

28 febbraio 2023

Fondazione d'investimento Swiss Life LPP-Mix 75



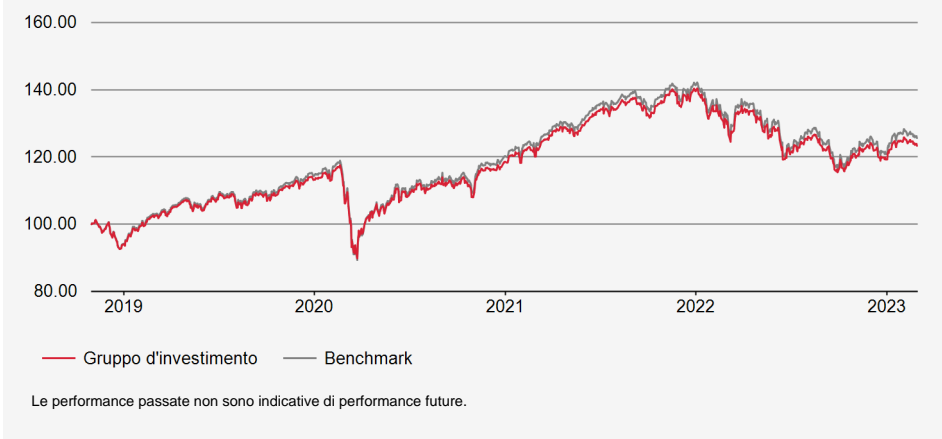
(superamento quota azionaria e in valuta estera secondo OPP 2)

Patrimonio netto (NAV) in mio. CHF: 137.96
Valore d'inventario netto per diritto in CHF: 123.32

Strategia d'investimento

Investimenti in tutte le categorie d'investimento ammesse dalla LPP (quota di azioni strategica: 75%). Asset Allocation attiva. Limitazione per titoli di partecipazione: 85%. Limitazione per valute estere: 50%. Rating medio delle obbligazioni: almeno BBB. Realizzazione tramite investimenti collettivi puri. A seguito della maggiore quota azionaria e in valuta estera, questo gruppo d'investimento comporta un rischio più elevato rispetto un LPP-Mix con quota azionaria del 50% e quota in valuta estera del 30% al massimo.

Evoluzione del valore nella valuta di riferimento (base 100)



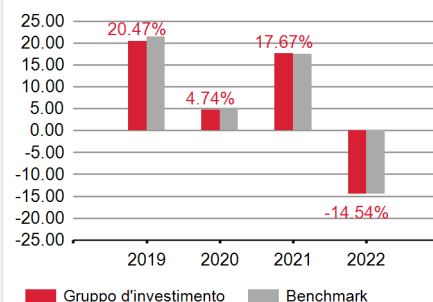
Performance nella valuta di riferimento

	PERFORMANCE CUMULATA				PERFORMANCE ANNUALIZZATA			
	YTD	1 MESE	3 MESI	1 ANNO	3 ANNI	5 ANNI	10 ANNI	INIZIO
GRUPPO D'INVESTIMENTO	3.39%	-0.96%	-0.39%	-5.77%	5.09%	-	-	4.96%
BENCHMARK	3.89%	-0.97%	-0.09%	-5.41%	5.37%	-	-	5.41%

Dati statistici (annualizzati)

	1 ANNO	3 ANNI	5 ANNI	10 ANNI	INIZIO
Volatilità Gruppo d'investimento (in %)	12.94	11.98	-	-	11.58
Volatilità del Benchmark (in %)	13.96	12.69	-	-	12.11
Tracking Error ex post (in %)	1.17	1.09	-	-	0.93
Information Ratio	-0.31	-0.25	-	-	-0.49
Sharpe Ratio	-0.46	0.45	-	-	0.46
Correlazione	1.00	1.00	-	-	1.00
Beta	0.93	0.94	-	-	0.95
Jensen alfa	-0.76	0.06	-	-	-0.18

Performance



Informazioni sul prodotto

Numero di valore: 43583002
ISIN: CH0435830028
LEI: 2549007MI5RG5X8NMB06
Codice Bloomberg: SWABM75 SW
Benchmark: Customized
Moneta: CHF
Domicilio: Svizzera
Data di creazione: 31/10/2018
Prezzo di prima emissione: 100.00
Chiusura d'esercizio: 30.09
Emissione/Riscatto: giornalmente
Termine d'accettazione: 14.00
Commissione d'emissione/riscatto: nessuna
Prassi 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: 0.64%
ex post al: 30/09/2022 0.63%

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.
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 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	4.70%	2.00%	-
Ipotecche Svizzera	0.47%	-	-
Obbligazioni valute estere (CHF hedged)	13.09%	13.00%	-
Azioni Svizzera	37.63%	38.00%	-
Azioni Estero	31.89%	37.00%	-
Azioni Estero (CHF hedged)	4.66%	-	-
Immobili Svizzera	4.63%	5.00%	30.00%
Immobili estero (CHF hedged)	0.60%	-	10.00%
Investimenti alternativi (CHF hedged)	2.32%	5.00%	15.00%
Totale azioni (Svizzera ed Estero)	74.19%	75.00%	50.00%
Totale valute estere	31.89%	37.00%	30.00%

Struttura del portafoglio secondo le valute

CHF	68.11%
USD	21.62%
EUR	4.19%
JPY	2.02%
ALTRI	4.06%

Composizione del benchmark

1M SARON	2.00%
BLOOMBERG GL. AGG. TREAS. EX CH TR (CHF HEDGED)	2.00%
BLOOMBERG GL. AGG. CORP. TR (CHF HEDGED)	4.00%
BLOOMBERG GL. AGG. CORP. SHORT TERM TR (CHF HEDGED)	4.00%
JP MORGAN CEMBI BROAD DIV IG INDEX (CHF HEDGED)	3.00%
SWISS PERFORMANCE INDEX	38.00%
MSCI WORLD EX CH ESG LEADERS, IN CHF	29.60%
MSCI AC WORLD SMALL CAP, IN CHF	5.55%
MSCI EMERGING MARKETS, IN CHF	1.85%
KGAST IMMO-INDEX	5.00%
HFRX GLOBAL HEDGE FUNDS (CHF HEDGED)	5.00%

Qualità degli investimenti a reddito fisso

Modified Duration	4.39
Rating medio	A-