

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); fondo d'investimento di diritto svizzero della categoria "Altri fondi per investimenti tradizionali"

Informazioni sul prodotto

Numero di valore	39561885
ISIN	CH0395618850
LEI	254900P0FZIREAGSUQ60
Bloomberg Ticker	SLASLCI SW
Benchmark	SPI 20@
Moneta	CHF
Data di lancio	01.02.2018
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® *
	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

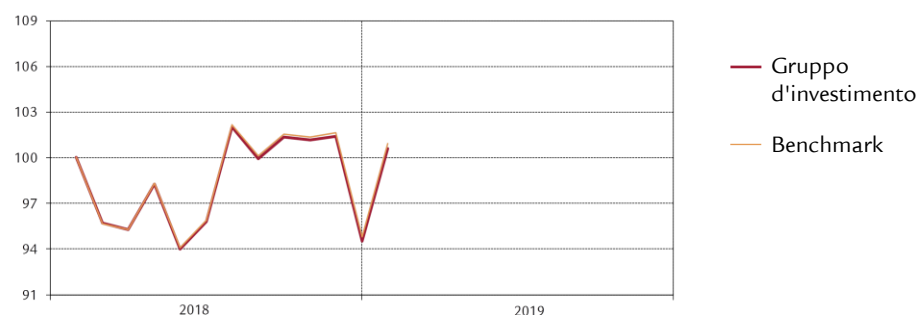
Pubblicazioni di corsi Bloomberg: ASSL
www.swisslife.ch/fondazioneinvestimento

Quote spese operative TER _{KGAST} **	
- ex ante	0.35%
- ex post all 30.09.2018	0.35%
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

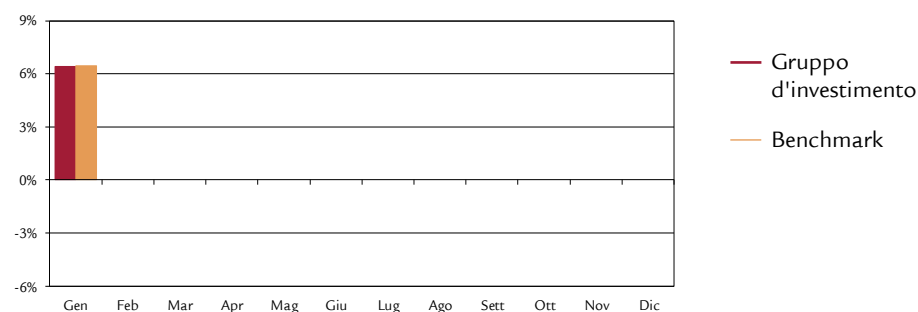
** La quota spese operative TER_{KGAST} copre tutti i costi, eccezione fatta per i costi di transazione e i tributi fiscali legati alla transazione

Evoluzione del valore indicizzata e performance



Performance	1M	3M	1A	3A	5A	p.a. dal
				p.a.	p.a.	01.02.18
Gruppo d'investimento (in %)	6.41	-0.55	0.59			0.59
Benchmark (in %)	6.46	-0.46	0.91			0.91
	YTD	2018	2017	2016	2015	2014
Gruppo d'investimento (in %)	6.41					
Benchmark (in %)	6.46					

Performance mensile



Dati statistici (annualizzati)

	1A	3A	5A	dal
				01.02.18
Volatilità Gruppo d'investimento (in %)	14.25			14.25
Volatilità Benchmark (in %)	14.44			14.44
Tracking Error ex post (in %)	0.51			0.51
Tracking Error ex ante (in %)	0.10			
Information Ratio	-0.64			-0.64
Sharpe Ratio	0.09			0.09
Correlazione	1.00			1.00
Beta	0.99			0.99
Jensen-Alpha	-0.30			-0.30
Maximum Drawdown (in %)	-10.15			-10.15
Recovery Period (anni)	-			-

Cifre salienti (in CHF)

	31.12.2018	31.01.2019
Patrimonio in milioni CHF	89.2	107.1
Valore d'inventario netto per quota in CHF	94.53	100.59

31 gennaio 2019

Fondazione d'investimento Swiss Life Azioni Svizzera Large Caps Indicizzati



Struttura del portafoglio in base al volume dell'impresa¹⁾

	Gruppo d'investimento		Benchmark	
	Particip.	Numero	Particip.	Numero
Grandi imprese	98.6%	19	98.7%	19
Medie imprese	1.4%	1	1.3%	1
Piccole imprese	0.0%	0	-	-
Liquidità	0.0%	-	-	-
Totale	100.0%	20	100.0%	20

¹⁾ prendendo in considerazione i derivati e gli investimenti collettivi

Struttura del portafoglio per settore²⁾

	Gruppo d'investimento	Benchmark
Salute	39.7%	39.7%
Generi di consumo	29.8%	29.8%
Financials	17.1%	17.1%
Industrie	10.4%	10.4%
Materiali di base	1.8%	1.8%
Telecomunicazioni	1.2%	1.2%
Petrolio e gas	0.0%	0.0%
Servizi per il consumatore	0.0%	0.0%
Servizi di pubblica utilità	0.0%	0.0%
Tecnologia	0.0%	0.0%
Liquidità	0.0%	-
Totale	100.0%	100.0%

²⁾ prendendo in considerazione i derivati e gli investimenti collettivi

Le prime posizioni³⁾

	Gruppo d'investimento	Benchmark
Nestlé	25.5%	25.5%
Novartis	20.0%	20.0%
Roche BG	17.8%	17.8%
UBS	4.8%	4.8%
Cie Fin Richemont	4.5%	4.5%
Zurich Insurance Group	3.4%	3.4%
ABB	3.3%	3.3%
Credit Suisse Group	2.8%	2.8%
Swiss Re	2.8%	2.8%
LafargeHolcim	2.2%	2.2%

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.