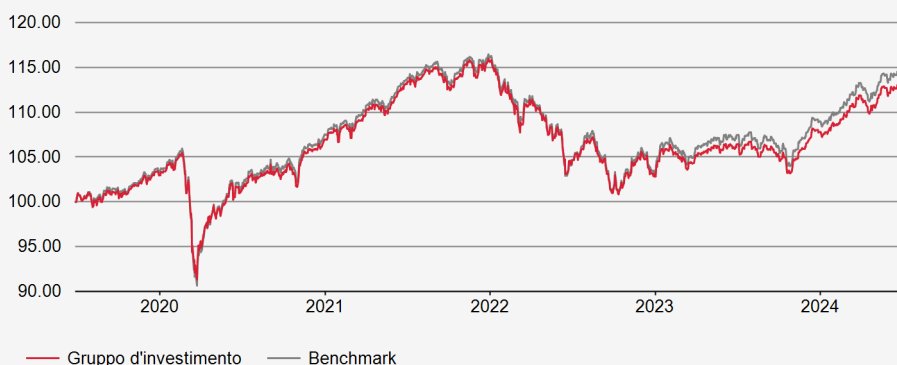


Patrimonio netto (NAV) in mio. CHF: 396.65
Valore d'inventario netto per diritto in CHF: 210.23

Strategia d'investimento

Investimenti in tutte le categorie d'investimento ammesse dalla LPP (quota di azioni strategica: 35%). Asset Allocation attiva. Limitazione per titoli di partecipazione: 45%, 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 15%.

Evoluzione del valore nella valuta di riferimento (base 100)



Le performance passate non sono indicative di performance future.

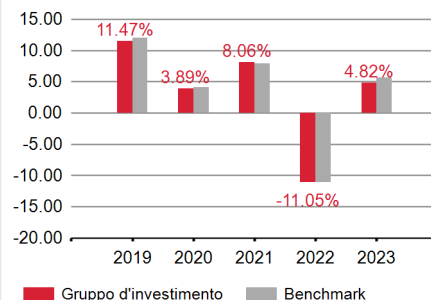
Performance nella valuta di riferimento

	Performance cumulata				Performance annualizzata			
	YTD	1 mese	3 mesi	1 anno	3 anni	5 anni	10 anni	Inizio
Gruppo d'investimento	4.83%	0.75%	1.01%	6.18%	-0.04%	2.47%	3.18%	3.32%
Benchmark	5.10%	0.79%	1.15%	6.61%	0.28%	2.75%	3.57%	3.86%

Dati statistici (annualizzati)

	1 anno	3 anni	5 anni	10 anni	Inizio
Volatilità Gruppo d'investimento (in %)	4.50	5.82	6.05	5.28	5.23
Volatilità del Benchmark (in %)	4.78	6.20	6.45	5.41	5.22
Tracking Error ex post (in %)	0.35	0.58	0.61	0.58	0.64
Information Ratio	-1.24	-0.54	-0.46	-0.68	-0.84
Sharpe Ratio	0.97	-0.10	0.40	0.66	0.59
Correlazione	1.00	1.00	1.00	0.99	0.99
Beta	0.94	0.93	0.94	0.97	0.99
Jensen alfa	-0.14	-0.33	-0.10	-0.28	-0.52
Maximum Drawdown (in %)	-3.29	-13.03	-13.41	-13.41	-21.36
Recovery Period (anni)	0.11	-	0.65	0.65	3.00

Performance



Informazioni sul prodotto

Numero di valore: 1245606

ISIN: CH0012456064

LEI: 254900SR5GM6HP44F130

Codice Bloomberg: SWABM35 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/fondazioneinvestimento

Quote spese operative TER KGAST

ex ante: 0.58%

ex post al: 30/09/2023 0.59%

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	3.67%	2.00%	-
Ipoteche Svizzera	0.60%	-	-
Obbligazioni CHF Svizzera	13.37%	14.00%	-
Obbligazioni CHF Estero	7.09%	7.00%	-
Obbligazioni valute estere (CHF hedged)	24.17%	24.00%	-
Azioni Svizzera	17.85%	18.00%	-
Azioni Estero	17.20%	17.00%	-
Azioni Estero (CHF hedged)	-	-	-
Immobili Svizzera	11.60%	11.00%	30.00%
Immobili estero (CHF hedged)	2.17%	2.00%	10.00%
Investimenti alternativi (CHF hedged)	2.28%	5.00%	15.00%
Totale azioni (Svizzera ed Estero)	35.05%	35.00%	50.00%
Totale valute estere	17.20%	17.00%	30.00%

Maggiori posizioni azionarie

NESTLE SA-REG	2.70%
NOVARTIS AG-REG	2.21%
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	1.97%
MICROSOFT CORP	1.26%
NVIDIA CORP	1.23%
UBS GROUP AG-REG	0.96%
ABB LTD-REG	0.89%
CIE FINANCIERE RICHEMO-A REG	0.85%
ALPHABET INC	0.80%
ZURICH INSURANCE GROUP AG	0.79%

Composizione del benchmark

1M SARON	2.00%
SBI Domestic AAA-BBB	14.00%
SBI Foreign AAA-BBB	7.00%
Bloomberg Gl. Agg. Treas. ex CH TR (CHF hedged)	3.50%
Bloomberg Gl. Agg. Corp. TR (CHF hedged)	7.50%
Bloomberg Gl. Agg. Corp. Short Term TR (CHF hedged)	8.00%
JP Morgan CEMBI Broad Div IG Index (CHF hedged)	5.00%
Swiss Performance Index	18.00%
MSCI World ex CH ESG Leaders, in CHF	13.60%
MSCI AC World Small Cap, in CHF	2.55%
MSCI Emerging Markets, in CHF	0.85%
KGAST Immo-Index	11.00%
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	81.25%
USD	11.87%
EUR	1.27%
JPY	1.04%
Altri	4.58%

Qualità degli investimenti a reddito fisso

Modified Duration	5.78
Rating medio	A