

30 giugno 2021

Fondazione d'investimento Swiss Life LPP-Mix 25

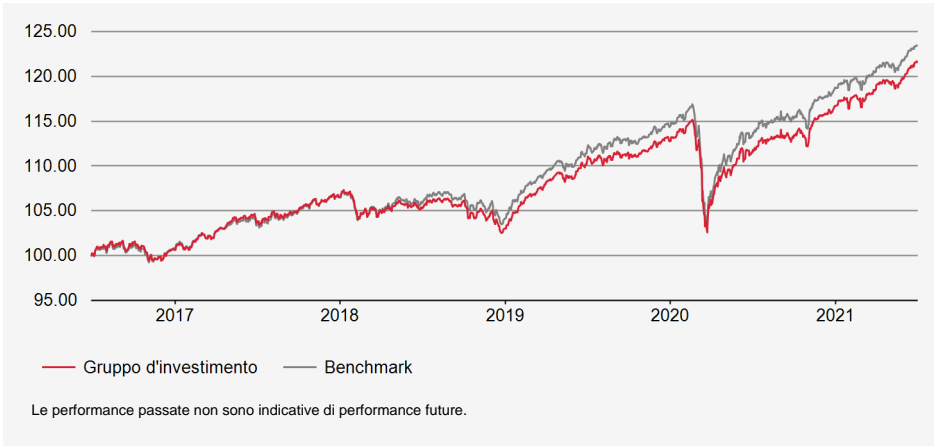


Patrimonio netto (NAV) in mio. CHF: 783.05
Valore d'inventario netto per diritto in CHF: 199.38

Strategia d'investimento

Investimenti in tutte le categorie d'investimento ammesse dalla LPP (quota di azioni strategica: 25%). Asset Allocation attiva. Limitazione per titoli di partecipazione: 35%, 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 10%.

Evoluzione del valore nella valuta di riferimento (base 100)



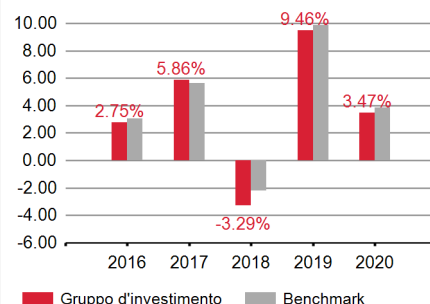
Performance nella valuta di riferimento

	PERFORMANCE CUMULATA			PERFORMANCE ANNUALIZZATA			
	YTD	1 MESE	1 ANNO	3 ANNI	5 ANNI	10 ANNI	INIZIO
GRUPPO D'INVESTIMENTO	4.18%	1.55%	8.96%	4.87%	3.98%	4.67%	3.55%
BENCHMARK	3.95%	1.39%	8.86%	5.21%	4.30%	4.97%	4.09%

Dati statistici (annualizzati)

	1 ANNO	3 ANNI	5 ANNI	10 ANNI	INIZIO
Volatilità Gruppo d'investimento (in %)	3.55	4.92	4.05	3.72	3.97
Volatilità del Benchmark (in %)	3.50	5.13	4.18	3.64	3.89
Tracking Error ex post (in %)	0.31	0.48	0.47	0.50	0.58
Tracking Error ex ante (in %)	0.50				
Information Ratio	0.32	-0.69	-0.67	-0.59	-0.92
Sharpe Ratio	2.60	1.12	1.16	1.36	0.84
Correlazione	1.00	1.00	0.99	0.99	0.99
Beta	1.01	0.96	0.96	1.01	1.01
Jensen alfa	0.00	-0.06	-0.14	-0.37	-0.58
Maximum Drawdown (in %)	-1.75	-10.89	-10.89	-10.89	-14.16
Recovery Period (anni)	0.02	0.65	0.65	0.65	0.98

Performance



Informazioni sul prodotto

Numero di valore: 1245601
ISIN: CH0012456015
LEI: 254900JNOBNDNHDGRO53
Codice Bloomberg: SWABM25 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: 0.53%
ex post al: 30/09/2020 0.57%

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.

Struttura del portafoglio per gruppo d'investimento

	Gruppo d'investimento	Benchmark	max. OPP2
Liquidità	3.31%	2.00%	-
Obbligazioni CHF Svizzera	12.06%	16.00%	-
Obbligazioni CHF Estero	6.90%	9.00%	-
Obbligazioni valute estere (CHF hedged)	29.40%	28.00%	-
Azioni Svizzera	13.18%	13.00%	-
Azioni Estero	11.63%	12.00%	-
Azioni Estero (CHF hedged)	4.21%	-	-
Immobili Svizzera	15.25%	13.00%	30.00%
Immobili estero (CHF hedged)	1.96%	2.00%	10.00%
Investimenti alternativi (CHF hedged)	2.11%	5.00%	15.00%
Totale azioni (Svizzera ed Estero)	29.02%	25.00%	50.00%
Totale valute estere	11.63%	12.00%	30.00%

Struttura del portafoglio secondo le valute

CHF	88.37%
USD	8.13%
EUR	1.34%
JPY	0.78%
ALTRI	1.38%

Composizione del benchmark

CITIGROUP CHF 1 M EURO DEPO	2.00%
SBI DOMESTIC AAA-BBB	16.00%
SBI FOREIGN AAA-BBB	9.00%
BB* GL. AGG. TREAS. EX CH TR (CHF HEDGED)	4.00%
BB* GL. AGG. CORP. TR (CHF HEDGED)	9.00%
BB* GL. AGG. CORP. SHORT TERM TR (CHF HEDGED)	9.00%
JP MORGAN CEMBI BROAD DIV IG INDEX (CHF HEDGED)	6.00%
SWISS PERFORMANCE INDEX	13.00%
MSCI WORLD EX CH, IN CHF	9.60%
MSCI AC WORLD SMALL CAP, IN CHF	1.80%
MSCI EMERGING MARKETS, IN CHF	0.60%
KGAST IMMO-INDEX	13.00%
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	5.79
Rating medio	A

* Bloomberg Barclays