

30 aprile 2024

Fondazione d'investimento Swiss Life

LPP-Mix 45 P

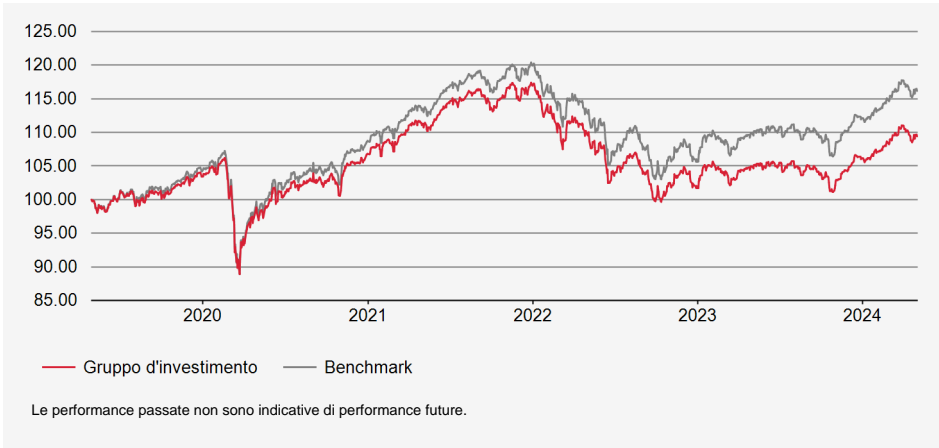


Patrimonio netto (NAV) in mio. CHF: 726.64
Valore d'inventario netto per diritto in CHF: 193.69

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)



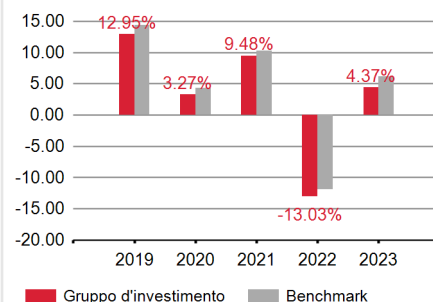
Performance nella valuta di riferimento

| | Performance cumulata | | | | Performance annualizzata | | | |
|-----------------------|----------------------|--------|--------|--------|--------------------------|--------|---------|--------|
| | YTD | 1 mese | 3 mesi | 1 anno | 3 anni | 5 anni | 10 anni | Inizio |
| Gruppo d'investimento | 3.07% | -1.45% | 2.30% | 4.24% | -0.51% | 1.81% | 2.79% | 3.11% |
| Benchmark | 3.59% | -1.32% | 2.75% | 5.72% | 0.84% | 3.04% | 4.16% | 4.63% |

Dati statistici (annualizzati)

| | 1 anno | 3 anni | 5 anni | 10 anni | Inizio |
|---|--------|--------|--------|---------|--------|
| Volatilità Gruppo d'investimento (in %) | 5.28 | 6.89 | 7.26 | 6.42 | 6.39 |
| Volatilità del Benchmark (in %) | 5.45 | 7.20 | 7.57 | 6.48 | 6.38 |
| Tracking Error ex post (in %) | 0.31 | 0.56 | 0.58 | 0.59 | 0.69 |
| Information Ratio | -4.71 | -2.41 | -2.13 | -2.34 | -2.24 |
| Sharpe Ratio | 0.48 | -0.14 | 0.25 | 0.48 | 0.45 |
| Correlazione | 1.00 | 1.00 | 1.00 | 1.00 | 0.99 |
| Beta | 0.97 | 0.96 | 0.96 | 0.99 | 1.00 |
| Jensen alfa | -1.34 | -1.33 | -1.09 | -1.31 | -1.51 |
| Maximum Drawdown (in %) | -4.33 | -15.10 | -16.28 | -16.28 | -29.17 |
| Recovery Period (anni) | 0.13 | - | 0.74 | 0.74 | 3.98 |

Performance



Informazioni sul prodotto

Numero di valore: 1436925
ISIN: CH0014369257
LEI: 2549001XL79VZWJO5Q69
Codice Bloomberg: SLVOR45 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: 1.42%
ex post al: 30/09/2023 1.43%

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 | 4.51% | 2.00% | - |
| Ipoteche Svizzera | 0.54% | - | - |
| Obbligazioni CHF Svizzera | 10.96% | 12.00% | - |
| Obbligazioni CHF Estero | 4.94% | 5.00% | - |
| Obbligazioni valute estere (CHF hedged) | 19.28% | 20.00% | - |
| Azioni Svizzera | 22.56% | 23.00% | - |
| Azioni Estero | 22.16% | 22.00% | - |
| Azioni Estero (CHF hedged) | 0.58% | - | - |
| Immobili Svizzera | 10.46% | 9.00% | 30.00% |
| Immobili estero (CHF hedged) | 1.72% | 2.00% | 10.00% |
| Investimenti alternativi (CHF hedged) | 2.27% | 5.00% | 15.00% |
| Totale azioni (Svizzera ed Estero) | 45.30% | 45.00% | 50.00% |
| Totale valute estere | 22.16% | 22.00% | 30.00% |

Maggiori posizioni azionarie

| | |
|------------------------------|-------|
| NESTLE SA-REG | 3.65% |
| NOVARTIS AG-REG | 2.71% |
| ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN | 2.30% |
| MICROSOFT CORP. | 1.55% |
| NVIDIA CORP | 1.20% |
| UBS GROUP AG-REG | 1.16% |
| ABB LTD-REG | 1.08% |
| CIE FINANCIERE RICHEMONT-REG | 1.02% |
| ALPHABET INC | 1.02% |
| ZURICH INSURANCE GROUP AG | 0.96% |

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% |
| Swiss Performance Index | 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 | 75.57% |
| USD | 14.96% |
| EUR | 1.79% |
| JPY | 1.46% |
| Altri | 6.21% |

Qualità degli investimenti a reddito fisso

| | |
|-------------------|------|
| Modified Duration | 5.55 |
| Rating medio | A |