

Fondazione d'investimento Swiss Life

LPP-Mix 45 P



Patrimonio netto (NAV) in mio. CHF: 804.21
Valore d'inventario netto per diritto in CHF: 200.75

Strategia d'investimento

Il gruppo d'investimento LPP-Mix 45 P investe in media ca. il 45% in azioni. Un po' più della metà di questa quota in azioni viene investita in titoli a reddito variabile svizzeri, mentre il resto è destinato a società estere. In media il 37% del patrimonio viene investito in obbligazioni. Sono posti i seguenti limiti massimi: 50% azioni, 30% valute estere. LPP-Mix 45 P è adatta per investitori disposti ad assumersi importanti oscillazioni dei corsi. Raccomandiamo di optare per una durata dell'investimento superiore a dieci anni.

Evoluzione del valore nella valuta di riferimento (base 100)



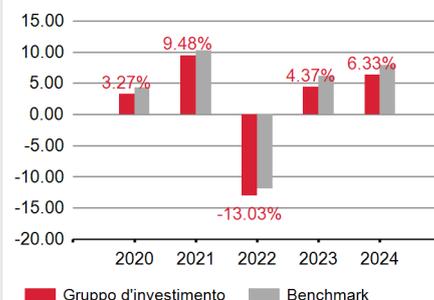
Performance nella valuta di riferimento

	Performance cumulata				Performance annualizzata			
	YTD	1 mese	3 mesi	1 anno	3 anni	5 anni	10 anni	Inizio
Gruppo d'investimento	0.47%	-2.09%	0.47%	2.15%	0.56%	3.79%	2.38%	3.14%
Benchmark	0.59%	-2.03%	0.59%	3.42%	1.99%	5.19%	3.76%	4.66%

Dati statistici (annualizzati)

	1 anno	3 anni	5 anni	10 anni	Inizio
Volatilità Gruppo d'investimento (in %)	4.87	6.62	6.59	6.32	6.33
Volatilità del Benchmark (in %)	4.77	6.98	6.80	6.42	6.31
Tracking Error ex post (in %)	0.26	0.55	0.49	0.56	0.67
Information Ratio	-4.96	-2.63	-2.87	-2.48	-2.27
Sharpe Ratio	0.24	-0.05	0.52	0.41	0.46
Correlazione	1.00	1.00	1.00	1.00	0.99
Beta	1.02	0.95	0.97	0.98	1.00
Jensen alfa	-1.32	-1.37	-1.24	-1.31	-1.50
Maximum Drawdown (in %)	-4.02	-11.16	-15.10	-16.28	-29.17
Recovery Period (anni)	0.20	1.61	-	0.74	3.98

Performance



Informazioni sul prodotto

Numero di valore: 1436925

ISIN: CH0014369257

LEI: 2549001XL79VZWJO5Q69

Codice Bloomberg: SLVOR45 SW

Benchmark: Customized

Valuta: CHF

Domicilio: Svizzera

Data di lancio: 30/09/2002

Prezzo di prima emissione: 100.00

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: 1.33%

ex post al: 30/09/2024 1.42%

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.

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	4.19%	2.00%	-
Ipotecche Svizzera	0.51%	-	-
Obbligazioni CHF Svizzera	10.66%	12.00%	-
Obbligazioni CHF Estero	4.32%	5.00%	-
Obbligazioni valute estere (CHF hedged)	18.82%	20.00%	-
Azioni Svizzera	24.00%	23.00%	-
Azioni Estero	22.72%	22.00%	-
Azioni Estero (CHF hedged)	0.98%	-	-
Immobili Svizzera	9.33%	9.00%	30.00%
Immobili estero (CHF hedged)	1.44%	2.00%	10.00%
Investimenti alternativi (CHF hedged)	3.02%	5.00%	15.00%
Totale azioni (Svizzera ed Estero)	47.71%	45.00%	50.00%
Totale valute estere	22.72%	22.00%	30.00%

Maggiori posizioni azionarie

NESTLE SA-REG	3.42%
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	2.98%
NOVARTIS AG-REG	2.82%
ZURICH INSURANCE GROUP AG	1.31%
NVIDIA CORP	1.25%
MICROSOFT CORP	1.25%
UBS GROUP AG-REG	1.25%
CIE FINANCIERE RICHEMO-A REG	1.20%
ABB LTD-REG	1.05%
HOLCIM LTD	0.75%

Composizione del benchmark

1M SARON	2.00%
SBI Domestic AAA-BBB	12.00%
SBI Foreign AAA-BBB	5.00%
Bloomberg Gl. Agg. Treas. ex CH TR (CHF hedged)	2.50%
Bloomberg Gl. Agg. Corp. TR (CHF hedged)	6.50%
Bloomberg Gl. Agg. Corp. Short Term TR (CHF hedged)	7.00%
JP Morgan CEMBI Broad Div IG Index (CHF hedged)	4.00%
SPI® Total Return	23.00%
MSCI World ex CH ESG Leaders, in CHF	17.60%
MSCI AC World Small Cap, in CHF	3.30%
MSCI Emerging Markets, in CHF	1.10%
KGAST Immo-Index	9.00%
SL REF (LUX) German Core Real Estate (CHF hedged)	2.00%
HFRX Global Hedge Funds (CHF hedged)	5.00%

Struttura del portafoglio secondo le valute

CHF	76.33%
USD	15.29%
JPY	1.31%
EUR	0.27%
Altri	5.85%

Qualità degli investimenti a reddito fisso

Modified Duration	5.44
Rating medio	A