

30 settembre 2024

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

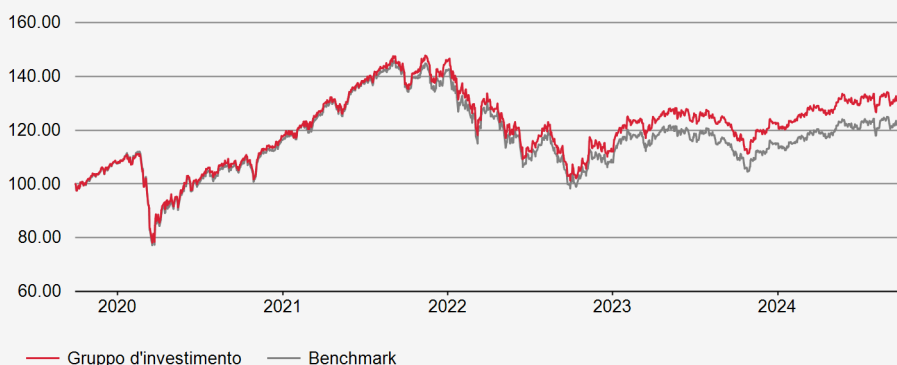


Patrimonio netto (NAV) in mio. CHF: 137.24
Valore d'inventario netto per diritto in CHF: 133.40

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.

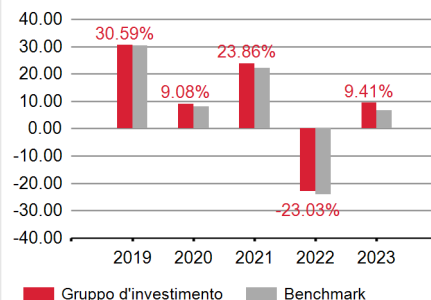
Performance nella valuta di riferimento

	Performance cumulata True				Performance annualizzata			
	YTD	1 mese	3 mesi	1 anno	3 anni	5 anni	10 anni	Inizio
Gruppo d'investimento	10.16%	0.72%	4.46%	13.40%	-0.60%	6.19%	-	4.42%
Benchmark	9.26%	0.58%	4.53%	12.27%	-2.75%	4.67%	-	3.20%

Dati statistici (annualizzati)

	1 anno	3 anni	5 anni	10 anni	Inizio
Volatilità Gruppo d'investimento (in %)	10.42	14.78	15.60	-	15.37
Volatilità del Benchmark (in %)	10.33	14.64	15.71	-	15.35
Tracking Error ex post (in %)	1.28	1.70	1.63	-	1.57
Information Ratio	0.88	1.27	0.93	-	0.78
Sharpe Ratio	1.06	-0.09	0.38	-	0.29
Correlazione	0.99	0.99	0.99	-	0.99
Beta	1.00	1.00	0.99	-	1.00
Jensen alfa	1.12	2.17	1.57	-	1.23
Maximum Drawdown (in %)	-6.61	-31.46	-31.46	-	-31.46
Recovery Period (anni)	0.05	-	-	-	-

Performance



Informazioni sul prodotto

Numero di valore: 39561897
ISIN: CH0395618975
LEI: 254900QGENUS1GIJ4549
Codice Bloomberg: SWLSMPM SW
Benchmark: SPI EXTRA® Total Return
Moneta: CHF
Domicilio: Svizzera
Data di creazione: 31/01/2018
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®: 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%

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.

Struttura del portafoglio per settore

	Gruppo d'investimento	Benchmark
Industrie	37.46%	33.25%
Salute	19.12%	19.67%
Finanza	14.73%	22.90%
Beni di prima necessità	13.71%	13.07%
Tecnologia dell'informazione	4.56%	3.58%
Beni voluttuari	2.38%	3.27%
Materiali	1.99%	2.68%
Servizi di pubblica utilità	1.97%	1.09%
Servizi di comunicazione	-	0.50%
Energia	-	-
Liquidità	4.08%	-

Le principali posizioni

	Gruppo d'investimento	Benchmark
LINDT & SPRÜNGLI	6.77%	7.12%
STRAUMANN HOLDING AG	5.43%	5.07%
SGS SA	5.42%	4.49%
SANDOZ GROUP AG	4.91%	4.72%
SCHINDLER HOLDING AG	4.27%	4.66%
VAT GROUP AG	4.17%	3.60%
JULIUS BAER GROUP LTD	3.94%	3.25%
BALOISE HOLDING AG	2.87%	2.33%
BELIMO HOLDING AG	2.76%	1.85%
SIEGFRIED HOLDING AG	2.41%	1.51%

Struttura del portafoglio in base al volume dell'impresa

	Gruppo d'investimento		Benchmark	
	Partecip.	Numero	Partecip.	Numero
Grandi imprese	12.18%	3	9.78%	2
Medie imprese	80.04%	45	82.01%	78
Piccole imprese	3.69%	4	8.21%	106
Liquidità	4.08%	-	-	-