

# Fondazione d'investimento Swiss Life

## Azioni Global Protect Flex (CHF hedged)



### Strategia d'investimento

- Strategia azionaria attiva basata su regole con strategia di copertura complementare
- L'universo d'investimento del gruppo d'investimento è composto da società dei maggiori indici borsistici stranieri (in particolare S&P 500, Euro Stoxx 50, FTSE 100 e Nikkei 225) nonché l'SMI; ponderato per la capitalizzazione di mercato o a uno schema di ponderazione alternativo (p.es. processo di riequilibrio o minimo di volatilità)
- I rischi valutari vengono coperti al 90 % almeno contro il franco
- Gli investimenti possono essere effettuati sotto forma di titoli di partecipazione, investimenti collettivi o strumenti derivati
- L'impiego complementare di una strategia di copertura composta da opzioni determina, in caso di forte ribasso dei mercati, una riduzione delle perdite sulle quotazioni e, in caso di forte rialzo dei mercati, una limitazione del potenziale di crescita ("put spread collar")
- A seconda della valutazione del mercato è possibile rinunciare alla vendita dell'opzione put e/o dell'opzione call
- Realizzazione tramite Swiss Life Funds (CH) Equity Global Protect Enhanced (CHF hedged)

### Informazioni sul prodotto

Numero di valore	31952442
ISIN	CH0319524424
LEI	254900LUAQC3MC0MWL48
Bloomberg Ticker	SLAGPCH SW
Benchmark	-
Moneta	CHF
Data di lancio	29.04.2016
Prezzo di prima emissione	100.00
Chiusura d'esercizio	30.09.
Emissione/Riscatto	täglich
Termine di accettazione	14.30
Asset Manager	Swiss Life Asset Management SA
Publicazioni di corsi	Bloomberg: ASSL <a href="http://www.swisslife.ch/fondazioneinvestimento">www.swisslife.ch/fondazioneinvestimento</a>
Quote spese operative TER <sub>KGAST</sub> *	
- ex ante	0.60%
- ex post all 30.09.2019	0.60%
Commissione d'emissione/riscatto	nessuna
Prassi di distribuzione	accumulazione

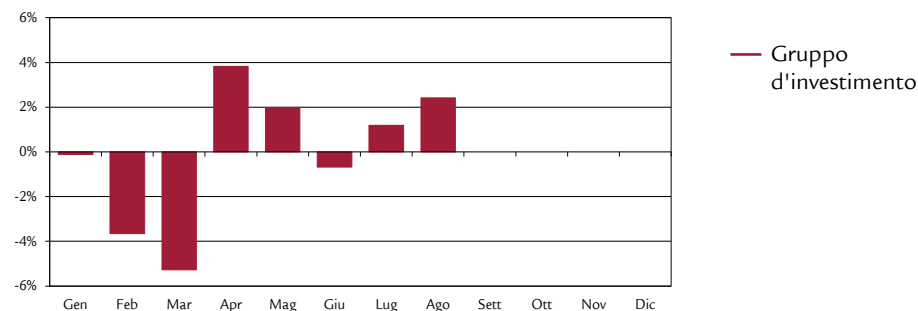
\* La quota spese operative TER<sub>KGAST</sub> copre tutti i costi, eccezione fatta per i costi di transazione e i tributi fiscali legati alla transazione

### Evoluzione del valore indicizzata e performance



Performance	1M	3M	1A	3A	5A	p.a. dal
				p.a.	p.a.	29.04.16
Gruppo d'investimento (in %)	2.42	2.94	3.67	2.82		3.83
	YTD	2019	2018	2017	2016	2015
Gruppo d'investimento (in %)	-0.65	12.04	-6.75	10.68		

### Performance mensile



### Dati statistici (annualizzati)

	1A	3A	5A	dal
				29.04.16
Volatilità Gruppo d'investimento (in %)	8.82	7.59		6.66
Sharpe Ratio	0.49	0.46		0.67
Maximum Drawdown (in %)	-15.99	-15.99		-15.99
Recovery Period (anni)	-	-		-

### Cifre salienti (in CHF)

	31.12.2019	31.08.2020
Patrimonio in milioni CHF	865.4	994.1
Valore d'inventario netto per quota in CHF	118.47	117.70

31 agosto 2020

# Fondazione d'investimento Swiss Life Azioni Global Protect Flex (CHF hedged)



---

## Maggiori posizioni azionarie

---

	Gruppo d'investimento
Alphabet Inc-Cl C	1.0%
Fast Retailing Co Ltd	0.9%
Home Depot Inc	0.8%
Newmont Corp	0.7%
Eli Lilly & Co	0.7%
Fidelity National Info Serv	0.7%
Microsoft Corp.	0.7%
Ucb SA	0.7%
Salesforce.com Inc	0.6%
Johnson & Johnson	0.6%

### 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, 8022 Zurigo, telefono 043 284 79 79. 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 rimosse al momento dell'emissione e del riscatto delle quote.