

31 agosto 2024

Fondazione d'investimento Swiss Life

Azioni Global ESG PM

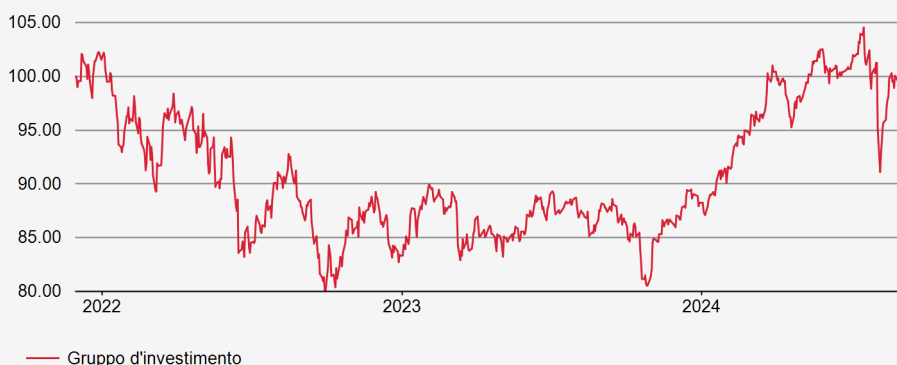


Patrimonio netto (NAV) in mio. CHF: 3.55
Valore d'inventario netto per diritto in CHF: 100.42

Strategia d'investimento

Il gruppo d'investimento persegue una strategia core-satellite. La parte "core" del portafoglio, con circa il 70%, viene gestita attivamente, investe in prevalenza in large e mid cap e si contraddistingue per un forte profilo ESG. L'attuazione compete a Swiss Life Funds (LUX) Equity ESG Global. La parte "satellite" del portafoglio, con circa il 30%, investe prevalentemente in small e mid cap che realizzano la maggior parte dei loro introiti tramite prodotti e servizi che promuovono la sostenibilità ambientale. I satelliti vengono implementati, per circa il 10% ciascuno, da Swiss Life Funds (LUX) Equity Climate Impact, Swiss Life Funds (LUX) Equity Green Buildings & Infrastructure Impact e Swiss Life Funds (LUX) Equity Environment & Biodiversity Impact. Le percentuali possono oscillare all'interno di margini prestabiliti. Il limite per società ammonta al 5%.

Evoluzione del valore nella valuta di riferimento (base 100)



Le performance passate non sono indicative di performance future.

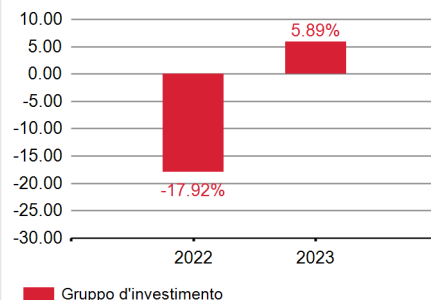
Performance nella valuta di riferimento

	Performance cumulata				Performance annualizzata			
	YTD	1 mese	3 mesi	1 anno	3 anni	5 anni	10 anni	Inizio
Gruppo d'investimento	13.79%	-0.82%	-0.52%	14.20%	-	-	-	0.15%

Dati statistici (annualizzati)

	1 anno	3 anni	5 anni	10 anni	Inizio
Volatilità Gruppo d'investimento (in %)	12.43	-	-	-	15.25
Sharpe Ratio	0.95	-	-	-	-0.04
Maximum Drawdown (in %)	-12.85	-	-	-	-21.73
Recovery Period (anni)	-	-	-	-	1.64

Performance



Informazioni sul prodotto

Numero di valore: 113873878
ISIN: CH1138738781
LEI: 254900RNJ8UYJ3OTB72
Codice Bloomberg: SWAGEPC SW
Moneta: CHF
Domicilio: Svizzera
Data di creazione: 30/11/2021
Prezzo di prima emissione: 100.00
Chiusura d'esercizio: 30.9
Emissione/Riscatto: giornalmente
Termine d'accettazione: 13.00
Commissione d'emissione / riscatto: nessuna
Prassi di distribuzione: Capitalizzazione
Asset Manager: Swiss Life Asset Management SA
Pubblicazioni di corsi: Bloomberg: ASSL
www.swisslife.ch/fondazioneinvestimento
Quote spese operative TER KGAST ex ante: 0.24%
ex post al: 30/09/2023 0.24%

PM tranche: Il cerchio degli investitori è limitato a investitori qualificati, che hanno stipulato un contratto di gestione patrimoniale o un altro contratto di servizi finanziari a titolo oneroso con Swiss Life Asset Management SA oppure con una società appartenente al gruppo Swiss Life.

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.

Struttura del portafoglio per settore

	Gruppo d'investimento
Tecnologia dell'informazione	23.20%
Industrie	17.97%
Finanza	10.62%
Salute	9.35%
Beni voluttuari	8.86%
Servizi di comunicazione	6.81%
Beni di prima necessità	4.86%
Servizi di pubblica utilità	4.34%
Immobili	4.03%
Materiali	3.05%
Energia	2.84%
Liquidità	2.55%
Equity index future	1.46%

Struttura del portafoglio secondo il paese/regione

	Gruppo d'investimento
USA e Canada	63.37%
Regione Asia e Pacifico	11.51%
Regione Europea (EUR)	10.69%
Regione Europea (Ex EUR)	9.20%
Future su indice azionario	1.46%
Mercati Emergenti Asia Pacifico	0.63%
Mercati Emergenti Medio Oriente	0.44%
Norway	0.05%
Altri	0.04%
Liquidità	2.55%

Posizioni principali

	Gruppo d'investimento
NVIDIA CORP	3.81%
APPLE INC	3.31%
MICROSOFT CORP	2.99%
ALPABET INC-CL	1.70%
AMAZON.COM INC	1.33%
JPMORGAN CHASE & CO	0.84%
META PLATFORMS INC-CLASS A	0.83%
NOVO NORDISK A/S-B	0.65%
COSTCO WHOLESALE CORP	0.58%
ENPHASE ENERGY INC	0.58%

Struttura del portafoglio secondo le valute

	Gruppo d'investimento
USD	60.19%
EUR	12.46%
JPY	8.37%
GBP	3.22%
CHF	2.48%
Altri	13.21%