

Fondazione d'investimento Swiss Life

LPP-Mix 25 P

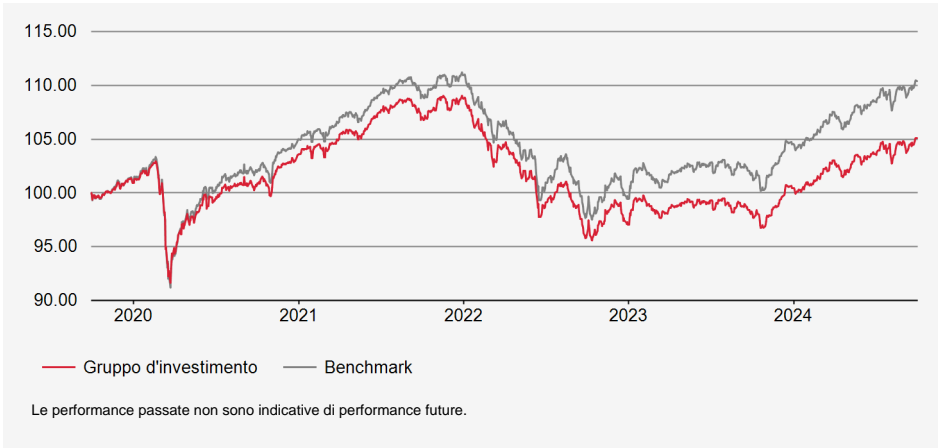


Patrimonio netto (NAV) in mio. CHF: 703.90
Valore d'inventario netto per diritto in CHF: 169.99

Strategia d'investimento

Il gruppo d'investimento LPP-Mix 25 P investe in media ca. il 25% 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 53% del patrimonio viene investito in obbligazioni. Sono posti i seguenti limiti massimi: 35% azioni, 30% valute estere. LPP-Mix 25 P è adatta per investitori disposti ad assumersi oscillazioni dei corsi. Raccomandiamo di optare per una durata dell'investimento superiore a cinque anni.

Evoluzione del valore nella valuta di riferimento (base 100)



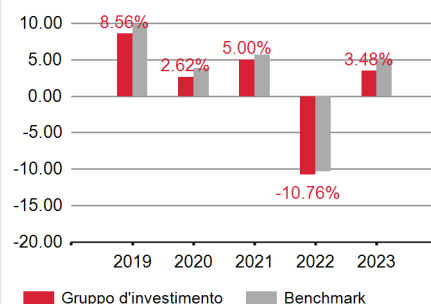
Performance nella valuta di riferimento

	Performance cumulata True				Performance annualizzata			
	YTD	1 mese	3 mesi	1 anno	3 anni	5 anni	10 anni	Inizio
Gruppo d'investimento	4.63%	0.28%	1.42%	6.95%	-0.61%	1.00%	1.70%	2.44%
Benchmark	5.58%	0.49%	1.73%	8.39%	0.40%	1.99%	2.89%	3.76%

Dati statistici (annualizzati)

	1 anno	3 anni	5 anni	10 anni	Inizio
Volatilità Gruppo d'investimento (in %)	3.31	4.81	5.10	4.28	4.09
Volatilità del Benchmark (in %)	3.60	5.24	5.46	4.42	4.10
Tracking Error ex post (in %)	0.42	0.59	0.55	0.52	0.59
Information Ratio	-3.45	-1.72	-1.80	-2.29	-2.26
Sharpe Ratio	1.58	-0.27	0.17	0.46	0.55
Correlazione	1.00	1.00	1.00	0.99	0.99
Beta	0.92	0.91	0.93	0.96	0.99
Jensen alfa	-0.86	-1.03	-0.87	-1.07	-1.28
Maximum Drawdown (in %)	-1.93	-12.33	-12.33	-12.33	-15.36
Recovery Period (anni)	0.07	-	-	-	1.67

Performance



Informazioni sul prodotto

Numero di valore: 1436904
ISIN: CH0014369042
LEI: 5493000KUC3Z24U77V93
Codice Bloomberg: SLVOR25 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: 12.00
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: 1.39%
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.

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	1.96%	2.00%	-
Ipotecche Svizzera	0.89%	-	-
Obbligazioni CHF Svizzera	15.00%	16.00%	-
Obbligazioni CHF Estero	9.07%	9.00%	-
Obbligazioni valute estere (CHF hedged)	26.85%	28.00%	-
Azioni Svizzera	13.23%	13.00%	-
Azioni Estero	12.02%	12.00%	-
Azioni Estero (CHF hedged)	-	-	-
Immobili Svizzera	15.28%	13.00%	30.00%
Immobili estero (CHF hedged)	3.22%	2.00%	10.00%
Investimenti alternativi (CHF hedged)	2.47%	5.00%	15.00%
Totale azioni (Svizzera ed Estero)	25.25%	25.00%	50.00%
Totale valute estere	12.02%	12.00%	30.00%

Maggiori posizioni azionarie

NESTLE SA-REG	1.82%
NOVARTIS AG-REG	1.63%
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	1.56%
MICROSOFT CORP	0.71%
NVIDIA CORP	0.70%
UBS GROUP AG-REG	0.69%
ABB LTD-REG	0.64%
ZURICH INSURANCE GROUP AG	0.61%
CIE FINANCIERE RICHEMO-A REG	0.59%
ALPHABET INC	0.42%

Composizione del benchmark

1M SARON	2.00%
SBI Domestic AAA-BBB	16.00%
SBI Foreign AAA-BBB	9.00%
Bloomberg Gl. Agg. Treas. ex CH TR (CHF hedged)	4.00%
Bloomberg Gl. Agg. Corp. TR (CHF hedged)	9.00%
Bloomberg Gl. Agg. Corp. Short Term TR (CHF hedged)	9.00%
JP Morgan CEMBI Broad Div IG Index (CHF hedged)	6.00%
Swiss Performance Index	13.00%
MSCI World ex CH ESG Leaders, in CHF	9.60%
MSCI AC World Small Cap, in CHF	1.80%
MSCI Emerging Markets, in CHF	0.60%
KGAST Immo-Index	13.00%
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	87.98%
USD	8.16%
EUR	0.89%
JPY	0.76%
Altri	2.21%

Qualità degli investimenti a reddito fisso

Modified Duration	5.82
Rating medio	A