

# Fondazione d'investimento Swiss Life

## Azioni Emerging Markets PM

### 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 straniera al benchmark: max. 15%
- Realizzazione tramite Candriam Equities L Emerging Markets; SICAV di diritto lussemburghese secondo l'OICVM

### Informazioni sul prodotto

Numero di valore	39561964
ISIN	CH0395619643
LEI	2549000LXTUB1EYJLV86
Bloomberg Ticker	SWLAEPM SW
Benchmark	MSCI Emerging Markets, in CHF
Moneta	CHF
Data di lancio	31.01.2018
Prezzo di prima emissione	100.00
Chiusura d'esercizio	30.09.
Emissione/Riscatto	giornalmente
Termine di accettazione *	11.00

Asset Manager in base al  
Swiss Life Select Invest Plus® \*\*

Candriam Investors Group

Consulenza esterna

PPCmetrics fornisce i seguenti servizi:  
consulenza sulle strutture idonee 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<sub>KGAST</sub> \*\*\*

- ex ante 0.55%

- ex post al 30.09.2019 0.55%

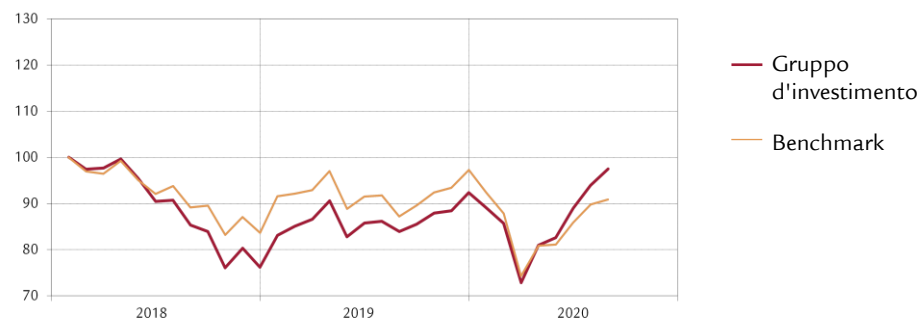
Commissione d'emissione/riscatto nessuna  
Prassi di distribuzione accumulazione

\* L'acquisto di questa tranche è possibile solo  
nell'ambito di un accordo speciale on Swiss Life  
Asset Managers

\*\* 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

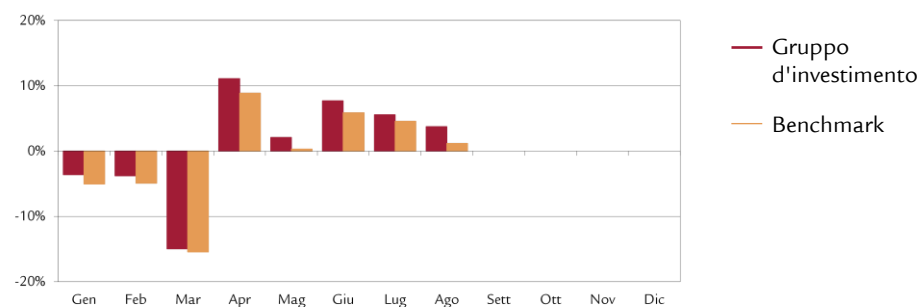
\*\*\* La quota spese operative TER<sub>KGAST</sub> copre tutti i  
costi, eccezione fatta per i costi di transazione e i  
tributi fiscali legati alla transazione

### Evoluzione del valore indicizzata e performance



Performance	1M	3M	1A	3A p.a.	5A p.a.	p.a. dal 31.01.18
Gruppo d'investimento (in %)	3.74	17.99	16.12			-0.99
Benchmark (in %)	1.17	12.03	4.19			-3.64
	YTD	2019	2018	2017	2016	2015
Gruppo d'investimento (in %)	5.54	21.19				
Benchmark (in %)	-6.59	16.34				

### Performance mensile



### Dati statistici (annualizzati)

	1A	3A	5A	dal 31.01.18
Volatilità del gruppo d'investimento (in %)	23.11			19.61
Volatilità Benchmark (in %)	22.30			18.25
Tracking Error ex post (in %)	3.87			4.64
Tracking Error ex ante (in %)	4.70			
Information Ratio	3.08			0.57
Sharpe Ratio	0.68			-0.01
Correlazione	0.99			0.97
Beta	1.02			1.04
Jensen-Alpha	10.74			2.85
Maximum Drawdown (in %)	-31.22			-35.43
Recovery Period (anni)	0.31			-

### Cifre salienti (in CHF)

	31.12.2019	31.08.2020
Patrimonio in milioni CHF	63.0	87.8
Valore d'inventario netto per quota in CHF	92.35	97.47

# Fondazione d'investimento Swiss Life

## Azioni Emerging Markets PM



### Struttura del portafoglio secondo il paese/regione

	Gruppo d'investimento	Benchmark
Cina	43.5%	42.4%
Corea	13.1%	11.6%
Taiwan	10.7%	12.3%
India	7.4%	8.1%
Brasile	6.1%	4.8%
Africa del sud	4.1%	3.5%
Altri paesi Asia	3.1%	5.8%
Altri paesi EMEA	5.5%	8.8%
Altr paesi America	3.4%	2.7%
Liquidità	3.1%	-
Totale	100.0%	100.0%

### Maggiori posizioni azionarie

	Gruppo d'investimento	Benchmark
Taiwan Semiconductor Manufacture	4.6%	5.5%
Tencent Holdings Ltd	4.5%	6.1%
Samsung Electronics Co Ltd	3.5%	3.4%
Alibaba Group Holding	3.0%	8.3%
Meituan Dianping-Class B	2.6%	1.8%
Naspers Ltd-N Shs	2.5%	1.2%
Reliance Industries Ltd	2.0%	1.2%
Alibaba Group Holding Ltd	1.9%	0.0%
JD.Com Inc	1.8%	1.0%
China Construction Bank-H	1.5%	1.1%

### Struttura del portafoglio per settore

	Gruppo d'investimento	Benchmark
Tecnologia dell'informazione	17.9%	17.4%
Financials	15.2%	17.7%
Beni voluttuari	20.7%	19.6%
Materie prime	10.0%	7.0%
Energia	5.6%	5.7%
Industrie	7.6%	4.4%
Salute	4.4%	4.5%
Beni di prima necessità	2.5%	6.2%
Immobili	2.1%	2.4%
Servizi di telecomunicazione	10.0%	13.1%
Servizi di pubblica utilità	0.9%	2.0%
Liquidità	3.1%	-
Totale	100.0%	100.0%

### Ulteriori informazioni sulle società

Numero di società	154
Numero di società non benchmark	7.6%

#### Disclaimer

La presente pubblicazione non rappresenta né un invito, né una raccomandazione ad acquistare o vendere strumenti d'investimento, ma funge meramente da veicolo informativo. È possibile richiedere gratuitamente tutti i documenti che costituiscono la base giuridica di un eventuale investimento presso la Fondazione d'investimento Swiss Life, 8022 Zurigo, telefono 043 284 79 79. La cerchia degli investitori è limitata alle istituzioni del secondo pilastro e del pilastro 3a, nonché istituzioni esonerate dall'obbligo tributario, con sede in Svizzera e che secondo l'oggetto sociale perseguono la previdenza professionale e persone che gestiscono investimenti collettivi per queste istituzioni, sono sorvegliate dall'Autorità federale di vigilanza sui mercati finanziari e che investono presso la fondazione esclusivamente capitali per queste istituzioni che hanno concluso un accordo speciale on Swiss Life Asset Managers.

La performance precedente non rappresenta un indicatore né per l'evoluzione attuale, né per quella futura. I dati relativi alla performance non prendono in considerazione le commissioni e le spese riscosse al momento dell'emissione e del riscatto delle quote.