

Fondazione d'investimento Swiss Life

Azioni Svizzera Large Caps Indicizzate

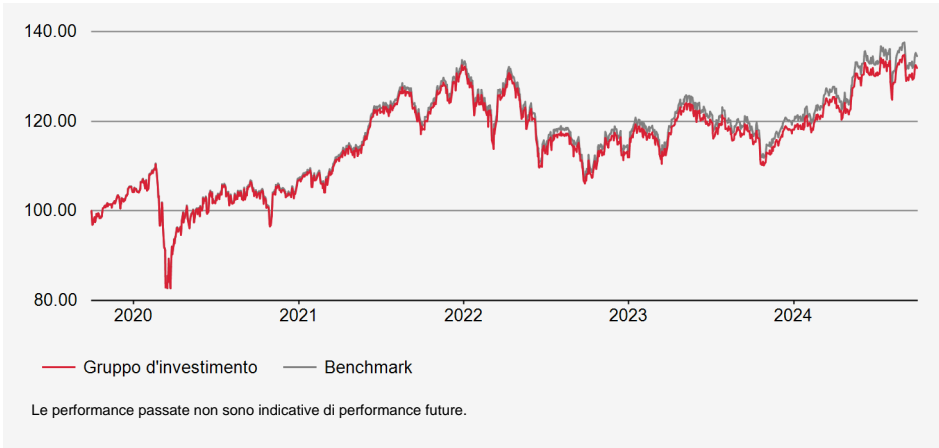


Patrimonio netto (NAV) in mio. CHF: 517.66
Valore d'inventario netto per diritto in CHF: 155.50

Strategia d'investimento

Il gruppo d'investimento viene gestito con un approccio indicizzato e si contraddistingue per l'ampia diversificazione e il tracking error minimo. L'obiettivo d'investimento consiste nel replicare il benchmark SPI® 20 Total Return. Realizzazione tramite Swiss Life Index Funds (CH) Equity Switzerland Large Cap; Fondi d'investimento di diritto svizzero della categoria "altri fondi per investimenti tradizionali".

Evoluzione del valore nella valuta di riferimento (base 100)



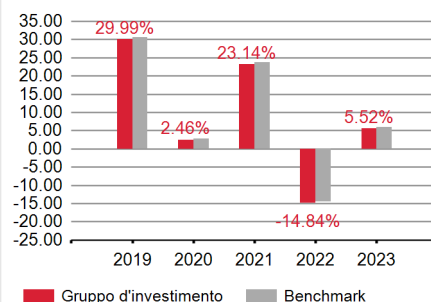
Performance nella valuta di riferimento

	Performance cumulata True				Performance annualizzata			
	YTD	1 mese	3 mesi	1 anno	3 anni	5 anni	10 anni	Inizio
Gruppo d'investimento	11.61%	-2.08%	1.36%	12.70%	3.53%	5.68%	-	6.85%
Benchmark	12.02%	-2.12%	1.42%	13.22%	3.95%	6.10%	-	7.27%

Dati statistici (annualizzati)

	1 anno	3 anni	5 anni	10 anni	Inizio
Volatilità Gruppo d'investimento (in %)	11.36	12.34	12.48	-	12.32
Volatilità del Benchmark (in %)	11.47	12.39	12.54	-	12.37
Tracking Error ex post (in %)	0.14	0.09	0.08	-	0.08
Information Ratio	-3.72	-4.62	-5.00	-	-5.21
Sharpe Ratio	0.92	0.22	0.43	-	0.55
Correlazione	1.00	1.00	1.00	-	1.00
Beta	0.99	1.00	1.00	-	1.00
Jensen alfa	-0.41	-0.40	-0.39	-	-0.39
Maximum Drawdown (in %)	-6.92	-19.89	-25.04	-	-25.04
Recovery Period (anni)	0.06	1.69	1.00	-	1.00

Performance



Informazioni sul prodotto

Numero di valore: 39561885

ISIN: CH0395618850

LEI: 254900P0FZIREAGSUQ60

Codice Bloomberg: SLASLCI SW

Benchmark: SPI® 20 Total Return

Moneta: CHF

Domicilio: Svizzera

Data di creazione: 01/02/2018

Prezzo di prima emissione: 100.00

Chiusura d'esercizio: 30.09

Emissione/Riscatto: giornalmente

Termine d'accettazione: 13.00

Commissione d'emissione / riscatto: nessuna

Prassi di distribuzione: Capitalizzazione

Asset Manager in base al

Swiss Life Best Select Invest Plus®:
Swiss Life Asset Management AG

Consulenza esterna:

PPCmetrics fornisce i seguenti servizi: consulenza sulla struttura idonea 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: 0.17%

ex post al: 30/09/2024 0.17%

Asset Manager: 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.

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.

Fondazione d'investimento Swiss Life

Azioni Svizzera Large Caps Indicizzate



Struttura del portafoglio per settore

	Gruppo d'investimento	Benchmark
Salute	37.73%	37.74%
Finanza	18.86%	18.87%
Beni di prima necessità	17.34%	17.34%
Materiali	9.86%	9.86%
Industrie	8.52%	8.52%
Beni voluttuari	5.60%	5.60%
Servizi di comunicazione	1.09%	1.09%
Tecnologia dell'informazione	0.97%	0.97%
Liquidità / Prestito	0.04%	-

Le principali posizioni

	Gruppo d'investimento	Benchmark
NESTLE SA-REG	17.34%	17.34%
NOVARTIS AG-REG	15.47%	15.48%
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	14.81%	14.81%
UBS GROUP AG-REG	6.56%	6.56%
ABB LTD-REG	6.09%	6.09%
ZURICH INSURANCE GROUP AG	5.81%	5.81%
CIE FINANCIERE RICHEMO-A REG	5.60%	5.60%
SIKA AG-REG	3.50%	3.50%
HOLCIM LTD	3.48%	3.49%
ALCON INC	3.28%	3.28%

Nota legale: 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, c/o Swiss Life SA, casella postale 8022 Zurigo, telefono 043 547 71 11 e su www.swisslife.ch/aniagesstiftung. 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 FINMA 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. L'utilizzo non implica alcuna affiliazione con o sponsorizzazione da parte di quest'ultimi. **Fonte:** Swiss Life Asset Managers. Tutti i diritti riservati.