

30 giugno 2023

Fondazione d'investimento Swiss Life LPP-Mix 45

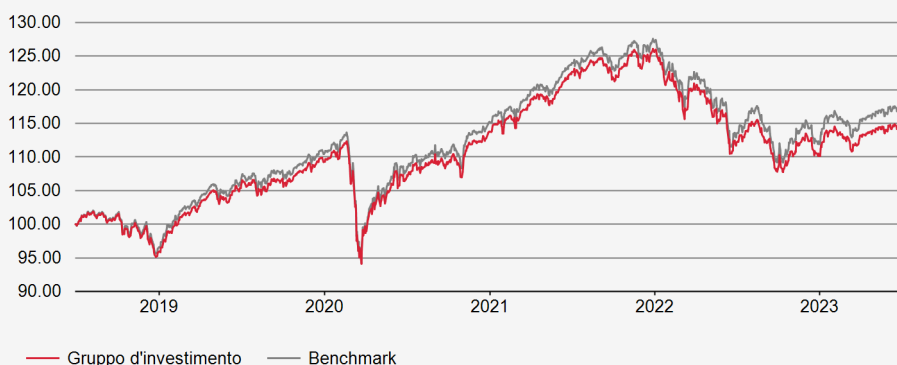


Patrimonio netto (NAV) in mio. CHF: 636.65
Valore d'inventario netto per diritto in CHF: 205.57

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.

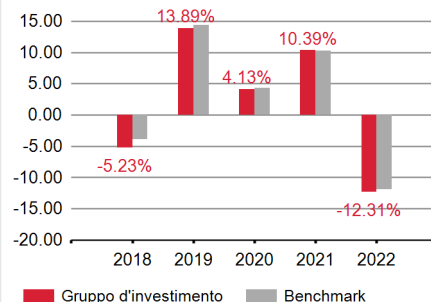
Performance nella valuta di riferimento

	PERFORMANCE CUMULATA				PERFORMANCE ANNUALIZZATA			
	YTD	1 MESE	3 MESI	1 ANNO	3 ANNI	5 ANNI	10 ANNI	INIZIO
GRUPPO D'INVESTIMENTO	4.14%	0.80%	1.37%	2.71%	2.39%	2.78%	3.97%	3.37%
BENCHMARK	4.90%	0.87%	1.62%	3.98%	2.82%	3.26%	4.45%	4.03%

Dati statistici (annualizzati)

	1 ANNO	3 ANNI	5 ANNI	10 ANNI	INIZIO
Volatilità Gruppo d'investimento (in %)	7.96	7.20	7.46	6.29	6.52
Volatilità del Benchmark (in %)	8.62	7.44	7.73	6.33	6.50
Tracking Error ex post (in %)	0.74	0.56	0.59	0.59	0.68
Information Ratio	-1.71	-0.76	-0.82	-0.82	-0.96
Sharpe Ratio	0.25	0.36	0.43	0.70	0.49
Correlazione	1.00	1.00	1.00	1.00	0.99
Beta	0.92	0.97	0.96	0.99	1.00
Jensen alfa	-1.02	-0.32	-0.34	-0.43	-0.66
Maximum Drawdown (in %)	-6.73	-14.55	-16.22	-16.22	-28.27
Recovery Period (anni)	-	-	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: 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: 0.59%
ex post al: 30/09/2022 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	3.97%	2.00%	-
Ipotecche Svizzera	0.58%	-	-
Obbligazioni CHF Svizzera	11.16%	12.00%	-
Obbligazioni CHF Estero	4.77%	5.00%	-
Obbligazioni valute estere (CHF hedged)	21.68%	20.00%	-
Azioni Svizzera	21.85%	23.00%	-
Azioni Estero	19.19%	22.00%	-
Azioni Estero (CHF hedged)	2.34%	-	-
Immobili Svizzera	10.00%	9.00%	30.00%
Immobili estero (CHF hedged)	2.12%	2.00%	10.00%
Investimenti alternativi (CHF hedged)	2.32%	5.00%	15.00%
Totale azioni (Svizzera ed Estero)	43.38%	45.00%	50.00%
Totale valute estere	19.19%	22.00%	30.00%

Struttura del portafoglio secondo le valute

CHF	80.81%
USD	13.47%
EUR	2.22%
JPY	1.42%
ALTRI	2.08%

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%

Qualità degli investimenti a reddito fisso

Modified Duration	5.39
Rating medio	A