31 marzo 2024

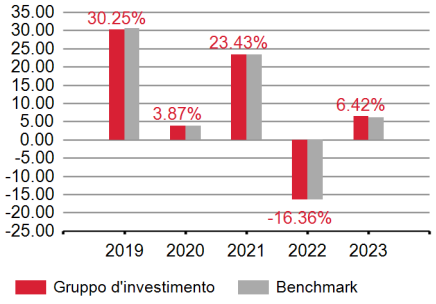
Fondazione d'investimento Swiss Life Azioni Svizzera PM

Patrimonio netto (NAV) in mio. CHF: 506.03
Valore d'inventario netto per diritto in CHF: 193.74

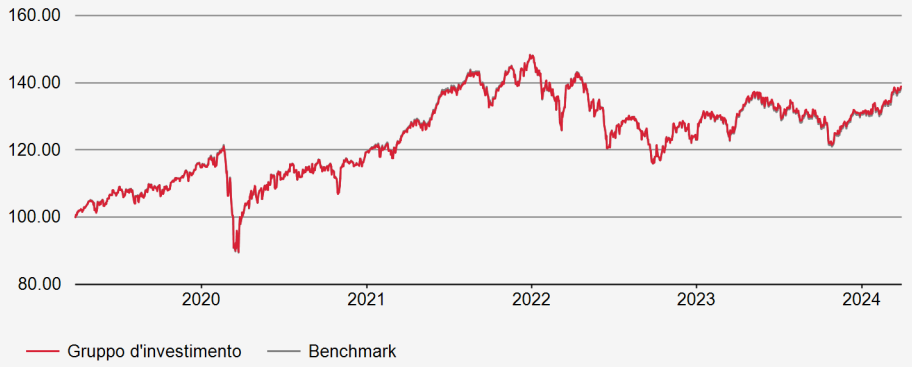
Strategia d'investimento

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	5.99%	3.78%	5.99%	6.24%	3.50%	6.64%	6.45%	4.01%
Benchmark	5.98%	3.94%	5.98%	6.16%	3.29%	6.55%	6.53%	4.23%

Dati statistici (annualizzati)

	1 anno	3 anni	5 anni	10 anni	Inizio
Volatilità Gruppo d'investimento (in %)	9.90	12.77	12.58	12.02	12.89
Volatilità del Benchmark (in %)	10.04	12.79	12.65	12.06	12.89
Tracking Error ex post (in %)	0.45	0.37	0.35	0.32	0.68
Information Ratio	0.18	0.55	0.24	-0.25	-0.33
Sharpe Ratio	0.45	0.24	0.52	0.55	0.31
Correlazione	1.00	1.00	1.00	1.00	1.00
Beta	0.99	1.00	0.99	1.00	1.00
Jensen alfa	0.15	0.21	0.12	-0.06	-0.22
Maximum Drawdown (in %)	-11.51	-21.74	-25.86	-25.86	-54.13
Recovery Period (anni)	0.38	-	0.83	0.83	4.84

Informazioni sul prodotto

Numero di valore: 3026057
ISIN: CH0030260571
LEI: 254900UNZU5YPIKQTQ23
Codice Bloomberg: SLACHPM SW
Benchmark: Swiss Performance Index
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: 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: 0.30%
ex post al: 30/09/2023 0.30%

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 logaritmizzati mensili.

31 marzo 2024

Fondazione d'investimento Swiss Life Azioni Svizzera PM

Struttura del portafoglio per settore

	Gruppo d'investimento	Benchmark
Salute	30.76%	31.18%
Generi di consumo	23.60%	23.89%
Industrie	19.19%	18.63%
Finanza	18.19%	20.09%
Materiali di base	2.44%	2.61%
Tecnologia	1.81%	1.62%
Telecomunicazioni	0.88%	1.04%
Servizi per il consumatore	0.50%	0.73%
Servizi di pubblica utilità	0.33%	0.21%
Petrolio e gas	-	-
Liquidità	2.28%	-

Le principali posizioni

	Gruppo d'investimento	Benchmark
NESTLE SA-REG	16.17%	16.36%
NOVARTIS AG-REG	11.33%	11.46%
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	10.21%	10.33%
UBS GROUP AG-REG	5.67%	5.74%
CIE FINANCIERE RICHEMONT-REG	4.67%	4.73%
ZURICH INSURANCE GROUP AG	4.51%	4.56%
ABB LTD-REG	4.29%	4.33%
HOLCIM LTD	2.80%	2.83%
SIKA AG	2.73%	2.76%
LONZA GROUP AG-REG	2.55%	2.57%

Struttura del portafoglio in base al volume dell'impresa

	Gruppo d'investimento		Benchmark	
	Partecip.	Numero	Partecip.	Numero
Grandi imprese	79.71%	21	80.02%	20
Medie imprese	17.29%	47	18.11%	80
Piccole imprese	0.73%	4	1.88%	112
Liquidità	2.28%	-	-	-

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, 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 FINMA e che investono presso la fondazione esclusivamente capitali per queste istituzioni. Inoltre, gli investitori citati devono aver concluso un accordo speciale con Swiss Life Asset Management SA. 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.