

# Fondazione d'investimento Swiss Life

## Azioni Global Protect Flex (CHF hedged)

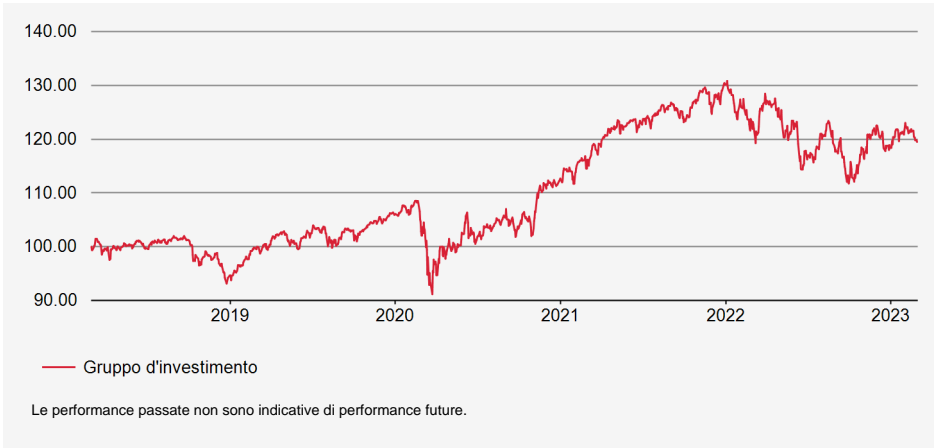


**Patrimonio netto (NAV) in mio. CHF: 1,357.95**  
**Valore d'inventario netto per diritto in CHF: 133.44**

### 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 SLF (CH) Equity Global Protect Enhanced (CHF hedged).

### Evoluzione del valore nella valuta di riferimento (base 100)



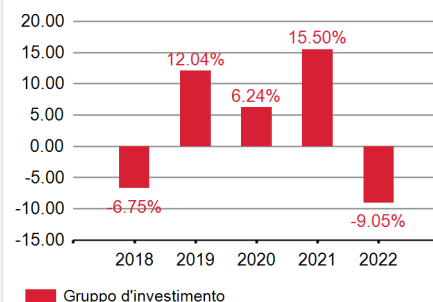
### Performance nella valuta di riferimento

	PERFORMANCE CUMULATA				PERFORMANCE ANNUALIZZATA			
	YTD	1 MESE	3 MESI	1 ANNO	3 ANNI	5 ANNI	10 ANNI	INIZIO
<b>GRUPPO D'INVESTIMENTO</b>	0.93%	-1.78%	-2.45%	-2.99%	5.38%	3.62%	-	4.31%

### Dati statistici (annualizzati)

	1 ANNO	3 ANNI	5 ANNI	10 ANNI	INIZIO
Volatilità Gruppo d'investimento (in %)	13.08	11.10	9.60	-	8.54
Sharpe Ratio	-0.23	0.51	0.43	-	0.56

### Performance



### Informazioni sul prodotto

**Numero di valore:** 31952442  
**ISIN:** CH0319524424  
**LEI:** 254900LUAQC3MC0MWL48  
**Codice Bloomberg:** SLAGPCH SW  
**Moneta:** CHF  
**Domicilio:** Svizzera  
**Data di creazione:** 29/04/2016  
**Prezzo di prima emissione:** 100.00  
**Chiusura d'esercizio:** 30.09  
**Emissione/Riscatto:** giornalmente  
**Termine d'accettazione:** 14.30  
**Commissione d'emissione/riscatto:** nessuna  
**Prassi di distribuzione:** Capitalizzazione  
**Asset Manager in base al:** Swiss Life Asset Management SA  
**Pubblicazioni di corsi:** Bloomberg: ASSL  
[www.swisslife.ch/fondazioneinvestimento](http://www.swisslife.ch/fondazioneinvestimento)  
**Quote spese operative TER KGAST ex ante:** 0.60%  
**ex post al:** 30/09/2022 0.60%

**Quote spese operative TER KGAST:** La quota spese operative TER KGAST copre tutti i costi, eccezione fatta per i costi di transazione e i tributi fiscali legati alla transazione.

**Performance:** Rendimento complessivo per un determinato periodo di osservazione, sulla base di tassi di rendimento ponderati per il periodo di riferimento.

**Dati statistici:** Le cifre salienti relative al rischio si basano su tassi di rendimento ponderati per il periodo di riferimento logaritmicizzati mensili.

**Tracking error ex ante:** Il tracking error previsto per i prossimi 12 mesi corrisponde al Tracking error ex post degli ultimi 3 anni.

# Fondazione d'investimento Swiss Life

## Azioni Global Protect Flex (CHF hedged)



### Struttura del portafoglio per settore

	Gruppo d'investimento
TECNOLOGIA DELL'INFORMAZIONE	14.01%
SALUTE	13.81%
INDUSTRIE	11.49%
FINANZA	11.02%
BENI DI PRIMA NECESSITÀ	8.78%
BENI VOLUTTUARI	8.58%
FUTURE SU INDICE AZIONARIO	6.91%
SERVIZI DI COMUNICAZIONE	6.10%
SERVIZI DI PUBBLICA UTILITÀ	5.71%
MATERIALI	4.84%
IMMOBILI	2.80%
ENERGIA	2.09%
LIQUIDITÀ / PRESTITO	3.86%

### Le principali posizioni

	Gruppo d'investimento
FAST RETAILING CO LTD	0.58%
DUKE ENERGY CORP	0.56%
VERIZON COMMUNICATIONS INC	0.53%
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	0.53%
PAYCHEX INC	0.53%
GILEAD SCIENCES INC	0.51%
WASTE CONNECTIONS INC	0.48%
TEXAS INSTRUMENTS INC	0.48%
REPUBLIC SERVICES INC	0.47%
WASTE MANAGEMENT INC	0.46%

### Struttura del portafoglio secondo il paese/regione

	Gruppo d'investimento
USA E CANADA	57.85%
REGIONE EUROPEA (EUR)	16.36%
REGIONE EUROPEA (EX EUR)	9.07%
FUTURE SU INDICE AZIONARIO	6.91%
REGIONE ASIA E PACIFICO	5.83%
MERCATI EMERGENTI IN AMERICA	0.14%
LIQUIDITÀ / PRESTITO	3.86%