

Fondazione d'investimento Swiss Life

Azioni Svizzera Protect Flex

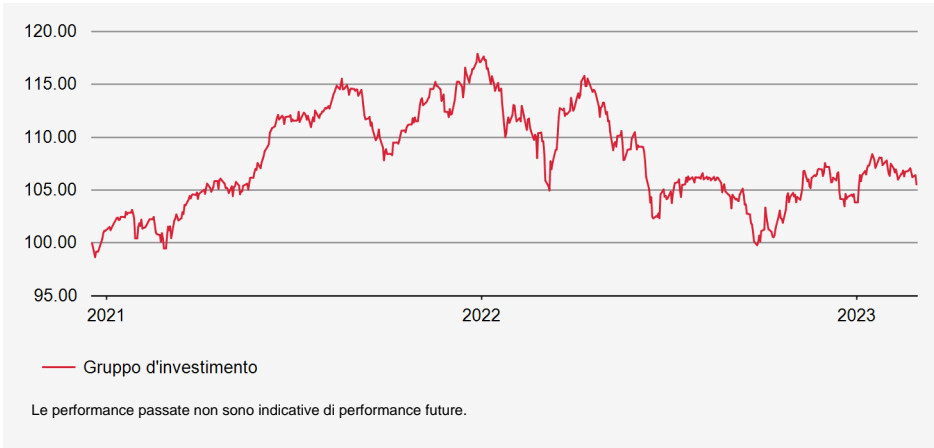


Patrimonio netto (NAV) in mio. CHF: 162.22
Valore d'inventario netto per diritto in CHF: 105.53

Strategia d'investimento

Strategia d'investimento indicizzata SMI con strategia di copertura delle opzioni a gestione attiva. L'universo d'investimento del gruppo d'investimento è composto da società dello SMI; ponderato per la capitalizzazione di mercato. 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. A seconda della valutazione del mercato è possibile rinunciare alla vendita dell'opzione put e/o dell'opzione call. Realizzazione tramite SLF (CH) Equity Switzerland Protect Enhanced.

Evoluzione del valore nella valuta di riferimento (base 100)



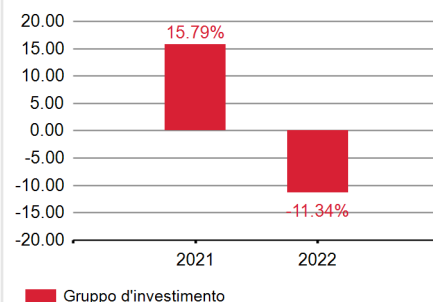
Performance nella valuta di riferimento

	PERFORMANCE CUMULATA				PERFORMANCE ANNUALIZZATA			
	YTD	1 MESE	3 MESI	1 ANNO	3 ANNI	5 ANNI	10 ANNI	INIZIO
GRUPPO D'INVESTIMENTO	1.63%	-1.48%	-1.08%	-4.45%	-	-	-	2.48%

Dati statistici (annualizzati)

	1 ANNO	3 ANNI	5 ANNI	10 ANNI	INIZIO
Volatilità Gruppo d'investimento (in %)	9.97	-	-	-	9.92
Sharpe Ratio	-0.46	-	-	-	0.27

Performance



Informazioni sul prodotto

Numero di valore: 58002332
ISIN: CH0580023320
LEI: 254900ZUTROYHLYQ4E86
Codice Bloomberg: SLASPFC SW
Moneta: CHF
Domicilio: Svizzera
Data di creazione: 18/12/2020
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
Quote spese operative TER KGAST
ex ante: 0.46%
ex post al: 30/09/2022 0.46%

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.

Struttura del portafoglio per settore

	Gruppo d'investimento
SALUTE	36.29%
FINANZA	17.02%
BENI DI PRIMA NECESSITÀ	15.63%
MATERIALI	7.86%
BENI VOLUTTUARI	6.06%
INDUSTRIE	5.58%
FUTURE SU INDICE AZIONARIO	1.64%
SERVIZI DI COMUNICAZIONE	1.21%
TECNOLOGIA DELL'INFORMAZIONE	0.69%
LIQUIDITÀ / PRESTITO	8.02%

Le principali posizioni

	Gruppo d'investimento
NESTLE SA-REG	15.63%
NOVARTIS AG-REG	14.82%
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	14.46%
CIE FINANCIERE RICHEMO-A REG	6.06%
ZURICH INSURANCE GROUP AG	5.50%
UBS GROUP AG-REG	5.26%
ABB LTD-REG	4.16%
LONZA GROUP AG-REG	3.42%
SIKA AG-REG	3.32%
HOLCIM LTD	2.69%