

# Fondazione d'investimento Swiss Life

## LPP-Mix 35

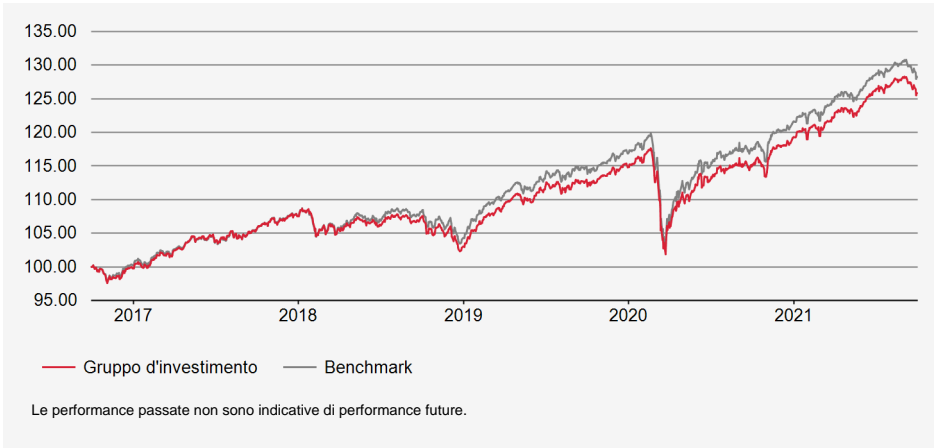


**Patrimonio netto (NAV) in mio. CHF: 286.84**  
**Valore d'inventario netto per diritto in CHF: 209.93**

### 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)



### 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	5.48%	-1.76%	-0.25%	9.44%	5.43%	4.70%	5.70%	3.78%
BENCHMARK	5.39%	-1.76%	-0.23%	9.29%	5.81%	5.09%	5.99%	4.35%

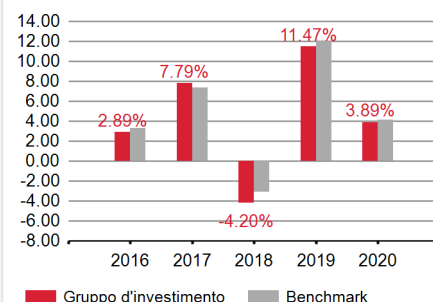
### Dati statistici (annualizzati)

	1 ANNO	3 ANNI	5 ANNI	10 ANNI	INIZIO
Volatilità Gruppo d'investimento (in %)	5.36	6.14	5.04	4.63	5.12
Volatilità del Benchmark (in %)	5.33	6.43	5.23	4.57	5.05
Tracking Error ex post (in %)	0.19	0.60	0.56	0.56	0.64
Information Ratio	0.81	-0.64	-0.70	-0.53	-0.89
Sharpe Ratio	1.80	0.98	1.06	1.31	0.70
Correlazione	1.00	1.00	0.99	0.99	0.99
Beta	1.00	0.95	0.96	1.01	1.01
Jensen alfa	0.11	-0.07	-0.15	-0.33	-0.60
Maximum Drawdown (in %)	-2.46	-13.41	-13.41	-13.41	-21.36
Recovery Period (anni)	0.03	0.65	0.65	0.65	3.00

**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.

### 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](http://www.swisslife.ch/fondazioneinvestimento)  
**Quote spese operative TER KGAST ex ante:** 0.58%  
**ex post al:** 30/09/2021 0.60%

## Struttura del portafoglio per gruppo d'investimento

	Gruppo d'investimento	Benchmark	max. OPP2
Liquidità	1.52%	2.00%	-
Obbligazioni CHF Svizzera	9.09%	14.00%	-
Obbligazioni CHF Estero	4.44%	7.00%	-
Obbligazioni valute estere (CHF hedged)	28.44%	24.00%	-
Azioni Svizzera	18.44%	18.00%	-
Azioni Estero	17.12%	17.00%	-
Azioni Estero (CHF hedged)	3.87%	-	-
Immobili Svizzera	12.52%	11.00%	30.00%
Immobili estero (CHF hedged)	2.43%	2.00%	10.00%
Investimenti alternativi (CHF hedged)	2.13%	5.00%	15.00%
<b>Totale azioni (Svizzera ed Estero)</b>	<b>39.42%</b>	<b>35.00%</b>	<b>50.00%</b>
<b>Totale valute estere</b>	<b>17.12%</b>	<b>17.00%</b>	<b>30.00%</b>

## Struttura del portafoglio secondo le valute

CHF	82.88%
USD	11.91%
EUR	2.00%
JPY	1.21%
ALTRI	2.00%

## Composizione del benchmark

CITIGROUP CHF 1 M EURO DEPO	2.00%
SBI DOMESTIC AAA-BBB	14.00%
SBI FOREIGN AAA-BBB	7.00%
BB* GL. AGG. TREAS. EX CH TR (CHF HEDGED)	3.50%
BB* GL. AGG. CORP. TR (CHF HEDGED)	7.50%
BB* 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, 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%

\* Bloomberg Barclays

## Qualità degli investimenti a reddito fisso

Modified Duration	5.84
Rating medio	A