

28 febbraio 2023

Fondazione d'investimento Swiss Life

Azioni Global Small Caps

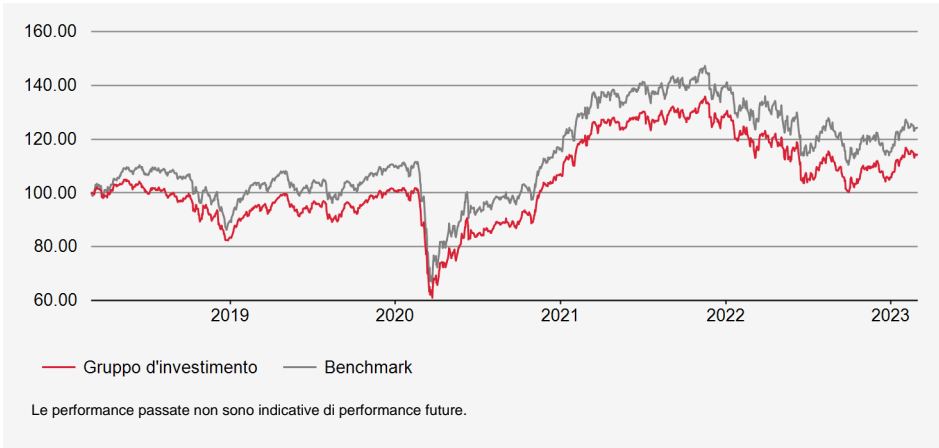


Patrimonio netto (NAV) in mio. CHF: 219.22
Valore d'inventario netto per diritto in CHF: 114.28

Strategia d'investimento

Investimenti in titoli di partecipazione di società a piccola capitalizzazione a livello mondiale. Selezione attiva di Paesi, settori e titoli. Limitazione per società: 5%. Realizzazione tramite Invesco Global Small Cap Equity Fund e Dimensional Global Small Cap Equity Fund.

Evoluzione del valore nella valuta di riferimento (base 100)



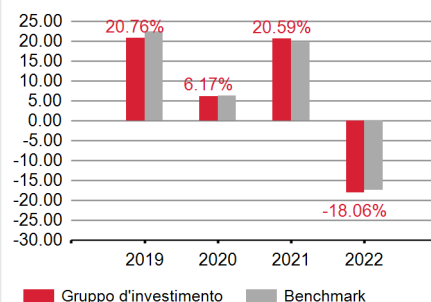
Performance nella valuta di riferimento

	PERFORMANCE CUMULATA				PERFORMANCE ANNUALIZZATA			
	YTD	1 MESE	3 MESI	1 ANNO	3 ANNI	5 ANNI	10 ANNI	INIZIO
GRUPPO D'INVESTIMENTO	8.07%	0.79%	2.36%	-4.34%	9.12%	2.70%	-	2.70%
BENCHMARK	7.90%	-0.17%	1.50%	-4.54%	8.62%	4.44%	-	4.44%

Dati statistici (annualizzati)

	1 ANNO	3 ANNI	5 ANNI	10 ANNI	INIZIO
Volatilità Gruppo d'investimento (in %)	21.86	23.45	21.01	-	21.01
Volatilità del Benchmark (in %)	22.16	23.13	20.68	-	20.68
Tracking Error ex post (in %)	2.34	2.06	2.57	-	2.57
Information Ratio	0.09	0.25	-0.68	-	-0.68
Sharpe Ratio	-0.20	0.39	0.15	-	0.15
Correlazione	0.99	1.00	0.99	-	0.99
Beta	0.98	1.01	1.01	-	1.01
Jensen alfa	0.11	0.42	-1.78	-	-1.78

Performance



Informazioni sul prodotto

Numero di valore: 40068789
ISIN: CH0400687890
LEI: 254900XCUD9NTWJQU706
Codice Bloomberg: SWLAGSC SW
Benchmark: MSCI AC World Small Cap, in CHF
Moneta: CHF
Domicilio: Svizzera
Data di creazione: 28/02/2018
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@: 50% Invesco / 50% Dimensional
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
Quote spese operative TER KGAST ex ante: 0.92%
ex post al: 30/09/2022 0.92%

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 Global Small Caps

Struttura del portafoglio per settore

	Gruppo d'investimento	Benchmark
INDUSTRIE	20.60%	19.67%
FINANZA	15.98%	13.86%
BENI VOLUTTUARI	14.35%	12.86%
TECNOLOGIA DELL'INFORMAZIONE	12.90%	11.59%
SALUTE	9.44%	10.07%
MATERIALI	6.79%	8.09%
IMMOBILI	5.62%	8.76%
ENERGIA	4.90%	4.59%
BENI DI PRIMA NECESSITÀ	3.53%	4.62%
SERVIZI DI TELECOMUNICAZIONE	2.74%	3.03%
SERVIZI DI PUBBLICA UTILITÀ	2.05%	2.88%
LIQUIDITÀ	1.09%	-

Struttura del portafoglio secondo il paese/regione

	Gruppo d'investimento	Benchmark
USA	57.19%	56.39%
GIAPPONE	8.32%	10.29%
GRAN BRETAGNA	5.83%	5.13%
FRANCIA	2.69%	1.33%
CANADA	2.29%	3.67%
GERMANIA	2.25%	1.69%
RESTO DELL'EUROPA	11.15%	9.47%
ALTRI PAESI ASIA	5.42%	7.53%
ALTRI	3.78%	4.49%
LIQUIDITÀ	1.09%	-

Le principali posizioni

	Gruppo d'investimento	Benchmark
WEATHERFORD INTERNAT USD 0001	0.80%	0.03%
VISTEON CORP COMMON	0.50%	0.03%
COFACE	0.49%	0.01%
CACTUS INC CLASS A COMMON STOCK	0.49%	0.02%
SAIPEM SPA NPV	0.43%	0.01%
AVANTAX INC COMMON	0.43%	0.01%
WILLSCOT MOBILE MINI COMMON	0.40%	0.07%
OXFORD INDS INC COMMON	0.40%	0.01%
PRIMERICA INC COMMON	0.39%	0.04%
GAMING&LEISURE PPTYS	0.37%	-

Ulteriori informazioni sulle società

Numero di società	6,747
Quota di società senza benchmark	22.02%