

31 gennaio 2025

Fondazione d'investimento Swiss Life LPP-Mix Index 35

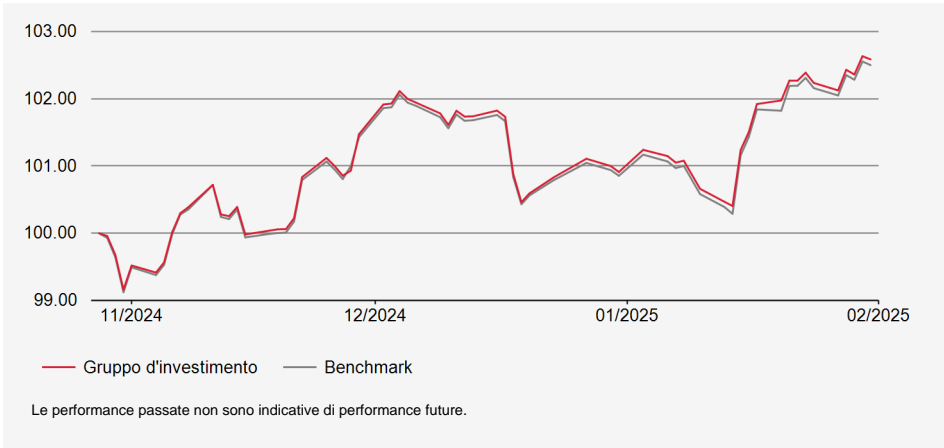


Patrimonio netto (NAV) in mio. CHF: 11.90
Valore d'inventario netto per diritto in CHF: 1,025.86

Strategia d'investimento

Il gruppo d'investimento viene gestito con un approccio indicizzato; la quota azionaria strategica ammonta al 35%. 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	1.66%	1.66%	3.45%	-	-	-	-	-
Benchmark	1.63%	1.63%	3.41%	-	-	-	-	-

Dati statistici (annualizzati)

	1 anno	3 anni	5 anni	10 anni	Inizio
Volatilità Gruppo d'investimento (in %)	-	-	-	-	5.44
Volatilità del Benchmark (in %)	-	-	-	-	5.47
Tracking Error ex post (in %)	-	-	-	-	0.05
Information Ratio	-	-	-	-	5.17
Sharpe Ratio	-	-	-	-	1.28
Correlazione	-	-	-	-	1.00
Beta	-	-	-	-	1.00
Jensen alfa	-	-	-	-	0.38
Maximum Drawdown (in %)	-	-	-	-	-1.67
Recovery Period (anni)	-	-	-	-	0.02

Performance

Storia insufficiente di dati

Informazioni sul prodotto

Numero di valore: 137660522
ISIN: CH1376605221
LEI: 254900GF0BJD6RE4WJ66
Codice Bloomberg: SLAI35S 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	0.18%	-	-
Obbligazioni CHF	22.44%	23.00%	-
Obbligazioni valute estere (CHF hedged)	34.34%	35.00%	-
Azioni Svizzera	13.25%	12.50%	-
Azioni Estero	22.98%	22.50%	-
Azioni Estero (CHF hedged)	-	-	-
Immobili Svizzera	6.80%	7.00%	30.00%
Totale azioni (Svizzera ed Estero)	36.23%	-	50.00%
Totale valute estere	22.98%	-	30.00%

Maggiori posizioni

NESTLE SA-REG	1.63%
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	1.61%
NOVARTIS AG-REG	1.56%
APPLE INC	1.03%
NVIDIA CORP	0.85%
MICROSOFT CORP	0.85%
UBS GROUP AG-REG	0.79%
CIE FINANCIERE RICHEMO-A REG	0.76%
ZURICH INSURANCE GROUP AG	0.65%
AMAZON.COM INC	0.65%

Composizione del benchmark

SBI® AAA-BBB Total Return	23.00%
FTSE Non-CHF World Government Bond Index TR (CHF hedged))	17.50%
Bloomberg Global Aggregate Corporate ex CHF TR (CHF hedged)	17.50%
Swiss Performance Index	12.50%
MSCI World ex Switzerland Total Return	20.00%
MSCI World ex Switzerland Small Cap Total Return	2.50%
SXI Real Estate® Funds Broad Total Return	7.00%

Struttura del portafoglio secondo le valute

CHF	77.02%
USD	17.10%
EUR	1.79%
JPY	1.42%
Altri	2.67%

Qualità degli investimenti a reddito fisso

Modified Duration	6.75
Rating medio	A+