

## News

# Swiss Life Asset Managers premia i migliori lavori di diploma nel settore finanziario

13 novembre 2024

Martedì sera Swiss Life Asset Managers, con la Hochschule Luzern e il partner mediatico «Finanz und Wirtschaft», ha conferito il Premio agli studi di Swiss Life per le migliori tesi di master e bachelor realizzate nelle scuole universitarie professionali svizzere su tematiche finanziarie.

Per il Premio agli studi di Swiss Life 2024 sono state nominate 26 tesi di bachelor e master provenienti da scuole universitarie professionali dell'intera Svizzera, su tematiche di rilievo per il settore finanziario. Una giuria specializzata ha valutato come «eccellenti» quattro lavori. Martedì sera i vincitori sono stati insigniti dell'ambito riconoscimento presso la sede centrale di Swiss Life a Zurigo, ricevendo, inoltre, una ricompensa finanziaria per le loro eccezionali prestazioni.

Alla premiazione tenutasi ieri, Stefan Mächler, Chief Investment Officer del gruppo Swiss Life, ha espresso apprezzamento per la performance dei diplomati: «Gli studenti hanno analizzato un gran numero di sfide e sviluppi attuali sui mercati finanziari e nel settore dei servizi finanziari. È impressionante come siano riusciti a presentare i temi di ricerca accademica con un orientamento pratico e in modo chiaro». Anche il prof. dr. Philipp Lütolf, membro della giuria e docente presso l'Institut für Finanzdienstleistungen Zug (IFZ) della Hochschule Luzern, ha elogiato l'eccellente qualità dei lavori: «Mi fa particolarmente piacere che anche quest'anno le scuole universitarie professionali abbiano presentato 26 tesi di bachelor e master eccellenti. Si tratta di un mix equilibrato di lavori di ricerca e su commissione. È molto importante che le studentesse e gli studenti si occupino in maniera approfondita di temi finanziari complessi e delle implicazioni economiche. Il loro lavoro non ha solo un'utilità pratica, ma fornisce anche un prezioso impulso alla ricerca. Tutti i candidati e le candidate possono essere molto orgogliosi delle loro performance».

### Panoramica dei vincitori

**Yannis Pieren**, di Sutz-Lattrigen, diplomando della Hochschule Luzern, nella sua tesi si è occupato della profilazione dei rischi nei robo advisor – ossia piattaforme digitali e automatizzate che offrono consulenza finanziaria algoritmica – in Svizzera. Ha esaminato 12 robo advisor, soprattutto di start-up, ma anche quelli di banche affermate. Come gruppo di confronto sono state utilizzate soluzioni d'investimento tradizionali di otto banche nonché la profilazione dei rischi di un fornitore di servizi finanziari australiano specializzato e uno studio sui robo advisor esteri. Valutazione della giuria: «Occorre sottolineare in particolare che l'obiettivo del lavoro è chiaramente definito e che alle domande viene data una risposta precisa. La bibliografia è mirata, appropriata e ben integrata nelle argomentazioni. La definizione accurata dei profili di rischio e il loro raffronto significativo con la quota azionaria conferisce al lavoro un ulteriore valore aggiunto». Per la sua tesi, la giuria ha insignito Yannis Pieren del **Premio agli studi di Swiss Life nella categoria Bachelor**, dotato di 5000 franchi.



*Yannis Pieren, vincitore del Premio agli studi di Swiss Life 2024 nella categoria Bachelor*

**Moritz Leon Schroeter**, di Tägerwilen, diplomando della Zürcher Hochschule für angewandte Wissenschaften, nella sua tesi di bachelor si è dedicato alla valutazione di opzioni lookback, un tipo di derivato finanzia-

rio esotico. Ha utilizzato il modello di Heston di volatilità stocastica e il metodo delle differenze finite per sviluppare modelli di valutazione appropriati in Python. «La tesi di bachelor si distingue per un'eccellente espressione stilistica e dimostra solide conoscenze nella valutazione di derivati esotici, nonché la capacità di applicare con successo metodi complessi in Python». La giuria gli conferisce il **Premio di riconoscimento Bachelor** che ammonta a 2500 franchi.



*Moritz Leon Schroeter, vincitore del Premio di riconoscimento Bachelor 2024*

**Sven Koch** di Wohlen, diplomando della Hochschule Luzern, nella sua tesi di master ha analizzato il modo in cui i valori patrimoniali in criptovalute influenzano la performance di portafogli diversificati e l'importanza del rebalancing in questo contesto. Valutazione della giuria: «Questa tesi di master tratta un argomento di grande attualità, in particolare nell'ambito dell'asset allocation e delle strategie di rebalancing, con particolare attenzione agli asset in criptovalute. Il lavoro si contraddistingue per un chiaro contributo proprio, con rappresentazioni precise e chiare dei risultati. La tesi è scritta in modo eccellente, in parte molto dettagliato, ma riporta puntualmente delle sintesi utili che contribuiscono a un migliore orientamento. Nel complesso si tratta di un lavoro ben ponderato che analizza una domanda di ricerca chiara e fornisce risposte convincenti». Con questo lavoro finale, Sven Koch si è aggiudicato il **Premio agli studi di Swiss Life nella categoria Master**, dotato di 5000 franchi.



*Sven Koch, vincitore del Premio agli studi di Swiss Life 2023 nella categoria Master*

**Zef Gjergji**, di Märwil, diplomando della Zürcher Hochschule für angewandte Wissenschaften, nella sua tesi si è occupato della replica di hedge fund mediante strategie di trend following. Valutazione della giuria: «Scritta in modo chiaro e comprensibile, la tesi offre

una sintesi fondata della letteratura empirica. Da sottolineare in particolare sono le molteplici verifiche dei risultati e l'uso di metodi innovativi, come quello della regressione Lasso, che vanno oltre le basi della letteratura utilizzata». L'autore si è aggiudicato il **Premio di riconoscimento Master** dotato di 2500 franchi.



*Zef Gjergji, vincitore del Premio di riconoscimento Master 2024*

Le scuole universitarie professionali dei vincitori ricevono rispettivamente 1500 franchi per la vincita del Premio agli studi di Swiss Life e 1000 franchi per il Premio di riconoscimento.

### **Premio agli studi di Swiss Life**

Il Premio agli studi di Swiss Life, in collaborazione con l'Institut für Finanzdienstleistungen Zug IFZ della Hochschule Luzern e «Finanz und Wirtschaft», promuove ogni anno lavori di ricerca innovativi e di tipo pratico presso le scuole universitarie professionali svizzere su tematiche come gli investimenti finanziari, i mercati finanziari, le imprese fornitrici di servizi finanziari, gli strumenti finanziari e corporate finance. I migliori lavori di diploma vengono premiati e ricevono così una piattaforma a titolo di riconoscimento e di ricompensa delle prestazioni fornite.

Ulteriori informazioni sul Premio agli studi di Swiss Life al sito <http://www.swisslife-am.com>.

### **Membri della giuria del Premio agli studi di Swiss Life**

- Prof. dr. Philipp Lütolf, docente presso l'Institut für Finanzdienstleistungen Zug IFZ della Hochschule Luzern
- Philippe Béguelin, responsabile della rubrica Mercati, «Finanz und Wirtschaft»
- Dr. Claudia Bernasconi, Head Current Account presso la Banca nazionale svizzera (BNS)
- Rita Fler, Economist Quantitative Analysis, Swiss Life Asset Managers
- Dr. Peter Kaste, CIO, Swiss Life Wealth Managers
- Dr. Diego Liechti, membro del comitato di direzione, Nest Sammelstiftung

## Informazione

### Media Relations

Telefono +41 43 284 77 77

media.relations@swisslife.ch

### Swiss Life Asset Managers

Communications

Telefono: +41 43 547 66 88

communications@swisslife-am.com

www.swisslife-am.com



### Swiss Life Asset Managers

Swiss Life Asset Managers vanta un'esperienza di 165 anni nella gestione dei valori patrimoniali del gruppo Swiss Life. L'origine assicurativa ha avuto un impatto decisivo sulla filosofia d'investimento. In primo piano si collocano principi essenziali quali il mantenimento del valore, la realizzazione di redditi a lungo termine e costanti e la gestione responsabile dei rischi. In questo modo creiamo una base solida su cui i nostri clienti possono pianificare a lungo termine, con piena libertà di scelta e tranquillità finanziaria. Un approccio comprovato che Swiss Life Asset Managers rende accessibile anche a clienti terzi in Svizzera, Francia, Germania, Lussemburgo, Gran Bretagna, Italia e nei Paesi nordici.

Al 30 giugno 2024 Swiss Life Asset Managers ha gestito un patrimonio di 272,3 miliardi di euro per il gruppo Swiss Life, di cui oltre 121,2 miliardi di euro per il settore d'investimento di clienti terzi. Swiss Life Asset Managers è inoltre un investitore immobiliare istituzionale leader<sup>1</sup> in Europa. 91,1 miliardi dei complessivi 272,3 miliardi di euro di attività in gestione sono investiti in immobili. Inoltre, Swiss Life Asset Managers gestisce, assieme a Livit, complessivamente 21,6 miliardi di euro in immobili. Pertanto, a fine giugno 2024 il valore globale degli immobili gestiti ammontava a 112,7 miliardi di euro.

Swiss Life Asset Managers impiega oltre 2200 collaboratrici e collaboratori in Europa.

### Vivere in piena libertà di scelta finanziaria

Swiss Life sostiene le persone a vivere in piena libertà di scelta finanziaria e a guardare al futuro con fiducia. Un obiettivo perseguito anche da Swiss Life Asset Managers: abbiamo lo sguardo puntato sul lungo termine e operiamo in modo responsabile. Forti del nostro know-how e della nostra esperienza, sviluppiamo soluzioni d'investimento orientate al futuro. In questo modo aiutiamo i nostri clienti a raggiungere il loro obiettivo d'investimento sul lungo termine. Ciò, a sua volta, consente ai loro clienti di pianificare a lungo termine e agire in piena libertà di scelta finanziaria.

<sup>1</sup> #1 IPE Top 150 Real Estate Investment Managers 2023 Ranking Europe, #2 INREV Fund Manager Survey 2024