29 febbraio 2024

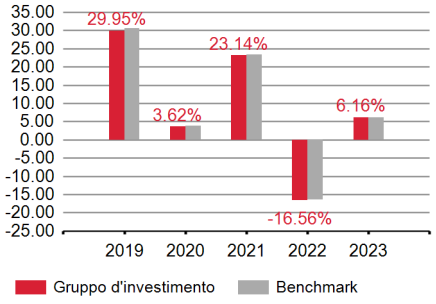
# Fondazione d'investimento Swiss Life Azioni Svizzera

**Patrimonio netto (NAV) in mio. CHF: 483.28**
**Valore d'inventario netto per diritto in CHF: 327.91**

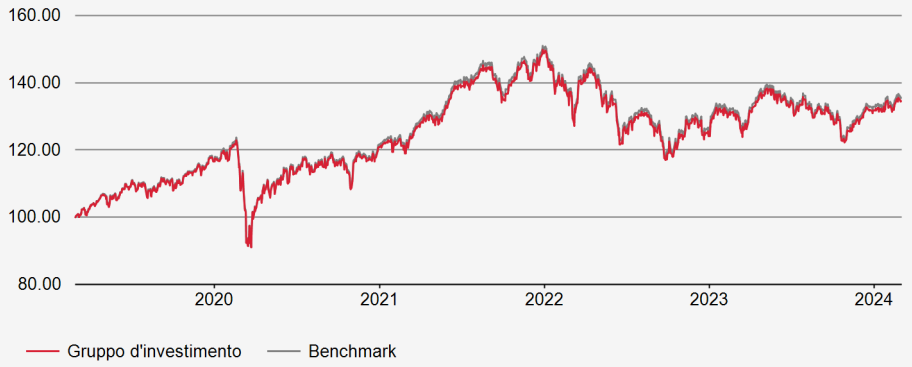
## Strategia d'investimento

Investimenti in titoli di partecipazione di società rappresentate allo Swiss Performance Index (SPI). La copertura per i Large Cap è passiva, gli Small & Mid Caps vengono gestiti attivamente (core satellite). 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 (CHF) e Equity Switzerland Small & Mid Cap (CHF); Fondi d'investimento di diritto svizzero della categoria "altri fondi per investimenti tradizionali".

## Performance




## 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 | | | | Performance annualizzata | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | YTD | 1 mese | 3 mesi | 1 anno | 3 anni | 5 anni | 10 anni | Inizio |
| Gruppo d'investimento | 2.10% | 0.70% | 4.37% | 4.04% | 4.16% | 6.11% | 5.85% | 5.44% |
| Benchmark | 1.97% | 0.56% | 4.36% | 3.87% | 4.18% | 6.26% | 6.17% | 5.93% |

## Dati statistici (annualizzati)

| | 1 anno | 3 anni | 5 anni | 10 anni | Inizio |
|---|---|---|---|---|---|
| Volatilità Gruppo d'investimento (in %) | 9.41 | 13.11 | 12.53 | 11.98 | 12.90 |
| Volatilità del Benchmark (in %) | 9.46 | 13.13 | 12.59 | 12.01 | 13.24 |
| Tracking Error ex post (in %) | 0.43 | 0.36 | 0.34 | 0.32 | 1.18 |
| Information Ratio | 0.37 | -0.06 | -0.43 | -0.99 | -0.48 |
| Sharpe Ratio | 0.25 | 0.29 | 0.48 | 0.51 | 0.40 |
| Correlazione | 1.00 | 1.00 | 1.00 | 1.00 | 1.00 |
| Beta | 0.99 | 1.00 | 1.00 | 1.00 | 0.97 |
| Jensen alfa | 0.18 | -0.01 | -0.12 | -0.30 | -0.32 |
| Maximum Drawdown (in %) | -11.61 | -21.88 | -25.88 | -25.88 | -54.46 |
| Recovery Period (anni) | - | - | 0.83 | 0.83 | 4.97 |

## Informazioni sul prodotto

**Numero di valore:** 1245481
**ISIN:** CH0012454812
**LEI:** 254900UNZU5YPIKQTQ23
**Codice Bloomberg:** SWAAKCH SW
**Benchmark:** Swiss Performance Index
**Moneta:** CHF
**Domicilio:** Svizzera
**Data di creazione:** 30/09/2001
**Prezzo di prima emissione:** 100.00
**Chiusura d'esercizio:** 30.09
**Emissione/Riscatto:** giornalmente
**Termine d'accettazione:** 14.30
**Commissione d'emissione/riscatto:** nessuna
**Prassi di distribuzione:** Capitalizzazione
**Asset Manager in base al Swiss Life Best Select Invest Plus®**
**Large Caps (passivo)**
Pictet Asset Management SA
**Small&Mid Caps (attivo)**
Privatbank Von Graffenried AG
**Consulenza esterna:**
PPCmetrics fornisce i seguenti servizi: consulenza sulle strutture idonee del mandato (core satellite), 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/fondazionedinvestimento
**Quote spese operative TER KGAST**
**ex ante:** 0.54%
**ex post al:** 30/09/2023 0.53%

**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 logaritmizzati mensili.

29 febbraio 2024

# Fondazione d'investimento Swiss Life Azioni Svizzera

## Struttura del portafoglio per settore

| | Gruppo d'investimento | Benchmark |
|---|---|---|
| Salute | 31.85% | 32.24% |
| Generi di consumo | 23.63% | 23.91% |
| Industrie | 19.06% | 18.39% |
| Finanza | 17.57% | 19.43% |
| Materiali di base | 2.31% | 2.47% |
| Tecnologia | 1.86% | 1.66% |
| Telecomunicazioni | 0.83% | 0.94% |
| Servizi per il consumatore | 0.53% | 0.75% |
| Servizi di pubblica utilità | 0.31% | 0.20% |
| Petrolio e gas | - | - |
| Liquidità | 2.04% | - |

## Le principali posizioni

| | Gruppo d'investimento | Benchmark |
|---|---|---|
| NESTLE SA-REG | 15.89% | 16.16% |
| NOVARTIS AG-REG | 12.27% | 12.48% |
| ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN | 10.57% | 10.74% |
| UBS GROUP AG-REG | 5.00% | 5.09% |
| CIE FINANCIERE RICHEMONT-REG | 4.90% | 4.98% |
| ZURICH INSURANCE GROUP AG | 4.46% | 4.53% |
| ABB LTD-REG | 4.27% | 4.34% |
| SIKA AG | 2.66% | 2.70% |
| HOLCIM LTD | 2.49% | 2.53% |
| ALCON INC | 2.44% | 2.48% |

## Struttura del portafoglio in base al volume dell'impresa

| | Gruppo d'investimento | | Benchmark | |
|---|---|---|---|---|
| | Partecip. | Numero | Partecip. | Numero |
| Grandi imprese | 79.45% | 21 | 80.09% | 20 |
| Medie imprese | 18.10% | 47 | 18.11% | 80 |
| Piccole imprese | 0.41% | 3 | 1.80% | 112 |
| Liquidità | 2.04% | - | - | - |

**Nota legale:** 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, c/o Swiss Life SA, casella postale 8022 Zurigo, telefono 043 547 71 11 e su www.swisslife.ch/anlagestiftung. La cerchia degli investitori è limitata alle istituzioni del secondo pilastro e del pilastro 3a, non-ché 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 FINMA 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. L'utilizzo non implica alcuna affiliazione con o sponsorizzazione da parte di quest'ultimi. **Fonte:** Swiss Life Asset Managers. Tutti i diritti riservati.