

Fondazione d'investimento Swiss Life

LPP-Mix 75

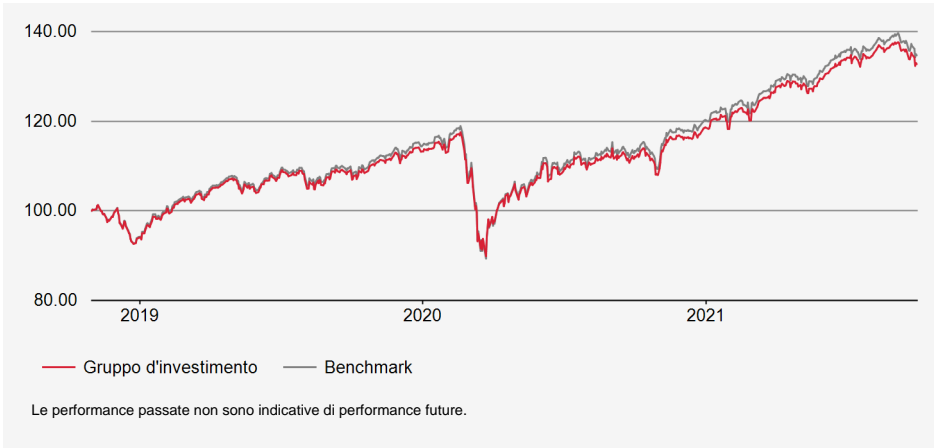
(superamento quota azionaria e in valuta estera secondo OPP 2)

Patrimonio netto (NAV) in mio. CHF: 68.94
Valore d'inventario netto per diritto in CHF: 132.73

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 | 11.90% | -3.17% | -0.68% | 18.92% | - | - | - | 10.19% |
| BENCHMARK | 11.96% | -3.02% | -0.54% | 19.31% | - | - | - | 10.74% |

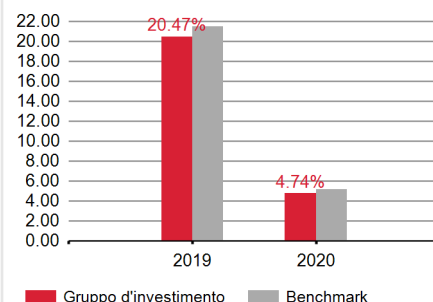
Dati statistici (annualizzati)

| | 1 ANNO | 3 ANNI | 5 ANNI | 10 ANNI | INIZIO |
|---|--------|--------|--------|---------|--------|
| Volatilità Gruppo d'investimento (in %) | 10.56 | - | - | - | 11.13 |
| Volatilità del Benchmark (in %) | 10.43 | - | - | - | 11.58 |
| Tracking Error ex post (in %) | 0.31 | - | - | - | 0.90 |
| Information Ratio | -1.26 | - | - | - | -0.60 |
| Sharpe Ratio | 1.70 | - | - | - | 0.91 |
| Correlazione | 1.00 | - | - | - | 1.00 |
| Beta | 1.01 | - | - | - | 0.96 |
| Jensen alfa | -0.61 | - | - | - | -0.09 |
| Maximum Drawdown (in %) | -5.22 | - | - | - | -23.54 |
| Recovery Period (anni) | 0.03 | - | - | - | 0.74 |

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: 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
Quote spese operative TER KGAST ex ante: 0.64%
ex post al: 30/09/2021 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 | 2.15% | 2.00% | - |
| Obbligazioni valute estere (CHF hedged) | 11.87% | 13.00% | - |
| Azioni Svizzera | 38.39% | 38.00% | - |
| Azioni Estero | 38.87% | 37.00% | - |
| Azioni Estero (CHF hedged) | 0.98% | - | - |
| Immobili Svizzera | 5.00% | 5.00% | 30.00% |
| Immobili estero (CHF hedged) | 0.42% | - | 10.00% |
| Investimenti alternativi (CHF hedged) | 2.32% | 5.00% | 15.00% |
| Totale azioni (Svizzera ed Estero) | 78.24% | 75.00% | 50.00% |
| Totale valute estere | 38.87% | 37.00% | 30.00% |

Struttura del portafoglio secondo le valute

| | |
|-------|--------|
| CHF | 61.13% |
| USD | 26.79% |
| EUR | 4.63% |
| JPY | 2.80% |
| ALTRI | 4.65% |

Composizione del benchmark

| | |
|---|--------|
| CITIGROUP CHF 1 M EURO DEPO | 2.00% |
| BB* GL. AGG. TREAS. EX CH TR (CHF HEDGED) | 2.00% |
| BB* GL. AGG. CORP. TR (CHF HEDGED) | 4.00% |
| BB* 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, 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% |

* Bloomberg Barclays

Qualità degli investimenti a reddito fisso

| | |
|-------------------|------|
| Modified Duration | 5.09 |
| Rating medio | A- |