

Fondazione d'investimento Swiss Life

LPP-Mix Index 45

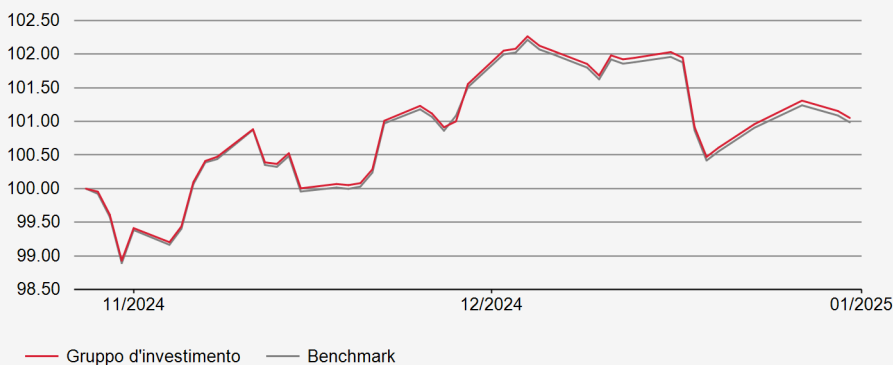


Patrimonio netto (NAV) in mio. CHF: 10.11
Valore d'inventario netto per diritto in CHF: 1,010.52

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)



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 | - | -0.50% | - | - | - | - | - | - |
| Benchmark | - | -0.51% | - | - | - | - | - | - |

Dati statistici (annualizzati)

| | 1 anno | 3 anni | 5 anni | 10 anni | Inizio |
|---|--------|--------|--------|---------|--------|
| Volatilità Gruppo d'investimento (in %) | - | - | - | - | 6.88 |
| Volatilità del Benchmark (in %) | - | - | - | - | 6.93 |
| Tracking Error ex post (in %) | - | - | - | - | 0.06 |
| Information Ratio | - | - | - | - | 4.56 |
| Sharpe Ratio | - | - | - | - | 0.49 |
| Correlazione | - | - | - | - | 1.00 |
| Beta | - | - | - | - | 0.99 |
| Jensen alfa | - | - | - | - | 0.42 |
| Maximum Drawdown (in %) | - | - | - | - | -1.75 |
| Recovery Period (anni) | - | - | - | - | - |

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 | 0.04% | - | - |
| Obbligazioni CHF | 19.02% | 19.00% | - |
| Obbligazioni valute estere (CHF hedged) | 28.44% | 29.00% | - |
| Azioni Svizzera | 16.24% | 16.00% | - |
| Azioni Estero | 28.95% | 29.00% | - |
| Azioni Estero (CHF hedged) | - | - | - |
| Immobili Svizzera | 7.31% | 7.00% | 30.00% |
| Totale azioni (Svizzera ed Estero) | 45.19% | - | 50.00% |
| Totale valute estere | 28.95% | - | 30.00% |

Maggiori posizioni

| | |
|------------------------------|-------|
| NESTLE SA-REG | 2.08% |
| NOVARTIS AG-REG | 1.92% |
| ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN | 1.90% |
| APPLE INC | 1.44% |
| NVIDIA CORP | 1.25% |
| MICROSOFT CORP | 1.13% |
| UBS GROUP AG-REG | 0.90% |
| ZURICH INSURANCE GROUP AG | 0.84% |
| ABB LTD-REG | 0.83% |
| CIE FINANCIERE RICHEMO-A REG | 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 | 71.05% |
| USD | 21.62% |
| EUR | 2.17% |
| JPY | 1.81% |
| Altri | 3.35% |

Qualità degli investimenti a reddito fisso

| | |
|-------------------|------|
| Modified Duration | 6.82 |
| Rating medio | A+ |