

# Fondazione d'investimento Swiss Life

## LPP-Mix 35 P

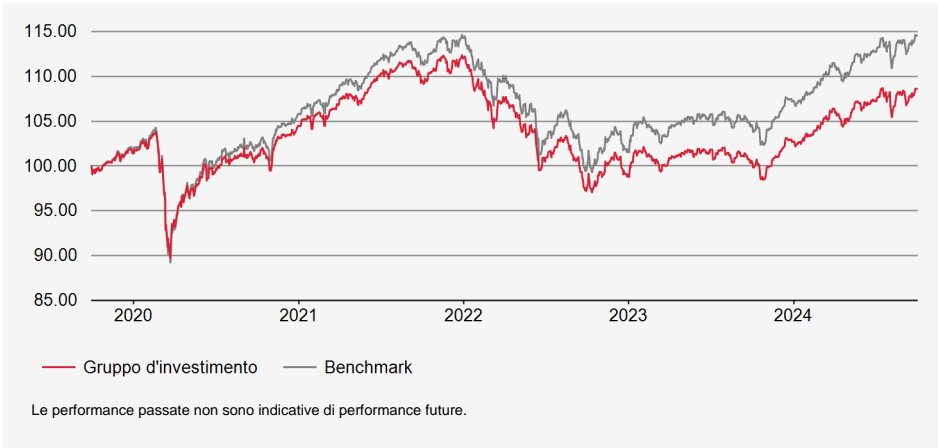


**Patrimonio netto (NAV) in mio. CHF: 403.62**  
**Valore d'inventario netto per diritto in CHF: 185.60**

### 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)



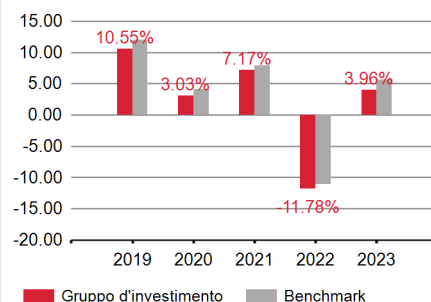
### Performance nella valuta di riferimento

	Performance cumulata True				Performance annualizzata			
	YTD	1 mese	3 mesi	1 anno	3 anni	5 anni	10 anni	Inizio
Gruppo d'investimento	5.71%	0.18%	1.26%	7.98%	-0.29%	1.66%	2.26%	2.85%
Benchmark	6.76%	0.42%	1.58%	9.49%	0.86%	2.75%	3.53%	4.26%

### Dati statistici (annualizzati)

	1 anno	3 anni	5 anni	10 anni	Inizio
Volatilità Gruppo d'investimento (in %)	4.11	5.72	6.06	5.27	5.16
Volatilità del Benchmark (in %)	4.35	6.11	6.46	5.40	5.16
Tracking Error ex post (in %)	0.37	0.58	0.60	0.58	0.66
Information Ratio	-4.05	-1.98	-1.80	-2.19	-2.16
Sharpe Ratio	1.50	-0.17	0.25	0.48	0.51
Correlazione	1.00	1.00	1.00	0.99	0.99
Beta	0.94	0.93	0.94	0.97	0.99
Jensen alfa	-1.06	-1.14	-0.92	-1.15	-1.38
Maximum Drawdown (in %)	-2.97	-13.60	-13.60	-13.60	-22.51
Recovery Period (anni)	-	-	-	-	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:** 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](http://www.swisslife.ch/fondazioneinvestimento)  
**Quote spese operative TER KGAST ex ante:** 1.40%  
**ex post al:** 30/09/2024 1.40%

**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	3.26%	2.00%	-
Ipotecche Svizzera	0.60%	-	-
Obbligazioni CHF Svizzera	13.10%	14.00%	-
Obbligazioni CHF Estero	7.13%	7.00%	-
Obbligazioni valute estere (CHF hedged)	24.95%	24.00%	-
Azioni Svizzera	17.88%	18.00%	-
Azioni Estero	16.98%	17.00%	-
Azioni Estero (CHF hedged)	-	-	-
Immobili Svizzera	11.74%	11.00%	30.00%
Immobili estero (CHF hedged)	2.06%	2.00%	10.00%
Investimenti alternativi (CHF hedged)	2.29%	5.00%	15.00%
Totale azioni (Svizzera ed Estero)	34.87%	35.00%	50.00%
Totale valute estere	16.98%	17.00%	30.00%

## Maggiori posizioni azionarie

NESTLE SA-REG	2.46%
NOVARTIS AG-REG	2.20%
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	2.10%
MICROSOFT CORP	1.00%
NVIDIA CORP	0.98%
UBS GROUP AG-REG	0.93%
ABB LTD-REG	0.87%
ZURICH INSURANCE GROUP AG	0.83%
CIE FINANCIERE RICHEMO-A REG	0.80%
ALPHABET INC	0.60%

## 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	83.02%
USD	11.53%
EUR	1.26%
JPY	1.07%
Altri	3.12%

## Qualità degli investimenti a reddito fisso

Modified Duration	5.68
Rating medio	A