

28 febbraio 2023

# Fondazione d'investimento Swiss Life

## Azioni Estero ESG PM

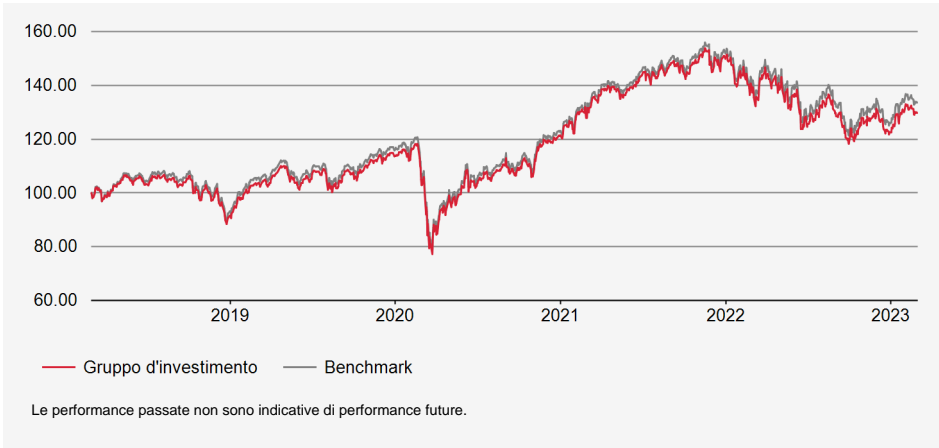


**Patrimonio netto (NAV) in mio. CHF: 340.83**  
**Valore d'inventario netto per diritto in CHF: 157.10**

### 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 straniera 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 e fondo Candriam Sustainable Equity Emerging Markets.

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



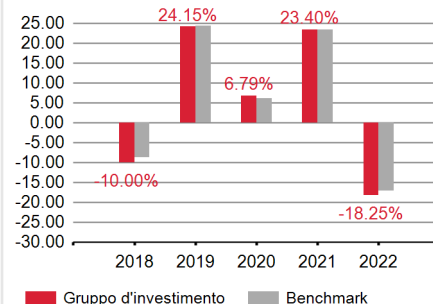
### Performance nella valuta di riferimento

	PERFORMANCE CUMULATA				PERFORMANCE ANNUALIZZATA			
	YTD	1 MESE	3 MESI	1 ANNO	3 ANNI	5 ANNI	10 ANNI	INIZIO
<b>GRUPPO D'INVESTIMENTO</b>	5.88%	-0.58%	-1.22%	-6.75%	8.01%	5.34%	7.97%	2.91%
<b>BENCHMARK</b>	6.08%	-0.59%	-1.11%	-5.65%	8.37%	5.95%	8.44%	3.42%

### Dati statistici (annualizzati)

	1 ANNO	3 ANNI	5 ANNI	10 ANNI	INIZIO
Volatilità Gruppo d'investimento (in %)	20.23	19.11	17.52	14.61	16.25
Volatilità del Benchmark (in %)	20.41	19.10	17.47	14.58	16.26
Tracking Error ex post (in %)	0.46	0.52	0.54	0.66	0.95
Information Ratio	-2.41	-0.70	-1.15	-0.72	-0.53
Sharpe Ratio	-0.35	0.43	0.33	0.56	0.18
Correlazione	1.00	1.00	1.00	1.00	1.00
Beta	0.99	1.00	1.00	1.00	1.00
Jensen alfa	-1.15	-0.37	-0.63	-0.48	-0.50

### Performance



### Informazioni sul prodotto

**Numero di valore:** 3026051  
**ISIN:** CH0030260514  
**LEI:** 2549000B6X3SG0K4LZ68  
**Codice Bloomberg:** SLAAUPM 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:** 31/05/2007  
**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)**  
 Candriam Investors Group  
**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/fondazioneinvestimento](http://www.swisslife.ch/fondazioneinvestimento)  
**Quote spese operative TER KGAST**  
**ex ante:** 0.37%  
**ex post al:** 30/09/2022 0.37%

**PM tranche:** L'acquisto di questa tranche è possibile solo nell'ambito di un accordo speciale con Swiss Life Asset Management SA.  
**Benchmark:** Fino al 31.03.2022 80% MSCI World ex CH in CHF, 15% MSCI AC World Small Cap in CHF, 5% MSCI Emerging Markets in CHF - Fino al 31.12.2009 100% MSCI World, ex CH, in CHF.  
**Asset Manager:** La selezione dei manager, il controllo permanente di questi ultimi e l'intero accompagnamento nel processo vengono effettuati da Swiss Life Asset Management SA in base a criteri oggettivi e alla migliore prassi istituzionale.  
**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.  
**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	20.54%	20.48%
FINANZA	15.41%	14.99%
SALUTE	12.64%	12.67%
BENI VOLUTTUARI	11.99%	11.75%
INDUSTRIE	11.92%	11.69%
BENI DI PRIMA NECESSITÀ	6.72%	6.97%
SERVIZI DI TELECOMUNICAZIONE	6.56%	6.74%
MATERIALI	4.80%	5.31%
ENERGIA	3.59%	3.80%
IMMOBILI	3.03%	3.58%
SERVIZI DI PUBBLICA UTILITÀ	1.81%	2.03%
LIQUIDITÀ	0.98%	-

### Struttura del portafoglio secondo il paese/regione

	Gruppo d'investimento	Benchmark
USA	63.03%	63.13%
GIAPPONE	6.36%	6.67%
GRAN BRETAGNA	4.61%	4.55%
FRANCIA	3.91%	3.73%
CANADA	3.16%	3.38%
GERMANIA	1.87%	1.77%
RESTO DELL'EUROPA	7.40%	7.11%
ALTRI PAESI ASIA	6.65%	7.20%
ALTRI	2.04%	2.45%
LIQUIDITÀ	0.98%	-

### Le principali posizioni

	Gruppo d'investimento	Benchmark
MICROSOFT CORP.	5.53%	5.55%
ALPHABET INC	3.23%	3.25%
NVIDIA	1.82%	1.83%
TESLA INC	1.73%	1.73%
JOHNSON & JOHNSON	1.27%	1.28%
VISA INC	1.12%	1.13%
PROCTER & GAMBLE	1.04%	1.04%
MASTERCARD INC	0.95%	0.96%
HOME DEPOT	0.94%	0.95%
MERCK & CO	0.87%	0.87%

### Ulteriori informazioni sulle società

Numero di società	7,512
Quota di società senza benchmark	3.81%