

# Fondazione d'investimento Swiss Life

## LPP-Mix 35 P



### 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.

### Informazioni sul prodotto

Numero di valore	1436916
ISIN	CH0014369166
LEI	254900SR5GM6HP44F130
Bloomberg Ticker	SLVOR35 SW
Benchmark	customized
Moneta	CHF
Data di lancio	30.09.2002
Prezzo di prima emissione	100.00
Chiusura d'esercizio	30.09.
Emissione/Riscatto	giornalmente
Termine di accettazione	14.00

#### 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<sub>KGAST</sub> \*\*

- ex ante	1.42%
- ex post al 30.09.2019	1.43%

Commissione d'emissione/riscatto nessuna

Prassi di distribuzione accumulazione

\* 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

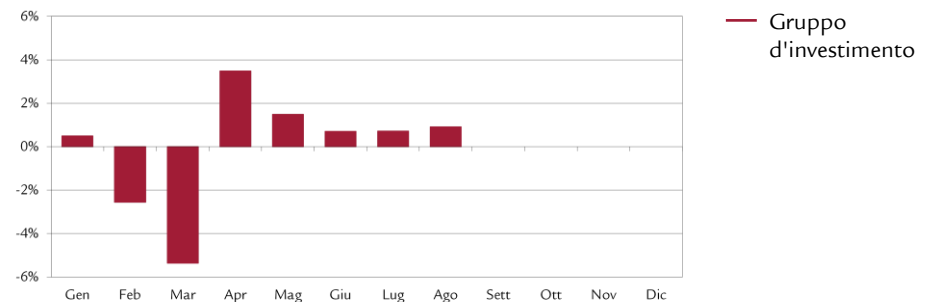
\*\* La quota spese operative TER<sub>KGAST</sub> copre tutti i costi, eccezione fatta per i costi di transazione e i tributi fiscali legati alla transazione

### Evoluzione del valore indicizzata e performance



Performance	1M	3M	1A	3A	5A	10A	p.a. dal 30.09.02
Gruppo d'investimento (in %)	0.92	2.36	1.41	7.16	15.09	45.81	72.73
	YTD	2019	2018	2017	2016	2015	2014
Gruppo d'investimento (in %)	-0.37	10.55	-5.00	6.90	2.04	0.09	8.11

### Performance mensile 2020



### Dati statistici (annualizzati)

	1A	3A	5A	10A	dal 30.09.02
Volatilità Gruppo d'investimento (in %)	7.60	5.47	4.83	4.49	5.04
Volatilità Benchmark (in %)	8.39	5.81	4.99	4.42	4.97
Tracking Error ex post (in %)	0.89	0.63	0.58	0.55	0.66
Tracking Error ex ante (in %)	0.60				
Information Ratio	-1.09	-2.38	-2.23	-2.08	-2.23
Sharpe Ratio	0.28	0.55	0.73	0.93	0.55
Correlazione	1.00	1.00	0.99	0.99	0.99
Beta	0.91	0.94	0.96	1.01	1.01
Jensen-Alpha	-0.66	-1.18	-1.06	-1.14	-1.45
Maximum Drawdown (in %)	-13.47	-13.47	-13.47	-13.47	-22.51
Recovery Period (anni)	-	-	-	-	3.44

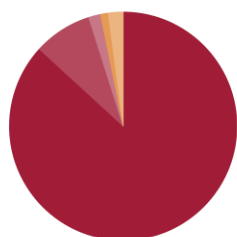
### Cifre salienti (in CHF)

	31.12.2019	31.08.2020
Patrimonio in milioni CHF	214.2	227.0
Valore d'inventario netto per quota in CHF	173.37	172.73

### Struttura del portafoglio per gruppo d'investimento

	Gruppo d'investimento	Benchmark	max. OPP2
Liquidità	1.8%	2%	
Obbligazioni CHF Svizzera	9.0%	14%	
Obbligazioni CHF Estero	4.4%	7%	
Obbligazioni valute estere (CHF hedged)	30.2%	24%	
Azioni Svizzera	17.4%	18%	
Azioni Estero	13.2%	17%	
Azioni Estero (CHF hedged)	7.9%	0%	
Immobili Svizzera	11.8%	11%	30%
Immobili estero (CHF hedged)	2.1%	2%	10%
Investimenti alternativi (CHF hedged)	2.2%	5%	15%
<b>Totale</b>	<b>100.0%</b>	<b>100%</b>	
<hr/>			
Totale azioni (Svizzera ed Estero)	38.5%	35%	50%
Totale valute estere	13.2%	17%	30%

### Struttura del portafoglio secondo le valute



CHF	86.8%
USD	8.3%
EUR	1.7%
JPY	1.1%
Altri	2.1%

### Maggiori posizioni azionarie

Nestlé	3.8%
Roche BG	2.6%
Novartis	2.3%
Apple Inc.	0.7%
Zurich Insurance Group	0.6%
Microsoft Corp.	0.5%
Lonza Group AG	0.5%
ABB	0.5%
UBS	0.5%
Amazon.com, Inc.	0.5%

### Qualità degli investimenti a reddito fisso

Duration modificata	6.01
Rating media	A

#### Disclaimer

La presente pubblicazione non rappresenta né un invito, né una raccomandazione ad acquistare o vendere strumenti d'investimento, ma funge meramente da veicolo informativo. È possibile richiedere gratuitamente tutti i documenti che costituiscono la base giuridica di un eventuale investimento presso la Fondazione d'investimento Swiss Life, casella postale, 8022 Zurigo, telefono 043 284 79 79, la Fondazione di libero passaggio Swiss Life, p.A. Swiss Life SA, Service Center LPZ, casella postale, 8022 Zurigo, telefono 0800 378 378 o la Fondazione previdenza 3a Swiss Life, p.A. Swiss Life SA, casella postale, 8022 Zurigo, telefono 0800 378 378. La cerchia degli investitori è limitata alle istituzioni del secondo pilastro e del pilastro 3a, non-ché istituzioni esonerate dall'obbligo tributario, con sede in Svizzera e che secondo l'oggetto sociale perseguono la previdenza professionale e persone che gestiscono investimenti collettivi per queste istituzioni, sono sorvegliate dall'Autorità federale di vigilanza sui mercati finanziari e che investono presso la fondazione esclusivamente capitali per queste istituzioni.

La performance precedente non rappresenta un indicatore né per l'evoluzione attuale, né per quella futura. I dati relativi alla performance non prendono in considerazione le commissioni e le spese riscosse al momento dell'emissione e del riscatto delle quote.