

Fondazione d'investimento Swiss Life

Azioni Emerging Markets ESG

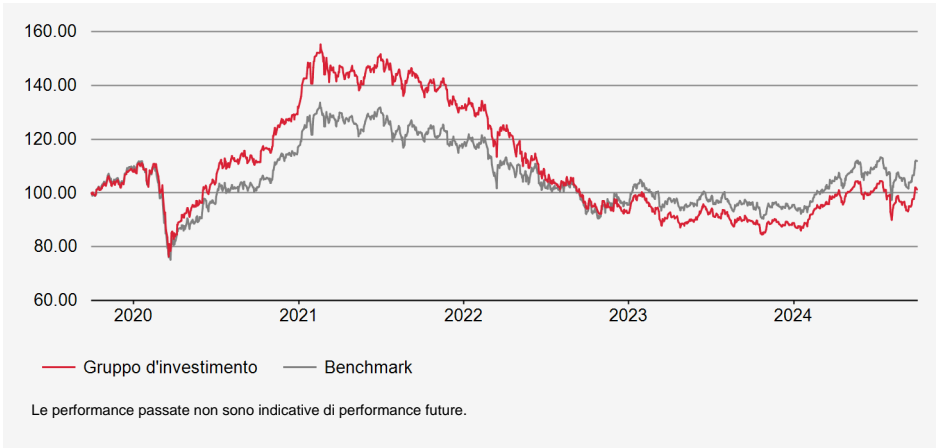


Patrimonio netto (NAV) in mio. CHF: 261.74
Valore d'inventario netto per diritto in CHF: 86.75

Strategia d'investimento

Investimenti in titoli di partecipazione di società domiciliate in Paesi emergenti. Selezione attiva di Paesi, settori e titoli. Realizzazione tramite Amundi Emerging Markets Equity Focus e Robeco Emerging Markets Equities Fund; SICAV di diritto lussemburghese secondo l'OICVM.

Evoluzione del valore nella valuta di riferimento (base 100)



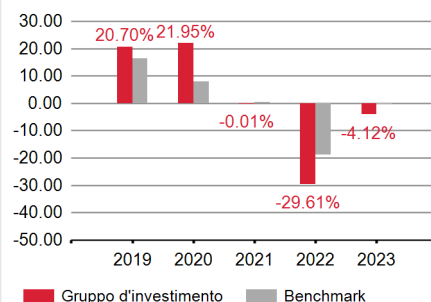
Performance nella valuta di riferimento

	Performance cumulata True				Performance annualizzata			
	YTD	1 mese	3 mesi	1 anno	3 anni	5 anni	10 anni	Inizio
Gruppo d'investimento	14.08%	4.90%	-0.39%	13.01%	-10.16%	0.26%	-	-2.11%
Benchmark	17.13%	6.06%	2.06%	16.23%	-2.91%	2.27%	-	0.12%

Dati statistici (annualizzati)

	1 anno	3 anni	5 anni	10 anni	Inizio
Volatilità Gruppo d'investimento (in %)	12.18	13.88	16.60	-	16.59
Volatilità del Benchmark (in %)	12.95	14.52	16.38	-	15.99
Tracking Error ex post (in %)	2.51	4.73	5.15	-	5.16
Information Ratio	-1.29	-1.54	-0.39	-	-0.43
Sharpe Ratio	0.88	-0.82	0.01	-	-0.12
Correlazione	0.98	0.94	0.95	-	0.95
Beta	0.92	0.90	0.96	-	0.99
Jensen alfa	-2.09	-7.62	-1.94	-	-2.23
Maximum Drawdown (in %)	-13.87	-40.72	-45.54	-	-45.54
Recovery Period (anni)	-	-	-	-	-

Performance



Informazioni sul prodotto

Numero di valore: 39561902
ISIN: CH0395619023
LEI: 254900OLXTUB1EYJLV86
Codice Bloomberg: SWLAKEM SW
Benchmark: MSCI Emerging Markets, in CHF
Moneta: CHF
Domicilio: Svizzera
Data di creazione: 01/02/2018
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@: 50% Amundi / 50% Robeco

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: 0.86%
ex post al: 30/09/2024 0.86%

Fondazione d'investimento Swiss Life

Azioni Emerging Markets ESG

Struttura del portafoglio per settore

	Gruppo d'investimento	Benchmark
Finanza	18.23%	22.92%
Tecnologia dell'informazione	18.00%	22.50%
Beni voluttuari	13.17%	13.79%
Servizi di comunicazione	5.90%	9.36%
Industrie	4.51%	6.76%
Immobili	4.13%	1.58%
Beni di prima necessità	3.66%	5.20%
Materiali	3.28%	6.63%
Servizi di pubblica utilità	2.54%	2.92%
Energia	2.17%	4.77%
Salute	1.36%	3.57%
Liquidità	22.99%	-

Le principali posizioni

	Gruppo d'investimento	Benchmark
TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFACTURING CO LT	7.29%	9.18%
SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	3.11%	2.96%
ALIBABA GROUP HOLDING LTD	2.44%	2.51%
TENCENT HOLDINGS LTD	2.08%	2.22%
HDFC BANK LTD	2.05%	1.07%
NASPERS LTD	1.55%	0.26%
INFOSYS LTD	1.48%	0.46%
ICICI BANK LTD ADR	1.32%	-
HON HAI PRECISION INDUSTRY CO LTD	0.97%	0.45%
SK HYNIX INC	0.88%	0.44%

Struttura del portafoglio secondo il paese/regione

	Gruppo d'investimento	Benchmark
Cina	18.60%	27.24%
India	14.90%	19.63%
Taiwan	11.59%	17.79%
Corea	10.07%	10.53%
Brasile	4.51%	4.85%
Africa del sud	2.84%	3.03%
Altri paesi Asia	5.85%	5.26%
Altri paesi EMEA	6.45%	8.97%
Altr paesi America	2.22%	2.71%
Liquidità	22.99%	-

Struttura del portafoglio secondo le valute

	Gruppo d'investimento	Benchmark
HKD	13.74%	21.19%
TWD	12.26%	17.82%
INR	12.20%	19.63%
KRW	10.11%	10.53%
USD	6.25%	3.00%
EUR	1.19%	0.46%
CHF	0.00%	-
Altri	44.29%	27.32%

Ulteriori informazioni sulle società

Numero di società	265
Quota di società senza benchmark	3.39%