

30 settembre 2024

Fondazione d'investimento Swiss Life

Azioni Global Small Caps PM

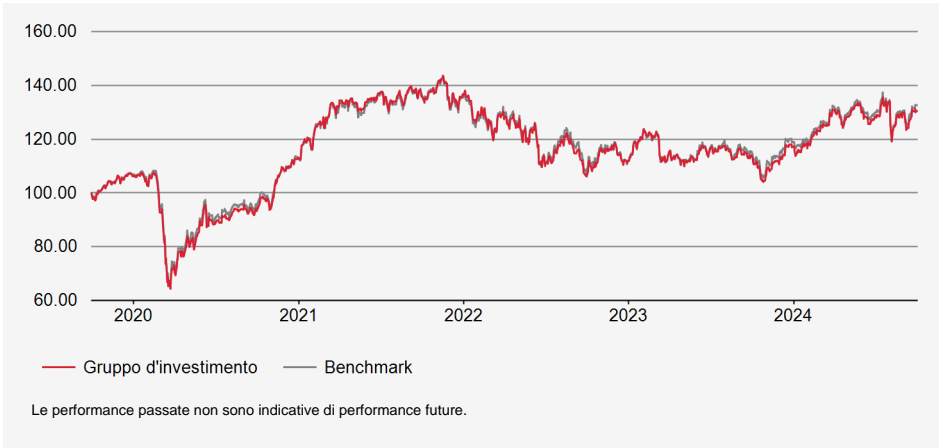


Patrimonio netto (NAV) in mio. CHF: 468.19
Valore d'inventario netto per diritto in CHF: 124.27

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)



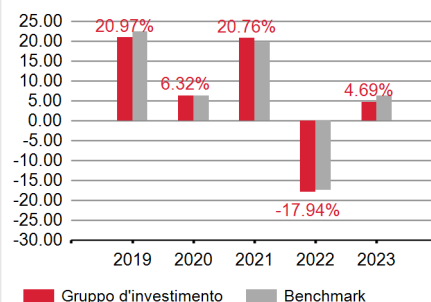
Performance nella valuta di riferimento

	Performance cumulata True				Performance annualizzata			
	YTD	1 mese	3 mesi	1 anno	3 anni	5 anni	10 anni	Inizio
Gruppo d'investimento	11.30%	0.62%	1.85%	14.60%	-1.34%	5.46%	-	3.35%
Benchmark	11.54%	1.54%	2.13%	14.91%	-0.79%	5.80%	-	4.84%

Dati statistici (annualizzati)

	1 anno	3 anni	5 anni	10 anni	Inizio
Volatilità Gruppo d'investimento (in %)	14.43	15.99	20.19	-	19.30
Volatilità del Benchmark (in %)	13.85	15.96	19.77	-	18.98
Tracking Error ex post (in %)	1.78	1.80	1.90	-	2.35
Information Ratio	-0.18	-0.31	-0.18	-	-0.63
Sharpe Ratio	0.84	-0.13	0.26	-	0.18
Correlazione	0.99	0.99	1.00	-	0.99
Beta	1.03	1.00	1.02	-	1.01
Jensen alfa	-0.77	-0.56	-0.43	-	-1.53
Maximum Drawdown (in %)	-12.06	-27.52	-40.04	-	-41.60
Recovery Period (anni)	-	-	0.67	-	0.73

Performance



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: 13.00
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: 0.59%
ex post al: 30/09/2024 0.59%

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 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 PM

Struttura del portafoglio per settore

	Gruppo d'investimento	Benchmark
Industrie	22.01%	19.72%
Finanza	16.42%	14.82%
Beni voluttuari	12.64%	13.48%
Tecnologia dell'informazione	12.11%	11.22%
Salute	10.03%	9.64%
Materiali	6.80%	7.91%
Immobili	6.29%	8.59%
Beni di prima necessità	4.46%	4.89%
Energia	3.87%	3.96%
Servizi di comunicazione	3.22%	3.13%
Servizi di pubblica utilità	1.78%	2.64%
Liquidità	0.37%	-

Le principali posizioni

	Gruppo d'investimento	Benchmark
TAYLOR MORRISON	0.66%	0.04%
CACTUS	0.63%	0.02%
PLANISWARE	0.59%	0.00%
WEATHERFORD INTERNAT	0.56%	0.03%
SPROUTS FARMERS MARKET	0.54%	0.06%
PIPER SANDLER	0.49%	0.03%
SIGMAROC	0.46%	-
TMX	0.44%	-
PINNACLE FINANCIAL PARTNERS	0.44%	0.04%
HELIOS TOWERS	0.41%	0.01%

Struttura del portafoglio secondo il paese/regione

	Gruppo d'investimento	Benchmark
USA	60.31%	56.65%
Giappone	7.69%	11.61%
Gran Bretagna	6.55%	4.95%
Canada	2.26%	3.57%
Francia	2.00%	1.10%
Germania	1.72%	1.24%
Resto dell'Europa	10.36%	8.20%
Altri paesi Asia	5.56%	8.66%
Altri	3.17%	4.03%
Liquidità	0.37%	-

Struttura del portafoglio secondo le valute

	Gruppo d'investimento	Benchmark
USD	62.28%	56.90%
EUR	8.52%	5.80%
JPY	7.73%	11.60%
GBP	6.62%	4.97%
CHF	1.86%	1.42%
Altri	12.99%	19.31%

Ulteriori informazioni sulle società

Numero di società	6,835
Quota di società senza benchmark	23.05%