

31 gennaio 2025

Fondazione d'investimento Swiss Life LPP-Mix Index 25

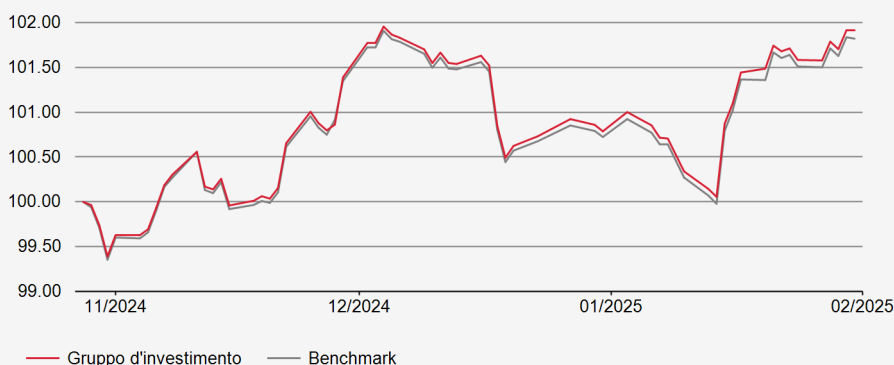


Patrimonio netto (NAV) in mio. CHF: 11.20
Valore d'inventario netto per diritto in CHF: 1,019.13

Strategia d'investimento

Il gruppo d'investimento viene gestito con un approccio indicizzato; la quota azionaria strategica ammonta al 25%. 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)



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	1.12%	1.12%	2.54%	-	-	-	-	-
Benchmark	1.09%	1.09%	2.48%	-	-	-	-	-

Dati statistici (annualizzati)

	1 anno	3 anni	5 anni	10 anni	Inizio
Volatilità Gruppo d'investimento (in %)	-	-	-	-	4.48
Volatilità del Benchmark (in %)	-	-	-	-	4.52
Tracking Error ex post (in %)	-	-	-	-	0.05
Information Ratio	-	-	-	-	5.76
Sharpe Ratio	-	-	-	-	1.11
Correlazione	-	-	-	-	1.00
Beta	-	-	-	-	0.99
Jensen alfa	-	-	-	-	0.42
Maximum Drawdown (in %)	-	-	-	-	-1.86
Recovery Period (anni)	-	-	-	-	-

Performance

Storia insufficiente di dati

Informazioni sul prodotto

Numero di valore: 137660520
ISIN: CH1376605205
LEI: 254900BN8UJF3508WG67
Codice Bloomberg: SLAI25S 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
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, «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	2.80%	-	-
Obbligazioni CHF	25.97%	27.00%	-
Obbligazioni valute estere (CHF hedged)	39.70%	41.00%	-
Azioni Svizzera	9.25%	9.00%	-
Azioni Estero	15.76%	16.00%	-
Azioni Estero (CHF hedged)	-	-	-
Immobili Svizzera	6.51%	7.00%	30.00%
Totale azioni (Svizzera ed Estero)	25.01%	-	50.00%
Totale valute estere	15.76%	-	30.00%

Maggiori posizioni

NESTLE SA-REG	1.13%
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	1.12%
NOVARTIS AG-REG	1.09%
APPLE INC	0.70%
NVIDIA CORP	0.58%
MICROSOFT CORP	0.57%
UBS GROUP AG-REG	0.55%
CIE FINANCIERE RICHEMO-A REG	0.53%
ZURICH INSURANCE GROUP AG	0.45%
ABB LTD-REG	0.45%

Composizione del benchmark

SBI® AAA-BBB Total Return	27.00%
FTSE Non-CHF World Government Bond Index TR (CHF hedged))	20.50%
Bloomberg Global Aggregate Corporate ex CHF TR (CHF hedged)	20.50%
Swiss Performance Index	9.00%
MSCI World ex Switzerland Total Return	14.00%
MSCI World ex Switzerland Small Cap Total Return	2.00%
SXI Real Estate® Funds Broad Total Return	7.00%

Struttura del portafoglio secondo le valute

CHF	84.24%
USD	11.71%
EUR	1.22%
JPY	0.98%
Altri	1.84%

Qualità degli investimenti a reddito fisso

Modified Duration	6.75
Rating medio	A+