

Fondazione d'investimento Swiss Life

Azioni Global Protect Flex PM (CHF hedged)

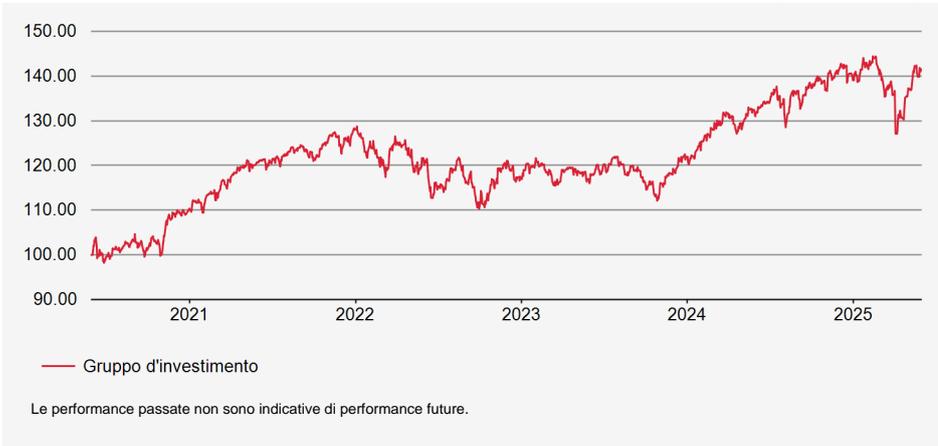


Patrimonio netto (NAV) in mio. CHF: 443.94
Valore d'inventario netto per diritto in CHF: 164.86

Strategia d'investimento

Strategia azionaria attiva basata su regole con strategia di copertura complementare. L'universo d'investimento del gruppo d'investimento è composto da società dei maggiori indici borsistici stranieri (in particolare S&P 500, Euro Stoxx 50, FTSE 100 e Nikkei 225) nonché l'SMI; ponderato per la capitalizzazione di mercato. I rischi valutari vengono coperti al 90 % almeno contro il franco. 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 ("put spread collar"). A seconda della valutazione del mercato è possibile rinunciare alla vendita dell'opzione put e/o dell'opzione call. Realizzazione tramite SLF (CH) Equity Global Protect (CHF hedged).

Evoluzione del valore nella valuta di riferimento (base 100)



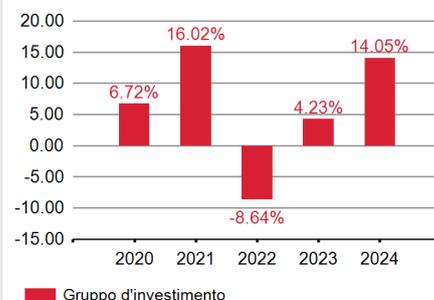
Performance nella valuta di riferimento

	Performance cumulata				Performance annualizzata			
	YTD	1 mese	3 mesi	1 anno	3 anni	5 anni	10 anni	Inizio
Gruppo d'investimento	1.78%	4.45%	0.13%	7.56%	5.39%	7.19%	-	5.65%

Dati statistici (annualizzati)

	1 anno	3 anni	5 anni	10 anni	Inizio
Volatilità Gruppo d'investimento (in %)	7.83	10.23	9.74	-	8.48
Sharpe Ratio	0.83	0.42	0.68	-	0.67
Maximum Drawdown (in %)	-12.00	-12.00	-14.29	-	-15.96
Recovery Period (anni)	-	-	1.42	-	0.63

Performance



Informazioni sul prodotto

Numero di valore: 31954200

ISIN: CH0319542004

LEI: 254900LUAQC3MCOMWL48

Codice Bloomberg: SLAGCPM SW

Valuta: CHF

Domicilio: Svizzera

Data di lancio: 29/04/2016

Prezzo di prima emissione: 100.00

Chiusura d'esercizio: 30.09

Emissione/Riscatto: giornalmente

Termine d'accettazione: 13.00

Protezione contro la diluizione:

Commissione di emissione / riscatto a favore del gruppo d'investimento secondo la panoramica delle condizioni.

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: 0.14%

ex post al: 30/09/2024 0.15%

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.

Protezione contro la diluizione: Panoramica delle condizioni: www.swisslife.ch/fondazioneinvestimento, «Documenti giuridici» (modifiche possibili in qualsiasi momento senza preavviso).

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.

Fondazione d'investimento Swiss Life

Azioni Global Protect Flex PM (CHF hedged)

Struttura del portafoglio per settore

	Gruppo d'investimento
Tecnologia dell'informazione	16.82%
Finanza	15.71%
Industrie	12.10%
Salute	11.79%
Beni voluttuari	7.99%
Beni di prima necessità	7.72%
Servizi di pubblica utilità	5.81%
Servizi di comunicazione	5.36%
Immobili	3.38%
Energia	3.10%
Materiali	2.81%
Future su indice azionario	0.29%
Liquidità	7.13%

Posizioni principali

	Gruppo d'investimento
WALMART INC	0.88%
INTL BUSINESS MACHINES CORP	0.86%
CONSOLIDATED EDISON INC	0.83%
CHUBB LTD	0.83%
PROGRESSIVE CORP	0.77%
REPUBLIC SERVICES INC	0.75%
AMPHENOL CORP-CL A	0.71%
WASTE CONNECTIONS INC	0.69%
CISCO SYSTEMS INC	0.68%
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	0.67%

Struttura del portafoglio secondo il paese/regione

	Gruppo d'investimento
USA e Canada	67.85%
Regione Europea (EUR)	10.85%
Regione Asia e Pacifico	7.72%
Regione Europea (Ex EUR)	5.67%
Mercati Emergenti in America	0.49%
Future su indice azionario	0.29%
Liquidità	7.13%

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. Questo documento potrebbe essere stato creato utilizzando l'intelligenza artificiale. **Fonte:** Swiss Life Asset Managers. Tutti i diritti riservati.