

Fondazione d'investimento Swiss Life

Azioni Svizzera Large Caps Indicizzati



Strategia d'investimento

- Investimenti in titoli di partecipazione di società rappresentate allo SPI 20
- Implementazione indicizzata, il benchmark viene interamente riprodotto ("full replication")
- La ponderazione di ogni singola società deve discostarsi al massimo di +/- 0,5 punti percentuali dalla ponderazione del benchmark
- Realizzazione tramite Swiss Life iFunds (CH) Equity Switzerland (CHF); fondo d'investimento di diritto svizzero della categoria "Altri fondi per investimenti tradizionali"

Informazioni sul prodotto

Numero di valore	39561885
ISIN	CH0395618850
LEI	254900P0FZIREAGSUQ60
Bloomberg Ticker	SLASLCI SW
Benchmark	SPI 20@
Moneta	CHF
Data di lancio	01.02.2018
Prezzo di prima emissione	100.00
Chiusura d'esercizio	30.09.
Emissione/Riscatto	giornalmente
Termine di accettazione	14.30
Asset Manager in base al	Swiss Life Best Select Invest Plus® *
	Pictet Asset Management AG

Consulenza esterna
PPCmetrics fornisce i seguenti servizi:
consulenza sulle strutture idonee 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

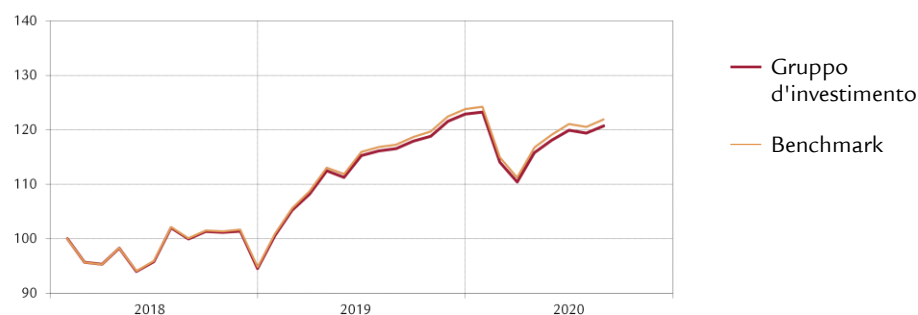
Quote spese operative TER_{KGAST} **
- ex ante 0.35%
- ex post all 30.09.2019 0.35%

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

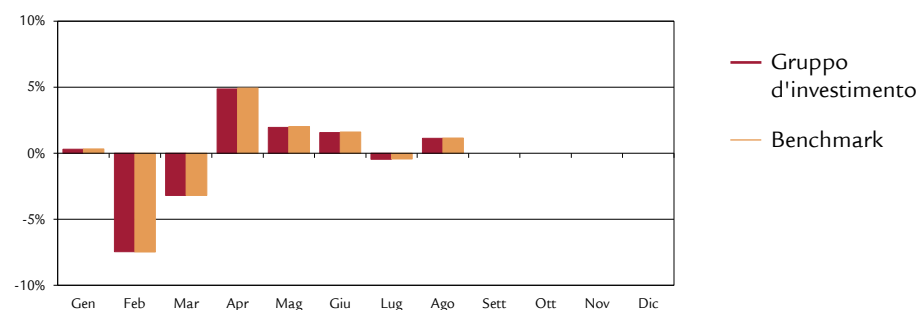
** La quota spese operative TER_{KGAST} copre tutti i costi, eccezione fatta per i costi di transazione e i tributi fiscali legati alla transazione

Evoluzione del valore indicizzata e performance



Performance	1M	3M	1A	3A p.a.	5A p.a.	p.a. dal 01.02.18
Gruppo d'investimento (in %)	1.14	2.26	3.62			7.57
Benchmark (in %)	1.16	2.36	3.99			7.98
	YTD	2019	2018	2017	2016	2015
Gruppo d'investimento (in %)	-1.74	29.99				
Benchmark (in %)	-1.53	30.62				

Performance mensile



Dati statistici (annualizzati)

	1A	3A	5A	dal 01.02.18
Volatilità Gruppo d'investimento (in %)	10.69			11.64
Volatilità Benchmark (in %)	10.76			11.77
Tracking Error ex post (in %)	0.08			0.32
Tracking Error ex ante (in %)	0.10			
Information Ratio	-4.60			-1.27
Sharpe Ratio	0.40			0.69
Correlazione	1.00			1.00
Beta	0.99			0.99
Jensen-Alpha	-0.32			-0.28
Maximum Drawdown (in %)	-25.04			-25.04
Recovery Period (anni)	-			-

Cifre salienti (in CHF)

	31.12.2019	31.08.2020
Patrimonio in milioni CHF	167.6	176.7
Valore d'inventario netto per quota in CHF	122.88	120.74

Struttura del portafoglio in base al volume dell'impresa¹⁾

	Gruppo d'investimento		Benchmark	
	Particip.	Numero	Particip.	Numero
Grandi imprese	99.2%	19	99.3%	19
Medie imprese	0.7%	1	0.7%	1
Piccole imprese	0.0%	0	-	-
Liquidità	0.1%	-	-	-
Totale	100.0%	20	100.0%	20

¹⁾ prendendo in considerazione i derivati e gli investimenti collettivi

Struttura del portafoglio per settore²⁾

	Gruppo d'investimento	Benchmark
Salute	41.3%	41.3%
Generi di consumo	30.8%	30.9%
Financials	12.5%	12.5%
Industrie	11.6%	11.6%
Materiali di base	2.6%	2.6%
Telecomunicazioni	1.1%	1.1%
Petrolio e gas	0.0%	0.0%
Servizi per il consumatore	0.0%	0.0%
Servizi di pubblica utilità	0.0%	0.0%
Tecnologia	0.0%	0.0%
Liquidità	0.1%	-
Totale	100.0%	100.0%

²⁾ prendendo in considerazione i derivati e gli investimenti collettivi

Le prime posizioni³⁾

	Gruppo d'investimento	Benchmark
Nestlé	27.7%	27.7%
Roche BG	19.0%	19.0%
Novartis	16.5%	16.5%
Zurich Insurance Group	4.3%	4.3%
Lonza Group AG	3.6%	3.6%
ABB	3.6%	3.6%
UBS	3.4%	3.4%
Cie Fin Richemont	2.7%	2.7%
Sika AG	2.6%	2.6%
Givaudan-Reg	2.6%	2.6%

³⁾ prendendo in considerazione i derivati e gli investimenti collettivi

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 riscosse al momento dell'emissione e del riscatto delle quote.