

# Fondazione d'investimento Swiss Life LPP-Mix 75



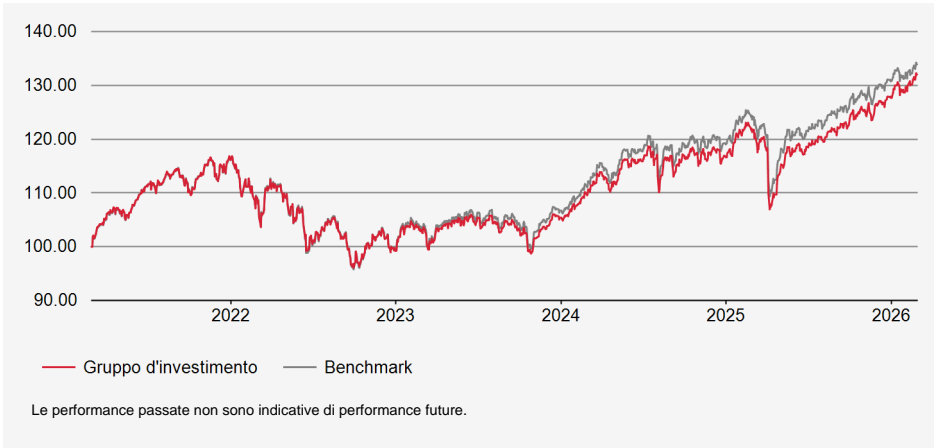
(superamento quota azionaria e in valuta estera secondo OPP 2)

**Patrimonio netto (NAV) in mio. CHF: 516.06**  
**Valore d'inventario netto per diritto in CHF: 158.61**

## 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)



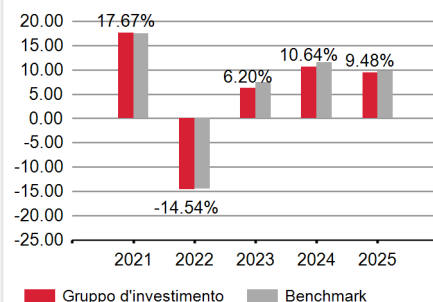
## Performance nella valuta di riferimento

	Performance cumulata				Performance annualizzata			
	YTD	1 mese	3 mesi	1 anno	3 anni	5 anni	10 anni	Inizio
Gruppo d'investimento	3.38%	2.57%	4.31%	8.39%	8.75%	5.70%	-	6.49%
Benchmark	2.40%	1.98%	3.26%	7.78%	9.07%	6.00%	-	6.89%

## Dati statistici (annualizzati)

	1 anno	3 anni	5 anni	10 anni	Inizio
Volatilità Gruppo d'investimento (in %)	6.99	6.75	8.88	-	9.86
Volatilità del Benchmark (in %)	6.58	6.65	9.07	-	10.20
Tracking Error ex post (in %)	0.88	0.57	0.69	-	0.80
Information Ratio	0.69	-0.56	-0.44	-	-0.50
Sharpe Ratio	1.15	1.11	0.58	-	0.63
Correlazione	0.99	1.00	1.00	-	1.00
Beta	1.06	1.01	0.98	-	0.96
Jensen alfa	0.18	-0.43	-0.17	-	-0.16
Maximum Drawdown (in %)	-12.18	-13.10	-17.76	-	-23.54
Recovery Period (anni)	0.38	0.46	1.76	-	0.74

## Performance



## Informazioni sul prodotto

**Numero di valore:** 43583002

**ISIN:** CH0435830028

**LEI:** 2549007MI5RG5X8NMB06

**Codice Bloomberg:** SWABM75 SW

**Benchmark:** Customized

**Valuta:** CHF

**Domicilio:** Svizzera

**Data di lancio:** 31/10/2018

**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](http://www.swisslife.ch/fondazioneinvestimento)

**Quote spese operative TER KGAST**

**ex ante:** 0.47%

**ex post al:** 30/09/2025 0.55%

**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](http://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.

# 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	4.07%	4.00%	-
Ipoteche Svizzera	0.91%	1.50%	-
Obbligazioni CHF Svizzera	2.58%	4.50%	-
Obbligazioni valute estere (CHF hedged)	4.17%	4.00%	-
Azioni Svizzera	28.24%	29.00%	-
Azioni Estero	19.08%	17.00%	-
Azioni Estero (CHF hedged)	28.97%	29.00%	-
Immobili Svizzera	6.30%	6.50%	30.00%
Immobili estero (CHF hedged)	1.28%	1.50%	10.00%
Investimenti alternativi (CHF hedged)	1.62%	3.00%	15.00%
Infrastrutture	-	-	-
Totale azioni (Svizzera ed Estero)	76.28%	75.00%	50.00%
Totale valute estere	19.08%	37.00%	30.00%

### Maggiori posizioni azionarie

ROCHE HOLDING AG-GENUSSSCHEIN	4.48%
NOVARTIS AG-REG	4.45%
NESTLE SA-REG	3.76%
ABB LTD-REG	1.97%
NVIDIA CORP	1.91%
APPLE INC	1.72%
UBS GROUP AG-REG	1.63%
ZURICH INSURANCE GROUP AG	1.48%
CIE FINANCIERE RICHEMO-A REG	1.47%
MICROSOFT CORP	1.23%

### Composizione del benchmark

1M SARON	4.00%
SBI Domestic AAA-A 1-3Y Total Return	1.50%
SBI AAA-BBB Total Return	4.50%
Bloomberg Gl. Agg. Treas. ex CH (CHF hedged)	1.00%
Bloomberg Gl. Agg. Corp. (CHF hedged)	1.00%
Bloomberg Gl. Agg. Corp. Short Term (CHF hedged)	-
JP Morgan CEMBI Broad Diversified IG Index (CHF hedged)	2.00%
SPI® Total Return	29.00%
MSCI World ex Switzerland Net Return	17.00%
MSCI World ex Switzerland Net Return (CHF hedged)	29.00%
KGAST Immo-Index	6.50%
SL REF (LUX) ESG German Core Real Estate (CHF hedged)	1.30%
Fondation de placement Swiss Life Immobili Europa Industria e Logistica ESG (EUR), CHF hedged	0.20%
HFRX Global Hedge Funds (CHF hedged)	3.00%
Fondation de placement Swiss Life Infrastruttura globale ESG (EUR)	-

### Struttura del portafoglio secondo le valute

CHF	80.92%
USD	9.05%
JPY	3.36%
EUR	1.29%
Altri	5.38%

### Qualità degli investimenti a reddito fisso

Modified Duration	5.26
Rating medio	A+