

# Fondazione d'investimento Swiss Life LPP-Mix 75



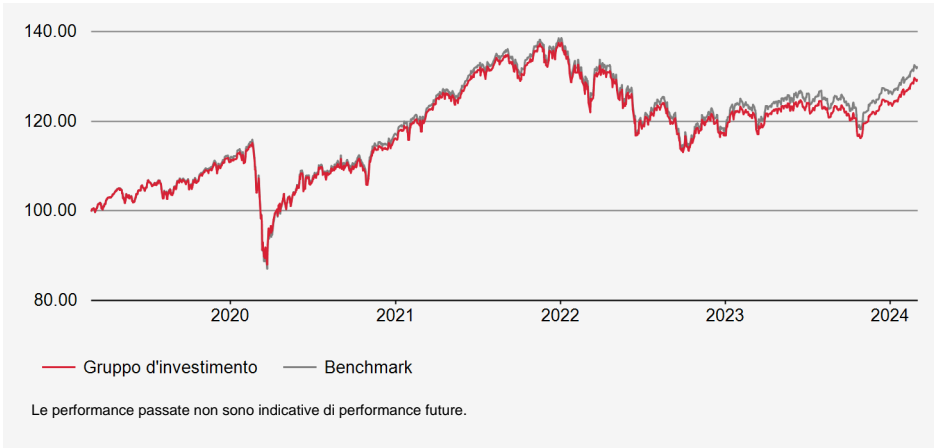
(superamento quota azionaria e in valuta estera secondo OPP 2)

**Patrimonio netto (NAV) in mio. CHF: 204.99**  
**Valore d'inventario netto per diritto in CHF: 131.95**

## 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.

## Evoluzione del valore nella valuta di riferimento (base 100)



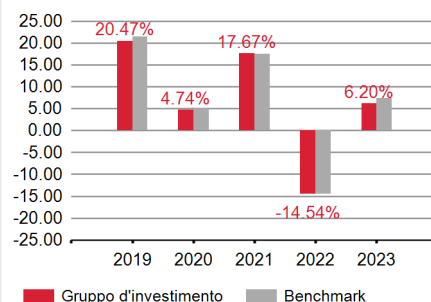
## Performance nella valuta di riferimento

|                       | Performance cumulata |        |        |        | Performance annualizzata |        |         |        |
|-----------------------|----------------------|--------|--------|--------|--------------------------|--------|---------|--------|
|                       | YTD                  | 1 mese | 3 mesi | 1 anno | 3 anni                   | 5 anni | 10 anni | Inizio |
| Gruppo d'investimento | 4.17%                | 2.63%  | 6.21%  | 7.00%  | 3.16%                    | 5.26%  | -       | 5.34%  |
| Benchmark             | 4.32%                | 2.75%  | 6.37%  | 7.89%  | 3.63%                    | 5.72%  | -       | 5.87%  |

## Dati statistici (annualizzati)

|   | 1 anno | 3 anni | 5 anni | 10 anni | Inizio |
|---|--------|--------|--------|---------|--------|
| Volatilità Gruppo d'investimento (in %) | 6.74   | 10.02  | 10.48  | -       | 10.80  |
| Volatilità del Benchmark (in %)         | 6.93   | 10.41  | 10.99  | -       | 11.28  |
| Tracking Error ex post (in %)           | 0.30   | 0.71   | 0.86   | -       | 0.85   |
| Information Ratio                       | -2.93  | -0.67  | -0.53  | -       | -0.63  |
| Sharpe Ratio                            | 0.77   | 0.28   | 0.50   | -       | 0.50   |
| Correlazione                            | 1.00   | 1.00   | 1.00   | -       | 1.00   |
| Beta                                    | 0.97   | 0.96   | 0.95   | -       | 0.96   |
| Jensen alfa                             | -0.71  | -0.34  | -0.18  | -       | -0.27  |
| Maximum Drawdown (in %)                 | -6.81  | -17.76 | -23.54 | -       | -23.54 |
| Recovery Period (anni)                  | 0.13   | -      | 0.74   | -       | 0.74   |

## Performance



## Informazioni sul prodotto

**Numero di valore:** 43583002  
**ISIN:** CH0435830028  
**LEI:** 2549007MI5RG5X8NMB06  
**Codice Bloomberg:** SWABM75 SW  
**Benchmark:** Customized  
**Moneta:** CHF  
**Domicilio:** Svizzera  
**Data di creazione:** 31/10/2018  
**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:** 0.64%  
**ex post al:** 30/09/2023 0.64%

# 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                                 | 3.46%                 | 2.00%         | -             |
| Ipoteche Svizzera                         | 0.34%                 | -             | -             |
| Obbligazioni valute estere (CHF hedged)   | 11.63%                | 13.00%        | -             |
| Azioni Svizzera                           | 37.46%                | 38.00%        | -             |
| Azioni Estero                             | 36.01%                | 37.00%        | -             |
| Azioni Estero (CHF hedged)                | 2.05%                 | -             | -             |
| Immobili Svizzera                         | 6.43%                 | 5.00%         | 30.00%        |
| Immobili estero (CHF hedged)              | 0.37%                 | -             | 10.00%        |
| Investimenti alternativi (CHF hedged)     | 2.25%                 | 5.00%         | 15.00%        |
| <b>Totale azioni (Svizzera ed Estero)</b> | <b>75.53%</b>         | <b>75.00%</b> | <b>50.00%</b> |
| <b>Totale valute estere</b>               | <b>36.01%</b>         | <b>37.00%</b> | <b>30.00%</b> |

### Maggiori posizioni azionarie

|                              |       |
|------------------------------|-------|
| NESTLE SA-REG                | 5.95% |
| NOVARTIS AG-REG              | 4.60% |
| ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN | 3.96% |
| MICROSOFT CORP.              | 2.65% |
| UBS GROUP AG-REG             | 1.87% |
| CIE FINANCIERE RICHEMONT-REG | 1.84% |
| NVIDIA CORP                  | 1.77% |
| ZURICH INSURANCE GROUP AG    | 1.67% |
| ABB LTD-REG                  | 1.60% |
| ALPHABET INC                 | 1.39% |

### Composizione del benchmark

|   |        |
|---|--------|
| 1M SARON  | 2.00%  |
| Bloomberg Gl. Agg. Treas. ex CH TR (CHF hedged)     | 2.00%  |
| Bloomberg Gl. Agg. Corp. TR (CHF hedged)            | 4.00%  |
| Bloomberg Gl. Agg. Corp. Short Term TR (CHF hedged) | 4.00%  |
| JP Morgan CEMBI Broad Div IG Index (CHF hedged)     | 3.00%  |
| Swiss Performance Index                             | 38.00% |
| MSCI World ex CH ESG Leaders, in CHF                | 29.60% |
| MSCI AC World Small Cap, in CHF                     | 5.55%  |
| MSCI Emerging Markets, in CHF                       | 1.85%  |
| KGAST Immo-Index                                    | 5.00%  |
| HFRX Global Hedge Funds (CHF hedged)                | 5.00%  |

### Struttura del portafoglio secondo le valute

|       |        |
|-------|--------|
| CHF   | 62.69% |
| USD   | 24.48% |
| EUR   | 2.85%  |
| JPY   | 2.43%  |
| Altri | 7.55%  |

### Qualità degli investimenti a reddito fisso

|                   |      |
|-------------------|------|
| Modified Duration | 4.62 |
| Rating medio      | A-   |