

31 gennaio 2025

Fondazione d'investimento Swiss Life LPP-Mix Index 75



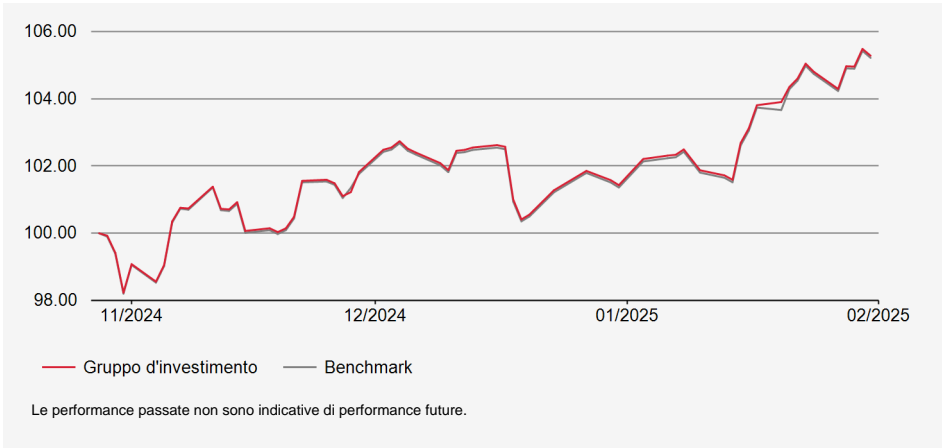
(superamento quota azionaria e in valuta estera secondo OPP 2)

Patrimonio netto (NAV) in mio. CHF: 12.98
Valore d'inventario netto per diritto in CHF: 1,052.81

Strategia d'investimento

Il gruppo d'investimento viene gestito con un approccio indicizzato; la quota azionaria strategica ammonta al 75%. 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. A causa della maggiore quota azionaria, questo prodotto presenta un rischio più elevato rispetto alle soluzioni previdenziali con una quota azionaria massima del 50%.

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	3.80%	3.80%	7.17%	-	-	-	-	-
Benchmark	3.80%	3.80%	7.14%	-	-	-	-	-

Dati statistici (annualizzati)

	1 anno	3 anni	5 anni	10 anni	Inizio
Volatilità Gruppo d'investimento (in %)	-	-	-	-	9.68
Volatilità del Benchmark (in %)	-	-	-	-	9.72
Tracking Error ex post (in %)	-	-	-	-	0.06
Information Ratio	-	-	-	-	3.72
Sharpe Ratio	-	-	-	-	1.52
Correlazione	-	-	-	-	1.00
Beta	-	-	-	-	1.00
Jensen alfa	-	-	-	-	0.35
Maximum Drawdown (in %)	-	-	-	-	-2.26
Recovery Period (anni)	-	-	-	-	0.08

Performance

Storia insufficiente di dati

Informazioni sul prodotto

Numero di valore: 137661037
ISIN: CH1376610379
LEI: 25490045MD808NK0DS90
Codice Bloomberg: SLAI75S 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/fondazioneinvestimento
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/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 Index 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	0.08%	-	-
Obbligazioni CHF	6.99%	7.00%	-
Obbligazioni valute estere (CHF hedged)	10.95%	11.00%	-
Azioni Svizzera	26.70%	26.50%	-
Azioni Estero	48.49%	48.50%	-
Azioni Estero (CHF hedged)	-	-	-
Immobili Svizzera	6.78%	7.00%	30.00%
Totale azioni (Svizzera ed Estero)	75.19%	-	50.00%
Totale valute estere	48.49%	-	30.00%

Maggiori posizioni

NESTLE SA-REG	3.28%
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	3.24%
NOVARTIS AG-REG	3.15%
APPLE INC	2.18%
NVIDIA CORP	1.79%
MICROSOFT CORP	1.78%
UBS GROUP AG-REG	1.60%
CIE FINANCIERE RICHEMO-A REG	1.54%
AMAZON.COM INC	1.37%
ZURICH INSURANCE GROUP AG	1.31%

Composizione del benchmark

SBI® AAA-BBB Total Return	7.00%
FTSE Non-CHF World Government Bond Index TR (CHF hedged))	5.50%
Bloomberg Global Aggregate Corporate ex CHF TR (CHF hedged)	5.50%
Swiss Performance Index	26.50%
MSCI World ex Switzerland Total Return	43.00%
MSCI World ex Switzerland Small Cap Total Return	5.50%
SXI Real Estate® Funds Broad Total Return	7.00%

Struttura del portafoglio secondo le valute

CHF	51.51%
USD	36.09%
EUR	3.77%
JPY	2.99%
Altri	5.63%

Qualità degli investimenti a reddito fisso

Modified Duration	6.75
Rating medio	A+