

Strategia d'investimento

- Investimenti in titoli di partecipazione di società rappresentate allo Swiss Performance Index (SPI)
- La copertura per i Large Cap è passiva, gli Small & Mid Caps vengono gestiti attivamente (core satellite)
- Limitazione per società: 5% (eccezione: se rappresentati nel benchmark; max. 5%-punti in più della ponderazione del benchmark)
- Realizzazione tramite Swiss Life iFunds (CH) Equity Switzerland (CHF) e Equity Switzerland Small & Mid Cap (CHF); fondi d'investimento di diritto svizzero della categoria "Altri fondi per investimenti tradizionali"

Informazioni sul prodotto

| | |
|---|-------------------------------|
| Numero di valore | 1245481 |
| ISIN | CH0012454812 |
| LEI | 254900UNZU5YPIKQTQ23 |
| Bloomberg Ticker | SWAAKCH SW |
| Benchmark | Swiss Performance Index |
| Moneta | CHF |
| Data di lancio | 30.09.2001 |
| Prezzo di prima emissione | 100.00 |
| Chiusura d'esercizio | 30.09. |
| Emissione/Riscatto | giornalmente |
| Termine di accettazione | 14.30 |
| Asset Manager in base al | |
| Swiss Life Best Select Invest Plus® * | |
| Large Caps (passivo) | Pictet Asset Management SA |
| Small&Mid Caps (attivo) | Privatbank Von Graffenried AG |
| Consulenza esterna | |
| PPCmetrics fornisce i seguenti servizi: | |
| consulenza sulle strutture idonee del mandato (core satellite), 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 | 0.54% |
| - ex post all 30.09.2018 | 0.54% |
| Commissione d'emissione/riscatto | nessuna |
| Prassi di distribuzione | accumulazione |

* 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

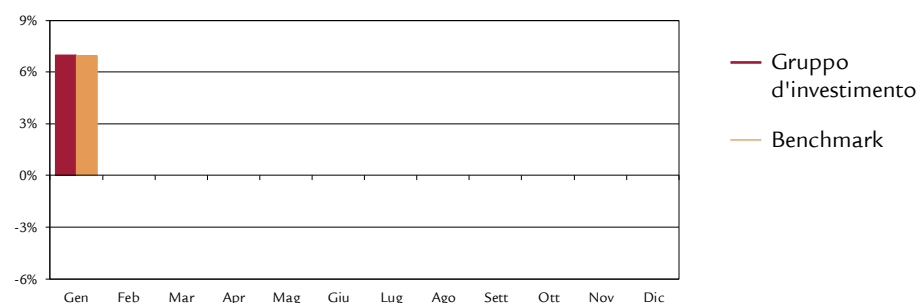
** La quota spese operative TER_{KGAST} copre tutti i costi, eccezione fatta per i costi di transazione e i tributi fiscali legati alla transazione

Evoluzione del valore indicizzata e performance



| Performance | 1M | 3M | 1A | 3A | 5A | 10A | p.a. dal |
|------------------------------|------|-------|-------|-------|------|-------|----------|
| | | | | p.a. | p.a. | p.a. | 30.09.01 |
| Gruppo d'investimento (in %) | 6.96 | -1.34 | -2.17 | 6.60 | 5.56 | 8.75 | 5.02 |
| Benchmark (in %) | 6.96 | -1.14 | -2.08 | 6.88 | 6.07 | 9.16 | 5.61 |
| | YTD | 2018 | 2017 | 2016 | 2015 | 2014 | 2013 |
| Gruppo d'investimento (in %) | 6.96 | -8.61 | 19.03 | -1.44 | 2.06 | 11.84 | 24.38 |
| Benchmark (in %) | 6.96 | -8.57 | 19.92 | -1.41 | 2.68 | 13.00 | 24.60 |

Performance mensile



Dati statistici (annualizzati)

| | 1A | 3A | 5A | 10A | dal |
|---|--------|--------|--------|--------|----------|
| | | | | | 30.09.01 |
| Volatilità Gruppo d'investimento (in %) | 13.88 | 10.13 | 11.49 | 11.85 | 12.95 |
| Volatilità Benchmark (in %) | 13.84 | 10.15 | 11.52 | 11.96 | 13.34 |
| Tracking Error ex post (in %) | 0.27 | 0.28 | 0.31 | 0.51 | 1.36 |
| Tracking Error ex ante (in %) | 0.30 | | | | |
| Information Ratio | -0.36 | -1.02 | -1.69 | -0.80 | -0.43 |
| Sharpe Ratio | -0.11 | 0.70 | 0.52 | 0.73 | 0.34 |
| Correlazione | 1.00 | 1.00 | 1.00 | 1.00 | 1.00 |
| Beta | 1.00 | 1.00 | 1.00 | 0.99 | 0.97 |
| Jensen-Alpha | -0.10 | -0.25 | -0.47 | -0.29 | -0.38 |
| Maximum Drawdown (in %) | -12.72 | -13.18 | -19.54 | -28.03 | -54.46 |
| Recovery Period (anni) | - | - | 1.17 | 1.15 | 4.96 |

Cifre salienti (in CHF)

| | 31.12.2018 | 31.01.2019 |
|--|------------|------------|
| Patrimonio in milioni CHF | 197.1 | 213.8 |
| Valore d'inventario netto per quota in CHF | 218.68 | 233.91 |

31 gennaio 2019

Fondazione d'investimento Swiss Life Azioni Svizzera



Struttura del portafoglio in base al volume dell'impresa¹⁾

| | Gruppo d'investimento | | Benchmark | |
|-----------------|-----------------------|--------|-----------|--------|
| | Particip. | Numero | Particip. | Numero |
| Grandi imprese | 79.5% | 20 | 80.0% | 20 |
| Medie imprese | 17.9% | 50 | 18.0% | 76 |
| Piccole imprese | 1.0% | 8 | 2.0% | 104 |
| Liquidità | 1.6% | - | - | - |
| Totale | 100.0% | 78 | 100.0% | 200 |

¹⁾ prendendo in considerazione i derivati e gli investimenti collettivi

Struttura del portafoglio per settore²⁾

| | Gruppo d'investimento | Benchmark |
|-----------------------------|-----------------------|-----------|
| Salute | 33.8% | 34.5% |
| Generi di consumo | 26.0% | 26.5% |
| Financials | 16.9% | 19.0% |
| Industrie | 15.3% | 13.8% |
| Materiali di base | 2.0% | 2.3% |
| Telecomunicazioni | 1.3% | 1.2% |
| Tecnologia | 1.6% | 1.7% |
| Servizi per il consumatore | 1.1% | 0.9% |
| Servizi di pubblica utilità | 0.4% | 0.1% |
| Petrolio e gas | 0.0% | 0.0% |
| Liquidità | 1.6% | - |
| Totale | 100.0% | 100.0% |

²⁾ prendendo in considerazione i derivati e gli investimenti collettivi

Le prime posizioni³⁾

| | Gruppo d'investimento | Benchmark |
|------------------------|-----------------------|-----------|
| Nestlé | 20.5% | 20.7% |
| Novartis | 16.1% | 16.2% |
| Roche BG | 14.4% | 14.5% |
| UBS | 3.8% | 3.9% |
| Cie Fin Richemont | 3.7% | 3.7% |
| Zurich Insurance Group | 2.8% | 2.8% |
| ABB | 2.7% | 2.7% |
| Credit Suisse Group | 2.3% | 2.3% |
| Swiss Re | 2.2% | 2.3% |
| LafargeHolcim | 1.7% | 1.7% |

³⁾ prendendo in considerazione i derivati e gli investimenti collettivi

Disclaimer

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, 8022 Zurigo, telefono 043 284 79 79. 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 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. I dati relativi alla performance non prendono in considerazione le commissioni e le spese riscosse al momento dell'emissione e del riscatto delle quote.