

31 gennaio 2025

Fondazione d'investimento Swiss Life

LPP-Mix Index 45

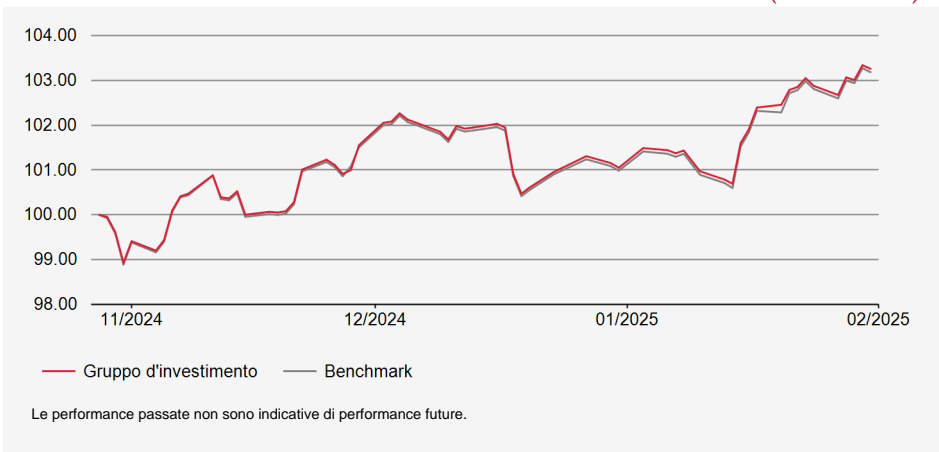


Patrimonio netto (NAV) in mio. CHF: 12.49
Valore d'inventario netto per diritto in CHF: 1,032.57

Strategia d'investimento

Il gruppo d'investimento viene gestito con un approccio indicizzato; la quota azionaria strategica ammonta al 45%. 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	2.18%	2.18%	4.37%	-	-	-	-	-
Benchmark	2.17%	2.17%	4.34%	-	-	-	-	-

Dati statistici (annualizzati)

	1 anno	3 anni	5 anni	10 anni	Inizio
Volatilità Gruppo d'investimento (in %)	-	-	-	-	6.43
Volatilità del Benchmark (in %)	-	-	-	-	6.48
Tracking Error ex post (in %)	-	-	-	-	0.05
Information Ratio	-	-	-	-	4.39
Sharpe Ratio	-	-	-	-	1.38
Correlazione	-	-	-	-	1.00
Beta	-	-	-	-	0.99
Jensen alfa	-	-	-	-	0.39
Maximum Drawdown (in %)	-	-	-	-	-1.75
Recovery Period (anni)	-	-	-	-	0.08

Performance

Storia insufficiente di dati

Informazioni sul prodotto

Numero di valore: 137661035
ISIN: CH1376610353
LEI: 2549004PTRK412MK4644
Codice Bloomberg: SLAI45S 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	0.09%	-	-
Obbligazioni CHF	19.03%	19.00%	-
Obbligazioni valute estere (CHF hedged)	28.92%	29.00%	-
Azioni Svizzera	16.14%	16.00%	-
Azioni Estero	29.03%	29.00%	-
Azioni Estero (CHF hedged)	-	-	-
Immobili Svizzera	6.79%	7.00%	30.00%
Totale azioni (Svizzera ed Estero)	45.17%	-	50.00%
Totale valute estere	29.03%	-	30.00%

Maggiori posizioni

NESTLE SA-REG	1.98%
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	1.96%
NOVARTIS AG-REG	1.91%
APPLE INC	1.32%
NVIDIA CORP	1.09%
MICROSOFT CORP	1.08%
UBS GROUP AG-REG	0.97%
CIE FINANCIERE RICHEMO-A REG	0.93%
AMAZON.COM INC	0.83%
ZURICH INSURANCE GROUP AG	0.79%

Composizione del benchmark

SBI® AAA-BBB Total Return	19.00%
FTSE Non-CHF World Government Bond Index TR (CHF hedged))	14.50%
Bloomberg Global Aggregate Corporate ex CHF TR (CHF hedged)	14.50%
Swiss Performance Index	16.00%
MSCI World ex Switzerland Total Return	26.00%
MSCI World ex Switzerland Small Cap Total Return	3.00%
SXI Real Estate® Funds Broad Total Return	7.00%

Struttura del portafoglio secondo le valute

CHF	70.97%
USD	21.64%
EUR	2.27%
JPY	1.77%
Altri	3.35%

Qualità degli investimenti a reddito fisso

Modified Duration	6.75
Rating medio	A+