

Fondazione d'investimento Swiss Life

Azioni Svizzera Small & Mid Caps

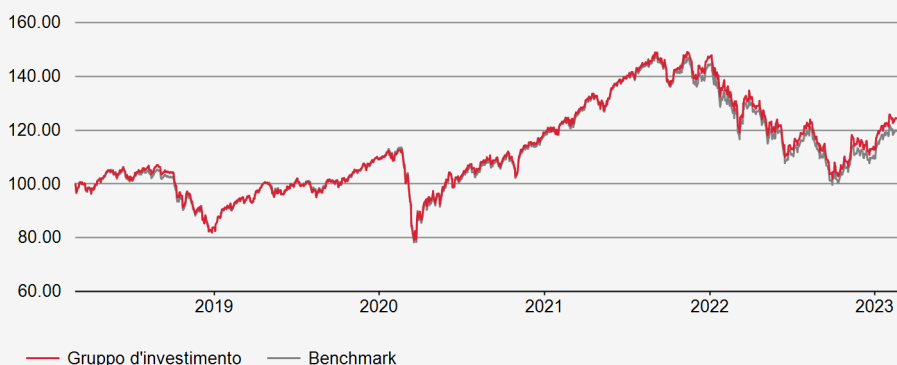


Patrimonio netto (NAV) in mio. CHF: 96.05
Valore d'inventario netto per diritto in CHF: 119.86

Strategia d'investimento

Investimenti in titoli di partecipazione di società rappresentate allo Swiss Performance Index Extra. Selezione attiva di settori e titoli. Limitazione per società: 5% (eccezione: se rappresentati nel benchmark; max. 5%-punti in più della ponderazione del benchmark). Realizzazione tramite Swiss Life iFunds (CH) Equity Switzerland Small & Mid Cap (CHF); Fondi d'investimento di diritto svizzero della categoria "altri fondi per investimenti tradizionali".

Evoluzione del valore nella valuta di riferimento (base 100)



Le performance passate non sono indicative di performance future.

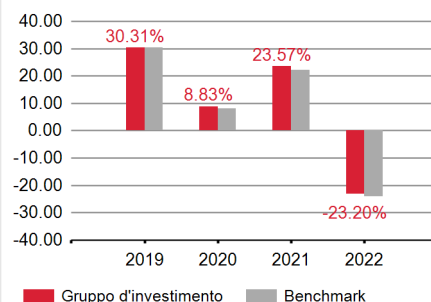
Performance nella valuta di riferimento

| | PERFORMANCE CUMULATA | | | | PERFORMANCE ANNUALIZZATA | | | |
|------------------------------|----------------------|--------|--------|--------|--------------------------|--------|---------|--------|
| | YTD | 1 MESE | 3 MESI | 1 ANNO | 3 ANNI | 5 ANNI | 10 ANNI | INIZIO |
| GRUPPO D'INVESTIMENTO | 9.62% | 1.88% | 7.96% | -5.47% | 7.24% | 4.33% | - | 3.63% |
| BENCHMARK | 9.17% | 1.47% | 7.54% | -6.58% | 5.95% | 3.63% | - | 2.91% |

Dati statistici (annualizzati)

| | 1 ANNO | 3 ANNI | 5 ANNI | 10 ANNI | INIZIO |
|---|--------|--------|--------|---------|--------|
| Volatilità Gruppo d'investimento (in %) | 20.13 | 18.20 | 16.89 | - | 16.82 |
| Volatilità del Benchmark (in %) | 19.77 | 18.30 | 16.85 | - | 16.78 |
| Tracking Error ex post (in %) | 1.21 | 1.53 | 1.50 | - | 1.48 |
| Information Ratio | 0.92 | 0.84 | 0.47 | - | 0.48 |
| Sharpe Ratio | -0.28 | 0.41 | 0.29 | - | 0.25 |
| Correlazione | 1.00 | 1.00 | 1.00 | - | 1.00 |
| Beta | 1.02 | 0.99 | 1.00 | - | 1.00 |
| Jensen alfa | 1.22 | 1.35 | 0.71 | - | 0.73 |

Performance



Informazioni sul prodotto

Numero di valore: 39561890
ISIN: CH0395618900
LEI: 254900QGENUS1GIJ4549
Codice Bloomberg: SWLASM SW
Benchmark: SPI Extra TR Index (CHF)
Moneta: CHF
Domicilio: Svizzera
Data di creazione: 01/02/2018
Prezzo di prima emissione: 100.00
Chiusura d'esercizio: 30.09
Emissione/Riscatto: giornalmente
Termine d'accettazione: 14.30
Commissione d'emissione/riscatto: nessuna
Prassi di distribuzione: Capitalizzazione
Asset Manager in base al Swiss Life Best Select Invest Plus®: Privatbank Von Graffenried AG

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: 0.95%
ex post al: 30/09/2022 0.95%

Struttura del portafoglio per settore

| | Gruppo d'investimento | Benchmark |
|-----------------------------|-----------------------|-----------|
| INDUSTRIE | 39.40% | 36.53% |
| GENERI DI CONSUMO | 15.20% | 15.82% |
| FINANZA | 15.17% | 23.19% |
| SALUTE | 11.14% | 12.59% |
| TECNOLOGIA | 6.68% | 3.97% |
| MATERIALI DI BASE | 2.92% | 3.16% |
| SERVIZI PER IL CONSUMATORE | 2.19% | 3.13% |
| SERVIZI DI PUBBLICA UTILITÀ | 2.18% | 1.03% |
| PETROLIO E GAS | - | - |
| TELECOMUNICAZIONI | - | 0.58% |
| LIQUIDITÀ | 5.12% | - |

Le principali posizioni

| | Gruppo d'investimento | Benchmark |
|---------------------------------|-----------------------|-----------|
| LINDT & SPRÜNGLI (PS) | 5.82% | 3.46% |
| STRAUMANN HOLDING AG | 4.91% | 4.54% |
| JULIUS BAER GROUP LTD | 4.73% | 4.29% |
| KUEHNE + NAGEL INTERNATIONAL AG | 4.71% | 4.30% |
| SCHINDLER HOLDING AG (PS) | 4.24% | 2.77% |
| SGS SA | 3.96% | 4.21% |
| VAT GROUP AG | 3.50% | 2.46% |
| BALOISE HOLDING AG | 3.07% | 2.31% |
| SIG GROUP AG | 2.91% | 2.54% |
| BARRY CALLEBAUT AG | 2.91% | 2.15% |

Struttura del portafoglio in base al volume dell'impresa

| | Gruppo d'investimento | | Benchmark | |
|-----------------|-----------------------|--------|-----------|--------|
| | Partecip. | Numero | Partecip. | Numero |
| Grandi imprese | 10.15% | 3 | 8.75% | 2 |
| Medie imprese | 81.52% | 45 | 81.45% | 78 |
| Piccole imprese | 3.20% | 5 | 9.80% | 117 |
| Liquidità | 5.12% | - | - | - |