

Fondazione d'investimento Swiss Life

Azioni Global Small Caps

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

Informazioni sul prodotto

Numero di valore	40068789
ISIN	CH0400687890
LEI	254900XCUD9NTWJQU706
Bloomberg Ticker	SWLAGSC SW
Benchmark	MSCI AC World Small Cap, in CHF
Moneta	CHF
Data di lancio	28.02.2018
Prezzo di prima emissione	100.00
Chiusura d'esercizio	30.09.
Emissione/Riscatto	giornalmente
Termine di accettazione	11.00

Asset Manager in base al

Swiss Life Select Invest Plus® *

50% Invesco / 50% Dimensional

Consulenza esterna

PPCmetrics fornisce i seguenti servizi: consulenza sulle strutture idonee 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 0.98%

- ex post all 30.09.2019 0.98%

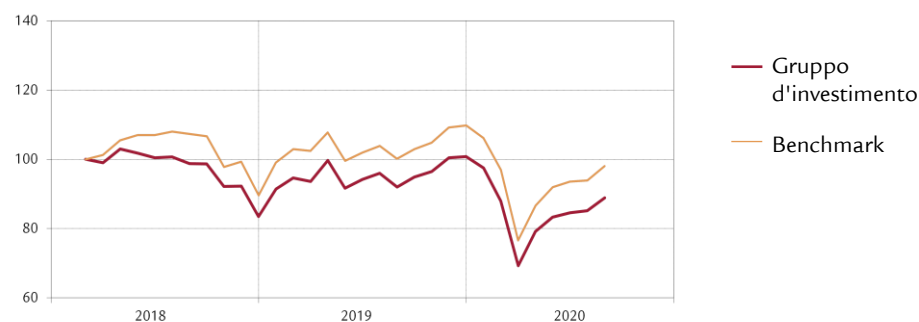
Commissione d'emissione/riscatto nessuna

Prassi di distribuzione accumulazione

* 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

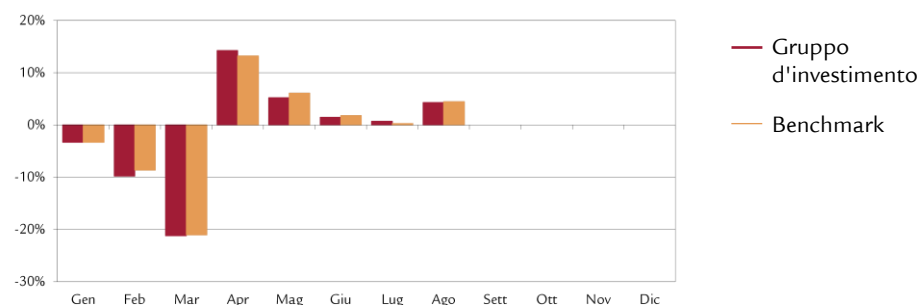
** La quota spese operative TER_{KGAST} copre tutti i costi, eccezione fatta per i costi di transazione e i tributi fiscali legati alla transazione

Evoluzione del valore indicizzata e performance



Performance	1M	3M	1A	3A p.a.	5A p.a.	p.a. dal 28.02.18
Gruppo d'investimento (in %)	4.32	6.61	-3.47			-4.62
Benchmark (in %)	4.45	6.65	-2.07			-0.78
	YTD	2019	2018	2017	2016	2015
Gruppo d'investimento (in %)	-11.88	20.76				
Benchmark (in %)	-10.65	22.45				

Performance mensile



Dati statistici (annualizzati)

	1A	3A	5A	dal 28.02.18
Volatilità del gruppo d'investimento (in %)	30.24			22.60
Volatilità Benchmark (in %)	29.39			22.43
Tracking Error ex post (in %)	1.97			3.24
Tracking Error ex ante (in %)	3.30			
Information Ratio	-0.71			-1.19
Sharpe Ratio	-0.09			-0.18
Correlazione	1.00			0.99
Beta	1.03			1.00
Jensen-Alpha	-1.40			-3.95
Maximum Drawdown (in %)	-40.05			-41.83
Recovery Period (anni)	-			-

Cifre salienti (in CHF)

	31.12.2019	31.08.2020
Patrimonio in milioni CHF	44.0	46.7
Valore d'inventario netto per quota in CHF	100.80	88.83

Struttura del portafoglio secondo il paese/regione

	Gruppo d'investimento	Benchmark		Gruppo d'investimento	Benchmark
America del Nord	50.7%	57.4%	USA	48.2%	53.8%
Europe	25.4%	20.4%	Gran Bretagna	7.5%	6.3%
Asia	18.9%	17.7%	Francia	2.2%	1.1%
Altri	3.9%	4.5%	Germania	2.6%	2.1%
Liquidità	1.1%	-	Giappone	11.0%	11.0%
Totale	100.0%	100.0%			

Struttura del portafoglio per settore

	Gruppo d'investimento	Benchmark
Industrie	19.7%	17.5%
Financials	14.1%	11.3%
Beni voluttuari	15.0%	13.4%
Tecnologia dell'informazione	15.3%	14.5%
Salute	9.7%	12.5%
Immobili	7.0%	10.1%
Materie prime	6.9%	7.3%
Beni di prima necessità	3.4%	4.8%
Energia	1.8%	2.5%
Servizi di telecomunicazione	3.2%	3.4%
Servizi di pubblica utilità	2.8%	2.7%
Liquidità	1.1%	-
Totale	100.0%	100.0%

Maggiori posizioni azionarie

	Gruppo d'investimento	Benchmark
Philips Lighting	0.4%	0.4%
Horizon Pharma	0.4%	0.4%
Penn National Gaming	0.4%	0.4%
Nordex	0.4%	0.4%
Avalara	0.3%	0.3%
Tkh Group	0.3%	0.3%
Taylor Morrison	0.3%	0.3%
Iridium Communications	0.3%	0.3%
Altra Industrial Motion	0.3%	0.3%
Dyocm	0.3%	0.3%

Ulteriori informazioni sui debitori

Numero di debitori	6'201
Numero di debitori non benchmark	24.2%

Disclaimer

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, 8022 Zurigo, telefono 043 284 79 79. 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 e che investono presso la fondazione esclusivamente capitali per queste istituzioni.

La performance precedente non rappresenta un indicatore né per l'evoluzione attuale, né per quella futura. I dati relativi alla performance non prendono in considerazione le commissioni e le spese riscosse al momento dell'emissione e del riscatto delle quote.