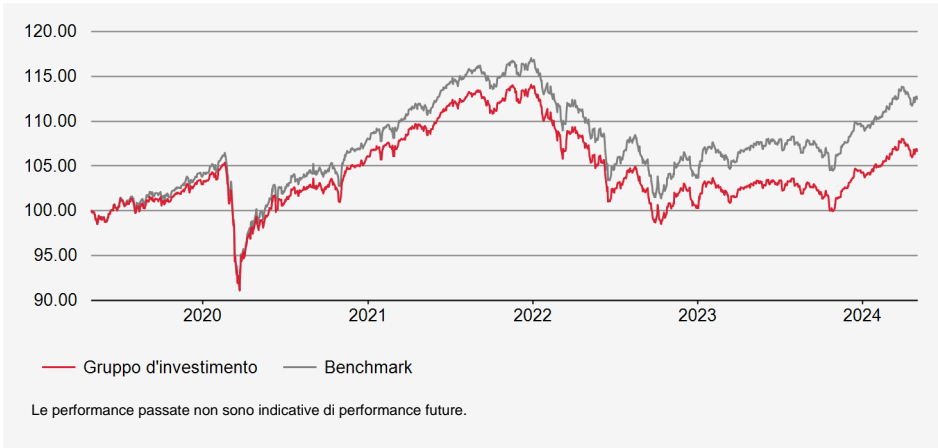


Patrimonio netto (NAV) in mio. CHF: 383.83
Valore d'inventario netto per diritto in CHF: 179.56

Strategia d'investimento

Il gruppo d'investimento LPP-Mix 35 P investe in media ca. il 35% 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 45% del patrimonio viene investito in obbligazioni. Sono posti i seguenti limiti massimi: 45% azioni, 30% valute estere. LPP-Mix 35 P è adatta per investitori disposti ad assumersi oscillazioni dei corsi medie. Raccomandiamo di optare per una durata dell'investimento superiore a sette anni.

Evoluzione del valore nella valuta di riferimento (base 100)



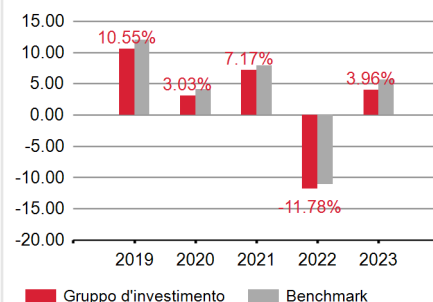
Performance nella valuta di riferimento

	Performance cumulata				Performance annualizzata			
	YTD	1 mese	3 mesi	1 anno	3 anni	5 anni	10 anni	Inizio
Gruppo d'investimento	2.27%	-1.25%	1.73%	3.54%	-0.77%	1.30%	2.28%	2.75%
Benchmark	2.69%	-1.17%	2.08%	4.85%	0.32%	2.38%	3.51%	4.15%

Dati statistici (annualizzati)

	1 anno	3 anni	5 anni	10 anni	Inizio
Volatilità Gruppo d'investimento (in %)	4.40	5.85	6.10	5.28	5.20
Volatilità del Benchmark (in %)	4.66	6.22	6.48	5.41	5.20
Tracking Error ex post (in %)	0.35	0.58	0.61	0.58	0.66
Information Ratio	-3.72	-1.88	-1.77	-2.11	-2.14
Sharpe Ratio	0.42	-0.21	0.22	0.49	0.49
Correlazione	1.00	1.00	1.00	0.99	0.99
Beta	0.94	0.94	0.94	0.97	0.99
Jensen alfa	-1.12	-1.09	-0.93	-1.12	-1.38
Maximum Drawdown (in %)	-3.49	-13.60	-13.60	-13.60	-22.51
Recovery Period (anni)	0.12	-	-	-	3.44

Performance



Informazioni sul prodotto

Numero di valore: 1436916
ISIN: CH0014369166
LEI: 254900SR5GM6HP44F130
Codice Bloomberg: SLVOR35 SW
Benchmark: Customized
Moneta: CHF
Domicilio: Svizzera
Data di creazione: 30/09/2002
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: 1.41%
ex post al: 30/09/2023 1.41%

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.

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	4.33%	2.00%	-
Ipotecche Svizzera	0.62%	-	-
Obbligazioni CHF Svizzera	13.31%	14.00%	-
Obbligazioni CHF Estero	7.10%	7.00%	-
Obbligazioni valute estere (CHF hedged)	22.91%	24.00%	-
Azioni Svizzera	17.77%	18.00%	-
Azioni Estero	16.93%	17.00%	-
Azioni Estero (CHF hedged)	0.57%	-	-
Immobili Svizzera	11.92%	11.00%	30.00%
Immobili estero (CHF hedged)	2.24%	2.00%	10.00%
Investimenti alternativi (CHF hedged)	2.30%	5.00%	15.00%
Totale azioni (Svizzera ed Estero)	35.27%	35.00%	50.00%
Totale valute estere	16.93%	17.00%	30.00%

Maggiori posizioni azionarie

NESTLE SA-REG	2.88%
NOVARTIS AG-REG	2.13%
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	1.81%
MICROSOFT CORP.	1.18%
UBS GROUP AG-REG	0.92%
NVIDIA CORP	0.92%
ABB LTD-REG	0.85%
CIE FINANCIERE RICHEMONT-REG	0.80%
ALPHABET INC	0.78%
ZURICH INSURANCE GROUP AG	0.76%

Composizione del benchmark

1M SARON	2.00%
SBI Domestic AAA-BBB	14.00%
SBI Foreign AAA-BBB	7.00%
Bloomberg Gl. Agg. Treas. ex CH TR (CHF hedged)	3.50%
Bloomberg Gl. Agg. Corp. TR (CHF hedged)	7.50%
Bloomberg Gl. Agg. Corp. Short Term TR (CHF hedged)	8.00%
JP Morgan CEMBI Broad Div IG Index (CHF hedged)	5.00%
Swiss Performance Index	18.00%
MSCI World ex CH ESG Leaders, in CHF	13.60%
MSCI AC World Small Cap, in CHF	2.55%
MSCI Emerging Markets, in CHF	0.85%
KGAST Immo-Index	11.00%
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	80.94%
USD	11.42%
EUR	1.37%
JPY	1.12%
Altri	5.15%

Qualità degli investimenti a reddito fisso

Modified Duration	5.50
Rating medio	A