

Fondazione d'investimento Swiss Life
Azioni Global Small Caps ex Svizzera Indicizzate PM

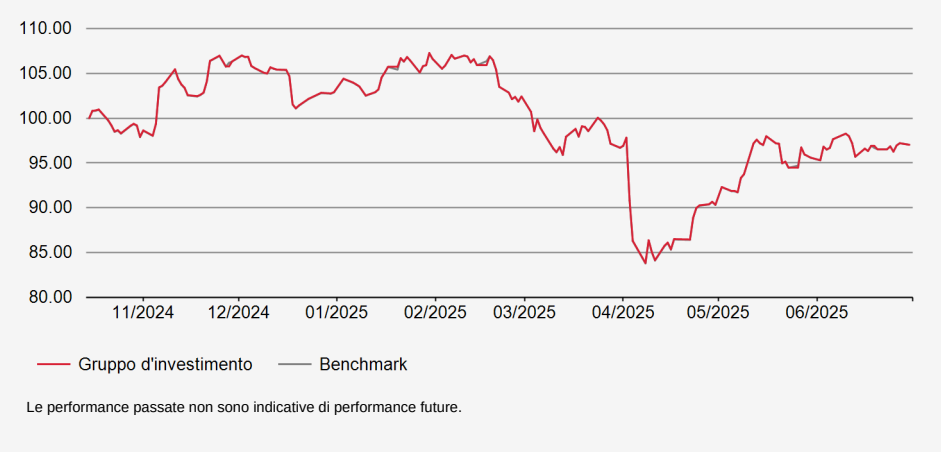


Patrimonio netto (NAV) in mio. CHF: 119.87
Valore d'inventario netto per diritto in CHF: 970.33

Strategia d'investimento

Il gruppo d'investimento viene gestito con un approccio indicizzato e si contraddistingue per l'ampia diversificazione e il tracking error minimo. L'obiettivo d'investimento consiste nel replicare al meglio il benchmark MSCI World ex Switzerland Small Cap Total Return. Realizzazione tramite Swiss Life Index Funds II (CH) Equity Global Small Cap ex Switzerland PF; fondo d'investimento contrattuale di diritto svizzero del tipo "altri fondi per investimenti tradizionali". Non viene effettuato securities lending e non vengono effettuati investimenti in titoli che l'Associazione svizzera per gli investimenti responsabili (www.svvk-asir.ch) raccomanda di escludere.

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	-5.70%	1.50%	0.33%	-	-	-	-	-
Benchmark	-5.66%	1.52%	0.36%	-	-	-	-	-

Dati statistici
(annualizzati)

	1 anno	3 anni	5 anni	10 anni	Inizio
Volatilità Gruppo d'investimento (in %)	-	-	-	-	18.35
Volatilità del Benchmark (in %)	-	-	-	-	18.39
Tracking Error ex post (in %)	-	-	-	-	0.07
Information Ratio	-	-	-	-	-0.16
Sharpe Ratio	-	-	-	-	-0.24
Correlazione	-	-	-	-	1.00
Beta	-	-	-	-	1.00
Jensen alfa	-	-	-	-	-0.02
Maximum Drawdown (in %)	-	-	-	-	-21.83
Recovery Period (anni)	-	-	-	-	-

Performance

Storia insufficiente di dati

Informazioni sul prodotto

Numero di valore: 137660515
ISIN: CH1376605155
LEI: 254900CCBGYEX2MIC497
Codice Bloomberg: SLAISCP SW
Benchmark: MSCI World ex Switzerland Small Cap Total Return
Valuta: CHF
Domicilio: Svizzera
Data di lancio: 15/10/2024
Prezzo di prima emissione: 1000.00
Chiusura d'esercizio: 30.09
Emissione/Riscatto: giornalmente
Termine d'accettazione: 14:00 (G-1)
Protezione contro la diluizione: Commissione di emissione / riscatto a favore del gruppo d'investimento secondo la panoramica delle condizioni.
Asset Manager in base al Swiss Life Best Select Invest Plus®: Swiss Life Asset Management SA
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/fondazionedinvestimento
Quote spese operative TER KGAST ex ante: 0.02%

PM tranches: L'acquisto di questa tranche è possibile solo nell'ambito di un accordo speciale con Swiss Life Asset Management SA.
Asset Manager: La selezione del 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.
Protezione contro la diluizione: Panoramica delle condizioni: www.swisslife.ch/fondazionedinvestimento, «Documenti giuridici» (modifiche possibili in qualsiasi momento senza preavviso).
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 ex Svizzera Indicizzate PM

Posizioni principali

	Gruppo d'investimento	Benchmark
FLEX LTD	0.22%	0.22%
SOFI TECHNOLOGIES INC	0.22%	0.22%
COMFORT SYSTEMS USA INC	0.22%	0.22%
CASEY'S GENERAL STORES INC	0.22%	0.22%
GUIDEWIRE SOFTWARE INC	0.21%	0.22%
CURTISS-WRIGHT CORP	0.21%	0.21%
INSMED INC	0.21%	0.21%
TAPESTRY INC	0.21%	0.21%
US FOODS HOLDING CORP	0.20%	0.20%
AFFIRM HOLDINGS INC	0.20%	0.20%

Struttura del portafoglio secondo il paese/regione

	Gruppo d'investimento	Benchmark
Stati Uniti	61.41%	61.53%
Giappone	12.78%	12.82%
Regno Unito	5.06%	5.06%
Canada	3.78%	3.77%
Australia	3.61%	3.60%
Svezia	1.98%	1.98%
Germania	1.67%	1.66%
Israele	1.47%	1.47%
Francia	1.26%	1.27%
Italia	1.24%	1.25%
Norvegia	0.78%	0.77%
Singapore	0.71%	0.70%
Altri	4.17%	4.11%
Liquidità	0.09%	-

Struttura del portafoglio per settore

	Gruppo d'investimento	Benchmark
Industrie	20.27%	20.38%
Finanza	16.13%	16.14%
Beni voluttuari	12.78%	12.90%
Tecnologia dell'informazione	11.38%	11.39%
Salute	8.87%	8.82%
Immobili	7.89%	7.84%
Materiali	7.09%	7.11%
Beni di prima necessità	4.66%	4.66%
Energia	4.27%	4.26%
Servizi di comunicazione	3.72%	3.70%
Servizi di pubblica utilità	2.83%	2.81%
Liquidità	0.09%	-

Struttura del portafoglio secondo le valute

	Gruppo d'investimento	Benchmark
USD	61.64%	61.83%
JPY	12.81%	12.82%
EUR	6.94%	6.90%
GBP	5.08%	5.06%
CAD	3.79%	3.77%
AUD	3.63%	3.60%
SEK	1.94%	1.93%
ILS	1.29%	1.28%
NOK	0.79%	0.77%
Altri	2.10%	2.05%