31 marzo 2024

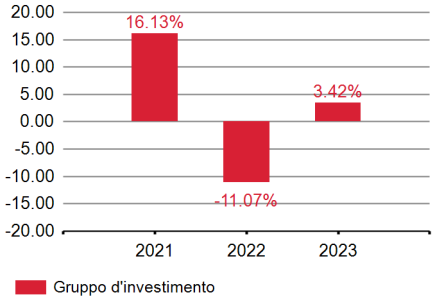
Fondazione d'investimento Swiss Life Azioni Svizzera Protect Flex PM

Patrimonio netto (NAV) in mio. CHF: 174.04
Valore d'inventario netto per diritto in CHF: 113.61

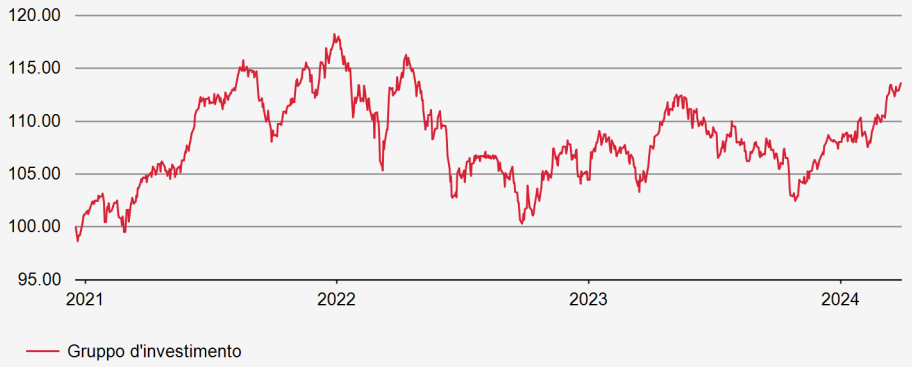
Strategia d'investimento

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.

Performance



Evoluzione del valore nella valuta di riferimento (base 100)



Le performance passate non sono indicative di performance future.

Informazioni sul prodotto

Numero di valore: 58002364
ISIN: CH0580023643
LEI: 254900ZUTROYHLYQ4E86
Codice Bloomberg: SLSPFPM 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/fondazionedinvestimento
Quote spese operative TER KGAST
ex ante: 0.15%
ex post al: 30/09/2023 0.15%

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	5.16%	3.18%	5.16%	5.51%	2.91%	-	-	3.97%

Dati statistici (annualizzati)

	1 anno	3 anni	5 anni	10 anni	Inizio
Volatilità Gruppo d'investimento (in %)	7.52	9.16	-	-	9.06
Sharpe Ratio	0.50	0.27	-	-	0.39
Maximum Drawdown (in %)	-8.92	-15.16	-	-	-15.16
Recovery Period (anni)	0.37	-	-	-	-

PM tranche: L'acquisto di questa tranche è possibile solo nell'ambito di un accordo speciale con Swiss Life Asset Management SA.
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 logaritmizzati mensili.
Tracking error ex ante: Il tracking error previsto per i prossimi 12 mesi corrisponde al Tracking error ex post degli ultimi 3 anni.

31 marzo 2024

Fondazione d'investimento Swiss Life Azioni Svizzera Protect Flex PM

Struttura del portafoglio per settore

	Gruppo d'investimento
Salute	33.57%
Finanza	18.26%
Beni di prima necessità	14.91%
Materiali	9.09%
Industrie	7.64%
Beni voluttuari	5.67%
Future su indice azionario	1.34%
Servizi di comunicazione	1.08%
Tecnologia dell'informazione	1.02%
Liquidità / Prestito	7.42%

Le principali posizioni

	Gruppo d'investimento
NESTLE SA-REG	14.91%
NOVARTIS AG-REG	14.21%
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	12.42%
UBS GROUP AG-REG	6.52%
CIE FINANCIERE RICHEMO-A REG	5.67%
ZURICH INSURANCE GROUP AG	5.47%
ABB LTD-REG	5.20%
HOLCIM LTD	3.32%
SIKA AG-REG	3.31%
LONZA GROUP AG-REG	3.09%

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/anlagestiftung. 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 FINMA e che investono presso la fondazione esclusivamente capitali per queste istituzioni. Inoltre, gli investitori citati devono aver concluso un accordo speciale con Swiss Life Asset Management SA. 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.