

# Fondazione d'investimento Swiss Life

## Azioni Svizzera Large Caps Indicizzati PM

### 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	39561886
ISIN	CH0395618868
LEI	254900P0FZIREAGSUQ60
Bloomberg Ticker	SLASLPM SW
Benchmark	SPI 20@
Moneta	CHF
Data di lancio	31.01.2018
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](http://www.swisslife.ch/fondazioneinvestimento)

Quote spese operative TER<sub>KGAST</sub> \*\*\*  
- ex ante 0.20%  
- ex post all 30.09.2019 0.20%

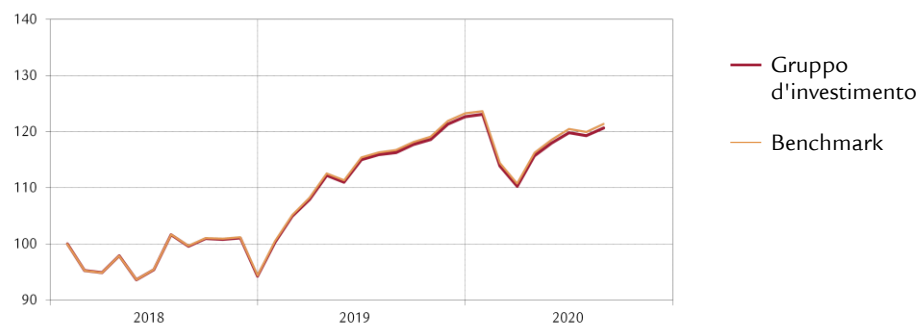
Commissione d'emissione/riscatto nessuna  
Prassi di distribuzione accumulazione

\* 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

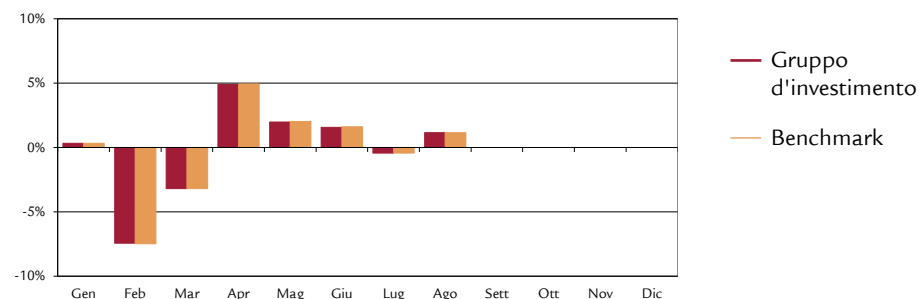
\*\*\* La quota spese operative TER<sub>KGAST</sub> copre tutti i costi, eccezione fatta per i costi di transazione e i tributi fiscali legati alla transazione

### Evoluzione del valore indicizzata e performance



Performance	1M	3M	1A	3A p.a.	5A p.a.	p.a. dal 31.01.18
Gruppo d'investimento (in %)	1.15	2.30	3.78			7.54
Benchmark (in %)	1.16	2.36	3.99			7.79
	YTD	2019	2018	2017	2016	2015
Gruppo d'investimento (in %)	-1.65	30.19				
Benchmark (in %)	-1.53	30.62				

### Performance mensile



### Dati statistici (annualizzati)

	1A	3A	5A	dal 31.01.18
Volatilità Gruppo d'investimento (in %)	10.69			11.71
Volatilità Benchmark (in %)	10.76			11.77
Tracking Error ex post (in %)	0.08			0.08
Tracking Error ex ante (in %)	0.10			
Information Ratio	-2.68			-3.20
Sharpe Ratio	0.41			0.68
Correlazione	1.00			1.00
Beta	0.99			1.00
Jensen-Alpha	-0.17			-0.19
Maximum Drawdown (in %)	-25.03			-25.03
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	122.69	120.67

# Fondazione d'investimento Swiss Life

## Azioni Svizzera Large Caps Indicizzati PM



### Struttura del portafoglio in base al volume dell'impresa<sup>1)</sup>

	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

<sup>1)</sup> prendendo in considerazione i derivati e gli investimenti collettivi

### Struttura del portafoglio per settore<sup>2)</sup>

	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%

<sup>2)</sup> prendendo in considerazione i derivati e gli investimenti collettivi

### Le prime posizioni<sup>3)</sup>

	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%

<sup>3)</sup> 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 con 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.