

31 gennaio 2025

# Fondazione d'investimento Swiss Life

## LPP-Mix Index 15

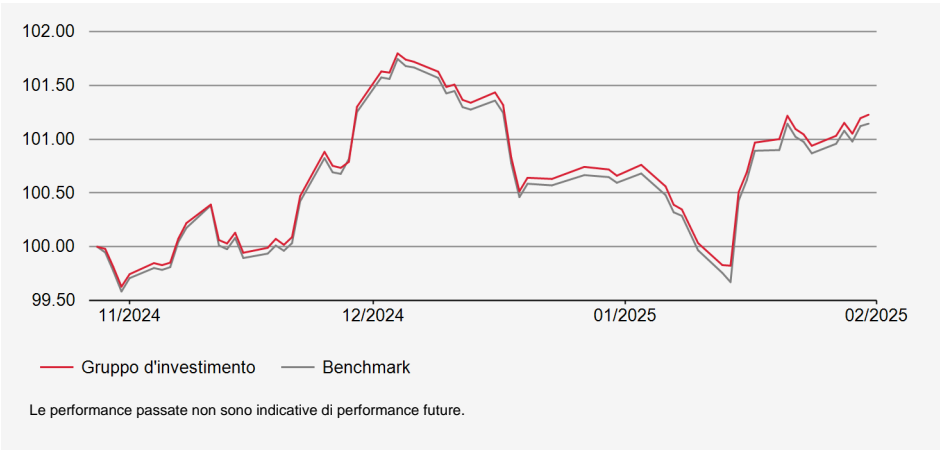


**Patrimonio netto (NAV) in mio. CHF: 12.97**  
**Valore d'inventario netto per diritto in CHF: 1,012.27**

### Strategia d'investimento

Il gruppo d'investimento viene gestito con un approccio indicizzato; la quota azionaria strategica ammonta al 15%. Il gruppo d'investimento investe indirettamente, tramite investimenti collettivi indicizzati, a livello globale in azioni, in obbligazioni societarie e titoli di Stato nonché in immobili svizzeri, e si contraddistingue per un'ampia diversificazione.

### 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	0.56%	0.56%	1.60%	-	-	-	-	-
Benchmark	0.55%	0.55%	1.57%	-	-	-	-	-

### Dati statistici (annualizzati)

	1 anno	3 anni	5 anni	10 anni	Inizio
Volatilità Gruppo d'investimento (in %)	-	-	-	-	3.61
Volatilità del Benchmark (in %)	-	-	-	-	3.65
Tracking Error ex post (in %)	-	-	-	-	0.06
Information Ratio	-	-	-	-	4.04
Sharpe Ratio	-	-	-	-	0.82
Correlazione	-	-	-	-	1.00
Beta	-	-	-	-	0.99
Jensen alfa	-	-	-	-	0.37
Maximum Drawdown (in %)	-	-	-	-	-1.94
Recovery Period (anni)	-	-	-	-	-

### Performance

Storia insufficiente di dati

### Informazioni sul prodotto

**Numero di valore:** 137660518  
**ISIN:** CH1376605189  
**LEI:** 254900B4UANU1ZR4GC06  
**Codice Bloomberg:** SLA115S SW  
**Benchmark:** Customized  
**Valuta:** CHF  
**Domicilio:** Svizzera  
**Data di lancio:** 28/10/2024  
**Prezzo di prima emissione:** 1000.00  
**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.

**Politica 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/fondazionedinvestimento](http://www.swisslife.ch/fondazionedinvestimento)

**Quote spese operative TER KGAST**  
**ex ante:** 0.35%

**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.  
**Protezione contro la diluizione:** Panoramica delle condizioni: [www.swisslife.ch/fondazionedinvestimento](http://www.swisslife.ch/fondazionedinvestimento), «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	0.09%	-	-
Obbligazioni CHF	30.77%	31.00%	-
Obbligazioni valute estere (CHF hedged)	46.93%	47.00%	-
Azioni Svizzera	5.84%	5.50%	-
Azioni Estero	9.58%	9.50%	-
Azioni Estero (CHF hedged)	-	-	-
Immobili Svizzera	6.79%	7.00%	30.00%
Totale azioni (Svizzera ed Estero)	15.42%	-	50.00%
Totale valute estere	9.58%	-	30.00%

## Maggiori posizioni

NESTLE SA-REG	0.72%
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	0.71%
NOVARTIS AG-REG	0.69%
APPLE INC	0.44%
NVIDIA CORP	0.36%
MICROSOFT CORP	0.36%
UBS GROUP AG-REG	0.35%
CIE FINANCIERE RICHEMO-A REG	0.34%
ZURICH INSURANCE GROUP AG	0.29%
ABB LTD-REG	0.28%

## Composizione del benchmark

SBI® AAA-BBB Total Return	31.00%
FTSE Non-CHF World Government Bond Index TR (CHF hedged))	23.50%
Bloomberg Global Aggregate Corporate ex CHF TR (CHF hedged)	23.50%
Swiss Performance Index	5.50%
MSCI World ex Switzerland Total Return	8.50%
MSCI World ex Switzerland Small Cap Total Return	1.00%
SXI Real Estate® Funds Broad Total Return	7.00%

## Struttura del portafoglio secondo le valute

CHF	90.42%
USD	7.14%
EUR	0.75%
JPY	0.58%
Altri	1.10%

## Qualità degli investimenti a reddito fisso

Modified Duration	6.75
Rating medio	A+