

Fondazione d'investimento Swiss Life

Azioni Svizzera PM



Strategia d'investimento

- Investimenti in titoli di partecipazione di società rappresentate allo Swiss Performance Index (SPI)
- La copertura per i Large Cap è passiva, gli Small & Mid Caps vengono gestiti attivamente (core satellite)
- Limitazione per società: 5% (eccezione: se rappresentati nel benchmark; max. 5%-punti in più della ponderazione del benchmark)
- Realizzazione tramite Swiss Life iFunds (CH) Equity Switzerland (CHF) e Equity Switzerland Small & Mid Cap (CHF); fondi d'investimento di diritto svizzero della categoria "Altri fondi per investimenti tradizionali"

Informazioni sul prodotto

Numero di valore	3026057
ISIN	CH0030260571
LEI	254900UNZU5YPIKQTQ23
Bloomberg Ticker	SLACHPM SW
Benchmark	Swiss Performance Index
Moneta	CHF
Data di lancio	31.05.2007
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® **	
Large Caps (passivo)	Pictet Asset Management SA
Small&Mid Caps (attivo)	Privatbank Von Graffenried AG
Consulenza esterna	
PPCmetrics fornisce i seguenti servizi:	
consulenza sulle strutture idonee del mandato (core satellite), 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	0.30%
- ex post all 30.09.2019	0.30%
Commissione d'emissione/riscatto	nessuna
Prassi di distribuzione	accumulazione

* L'acquisto di questa tranche è possibile solo nell'ambito di un accordo speciale on Swiss Life Asset Managers

** 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

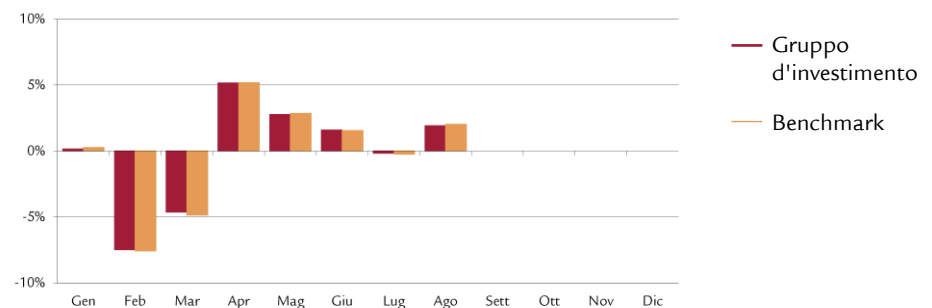
*** La quota spese operative TER_{KGAST} copre tutti i costi, eccezione fatta per i costi di transazione e i tributi fiscali legati alla transazione

Evoluzione del valore indicizzata e performance



Performance	1M	3M	1A	3A	5A	10A	p.a. dal
				p.a.	p.a.	p.a.	31.05.07
Gruppo d'investimento (in %)	1.92	3.35	5.08	7.44	7.04	8.64	3.52
Benchmark (in %)	2.03	3.37	4.96	7.54	7.10	8.76	3.84
	YTD	2019	2018	2017	2016	2015	2014
Gruppo d'investimento (in %)	-1.31	30.25	-8.39	19.30	-1.19	2.30	12.10
Benchmark (in %)	-1.39	30.59	-8.57	19.92	-1.41	2.68	13.00

Performance mensile



Dati statistici (annualizzati)

	1A	3A	5A	10A	dal
					31.05.07
Volatilità Gruppo d'investimento (in %)	11.78	11.11	10.55	10.97	12.72
Volatilità Benchmark (in %)	11.99	11.20	10.64	10.99	12.72
Tracking Error ex post (in %)	0.36	0.31	0.29	0.36	0.73
Tracking Error ex ante (in %)	0.40				
Information Ratio	0.33	-0.33	-0.21	-0.33	-0.44
Sharpe Ratio	0.48	0.71	0.71	0.79	0.27
Correlazione	1.00	1.00	1.00	1.00	1.00
Beta	0.98	0.99	0.99	1.00	1.00
Jensen-Alpha	0.21	-0.03	0.01	-0.09	-0.31
Maximum Drawdown (in %)	-25.86	-25.86	-25.86	-43.05	-54.13
Recovery Period (anni)	-	-	-	1.76	4.83

Cifre salienti (in CHF)

	31.12.2019	31.08.2020
Patrimonio in milioni CHF	273.8	295.1
Valore d'inventario netto per quota in CHF	160.19	158.09

Struttura del portafoglio in base al volume dell'impresa¹⁾

	Gruppo d'investimento		Benchmark	
	Particip.	Numero	Particip.	Numero
Grandi imprese	79.3%	20	79.5%	20
Medie imprese	18.8%	49	18.6%	79
Piccole imprese	0.7%	6	1.9%	114
Liquidità	1.2%	-	-	-
Totale	100.0%	75	100.0%	213

¹⁾ prendendo in considerazione i derivati e gli investimenti collettivi

Struttura del portafoglio per settore²⁾

	Gruppo d'investimento	Benchmark
Salute	35.3%	36.0%
Generi di consumo	26.9%	26.9%
Financials	14.3%	15.9%
Industrie	16.2%	14.5%
Materiali di base	2.6%	2.8%
Telecomunicazioni	1.1%	1.1%
Tecnologia	1.6%	2.1%
Servizi per il consumatore	0.5%	0.6%
Servizi di pubblica utilità	0.3%	0.1%
Petrolio e gas	0.0%	0.0%
Liquidità	1.2%	-
Totale	100.0%	100.0%

²⁾ prendendo in considerazione i derivati e gli investimenti collettivi

Maggiori posizioni azionarie³⁾

	Gruppo d'investimento	Benchmark
Nestlé	22.1%	22.2%
Roche BG	15.2%	15.2%
Novartis	13.2%	13.2%
Zurich Insurance Group	3.4%	3.4%
Lonza Group AG	2.9%	2.9%
ABB	2.8%	2.9%
UBS	2.7%	2.7%
Cie Fin Richemont	2.1%	2.1%
Sika AG	2.1%	2.1%
Givaudan-Reg	2.1%	2.1%

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, nonché 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 che hanno concluso un accordo speciale on Swiss Life Asset Managers.

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.