

Fondazione d'investimento Swiss Life

Azioni Global ex Svizzera ESG Indicizzate PM

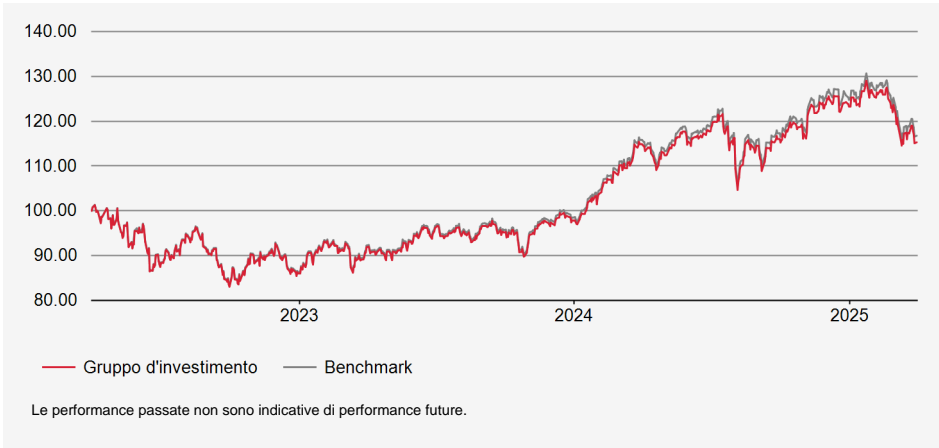


Patrimonio netto (NAV) in mio. CHF: 577.82
Valore d'inventario netto per diritto in CHF: 115.29

Strategia d'investimento

Il gruppo d'investimento viene gestito con un approccio indicizzato e si contraddistingue per l'ampia diversificazione e il tracking error minimo. L'obiettivo d'investimento consiste nel replicare al meglio il benchmark MSCI World ex Switzerland ESG Leaders Total Return. Realizzazione tramite Swiss Life Index Funds II (CH) Equity ESG Global ex Switzerland PF; fondo d'investimento contrattuale di diritto svizzero del tipo "altri fondi per investimenti tradizionali". Non viene effettuato securities lending e non vengono effettuati investimenti in titoli che l'Associazione svizzera per gli investimenti responsabili (www.svkv-asir.ch) raccomanda di escludere.

Evoluzione del valore nella valuta di riferimento (base 100)



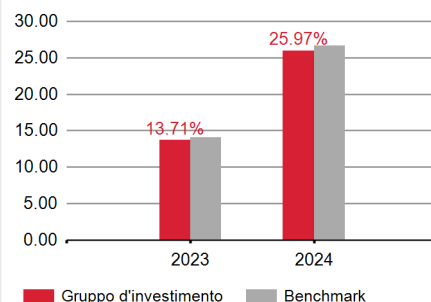
Performance nella valuta di riferimento

	Performance cumulata				Performance annualizzata			
	YTD	1 mese	3 mesi	1 anno	3 anni	5 anni	10 anni	Inizio
Gruppo d'investimento	-6.47%	-6.75%	-6.47%	0.37%	4.85%	-	-	4.85%
Benchmark	-6.41%	-6.75%	-6.41%	0.80%	5.30%	-	-	5.30%

Dati statistici (annualizzati)

	1 anno	3 anni	5 anni	10 anni	Inizio
Volatilità Gruppo d'investimento (in %)	11.50	14.94	-	-	14.73
Volatilità del Benchmark (in %)	11.56	14.97	-	-	14.77
Tracking Error ex post (in %)	0.08	0.13	-	-	0.13
Information Ratio	-5.68	-3.41	-	-	-3.32
Sharpe Ratio	-0.05	0.26	-	-	0.25
Correlazione	1.00	1.00	-	-	1.00
Beta	1.00	1.00	-	-	1.00
Jensen alfa	-0.44	-0.44	-	-	-0.44
Maximum Drawdown (in %)	-13.90	-17.96	-	-	-17.96
Recovery Period (anni)	0.26	1.30	-	-	1.30

Performance



Informazioni sul prodotto

Numero di valore: 117189938
ISIN: CH1171899383
LEI: 254900Q154AKVWL8UQ41
Codice Bloomberg: SWAEIPC SW
Benchmark: MSCI World ex Switzerland ESG Leaders (TR)
Valuta: CHF
Domicilio: Svizzera
Data di lancio: 31/03/2022
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.
Politica di distribuzione: Capitalizzazione
Asset Manager in base al Swiss Life Best Select Invest Plus@: Swiss Life Asset Management 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
Quote spese operative TER KGAST ex ante: 0.21%
ex post al: 30/09/2024 0.32%

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 ex Svizzera ESG Indicizzate PM



Posizioni principali

	Gruppo d'investimento	Benchmark
NVIDIA CORP	7.84%	7.84%
MICROSOFT CORP	7.83%	7.83%
ALPHABET INC-CL A	2.67%	2.67%
ALPHABET INC-CL C	2.30%	2.30%
TESLA INC	2.21%	2.21%
ELI LILLY & CO	1.97%	1.97%
VISA INC-CLASS A SHARES	1.79%	1.79%
MASTERCARD INC - A	1.33%	1.33%
PROCTER & GAMBLE CO/THE	1.19%	1.19%
JOHNSON & JOHNSON	1.18%	1.18%

Struttura del portafoglio secondo il paese/regione

	Gruppo d'investimento	Benchmark
Stati Uniti	74.13%	74.10%
Giappone	6.07%	6.11%
Regno Unito	3.74%	3.75%
Canada	3.40%	3.42%
Francia	2.92%	2.92%
Paesi Bassi	1.73%	1.73%
Australia	1.40%	1.42%
Germania	1.33%	1.34%
Svezia	1.16%	1.16%
Danimarca	1.07%	1.07%
Italia	0.68%	0.68%
Spagna	0.58%	0.58%
Altri	1.71%	1.72%
Liquidità	0.08%	-

Struttura del portafoglio per settore

	Gruppo d'investimento	Benchmark
Tecnologia dell'informazione	26.02%	26.05%
Finanza	17.07%	17.06%
Beni voluttuari	10.81%	10.83%
Salute	10.39%	10.40%
Industrie	10.38%	10.40%
Servizi di comunicazione	8.31%	8.32%
Beni di prima necessità	6.63%	6.64%
Materiali	3.51%	3.47%
Energia	2.65%	2.64%
Immobili	2.33%	2.33%
Servizi di pubblica utilità	1.84%	1.86%
Liquidità	0.08%	-

Struttura del portafoglio secondo le valute

	Gruppo d'investimento	Benchmark
USD	74.51%	74.49%
EUR	7.74%	7.75%
JPY	6.14%	6.11%
GBP	3.76%	3.75%
CAD	3.41%	3.42%
AUD	1.41%	1.42%
DKK	1.07%	1.07%
SEK	0.91%	0.91%
HKD	0.51%	0.51%
Altri	0.56%	0.57%