

30 settembre 2024

# Fondazione d'investimento Swiss Life

## Azioni Svizzera PM

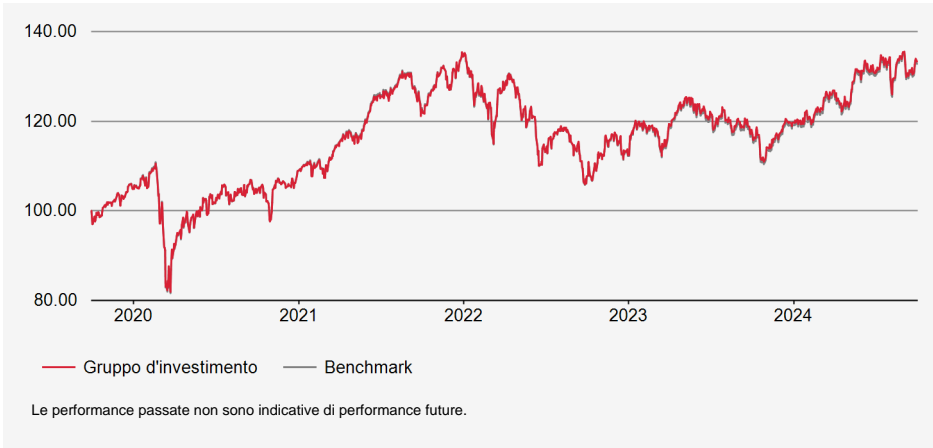


**Patrimonio netto (NAV) in mio. CHF: 518.72**  
**Valore d'inventario netto per diritto in CHF: 203.58**

### 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 Index Funds (CH) Equity Switzerland Large Cap e SL iFunds 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)



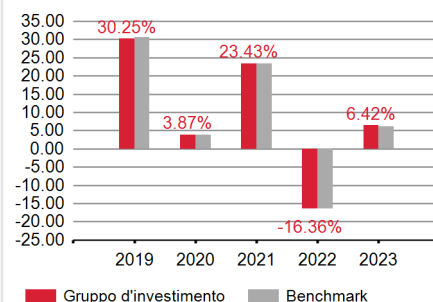
### Performance nella valuta di riferimento

	Performance cumulata True				Performance annualizzata			
	YTD	1 mese	3 mesi	1 anno	3 anni	5 anni	10 anni	Inizio
Gruppo d'investimento	11.37%	-1.57%	1.96%	12.91%	2.82%	5.91%	6.41%	4.18%
Benchmark	11.47%	-1.59%	2.03%	13.04%	2.58%	5.83%	6.44%	4.41%

### Dati statistici (annualizzati)

	1 anno	3 anni	5 anni	10 anni	Inizio
Volatilità Gruppo d'investimento (in %)	10.95	12.46	12.74	12.14	12.81
Volatilità del Benchmark (in %)	11.02	12.50	12.80	12.18	12.81
Tracking Error ex post (in %)	0.27	0.35	0.34	0.31	0.67
Information Ratio	-0.49	0.67	0.25	-0.10	-0.34
Sharpe Ratio	0.97	0.17	0.44	0.54	0.32
Correlazione	1.00	1.00	1.00	1.00	1.00
Beta	0.99	1.00	0.99	1.00	1.00
Jensen alfa	-0.05	0.24	0.11	0.00	-0.22
Maximum Drawdown (in %)	-6.50	-21.74	-25.86	-25.86	-54.13
Recovery Period (anni)	0.06	1.93	0.83	0.83	4.84

### Performance



### Informazioni sul prodotto

**Numero di valore:** 3026057  
**ISIN:** CH0030260571  
**LEI:** 254900UNZU5YPIKQTQ23  
**Codice Bloomberg:** SLACHPM SW  
**Benchmark:** SPI® Total Return  
**Moneta:** CHF  
**Domicilio:** Svizzera  
**Data di creazione:** 31/05/2007  
**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® Large Caps (passivo)**  
 Swiss Life Asset Management AG  
**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/fondazioneinvestimento](http://www.swisslife.ch/fondazioneinvestimento)  
**Quote spese operative TER KGAST ex ante:** 0.26%  
**ex post al:** 30/09/2024 0.27%

**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
Salute	33.76%	34.11%
Finanza	17.90%	19.68%
Beni di prima necessità	16.48%	16.48%
Industrie	14.17%	13.48%
Materiali	8.22%	8.42%
Beni voluttuari	4.92%	5.14%
Tecnologia dell'informazione	1.67%	1.49%
Servizi di comunicazione	0.87%	0.97%
Servizi di pubblica utilità	0.39%	0.22%
Energia	-	-
Liquidità	1.63%	-

## Le principali posizioni

	Gruppo d'investimento	Benchmark
NESTLE SA-REG	13.78%	13.86%
NOVARTIS AG-REG	12.30%	12.37%
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	11.77%	11.84%
UBS GROUP AG-REG	5.21%	5.24%
ABB LTD-REG	4.84%	4.87%
ZURICH INSURANCE GROUP AG	4.62%	4.65%
CIE FINANCIERE RICHEMO-A REG	4.45%	4.48%
SIKA AG-REG	2.78%	2.80%
HOLCIM LTD	2.77%	2.79%
ALCON INC	2.61%	2.62%

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

	Gruppo d'investimento		Benchmark	
	Partecip.	Numero	Partecip.	Numero
Grandi imprese	80.14%	20	80.20%	20
Medie imprese	17.50%	47	18.15%	80
Piccole imprese	0.74%	4	1.65%	106
Liquidità	1.63%	-	-	-