

### Strategia d'investimento

- Investimenti indicizzati con strategia di copertura complementare, basata su regole
- L'universo d'investimento si compone di società dello Swiss Market Index
- Gli investimenti possono essere effettuati sotto forma di titoli di partecipazione, investimenti collettivi o strumenti derivati
- Limitazione per società: 5% (eccezione: se rappresentati nell'indice; variazione minima dalla ponderazione dell'indice)
- 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")
- I mezzi liquidi, detenuti a causa degli strumenti derivati impiegati, possono essere collocati nel mercato monetario

### Informazioni sul prodotto

Numero di valore	13016963
ISIN	CH0130169631
LEI	549300NN5470DJJMX198
Bloomberg Ticker	SWLASPM SW
Benchmark	-
Moneta	CHF
Data di lancio	30.06.2011
Prezzo di prima emissione	100.00
Chiusura d'esercizio	30.09.
Emissione/Riscatto	giornalmente
Termine di accettazione *	14.30

Asset Manager

Swiss Life Asset Management SA

Pubblicazioni di corsi Bloomberg: ASSL  
www.swisslife.ch/fondazioneinvestimento

Quote spese operative TER <sub>KGAST</sub> **	
- ex ante	0.16%
- 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

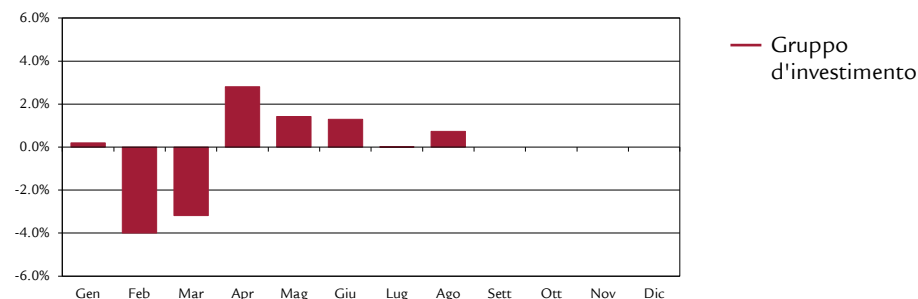
\*\* La quota spese operative TER<sub>KGAST</sub> copre tutti i costi, eccezione fatta per i costi di transazione e i tributi fiscali legati alla transazione

### Evoluzione del valore indicizzata e performance



Performance	1M	3M	1A	3A p.a.	5A p.a.	p.a. dal 30.06.11
Gruppo d'investimento (in %)	0.73	2.04	-0.79	0.46	0.49	2.03
	YTD	2019	2018	2017	2016	2015
Gruppo d'investimento (in %)	-0.91	7.22	-5.63	6.70	-3.83	0.32

### Performance mensile



### Dati statistici (annualizzati)

	1A	3A	5A	p.a. dal 30.06.11
Volatilità Gruppo d'investimento (in %)	6.47	6.04	5.69	5.51
Sharpe Ratio	-0.01	0.20	0.22	0.44
Maximum Drawdown (in %)	-17.28	-17.28	-17.28	-17.28
Recovery Period (anni)	-	-	-	-

### Cifre salienti

	31.12.2019	31.08.2020
Patrimonio in milioni CHF	180.5	81.3
Valore d'inventario netto per quota in CHF	121.34	120.24

31 agosto 2020

# Fondazione d'investimento Swiss Life

## Azioni Svizzera Protect PM



### Dettagli sul valore della strategia di copertura

	Gruppo d'investimento
Long put su SMI a 9'813.27	3.11%
Short put su SMI a 8'263.70	-0.75%
Short call su SMI a 10'933.54	-0.78%
Totale	1.58%

### Struttura del portafoglio

	Gruppo d'investimento
SMI (esposizione in futures sintetici)	99.1%
Strategia di copertura (put spread collar)	1.6%
Liquidità	-0.7%
Totale	100.0%

### Dettagli sull'investimento dei mezzi liquidi

	Gruppo d'investimento
Fondi monetari	27.5%
Averi in banche, in Posta, conto margini presso banche	72.5%
Totale	100.0%

#### 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.