

31 marzo 2025

Fondazione d'investimento Swiss Life Azioni Svizzera Small & Mid Caps PM

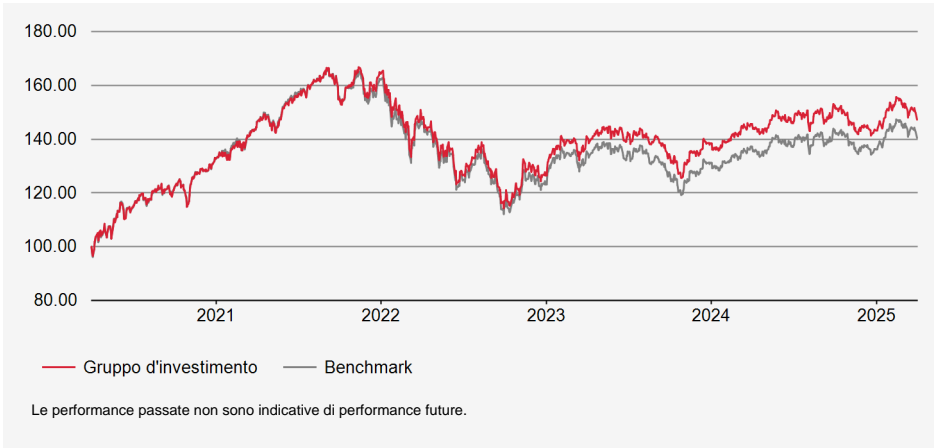


Patrimonio netto (NAV) in mio. CHF: 164.32
Valore d'inventario netto per diritto in CHF: 128.84

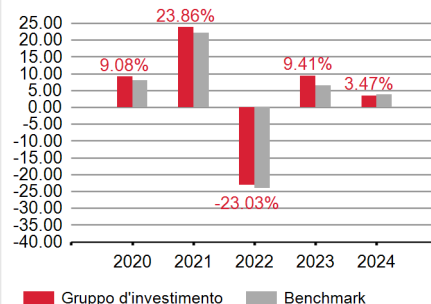
Strategia d'investimento

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)



Performance



Informazioni sul prodotto

Numero di valore: 39561897
ISIN: CH0395618975
LEI: 254900QGENUS1GIJ4549
Codice Bloomberg: SWLSMPM SW
Benchmark: SPI EXTRA® Total Return
Valuta: CHF
Domicilio: Svizzera
Data di lancio: 31/01/2018
Prezzo di prima emissione: 100.00
Chiusura d'esercizio: 30.09
Emissione/Riscatto: giornalmente
Termine d'accettazione: 13.00
Protezione contro la diluizione: Commissione di emissione / riscatto a favore del gruppo d'investimento secondo la panoramica delle condizioni.
Politica 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: 0.72%
ex post al: 30/09/2024 0.72%

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	2.83%	-3.05%	2.83%	1.09%	-0.09%	8.04%	-	3.60%
Benchmark	3.10%	-2.63%	3.10%	2.34%	-1.20%	7.02%	-	2.68%

Dati statistici (annualizzati)

	1 anno	3 anni	5 anni	10 anni	Inizio
Volatilità Gruppo d'investimento (in %)	10.98	14.35	14.68	-	15.21
Volatilità del Benchmark (in %)	10.12	14.00	14.45	-	15.12
Tracking Error ex post (in %)	1.12	1.64	1.59	-	1.58
Information Ratio	-1.11	0.68	0.64	-	0.58
Sharpe Ratio	0.01	-0.07	0.51	-	0.24
Correlazione	1.00	0.99	0.99	-	0.99
Beta	1.08	1.02	1.01	-	1.00
Jensen alfa	-1.36	1.15	0.95	-	0.92
Maximum Drawdown (in %)	-7.67	-22.92	-31.46	-	-31.46
Recovery Period (anni)	0.11	1.63	-	-	-

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.
Protezione contro la diluizione: Panoramica delle condizioni: www.swisslife.ch/fondazioneinvestimento, «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.

Struttura del portafoglio per settore

	Gruppo d'investimento	Benchmark
Industrie	31.23%	28.52%
Salute	22.28%	21.07%
Finanza	13.82%	17.74%
Beni di prima necessità	12.11%	10.58%
Tecnologia dell'informazione	5.25%	4.22%
Materiali	3.87%	3.91%
Immobili	3.17%	7.96%
Utilities	2.03%	1.13%
Beni voluttuari	1.64%	3.63%
Servizi di comunicazione	-	1.22%
Energia	-	-
Liquidità	4.58%	-

Le principali posizioni

	Gruppo d'investimento	Benchmark
LINDT & SPRÜNGLI	7.94%	7.78%
SGS SA	5.56%	4.44%
SANDOZ GROUP AG	5.50%	5.09%
SCHINDLER HOLDING AG	4.93%	5.21%
JULIUS BAER GROUP LTD	4.43%	3.90%
STRAUMANN HOLDING AG	4.06%	3.90%
BALOISE HOLDING AG	3.38%	2.40%
VAT GROUP AG	3.20%	2.64%
GALDERMA GROUP AG	2.58%	3.16%
GALENICA AG	2.44%	1.24%

Struttura del portafoglio in base al volume dell'impresa

	Gruppo d'investimento		Benchmark	
	Partecip.	Numero	Partecip.	Numero
Grandi imprese	11.76%	3	8.99%	2
Medie imprese	80.40%	45	82.78%	78
Piccole imprese	3.26%	3	8.23%	104
Liquidità	4.58%	-	-	-