

Fondazione d'investimento Swiss Life

LPP-Mix 35

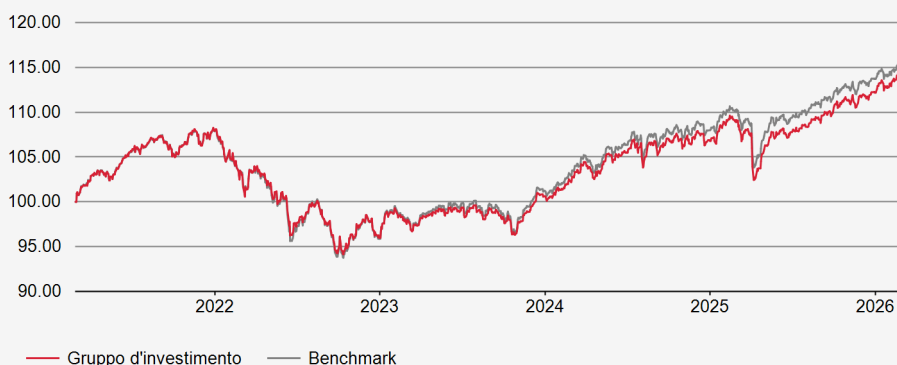


Patrimonio netto (NAV) in mio. CHF: 415.72
Valore d'inventario netto per diritto in CHF: 228.36

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)



Le performance passate non sono indicative di performance future.

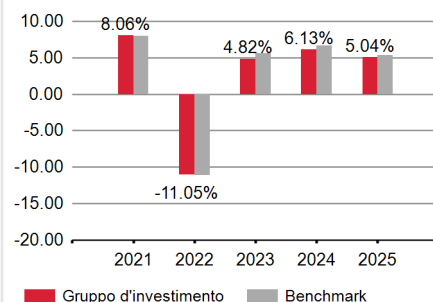
Performance nella valuta di riferimento

	Performance cumulata				Performance annualizzata			
	YTD	1 mese	3 mesi	1 anno	3 anni	5 anni	10 anni	Inizio
Gruppo d'investimento	2.15%	1.61%	2.44%	5.01%	5.47%	2.76%	3.71%	3.44%
Benchmark	1.66%	1.30%	1.91%	4.77%	5.71%	2.93%	3.94%	3.94%

Dati statistici (annualizzati)

	1 anno	3 anni	5 anni	10 anni	Inizio
Volatilità Gruppo d'investimento (in %)	3.52	3.59	5.09	4.97	5.12
Volatilità del Benchmark (in %)	3.21	3.58	5.29	5.16	5.10
Tracking Error ex post (in %)	0.60	0.43	0.53	0.55	0.63
Information Ratio	0.39	-0.56	-0.33	-0.43	-0.79
Sharpe Ratio	1.38	1.24	0.45	0.77	0.62
Correlazione	0.99	0.99	1.00	0.99	0.99
Beta	1.08	1.00	0.96	0.96	1.00
Jensen alfa	-0.16	-0.22	-0.07	-0.06	-0.49
Maximum Drawdown (in %)	-6.12	-6.55	-13.03	-13.41	-21.36
Recovery Period (anni)	0.35	0.42	2.28	0.65	3.00

Performance



Informazioni sul prodotto

Numero di valore: 1245606

ISIN: CH0012456064

LEI: 254900SR5GM6HP44F130

Codice Bloomberg: SWABM35 SW

Benchmark: Customized

Valuta: CHF

Domicilio: Svizzera

Data di lancio: 30/09/2001

Prezzo di prima emissione: 100.00

Chiusura d'esercizio: 30.09

Emissione/Riscatto: giornalmente

Termine d'accettazione: 12:00

Protezione contro la diluizione:

Commissione di emissione / riscatto a favore del gruppo d'investimento secondo la panoramica delle condizioni.

Asset Management:

Asset allocation strategica e tattica da parte di Swiss Life Asset Management SA

Gruppi d'investimento puri impiegati:

Diversi secondo l'approccio Swiss Life Best Select Invest Plus®

Consulenza esterna:

Monitoraggio dei risultati d'investimento dei gruppi d'investimento impiegati nonché consulenza sull'adeguata struttura del mandato e nella selezione di asset manager adeguati da parte di PPCmetrics

Pubblicazioni di corsi: Bloomberg: ASSL
www.swisslife.ch/fondazioneinvestimento

Quote spese operative TER KGAST

ex ante: 0.48%

ex post al: 30/09/2025 0.53%

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.

Protezione contro la diluizione: Panoramica delle condizioni: www.swisslife.ch/fondazioneinvestimento, «Documenti giuridici» (modifiche possibili in qualsiasi momento senza preavviso).

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	3.09%	4.00%	-
Ipotecche Svizzera	4.48%	5.00%	-
Obbligazioni CHF Svizzera	16.49%	19.00%	-
Obbligazioni valute estere (CHF hedged)	18.46%	20.00%	-
Azioni Svizzera	17.03%	15.00%	-
Azioni Estero	9.88%	8.00%	-
Azioni Estero (CHF hedged)	12.89%	12.00%	-
Immobili Svizzera	13.63%	12.00%	30.00%
Immobili estero (CHF hedged)	1.85%	2.00%	10.00%
Investimenti alternativi (CHF hedged)	2.20%	3.00%	15.00%
Infrastrutture	-	-	-
Totale azioni (Svizzera ed Estero)	39.80%	35.00%	50.00%
Totale valute estere	9.88%	17.00%	30.00%

Maggiori posizioni azionarie

ROCHE HOLDING AG-GENUSSSCHEIN	2.40%
NOVARTIS AG-REG	2.39%
NESTLE SA-REG	2.01%
ABB LTD-REG	1.06%
UBS GROUP AG-REG	0.87%
NVIDIA CORP	0.82%
ZURICH INSURANCE GROUP AG	0.79%
CIE FINANCIERE RICHEMO-A REG	0.79%
APPLE INC	0.74%
MICROSOFT CORP	0.53%

Composizione del benchmark

1M SARON	4.00%
SBI Domestic AAA-A 1-3Y Total Return	5.00%
SBI AAA-BBB Total Return	19.00%
Bloomberg Gl. Agg. Treas. ex CH (CHF hedged)	8.00%
Bloomberg Gl. Agg. Corp. (CHF hedged)	3.00%
Bloomberg Gl. Agg. Corp. Short Term (CHF hedged)	2.00%
JP Morgan CEMBI Broad Diversified IG Index (CHF hedged)	7.00%
SPI® Total Return	15.00%
MSCI World ex Switzerland Net Return	8.00%
MSCI World ex Switzerland Net Return (CHF hedged)	12.00%
KGAST Immo-Index	12.00%
SL REF (LUX) ESG German Core Real Estate (CHF hedged)	1.50%
Fondation de placement Swiss Life Immobili Europa Industria e Logistica ESG (EUR), CHF hedged	0.50%
HFRX Global Hedge Funds (CHF hedged)	3.00%
Fondation de placement Swiss Life Infrastruttura globale ESG (EUR)	-

Struttura del portafoglio secondo le valute

CHF	90.12%
USD	5.09%
JPY	1.42%
EUR	0.68%
Altri	2.69%

Qualità degli investimenti a reddito fisso

Modified Duration	5.66
Rating medio	A+