

# Fondazione d'investimento Swiss Life

## Azioni Emerging Markets ESG PM

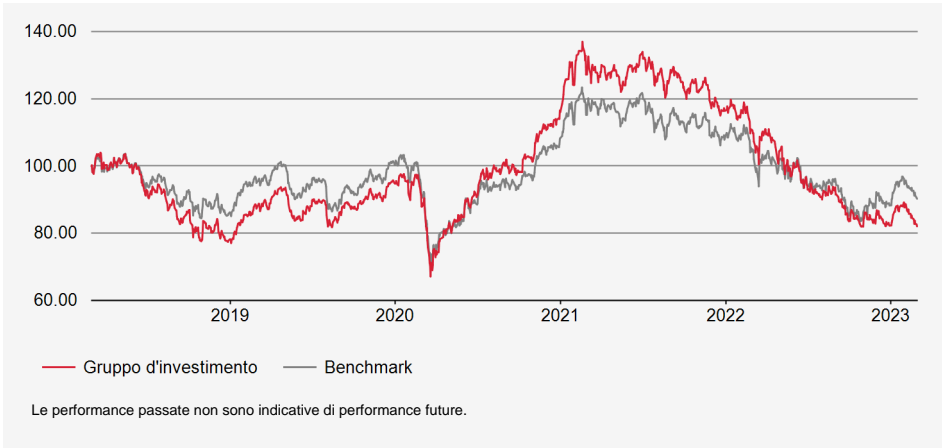


**Patrimonio netto (NAV) in mio. CHF: 193.81**  
**Valore d'inventario netto per diritto in CHF: 79.93**

### Strategia d'investimento

Investimenti in titoli di partecipazione di società domiciliate in Paesi emergenti. Selezione attiva di Paesi, settori e titoli. Limitazione per società: 5% Società straniere al benchmark: max. 15%. Realizzazione tramite Candriam Sustainable Equity Emerging Markets; SICAV di diritto lussemburghese secondo l'OICVM.

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



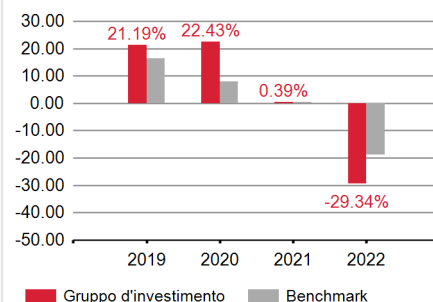
### Performance nella valuta di riferimento

	PERFORMANCE CUMULATA				PERFORMANCE ANNUALIZZATA			
	YTD	1 MESE	3 MESI	1 ANNO	3 ANNI	5 ANNI	10 ANNI	INIZIO
<b>GRUPPO D'INVESTIMENTO</b>	-0.34%	-6.44%	-4.54%	-25.92%	-2.29%	-3.88%	-	-4.31%
<b>BENCHMARK</b>	2.21%	-4.60%	-2.14%	-13.46%	-0.11%	-2.03%	-	-2.59%

### Dati statistici (annualizzati)

	1 ANNO	3 ANNI	5 ANNI	10 ANNI	INIZIO
Volatilità Gruppo d'investimento (in %)	17.67	19.47	18.10	-	17.98
Volatilità del Benchmark (in %)	19.56	18.72	17.21	-	17.11
Tracking Error ex post (in %)	6.51	6.18	5.72	-	5.67
Information Ratio	-1.91	-0.35	-0.32	-	-0.30
Sharpe Ratio	-1.70	-0.10	-0.19	-	-0.21
Correlazione	0.94	0.95	0.95	-	0.95
Beta	0.85	0.99	1.00	-	1.00
Jensen alfa	-14.45	-2.17	-1.85	-	-1.73

### Performance



### Informazioni sul prodotto

**Numero di valore:** 39561964  
**ISIN:** CH0395619643  
**LEI:** 254900OLXTUB1EYJLV86  
**Codice Bloomberg:** SWLAEPM SW  
**Benchmark:** MSCI Emerging Markets, in CHF  
**Moneta:** CHF  
**Domicilio:** Svizzera  
**Data di creazione:** 31/01/2018  
**Prezzo di prima emissione:** 100.00  
**Chiusura d'esercizio:** 30.09  
**Emissione/Riscatto:** giornalmente  
**Termine d'accettazione:** 11.00  
**Commissione d'emissione/riscatto:** nessuna  
**Prassi di distribuzione:** Capitalizzazione  
**Asset Manager in base al Swiss Life Best Select Invest Plus@:** Candriam Investors Group

**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](http://www.swisslife.ch/fondazioneinvestimento)  
**Quote spese operative TER KGAST ex ante:** 0.55%  
**ex post al:** 30/09/2022 0.55%

**PM tranche:** L'acquisto di questa tranche è possibile solo nell'ambito di un accordo speciale con Swiss Life Asset Management SA.

**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.

# Fondazione d'investimento Swiss Life

## Azioni Emerging Markets ESG PM

### Struttura del portafoglio per settore

	Gruppo d'investimento	Benchmark
FINANZA	26.20%	21.83%
TECNOLOGIA DELL'INFORMAZIONE	19.95%	20.21%
BENI VOLUTTUARI	15.17%	13.60%
INDUSTRIE	9.05%	5.98%
SERVIZI DI TELECOMUNICAZIONE	8.40%	10.08%
SALUTE	6.01%	3.88%
BENI DI PRIMA NECESSITÀ	5.77%	6.33%
MATERIALI	2.95%	8.74%
SERVIZI DI PUBBLICA UTILITÀ	1.34%	2.60%
IMMOBILI	-	1.98%
ENERGIA	-	4.77%
LIQUIDITÀ	5.16%	-

### Struttura del portafoglio secondo il paese/regione

	Gruppo d'investimento	Benchmark
CINA	30.76%	32.12%
TAIWAN	13.77%	15.23%
INDIA	13.50%	13.18%
COREA	9.53%	11.71%
BRASILIE	6.66%	5.04%
AFRICA DEL SUD	1.72%	3.52%
ALTRI PAESI ASIA	10.32%	6.22%
ALTRI PAESI EMEA	2.76%	9.39%
ALTR PAESI AMERICA	5.82%	3.58%
LIQUIDITÀ	5.16%	-

### Le principali posizioni

	Gruppo d'investimento	Benchmark
TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFACTURING CO LTD	8.00%	6.47%
ALIBABA GROUP HOLDING LTD	4.02%	2.56%
PING AN INSURANCE GROUP CO OF CHINA LTD	2.81%	0.74%
NETEASE INC	2.75%	0.48%
INFOSYS LTD	2.62%	0.95%
SK HYNIX INC	2.41%	0.58%
HOUSING DEVELOPMENT FINANCE CORP LTD	2.34%	0.85%
GRUPO FINANCIERO BANORTE SAB DE CV	2.34%	0.34%
AMERICA MOVIL SAB DE CV	2.16%	0.45%
DELTA ELECTRONICS INC	2.05%	0.29%

### Ulteriori informazioni sulle società

Numero di società	78
Quota di società senza benchmark	9.40%