

30 settembre 2024

# Fondazione d'investimento Swiss Life

## Azioni Estero ESG Indicizzate

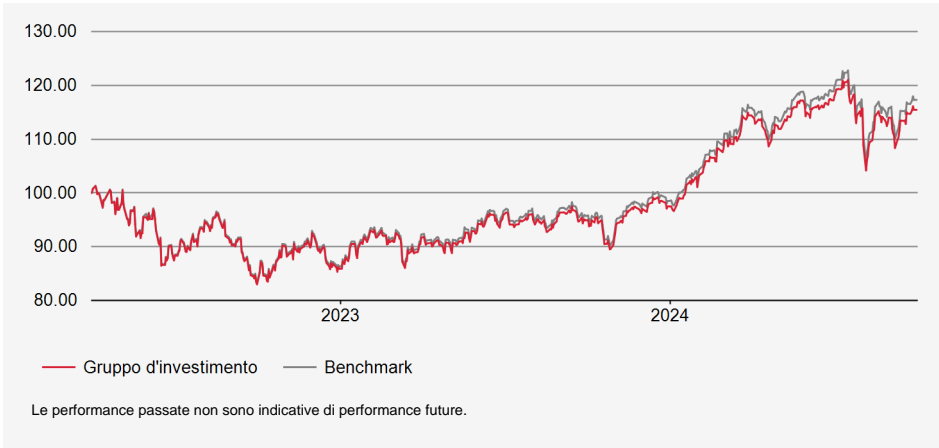


**Patrimonio netto (NAV) in mio. CHF: 610.15**  
**Valore d'inventario netto per diritto in CHF: 115.44**

### Strategia d'investimento

Investimenti in titoli di partecipazione di società comprese nell'MSCI World ex Switzerland ESG Leaders, in CHF. Sono ammessi anche titoli di partecipazione di società che, a seguito degli adeguamenti del benchmark, non sono ancora o non sono più comprese nel benchmark (variazione max. +0,5 punti percentuali). Attuazione tramite Swiss Life iFunds (CH) Equity ESG Global ex Switzerland (CHF).

### Evoluzione del valore nella valuta di riferimento (base 100)



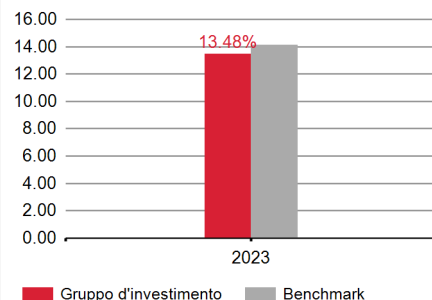
### Performance nella valuta di riferimento

	Performance cumulata True				Performance annualizzata			
	YTD	1 mese	3 mesi	1 anno	3 anni	5 anni	10 anni	Inizio
Gruppo d'investimento	18.40%	1.29%	-1.51%	21.64%	-	-	-	5.90%
Benchmark	19.08%	1.34%	-1.32%	22.55%	-	-	-	6.58%

### Dati statistici (annualizzati)

	1 anno	3 anni	5 anni	10 anni	Inizio
Volatilità Gruppo d'investimento (in %)	11.39	-	-	-	14.83
Volatilità del Benchmark (in %)	11.42	-	-	-	14.85
Tracking Error ex post (in %)	0.07	-	-	-	0.14
Information Ratio	-13.29	-	-	-	-4.70
Sharpe Ratio	1.59	-	-	-	0.31
Correlazione	1.00	-	-	-	1.00
Beta	1.00	-	-	-	1.00
Jensen alfa	-0.86	-	-	-	-0.67
Maximum Drawdown (in %)	-13.92	-	-	-	-18.04
Recovery Period (anni)	-	-	-	-	1.30

### Performance



### Informazioni sul prodotto

**Numero di valore:** 117189932  
**ISIN:** CH1171899326  
**LEI:** 254900Q154AKVWL8UQ41  
**Codice Bloomberg:** SWAEICI SW  
**Benchmark:** MSCI World ex Switzerland ESG Leaders Net Return  
**Moneta:** CHF  
**Domicilio:** Svizzera  
**Data di creazione:** 31/03/2022  
**Prezzo di prima emissione:** 100.00  
**Chiusura d'esercizio:** 30.09  
**Emissione/Riscatto:** giornalmente  
**Termine d'accettazione:** 13.00  
**Commissione d'emissione / riscatto:** nessuna  
**Prassi di distribuzione:** Capitalizzazione  
**Asset Manager in base al Swiss Life Best Select Invest Plus@:** UBS SA  
**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](http://www.swisslife.ch/fondazioneinvestimento)  
**Quote spese operative TER KGAST ex ante:** 0.52%  
**ex post al:** 30/09/2024 0.52%

**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.

### Struttura del portafoglio per settore

	Gruppo d'investimento	Benchmark
Tecnologia dell'informazione	27.69%	27.88%
Finanza	14.82%	14.89%
Salute	11.22%	11.27%
Industrie	10.64%	10.70%
Beni voluttuari	10.61%	10.68%
Servizi di comunicazione	8.01%	8.05%
Beni di prima necessità	6.19%	6.24%
Materiali	3.73%	3.73%
Energia	2.45%	2.46%
Immobili	2.29%	2.32%
Servizi di pubblica utilità	1.74%	1.78%
Liquidità	0.60%	-

### Le principali posizioni

	Gruppo d'investimento	Benchmark
MICROSOFT CORP	8.42%	8.48%
NVIDIA CORP	8.28%	8.34%
ALPHABET INC	5.04%	5.08%
TESLA INC	2.08%	2.10%
ELI LILLY & CO	1.98%	2.00%
VISA INC	1.20%	1.21%
MASTERCARD INC	1.14%	1.14%
PROCTER & GAMBLE CO/THE	1.13%	1.14%
HOME DEPOT INC/THE	1.11%	1.12%
JOHNSON & JOHNSON	1.08%	1.09%

### Struttura del portafoglio secondo il paese/regione

	Gruppo d'investimento	Benchmark
USA	73.77%	74.18%
Giappone	6.24%	6.24%
Gran Bretagna	3.61%	3.66%
Canada	3.19%	3.22%
Francia	2.92%	2.98%
Germania	1.04%	1.02%
Resto dell'Europa	6.20%	6.25%
Altri paesi Asia	2.42%	2.44%
Altri	-	-
Liquidità	0.60%	-

### Struttura del portafoglio secondo le valute

	Gruppo d'investimento	Benchmark
USD	74.20%	74.18%
EUR	7.42%	7.51%
JPY	6.26%	6.24%
GBP	3.74%	3.67%
Altri	8.38%	8.39%