

Fondazione d'investimento Swiss Life

Azioni Svizzera Large Caps Indicizzate PM

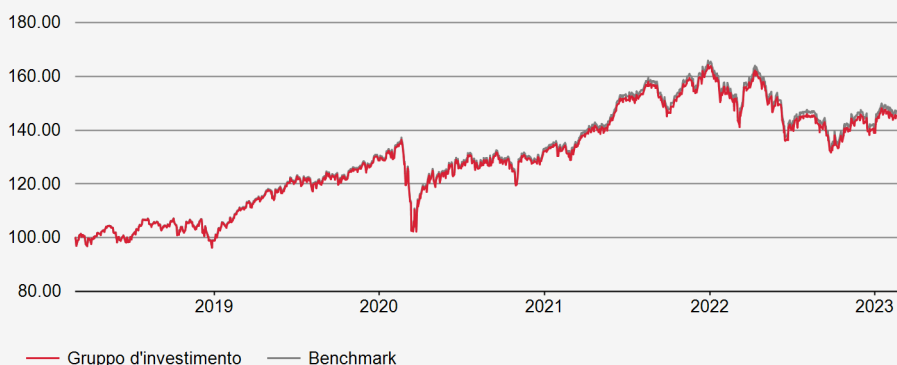


Patrimonio netto (NAV) in mio. CHF: 416.26
Valore d'inventario netto per diritto in CHF: 136.28

Strategia d'investimento

Investimenti in titoli di partecipazione di società rappresentate allo SPI 20. Implementazione indicizzata, l'indice di riferimento 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); Fondi d'investimento di diritto svizzero della categoria "altri fondi per investimenti tradizionali".

Evoluzione del valore nella valuta di riferimento (base 100)



Le performance passate non sono indicative di performance future.

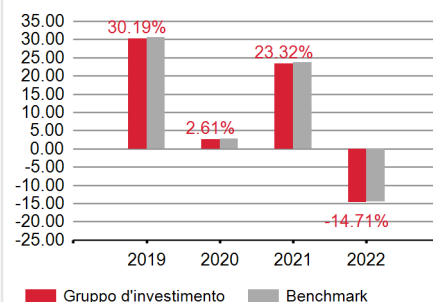
Performance nella valuta di riferimento

	PERFORMANCE CUMULATA				PERFORMANCE ANNUALIZZATA			
	YTD	1 MESE	3 MESI	1 ANNO	3 ANNI	5 ANNI	10 ANNI	INIZIO
GRUPPO D'INVESTIMENTO	2.91%	-1.96%	-0.89%	-5.75%	6.15%	7.42%	-	6.28%
BENCHMARK	2.93%	-1.97%	-0.87%	-5.59%	6.40%	7.67%	-	6.52%

Dati statistici (annualizzati)

	1 ANNO	3 ANNI	5 ANNI	10 ANNI	INIZIO
Volatilità Gruppo d'investimento (in %)	14.84	13.65	12.95	-	13.06
Volatilità del Benchmark (in %)	14.88	13.70	12.99	-	13.11
Tracking Error ex post (in %)	0.06	0.06	0.06	-	0.07
Information Ratio	-2.92	-4.04	-4.32	-	-3.53
Sharpe Ratio	-0.40	0.47	0.60	-	0.51
Correlazione	1.00	1.00	1.00	-	1.00
Beta	1.00	1.00	1.00	-	1.00
Jensen alfa	-0.18	-0.23	-0.23	-	-0.21

Performance



Informazioni sul prodotto

Numero di valore: 39561886

ISIN: CH0395618868

LEI: 254900P0FZIREAGSUQ60

Codice Bloomberg: SLASLPM SW

Benchmark: SPI 20 Total Return@

Moneta: CHF

Domicilio: Svizzera

Data di creazione: 31/01/2018

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 Best Select Invest Plus@:
Pictet 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: 0.20%

ex post al: 30/09/2022 0.20%

PM tranche: L'acquisto di questa tranche è possibile solo nell'ambito di un accordo speciale con Swiss Life Asset Management SA.

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 PM



Struttura del portafoglio per settore

	Gruppo d'investimento	Benchmark
SALUTE	37.51%	37.55%
GENERI DI CONSUMO	29.99%	30.01%
FINANZA	17.05%	17.06%
INDUSTRIE	11.61%	11.62%
MATERIALI DI BASE	1.86%	1.85%
TELECOMUNICAZIONI	1.21%	1.21%
TECNOLOGIA	0.69%	0.69%
SERVIZI PER IL CONSUMATORE	-	-
PETROLIO E GAS	-	-
SERVIZI DI PUBBLICA UTILITÀ	-	-
LIQUIDITÀ	0.09%	-

Le principali posizioni

	Gruppo d'investimento	Benchmark
NESTLE SA-REG	23.92%	23.94%
ROCHE HOLDING AG	15.65%	15.67%
NOVARTIS AG-REG	14.84%	14.86%
CIE FINANCIERE RICHEMONT-REG	6.07%	6.07%
ZURICH INSURANCE GROUP AG	5.51%	5.51%
UBS GROUP AG-REG	5.27%	5.28%
ABB LTD-REG	4.17%	4.17%
LONZA GROUP AG-REG	3.43%	3.43%
SIKA AG	3.33%	3.33%
HOLCIM LTD	2.69%	2.69%

Struttura del portafoglio in base al volume dell'impresa

	Gruppo d'investimento		Benchmark	
	Partecip.	Numero	Partecip.	Numero
Grandi imprese	98.01%	18	98.10%	18
Medie imprese	1.90%	2	1.90%	2
Piccole imprese	-	-	-	-
Liquidità	0.09%	-	-	-