31 marzo 2024

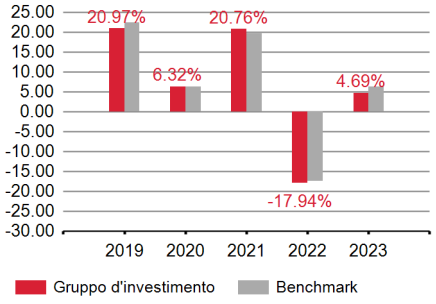
Fondazione d'investimento Swiss Life Azioni Global Small Caps PM

Patrimonio netto (NAV) in mio. CHF: 246.27
Valore d'inventario netto per diritto in CHF: 124.63

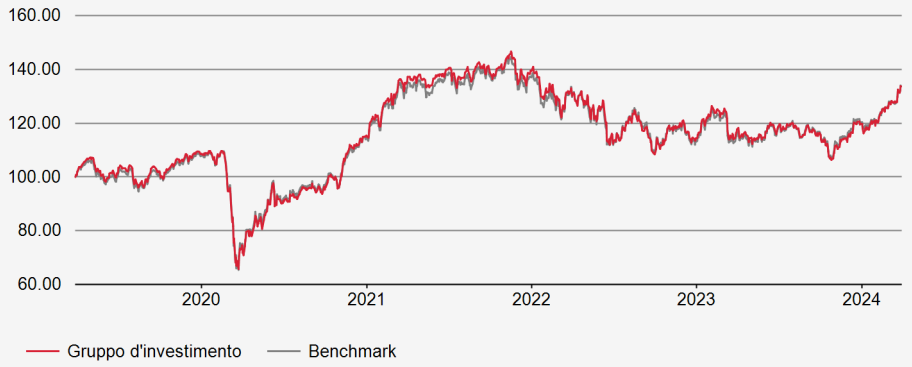
Strategia d'investimento

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.

Performance



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	11.63%	6.01%	11.63%	13.57%	-0.43%	5.81%	-	3.69%
Benchmark	11.05%	5.57%	11.05%	14.67%	0.10%	5.83%	-	5.18%

Dati statistici (annualizzati)

	1 anno	3 anni	5 anni	10 anni	Inizio
Volatilità Gruppo d'investimento (in %)	13.87	15.82	20.70	-	19.92
Volatilità del Benchmark (in %)	13.54	15.90	20.18	-	19.59
Tracking Error ex post (in %)	1.25	1.66	1.89	-	2.37
Information Ratio	-0.89	-0.32	-0.01	-	-0.63
Sharpe Ratio	0.80	-0.05	0.28	-	0.19
Correlazione	1.00	0.99	1.00	-	0.99
Beta	1.02	0.99	1.02	-	1.01
Jensen alfa	-1.37	-0.53	-0.14	-	-1.54
Maximum Drawdown (in %)	-11.52	-27.52	-40.04	-	-41.60
Recovery Period (anni)	0.14	-	0.67	-	0.73

Informazioni sul prodotto

Numero di valore: 40068790
ISIN: CH0400687908
LEI: 254900XCUD9NTWJQU706
Codice Bloomberg: SLAGSPM 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/fondazionedinvestimento
Quote spese operative TER KGAST
ex ante: 0.79%
ex post al: 30/09/2023 0.79%

PM tranche: L'acquisto di questa tranche è possibile solo nell'ambito di un accordo speciale con Swiss Life Asset Management SA.
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 logaritmizzati mensili.
Tracking error ex ante: Il tracking error previsto per i prossimi 12 mesi corrisponde al Tracking error ex post degli ultimi 3 anni.

31 marzo 2024

Fondazione d'investimento Swiss Life Azioni Global Small Caps PM

SwissLife

Struttura del portafoglio per settore

	Gruppo d'investimento	Benchmark
Industrie	23.85%	20.40%
Finanza	16.07%	14.32%
Beni voluttuari	13.30%	13.37%
Tecnologia dell'informazione	12.04%	11.57%
Salute	9.02%	9.69%
Materiali	6.40%	7.76%
Immobili	5.87%	7.97%
Energia	4.41%	4.86%
Beni di prima necessità	3.50%	4.75%
Servizi di telecomunicazione	2.80%	2.87%
Servizi di pubblica utilità	1.80%	2.42%
Liquidità	0.92%	-

Le principali posizioni

	Gruppo d'investimento	Benchmark
TAYLOR MORRISON	0.55%	0.04%
SPROUTS FARMERS MARKET	0.53%	0.04%
CACTUS	0.51%	0.02%
XPO	0.50%	0.08%
WEATHERFORD INTERNAT	0.49%	0.04%
ITT	0.45%	0.06%
TENET HEALTHCARE	0.45%	0.05%
CORE & MAIN	0.43%	0.06%
ACUSHNET	0.42%	0.01%
COMMVAULT SYSTEMS	0.40%	0.03%

Struttura del portafoglio secondo il paese/regione

	Gruppo d'investimento	Benchmark
USA	57.30%	56.90%
Giappone	8.53%	11.38%
Gran Bretagna	6.19%	4.80%
Canada	2.64%	3.45%
Germania	2.04%	1.49%
Francia	1.40%	1.25%
Resto dell'Europa	11.17%	8.61%
Altri paesi Asia	5.49%	8.08%
Altri	4.32%	4.05%
Liquidità	0.92%	-

Struttura del portafoglio secondo le valute

	Gruppo d'investimento	Benchmark
USD	60.36%	57.11%
EUR	8.95%	6.39%
JPY	8.57%	11.38%
GBP	6.12%	4.80%
CHF	1.99%	1.44%
Altri	14.00%	18.88%

Ulteriori informazioni sulle società

Numero di società	6,964
Quota di società senza benchmark	21.37%

Nota legale: 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, c/o Swiss Life SA, casella postale 8022 Zurigo, telefono 043 547 71 11 e su www.swisslife.ch/anlagestiftung. 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 FINMA e che investono presso la fondazione esclusivamente capitali per queste istituzioni. Inoltre, gli investitori citati devono aver concluso un accordo speciale con Swiss Life Asset Management SA. La performance precedente non rappresenta un indicatore né per l'evoluzione attuale, né per quella futura. L'utilizzo non implica alcuna affiliazione con o sponsorizzazione da parte di quest'ultimi. **Fonte:** Swiss Life Asset Managers. Tutti i diritti riservati.