

Fondazione d'investimento Swiss Life

Azioni Svizzera Small & Mid Caps PM



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); fondo d'investimento di diritto svizzero della categoria "Altri fondi per investimenti tradizionali"

Informazioni sul prodotto

Numero di valore	39561897
ISIN	CH0395618975
LEI	254900QGENUS1GIJ4549
Bloomberg Ticker	SWLSMPM SW
Benchmark	Swiss Performance Index Extra
Moneta	CHF
Data di lancio	31.01.2018
Prezzo di prima emissione	100.00
Chiusura d'esercizio	30.09.
Emissione/Riscatto	giornalmente
Termine di accettazione *	14.30
Asset Manager in base al	Swiss Life Best Select Invest Plus® **
	Privatbank Von Graffenried AG

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

Publicazioni di corsi Bloomberg: ASSL
www.swisslife.ch/fondazioneinvestimento

Quote spese operative TER_{KGAST} ***

- ex ante	0.72%
- ex post all 30.09.2019	0.72%

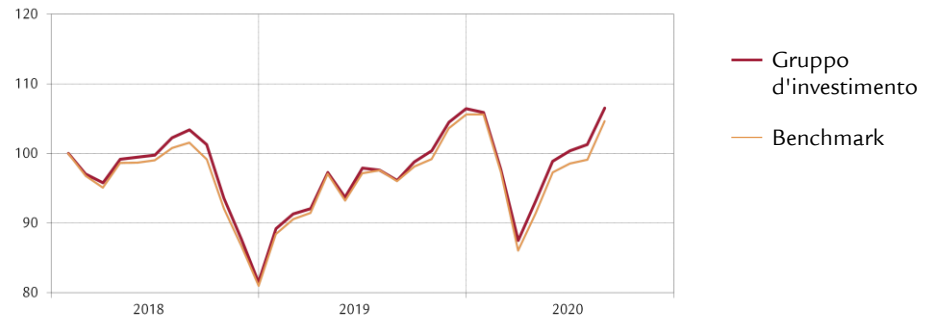
Commissione d'emissione/riscatto nessuna
Prassi di distribuzione accumulazione

* L'acquisto di questa tranche è possibile solo nell'ambito di un accordo speciale on Swiss Life Asset Managers

** 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

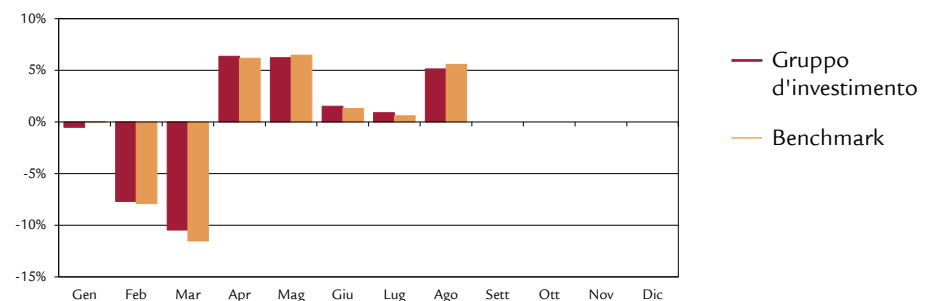
*** La quota spese operative TER_{KGAST} copre tutti i costi, eccezione fatta per i costi di transazione e i tributi fiscali legati alla transazione

Evoluzione del valore indicizzata e performance



Performance	1M	3M	1A	3A p.a.	5A p.a.	p.a. dal 31.01.18
Gruppo d'investimento (in %)	5.14	7.72	10.80			2.47
Benchmark (in %)	5.59	7.60	8.99			1.78
	YTD	2019	2018	2017	2016	2015
Gruppo d'investimento (in %)	0.07	30.59				
Benchmark (in %)	-0.90	30.42				

Performance mensile



Dati statistici (annualizzati)

	1A	3A	5A	dal 31.01.18
Volatilità Gruppo d'investimento (in %)	17.99			16.14
Volatilità Benchmark (in %)	18.96			16.33
Tracking Error ex post (in %)	1.68			1.49
Tracking Error ex ante (in %)	1.50			
Information Ratio	1.08			0.46
Sharpe Ratio	0.61			0.20
Correlazione	1.00			1.00
Beta	0.95			0.98
Jensen-Alpha	2.15			0.71
Maximum Drawdown (in %)	-29.67			-29.67
Recovery Period (anni)	-			-

Cifre salienti (in CHF)

	31.12.2019	31.08.2020
Patrimonio in milioni CHF	43.2	45.4
Valore d'inventario netto per quota in CHF	106.43	106.50

Struttura del portafoglio in base al volume dell'impresa¹⁾

	Gruppo d'investimento		Benchmark	
	Particip.	Numero	Particip.	Numero
Grandi imprese	7.9%	1	7.1%	1
Medie imprese	83.5%	48	83.4%	78
Piccole imprese	3.4%	6	9.5%	114
Liquidità	5.2%	-	-	-
Totale	100.0%	55	100.0%	193

¹⁾ prendendo in considerazione i derivati e gli investimenti collettivi

Struttura del portafoglio per settore²⁾

	Gruppo d'investimento	Benchmark
Industrie	34.8%	25.8%
Financials	21.5%	29.4%
Salute	11.4%	14.7%
Generi di consumo	11.4%	10.9%
Tecnologia	8.0%	10.6%
Servizi per il consumatore	2.4%	3.0%
Materiali di base	2.5%	3.8%
Telecomunicazioni	1.3%	1.1%
Servizi di pubblica utilità	1.5%	0.7%
Petrolio e gas	0.0%	0.0%
Liquidità	5.2%	-
Totale	100.0%	100.0%

²⁾ prendendo in considerazione i derivati e gli investimenti collettivi

Le prime posizioni³⁾

	Gruppo d'investimento	Benchmark
Partners Group Holding AG	7.9%	7.1%
Schindler Holding AG (PS)	5.7%	3.3%
Kuehne + Nagel International AG	4.2%	3.3%
Sonova Holding AG	3.9%	3.9%
Lindt & Sprüngli (PS)	3.6%	2.9%
Straumann Holding AG	3.5%	3.4%
Logitech International	3.3%	3.9%
Temenos AG	3.3%	3.3%
Baloise Holding AG	3.2%	2.2%
Vifor Pharma AG	2.8%	1.9%

³⁾ prendendo in considerazione i derivati e gli investimenti collettivi

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 che hanno concluso un accordo speciale con Swiss Life Asset Managers.

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.