Fondazione d'investimento Swiss Life Azioni Estero ESG

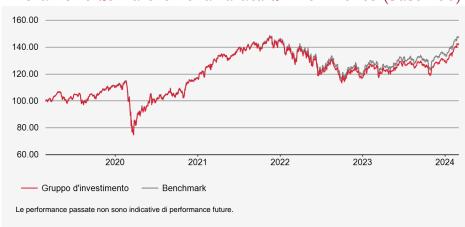


Patrimonio netto (NAV) in mio. CHF: 441.16 Valore d'inventario netto per diritto in CHF: 219.98

Strategia d'investimento

Investimenti in titoli di partecipazione di società con domicilio all'estero. La copertura per i Large &Mid Caps è passiva, gli Small Caps e il settore dei mercati emergenti (Emerging Markets) vengono gestiti attivamente (core satellite). Limitazione per società: 5% (eccezione: se la ponderazione è superiore al 5% nell'indice; allora 10% massimo). Società straniere al benchmark: max. 10%. Realizzazione tramite Swiss Life iFunds (CH) Equity ESG Global ex Switzerland (CHF), Invesco Global Small Cap Equity Fund, Dimensional Global Small Cap Equity Fund, Amundi Emerging Markets Equity Focus Fund e fondo Robeco Emerging Markets Equities.

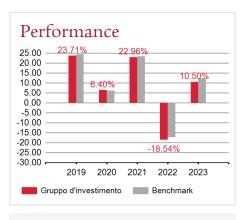
Evoluzione del valore nella valuta di riferimento (base 100)



Performance nella valuta di riferimento

Performance cumulata				Perfo	rmance ann	ualizzata		
	YTD	1 mese	3 mesi	1 anno	3 anni	5 anni	10 anni	Inizio
Gruppo d'investimento	9.85%	6.90%	11.96%	14.70%	4.91%	7.34%	7.77%	3.58%
Benchmark	9.90%	6.97%	11.99%	16.31%	6.18%	8.12%	8.60%	4.77%

Dati statistici	1 anno	3 anni	5 anni	10 anni	Inizio
(annualizzati)	i aiiio	Jann	J GIIIII	10 411111	IIIIZIO
Volatilità Gruppo d'investimento (in %)	10.52	14.48	16.82	14.71	15.59
Volatilità del Benchmark (in %)	10.26	14.51	16.75	14.67	15.84
Tracking Error ex post (in %)	0.43	0.43	0.48	0.65	1.40
Information Ratio	-3.69	-2.96	-1.64	-1.27	-0.86
Sharpe Ratio	1.16	0.31	0.43	0.54	0.21
Correlazione	1.00	1.00	1.00	1.00	1.00
Beta	1.02	1.00	1.00	1.00	0.98
Jensen alfa	-1.96	-1.26	-0.81	-0.85	-1.12
Maximum Drawdown (in %)	-8.41	-23.39	-34.66	-34.66	-60.40
Recovery Period (anni)	0.13	-	0.67	0.67	7.84



Informazioni sul prodotto

Numero di valore: 1245539 ISIN: CH0012455397

LEI: 2549000B6X3SG0K4LZ68

Codice Bloomberg: SWAAKAU SW

Benchmark: 80% MSCI World ex CH ESG
Leaders, 15% MSCI AC World Small Cap in CHF,

5% MSCI Emerging Markets in CHF Moneta: CHF Domicilio: Svizzera

Data di creazione: 30/09/2001 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 Best Select Invest Plus® Large&Mid Caps (passivo)

UBS SA

Small Caps (attivo)

50% Invesco / 50% Dimensional Emerging Markets (attivo)

50% Amundi / 50% Robeco

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/fondazionedinvestimento

Quote spese operative TER KGAST

ex ante: 0.73%

ex post al: 30/09/2023 0.76%

Fondazione d'investimento Swiss Life Azioni Estero ESG



Struttura del portafoglio per settore

	Gruppo d'investimento	Benchmark
Tecnologia dell'informazione	24.39%	24.56%
Finanza	14.70%	14.73%
Industrie	12.43%	12.15%
Beni voluttuari	11.05%	10.97%
Salute	10.81%	11.12%
Servizi di telecomunicazione	7.15%	7.39%
Beni di prima necessità	5.84%	6.15%
Materiali	4.24%	4.65%
Immobili	3.07%	3.25%
Energia	3.02%	3.26%
Servizi di pubblica utilità	1.68%	1.77%
Liquidità	1.63%	-

Le principali posizioni

	Gruppo d'investimento	Benchmark
MICROSOFT CORP.	7.35%	7.41%
NVIDIA CORP	4.91%	4.96%
ALPHABET INC	3.87%	3.94%
ELI LILLY & CO	1.53%	1.54%
TESLA INC	1.45%	1.46%
VISA INC	1.13%	1.15%
MASTERCARD INC	1.01%	1.02%
JOHNSON & JOHNSON	0.98%	0.98%
NOVO NORDISK A/S	0.98%	0.98%
ASML HOLDING NV	0.96%	0.96%

Struttura del portafoglio secondo il paese/regione

1 / 0	Gruppo d'investimento	Benchmark
USA	66.46%	67.36%
Giappone	6.64%	7.00%
Gran Bretagna	3.60%	3.44%
Francia	2.94%	3.03%
Canada	2.87%	3.03%
Germania	1.33%	1.24%
Resto dell'Europa	6.63%	6.27%
Altri paesi Asia	5.45%	6.06%
Altri	2.44%	2.58%
Liquidità	1.63%	-

Struttura del portafoglio secondo le valute

	Gruppo d'investimento	Benchmark
USD	67.98%	67.36%
EUR	7.92%	7.57%
JPY	6.74%	7.01%
GBP	3.71%	3.57%
CHF	0.31%	0.22%
Altri	13.35%	14.27%

Ulteriori informazioni sulle società

Numero di società	7,922
Quota di sociatà sonza honohmark	2 6 4 9 /