

30 settembre 2024

# Fondazione d'investimento Swiss Life

## Azioni Estero ESG PM

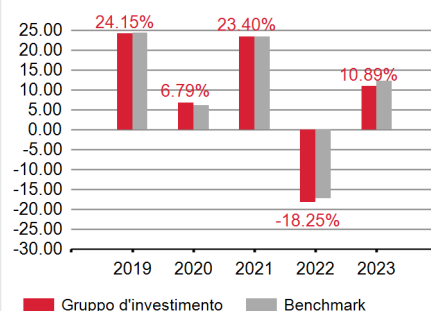


**Patrimonio netto (NAV) in mio. CHF: 473.76**  
**Valore d'inventario netto per diritto in CHF: 193.07**

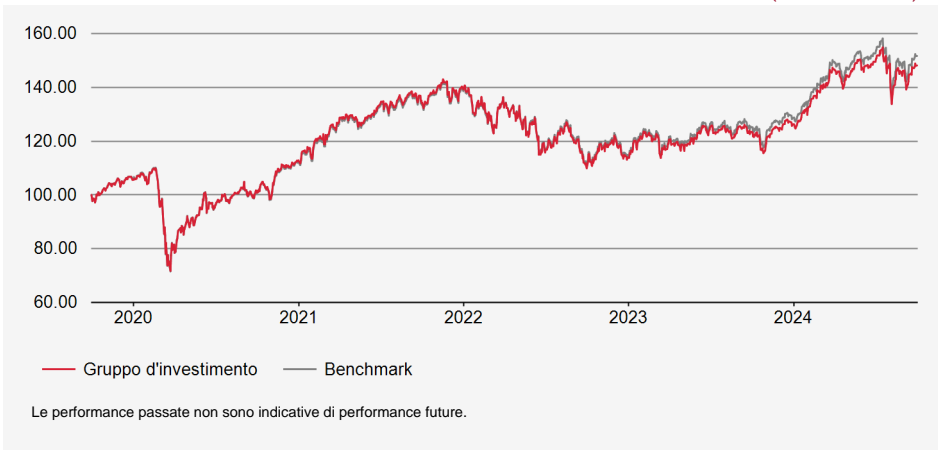
### Strategia d'investimento

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, Amundi Emerging Markets Equity Focus Fund e fondo Robeco Emerging Markets Equities.

### Performance



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



### 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:** 13.00  
**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/fondazioneinvestimento](http://www.swisslife.ch/fondazioneinvestimento)  
**Quote spese operative TER KGAST**  
**ex ante:** 0.38%  
**ex post al:** 30/09/2024 0.38%

### 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	17.35%	1.33%	-0.90%	20.04%	3.37%	8.17%	7.73%	3.87%
Benchmark	17.89%	1.61%	-0.62%	21.15%	4.35%	8.68%	8.26%	4.41%

### Dati statistici (annualizzati)

	1 anno	3 anni	5 anni	10 anni	Inizio
Volatilità Gruppo d'investimento (in %)	11.33	14.16	16.33	14.81	15.77
Volatilità del Benchmark (in %)	11.17	14.17	16.30	14.77	15.78
Tracking Error ex post (in %)	0.48	0.41	0.46	0.61	0.91
Information Ratio	-2.33	-2.39	-1.10	-0.87	-0.59
Sharpe Ratio	1.48	0.19	0.47	0.52	0.24
Correlazione	1.00	1.00	1.00	1.00	1.00
Beta	1.01	1.00	1.00	1.00	1.00
Jensen alfa	-1.38	-0.97	-0.52	-0.54	-0.53
Maximum Drawdown (in %)	-13.59	-23.15	-34.64	-34.64	-59.96
Recovery Period (anni)	-	1.47	0.67	0.67	7.75

**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	23.59%	25.11%
Finanza	15.70%	15.28%
Industrie	13.28%	11.86%
Beni voluttuari	11.46%	11.25%
Salute	10.45%	10.64%
Servizi di comunicazione	6.79%	7.38%
Beni di prima necessità	5.68%	5.99%
Materiali	4.53%	4.50%
Immobili	3.44%	3.22%
Energia	2.82%	2.80%
Servizi di pubblica utilità	1.82%	1.97%
Liquidità	0.40%	-

## Le principali posizioni

	Gruppo d'investimento	Benchmark
MICROSOFT CORP	5.88%	6.78%
NVIDIA CORP	5.78%	6.67%
ALPHABET INC	3.52%	4.06%
TESLA INC	1.45%	1.68%
ELI LILLY & CO	1.38%	1.60%
VISA INC	0.84%	0.97%
MASTERCARD INC	0.80%	0.91%
PROCTER & GAMBLE CO/THE	0.79%	0.91%
HOME DEPOT INC/THE	0.78%	0.90%
JOHNSON & JOHNSON	0.75%	0.87%

## Struttura del portafoglio secondo il paese/regione

	Gruppo d'investimento	Benchmark
USA	66.65%	67.84%
Giappone	6.30%	6.73%
Gran Bretagna	4.19%	3.67%
Canada	2.79%	3.11%
Francia	2.55%	2.55%
Germania	1.16%	1.00%
Resto dell'Europa	6.95%	6.23%
Altri paesi Asia	6.16%	6.29%
Altri	2.84%	2.56%
Liquidità	0.40%	-

## Struttura del portafoglio secondo le valute

	Gruppo d'investimento	Benchmark
USD	67.87%	68.03%
EUR	7.41%	6.90%
JPY	6.32%	6.73%
GBP	4.29%	3.68%
CHF	0.47%	0.21%
Altri	13.63%	14.43%

## Ulteriori informazioni sulle società

Numero di società	7,778
Quota di società senza benchmark	6.07%