

Fondazione d'investimento Swiss Life

Obbligazioni CHF Svizzera



Patrimonio netto (NAV) in mio. CHF: 535.16
Valore d'inventario netto per diritto in CHF: 149.46

Strategia d'investimento

Investimenti in titoli di credito in CHF di debitori domiciliati in Svizzera. Selezione attiva di titoli, gestione della duration e posizionamento della curva dei tassi d'interesse. Limitazione per debitore: 10% (eccezioni: istituti di credito fondiario 25%, Confederazione senza limitazione). Debitori esterni al benchmark: max. 10%. Rating medio: almeno A+. Realizzazione tramite Swiss Life iFunds (CH) Bond Swiss Francs Domestic (CHF); fondo d'investimento di diritto svizzero della categoria "altri fondi per investimenti tradizionali".

Evoluzione del valore nella valuta di riferimento (base 100)



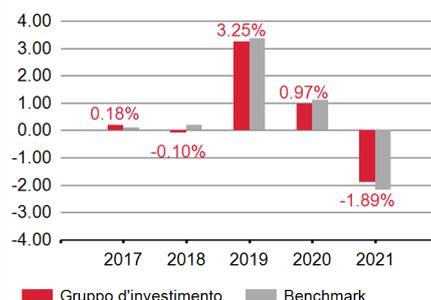
Performance nella valuta di riferimento

| | PERFORMANCE CUMULATA | | | | PERFORMANCE ANNUALIZZATA | | | |
|------------------------------|----------------------|---------------|---------------|----------------|--------------------------|---------------|---------------|--------------|
| | YTD | 1 MESE | 3 MESI | 1 ANNO | 3 ANNI | 5 ANNI | 10 ANNI | INIZIO |
| GRUPPO D'INVESTIMENTO | -13.09% | -2.43% | -1.98% | -13.18% | -5.52% | -2.26% | -0.24% | 1.93% |
| BENCHMARK | -12.09% | -2.17% | -1.54% | -12.15% | -5.19% | -1.95% | -0.13% | 2.05% |

Dati statistici (annualizzati)

| | 1 ANNO | 3 ANNI | 5 ANNI | 10 ANNI | INIZIO |
|---|--------|--------|--------|---------|--------|
| Volatilità Gruppo d'investimento (in %) | 7.08 | 6.17 | 5.33 | 4.43 | 3.73 |
| Volatilità del Benchmark (in %) | 6.89 | 5.83 | 5.09 | 4.30 | 3.72 |
| Tracking Error ex post (in %) | 0.32 | 0.48 | 0.39 | 0.35 | 0.45 |
| Information Ratio | -3.21 | -0.70 | -0.77 | -0.33 | -0.26 |
| Sharpe Ratio | -1.92 | -0.82 | -0.29 | 0.07 | 0.48 |
| Correlazione | 1.00 | 1.00 | 1.00 | 1.00 | 0.99 |
| Beta | 1.03 | 1.06 | 1.04 | 1.03 | 1.00 |
| Jensen alfa | -0.73 | -0.08 | -0.25 | -0.13 | -0.11 |
| Maximum Drawdown (in %) | -15.59 | -17.84 | -19.15 | -19.15 | -19.15 |
| Recovery Period (anni) | - | - | - | - | - |

Performance



Informazioni sul prodotto

Numero di valore: 1239071
ISIN: CH0012390719
LEI: 254900M0YGKYAE29FA28
Codice Bloomberg: SWAOBIN SW
Benchmark: SBI Domestic AAA - BBB TR
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®: Swiss Life Asset Management SA
Controllo asset manager: PPCmetrics supporta il controllo costante dell'asset manager e la valutazione dei risultati d'investimento.
Pubblicazioni di corsi: Bloomberg: ASSL
www.swisslife.ch/fondazioneinvestimento
Quote spese operative TER KGAST ex ante: 0.27%
ex post al: 30/09/2022 0.27%

Struttura del portafoglio per settore

| | Gruppo d'investimento | Benchmark |
|-----------------------------|-----------------------|-----------|
| INSTITUTI LETTERE DI PEGNO | 31.17% | 39.17% |
| STATI E SIMILI | 24.15% | 30.84% |
| FINANZA | 21.61% | 16.58% |
| CONSUMO NON CICLICO | 6.71% | 5.08% |
| SERVIZI DI PUBBLICA UTILITÀ | 5.06% | 2.65% |
| BENI INDUSTRIALI | 4.73% | 2.86% |
| CONSUMO CICLICO | 1.00% | 0.37% |
| MATERIALI DI BASE | 0.87% | 0.88% |
| SUPERNAZIONALE | 0.24% | - |
| ALTRI | 1.11% | 1.56% |
| LIQUIDITÀ | 3.33% | - |

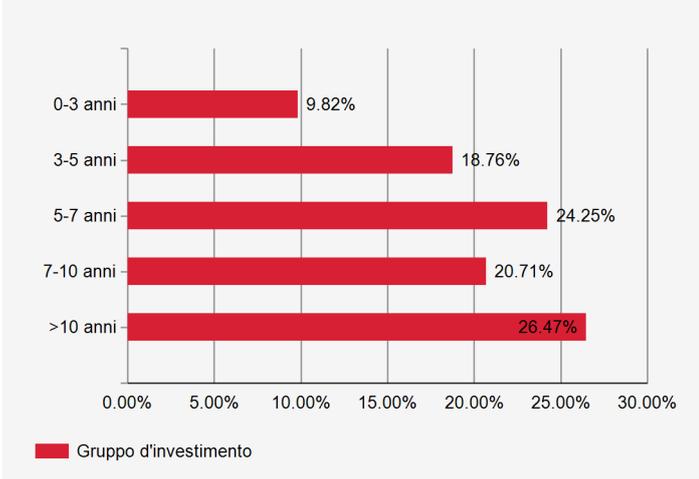
Principali debitori e rating

| | Rating | Gruppo d'investimento |
|---------------------------|--------|-----------------------|
| Pfandbriefbank | AAA | 16.25% |
| Pfandbriefzentrale | AAA | 14.50% |
| Confederazione | AAA | 14.16% |
| Banca cantonale di Zurigo | AAA | 2.80% |
| Cantone Ginevra | AA- | 1.64% |

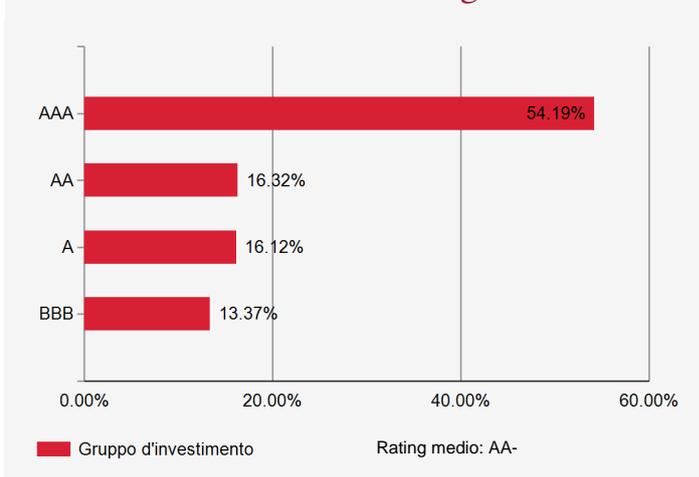
Ulteriori informazioni sui debitori

| | |
|-----------------------------------|-------|
| Numero di debitori | 117 |
| Quota di debitori senza benchmark | 1.57% |

Struttura della scadenza dei titoli



Investimenti secondo il rating



Durata e rendimento alla scadenza

| | Gruppo d'investimento | Benchmark |
|-----------------------------------|-----------------------|-----------|
| Modified Duration | 7.7 | 7.6 |
| Rendimento alla scadenza teorica* | 2.03% | 1.79% |

* prima copertura del rischio di cambio, prendendo in considerazione i derivati

Fondazione d'investimento Swiss Life

Obbligazioni CHF Estero



Patrimonio netto (NAV) in mio. CHF: 316.41
Valore d'inventario netto per diritto in CHF: 136.50

Strategia d'investimento

Investimenti in titoli di credito in CHF di debitori domiciliati prevalentemente all'estero. Selezione attiva di titoli, gestione della duration e posizionamento della curva dei tassi d'interesse. Limitazione per debitore: 10%. Debitori esterni al benchmark: max. 20%. Rating medio: almeno A. Realizzazione tramite Swiss Life iFunds (CH) Bond Swiss Francs Foreign (CHF); fondo d'investimento di diritto svizzero della categoria "altri fondi per investimenti tradizionali".

Evoluzione del valore nella valuta di riferimento (base 100)



Le performance passate non sono indicative di performance future.

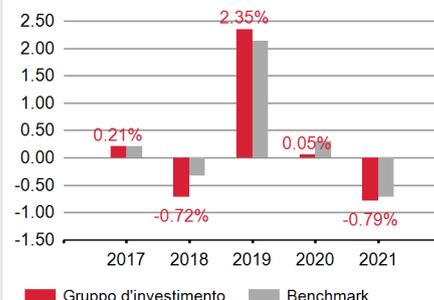
Performance nella valuta di riferimento

| | PERFORMANCE CUMULATA | | | | PERFORMANCE ANNUALIZZATA | | | |
|-----------------------|----------------------|--------|--------|---------|--------------------------|--------|---------|--------|
| | YTD | 1 MESE | 3 MESI | 1 ANNO | 3 ANNI | 5 ANNI | 10 ANNI | INIZIO |
| GRUPPO D'INVESTIMENTO | -10.53% | -1.75% | -2.04% | -10.92% | -4.15% | -1.99% | -0.19% | 1.49% |
| BENCHMARK | -10.12% | -1.53% | -1.83% | -10.50% | -3.93% | -1.80% | -0.13% | 1.64% |

Dati statistici (annualizzati)

| | 1 ANNO | 3 ANNI | 5 ANNI | 10 ANNI | INIZIO |
|---|--------|--------|--------|---------|--------|
| Volatilità Gruppo d'investimento (in %) | 4.37 | 5.16 | 4.20 | 3.26 | 3.26 |
| Volatilità del Benchmark (in %) | 4.40 | 4.87 | 3.98 | 3.11 | 3.10 |
| Tracking Error ex post (in %) | 0.37 | 0.43 | 0.35 | 0.36 | 0.90 |
| Information Ratio | -1.11 | -0.52 | -0.55 | -0.17 | -0.17 |
| Sharpe Ratio | -2.52 | -0.70 | -0.31 | 0.12 | 0.42 |
| Correlazione | 1.00 | 1.00 | 1.00 | 0.99 | 0.96 |
| Beta | 0.99 | 1.06 | 1.05 | 1.04 | 1.01 |
| Jensen alfa | -0.51 | -0.03 | -0.14 | -0.08 | -0.17 |
| Maximum Drawdown (in %) | -11.84 | -13.30 | -13.92 | -13.92 | -13.92 |
| Recovery Period (anni) | - | - | - | - | - |

Performance



Informazioni sul prodotto

Numero di valore: 1245477
ISIN: CH0012454770
LEI: 2549002XPEQH1AZYBW05
Codice Bloomberg: SWAOBAU SW
Benchmark: SBI Foreign AAA - BBB TR
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®: Swiss Life Asset Management SA
Controllo asset manager: PPCmetrics supporta il controllo costante dell'asset manager e la valutazione dei risultati d'investimento.
Pubblicazioni di corsi: Bloomberg: ASSL
www.swisslife.ch/fondazioneinvestimento
Quote spese operative TER KGAST ex ante: 0.27%
ex post al: 30/09/2022 0.27%

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.

Tracking error ex ante: Il tracking error previsto per i prossimi 12 mesi corrisponde al Tracking error ex post degli ultimi 3 anni.

Struttura del portafoglio per settore

| | Gruppo d'investimento | Benchmark |
|-----------------------------|-----------------------|-----------|
| FINANZA | 58.66% | 49.68% |
| ISTITUTI LETTERE DI PEGNO | 10.34% | 11.55% |
| ENERGIA | 3.54% | 3.21% |
| CONSUMO NON CICLICO | 3.25% | 4.59% |
| STATI E SIMILI | 3.08% | 17.14% |
| COMUNICAZIONE | 3.04% | 2.79% |
| BENI INDUSTRIALI | 2.48% | 4.93% |
| SERVIZI DI PUBBLICA UTILITÀ | 1.84% | 2.19% |
| SUPERNAZIONALE | 7.12% | - |
| ALTRI | 2.63% | 3.92% |
| LIQUIDITÀ | 4.03% | - |

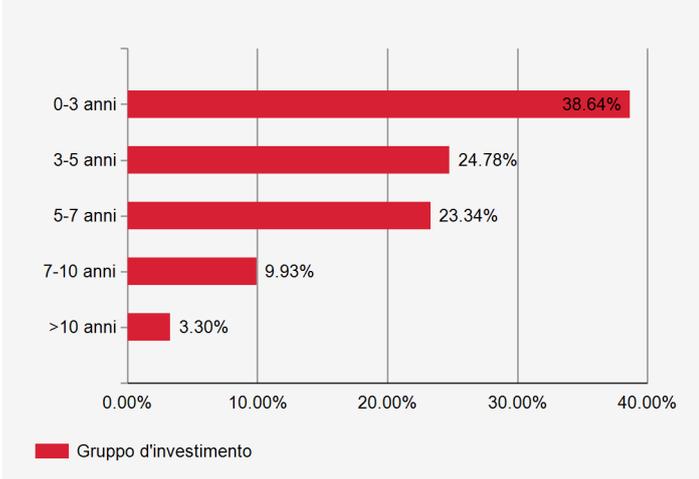
Principali debitori e rating

| | Rating | Gruppo d'investimento |
|--------------------------------|--------|-----------------------|
| Müchner Hypothekbank | AA- | 3.70% |
| Credit Agricole Group | AA- | 3.24% |
| Pfandbriefbank | AAA | 2.84% |
| Pfandbriefzentrale | AAA | 2.59% |
| Commonwealth Bank of Australia | AA | 2.51% |

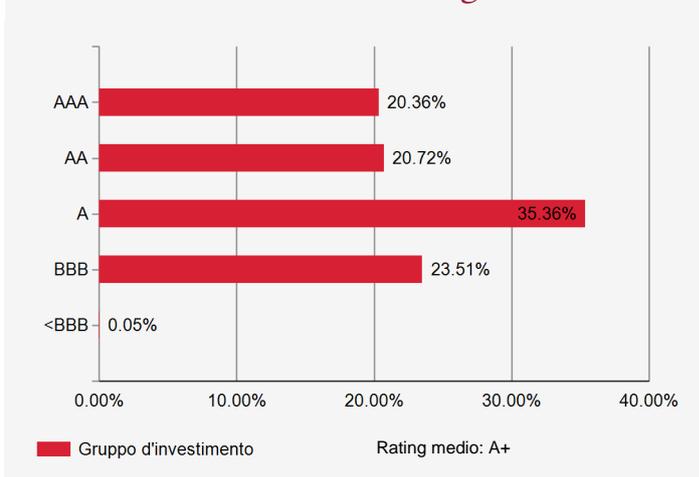
Ulteriori informazioni sui debitori

| | |
|-----------------------------------|-------|
| Numero di debitori | 121 |
| Quota di debitori senza benchmark | 9.23% |

Struttura della scadenza dei titoli



Investimenti secondo il rating



Durata e rendimento alla scadenza

| | Gruppo d'investimento | Benchmark |
|-----------------------------------|-----------------------|-----------|
| Modified Duration | 4.3 | 4.3 |
| Rendimento alla scadenza teorica* | 2.58% | 2.40% |

* prima copertura del rischio di cambio, prendendo in considerazione i derivati

Struttura del portafoglio secondo il paese/regione

| | Gruppo d'investimento | Benchmark |
|---------------------------------|-----------------------|-----------|
| STATI UNITI | 16.48% | 16.16% |
| FRANCIA | 12.91% | 14.40% |
| GERMANIA | 9.41% | 11.08% |
| AUSTRALIA | 8.40% | 7.83% |
| SVIZZERA | 7.23% | 0.54% |
| CANADA | 6.95% | 9.15% |
| REGNO UNITO | 6.19% | 4.83% |
| REGIONE EUROPEA (EUR) | 8.21% | 17.24% |
| MERCATI EMERGENTI IN AMERICA | 6.67% | 5.93% |
| MERCATI EMERGENTI MEDIO ORIENTE | 4.89% | 2.21% |
| ALTRI | 8.63% | 10.63% |
| LIQUIDITÀ, COPERTURA | 4.03% | - |

Fondazione d'investimento Swiss Life

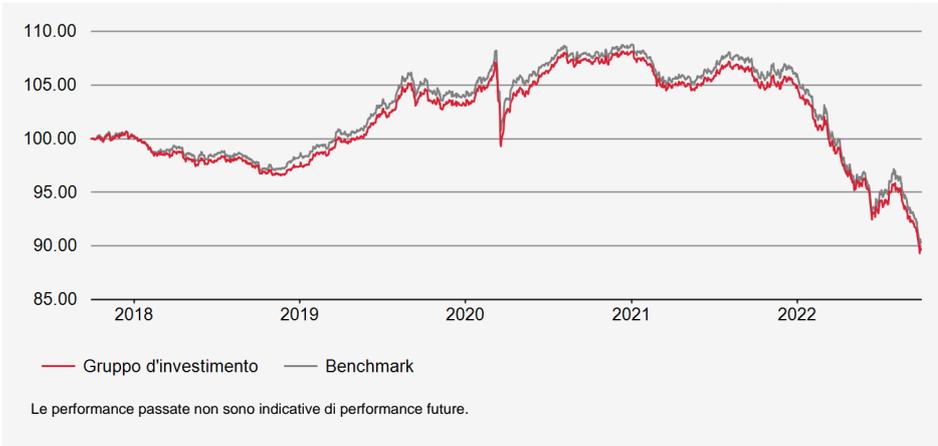
Obbligazioni Global (CHF hedged)

Patrimonio netto (NAV) in mio. CHF: 41.14
Valore d'inventario netto per diritto in CHF: 116.73

Strategia d'investimento

Investimenti in titoli di credito in valute estere di debitori domiciliati in Svizzera o all'estero (dal 1.1.2011 CHF hedged). Selezione attiva di titoli, gestione della duration e posizionamento della curva dei tassi d'interesse. Limitazione per debitore: 10% (eccezione: se rappresentati nel benchmark, max. 5%-punti in più della ponderazione del benchmark). Debitori esterni al benchmark: max. 10%. Rating medio: almeno A-. I rischi valutari vengono coperti al 90% almeno contro il franco. Realizzazione tramite Swiss Life iFunds (CH) Bond Global Government+ (CHF hedged) e Swiss Life iFunds (CH) Bond Global Corporates (CHF hedged), fondi d'investimento di diritto svizzero della categoria "altri fondi per investimenti tradizionali".

Evoluzione del valore nella valuta di riferimento (base 100)



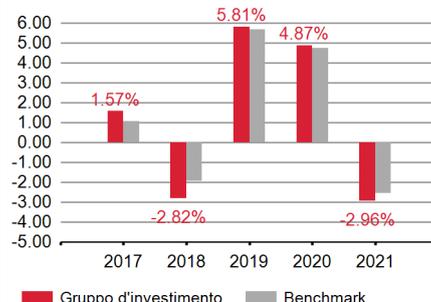
Performance nella valuta di riferimento

| | PERFORMANCE CUMULATA | | | | PERFORMANCE ANNUALIZZATA | | | |
|-----------------------|----------------------|--------|--------|---------|--------------------------|--------|---------|--------|
| | YTD | 1 MESE | 3 MESI | 1 ANNO | 3 ANNI | 5 ANNI | 10 ANNI | INIZIO |
| GRUPPO D'INVESTIMENTO | -14.51% | -3.55% | -4.29% | -14.87% | -4.86% | -2.15% | -0.08% | 0.74% |
| BENCHMARK | -14.74% | -3.70% | -4.33% | -14.92% | -4.91% | -2.00% | 0.04% | 0.81% |

Dati statistici (annualizzati)

| | 1 ANNO | 3 ANNI | 5 ANNI | 10 ANNI | INIZIO |
|---|--------|--------|--------|---------|--------|
| Volatilità Gruppo d'investimento (in %) | 5.71 | 5.15 | 4.43 | 3.86 | 5.42 |
| Volatilità del Benchmark (in %) | 6.22 | 5.28 | 4.55 | 3.86 | 5.59 |
| Tracking Error ex post (in %) | 0.71 | 0.50 | 0.49 | 0.62 | 1.46 |
| Information Ratio | 0.07 | 0.09 | -0.30 | -0.19 | -0.05 |
| Sharpe Ratio | -2.72 | -0.85 | -0.33 | 0.13 | 0.12 |
| Correlazione | 1.00 | 1.00 | 0.99 | 0.99 | 0.97 |
| Beta | 0.92 | 0.97 | 0.97 | 0.99 | 0.94 |
| Jensen alfa | -1.17 | -0.08 | -0.19 | -0.11 | -0.03 |
| Maximum Drawdown (in %) | -15.65 | -17.40 | -17.40 | -17.40 | -17.40 |
| Recovery Period (anni) | - | - | - | - | - |

Performance



Informazioni sul prodotto

Numero di valore: 1245479

ISIN: CH0012454796

LEI: 254900F82G5L48XPDV74

Codice Bloomberg: SWAOBFG SW

Benchmark: 40% Bloomberg Global Aggregate Corporates 60% Bloomberg Global Aggregate Treasuries ex CH (Indici CHF hedged)

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®: Swiss Life Asset Management SA

Controllo asset manager:

PPCmetrics supporta il controllo costante dell'asset manager e la valutazione dei risultati d'investimento.

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

Quote spese operative TER KGAST

ex ante: 0.46%

ex post al: 30/09/2022 0.46%

Benchmark: Il benchmark è stato modificato al 1° luglio 2012. Per informazioni relative al precedente benchmark potete rivolgervi alla Fondazione d'investimento Swiss Life.

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.

Tracking error ex ante: Il tracking error previsto per i prossimi 12 mesi corrisponde al Tracking error ex post degli ultimi 3 anni.

Fondazione d'investimento Swiss Life

Obbligazioni Global (CHF hedged)

Struttura del portafoglio per settore

| | Gruppo d'investimento | Benchmark |
|---------------------------------|-----------------------|-----------|
| STATI E SIMILI | 48.86% | 60.00% |
| FINANZA | 22.08% | 15.79% |
| CONSUMO NON CICLICO | 7.36% | 6.22% |
| SERVIZI DI PUBBLICA UTILITÀ | 3.01% | 3.34% |
| ENERGIA | 2.64% | 2.39% |
| CONSUMO CICLICO | 2.50% | 2.73% |
| BENI INDUSTRIALI | 2.44% | 2.83% |
| COMUNICAZIONE | 1.93% | 3.36% |
| TECNOLOGIA | 1.38% | 2.09% |
| SUPERNAZIONALE | 3.45% | - |
| OTHER | 0.51% | 1.25% |
| LIQUIDITÀ | 3.52% | - |
| COPERTURA DEL RISCHIO DI CAMBIO | 0.33% | - |

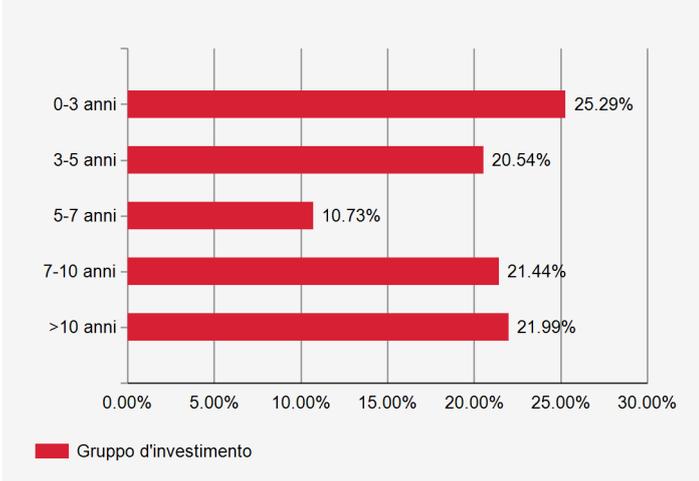
Principali debitori e rating

| | Gruppo d'investimento | Benchmark |
|---------------------------------|-----------------------|-----------|
| US Treasury N/B | AA+ | 19.28% |
| Giappone | A+ | 7.79% |
| Italia | BBB- | 4.00% |
| People's Republic of China | A+ | 3.32% |
| Kreditanstalt fuer Wiederaufbau | AAA | 2.46% |

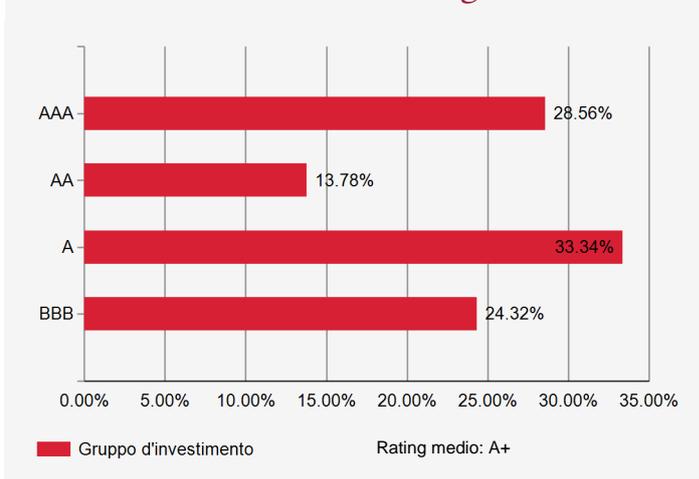
Ulteriori informazioni sui debitori

| | |
|-----------------------------------|-------|
| Numero di debitori | 269 |
| Quota di debitori senza benchmark | 2.02% |

Struttura della scadenza dei titoli



Investimenti secondo il rating



Durata e rendimento alla scadenza

| | Gruppo d'investimento | Benchmark |
|-----------------------------------|-----------------------|-----------|
| Modified Duration | 6.1 | 6.9 |
| Rendimento alla scadenza teorica* | 3.68% | 3.90% |

* prima copertura del rischio di cambio, prendendo in considerazione i derivati

Struttura del portafoglio per valute e la duration

| | Gruppo d'investimento | | Benchmark | |
|-------|-----------------------|----------|-----------|----------|
| | Peso | Duration | Peso | Duration |
| USD | 47.40% | 6.23 | 47.56% | 6.36 |
| EUR | 31.07% | 3.92 | 21.73% | 6.38 |
| JPY | 8.30% | 8.51 | 13.52% | 7.32 |
| Altri | 13.23% | 9.52 | 17.20% | 12.53 |

Struttura del portafoglio secondo il paese/regione

| | Gruppo d'investimento | Benchmark |
|---------------------------------|-----------------------|-----------|
| STATI UNITI | 35.85% | 41.99% |
| GIAPPONE | 10.81% | 14.60% |
| GERMANIA | 6.41% | 4.15% |
| CANADA | 4.94% | 3.31% |
| ITALIA | 3.99% | 2.81% |
| CINA | 3.32% | 5.02% |
| REGNO UNITO | 2.65% | 2.86% |
| REGIONE EUROPEA (EUR) | 11.29% | 9.42% |
| REGIONE EUROPEA (EX EUR) | 5.42% | 4.41% |
| MERCATI EMERGENTI ASIA PACIFICO | 1.45% | 0.88% |
| ALTRI | 10.03% | 10.55% |
| LIQUIDITÀ, COPERTURA | 3.85% | - |

Fondazione d'investimento Swiss Life

Obbligazioni Global Stati+ (CHF hedged)

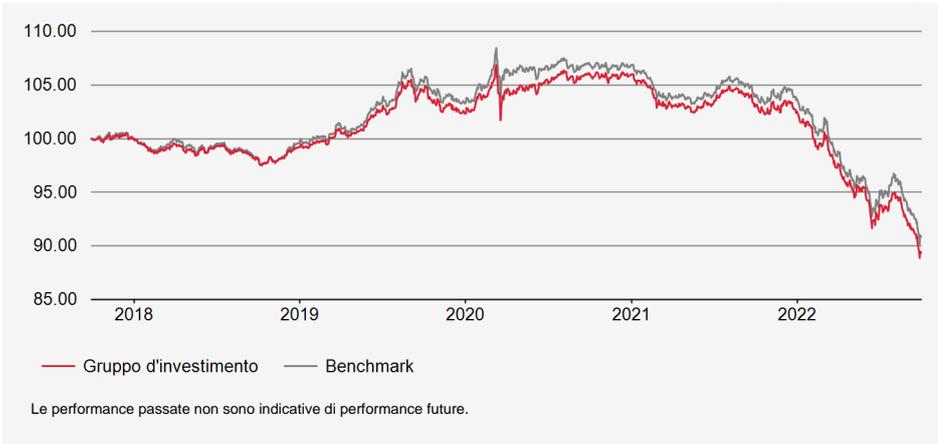


Patrimonio netto (NAV) in mio. CHF: 569.64
Valore d'inventario netto per diritto in CHF: 106.18

Strategia d'investimento

Investimenti in titoli di credito espressi in valute estere di Stati e istituzioni vicine allo Stato. Selezione attiva di titoli, gestione della duration e posizionamento della curva dei tassi d'interesse. Limitazione per debitore: 10% (eccezione: se rappresentati nel benchmark, max. 5%-punti in più della ponderazione del benchmark). Debitori esterni al benchmark: max. 10%. Rating medio: almeno A+. I rischi valutari vengono coperti al 90% almeno contro il franco. Realizzazione tramite Swiss Life iFunds (CH) Bond Global Government+ (CHF hedged); fondo d'investimento di diritto svizzero della categoria "altri fondi per investimenti tradizionali".

Evoluzione del valore nella valuta di riferimento (base 100)



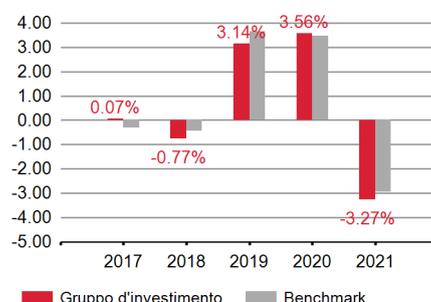
Performance nella valuta di riferimento

| | PERFORMANCE CUMULATA | | | | PERFORMANCE ANNUALIZZATA | | | |
|------------------------------|----------------------|---------------|---------------|----------------|--------------------------|---------------|---------------|--------------|
| | YTD | 1 MESE | 3 MESI | 1 ANNO | 3 ANNI | 5 ANNI | 10 ANNI | INIZIO |
| GRUPPO D'INVESTIMENTO | -12.76% | -3.06% | -4.13% | -13.17% | -5.05% | -2.21% | -0.29% | 0.51% |
| BENCHMARK | -12.35% | -2.98% | -3.82% | -12.50% | -4.80% | -1.89% | -0.05% | 0.54% |

Dati statistici (annualizzati)

| | 1 ANNO | 3 ANNI | 5 ANNI | 10 ANNI | INIZIO |
|---|--------|--------|--------|---------|--------|
| Volatilità Gruppo d'investimento (in %) | 4.91 | 4.08 | 3.66 | 3.37 | 3.40 |
| Volatilità del Benchmark (in %) | 5.21 | 4.14 | 3.78 | 3.39 | 3.33 |
| Tracking Error ex post (in %) | 0.62 | 0.64 | 0.56 | 0.62 | 0.71 |
| Information Ratio | -1.07 | -0.39 | -0.57 | -0.38 | -0.05 |
| Sharpe Ratio | -2.76 | -1.12 | -0.41 | 0.08 | 0.29 |
| Correlazione | 0.99 | 0.99 | 0.99 | 0.98 | 0.98 |
| Beta | 0.94 | 0.97 | 0.96 | 0.98 | 1.00 |
| Jensen alfa | -1.41 | -0.35 | -0.37 | -0.22 | -0.03 |
| Maximum Drawdown (in %) | -14.15 | -16.83 | -16.83 | -16.83 | -16.83 |
| Recovery Period (anni) | - | - | - | - | - |

Performance



Informazioni sul prodotto

Numero di valore: 11955694
ISIN: CH0119556949
LEI: 254900H7WEVS3K9ANR90
Codice Bloomberg: SWLGSTP SW
Benchmark: BLOOMBERG GLOBAL AGG TREAS EX CHF TR HEDGED CHF
Moneta: CHF
Domicilio: Svizzera
Data di creazione: 14/12/2010
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@: Swiss Life Asset Management SA
Controllo asset manager: PPCmetrics supporta il controllo costante dell'asset manager e la valutazione dei risultati d'investimento.
Pubblicazioni di corsi: Bloomberg: ASSL
www.swisslife.ch/fondazioneinvestimento
Quote spese operative TER KGAST ex ante: 0.42%
ex post al: 30/09/2022 0.42%

Benchmark: Il benchmark è stato modificato al 1° luglio 2012. Per informazioni relative al precedente benchmark potete rivolgervi alla Fondazione d'investimento Swiss Life.
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.
Tracking error ex ante: Il tracking error previsto per i prossimi 12 mesi corrisponde al Tracking error ex post degli ultimi 3 anni.

Fondazione d'investimento Swiss Life

Obbligazioni Global Stati+ (CHF hedged)

Struttura del portafoglio per settore

| | Gruppo d'investimento | Benchmark |
|---------------------------------|-----------------------|-----------|
| STATI E SIMILI | 81.32% | 100.00% |
| FINANZA | 9.26% | - |
| CONSUMO NON CICLICO | 0.49% | - |
| BENI INDUSTRIALI | 0.11% | - |
| SUPERNAZIONALE | 5.74% | - |
| LIQUIDITÀ | 2.09% | - |
| COPERTURA DEL RISCHIO DI CAMBIO | 0.99% | - |

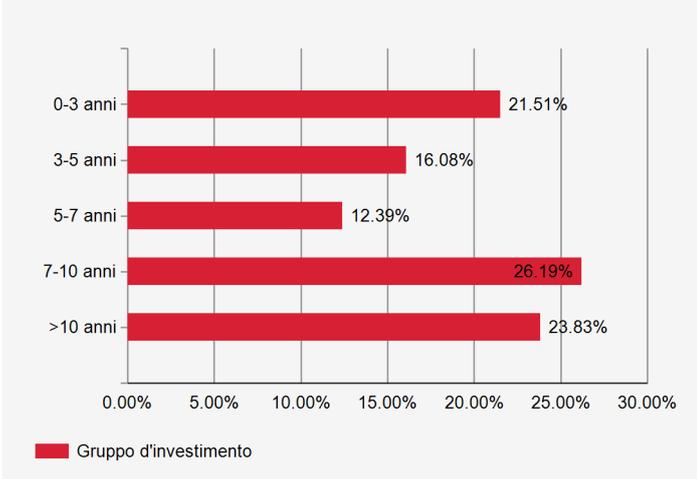
Principali debitori e rating

| | Rating | Gruppo d'investimento |
|---------------------------------|--------|-----------------------|
| US Treasury N/B | AA+ | 32.09% |
| Giappone | A+ | 12.97% |
| Italia | BBB- | 6.65% |
| People's Republic of China | A+ | 5.53% |
| Kreditanstalt fuer Wiederaufbau | AAA | 4.09% |

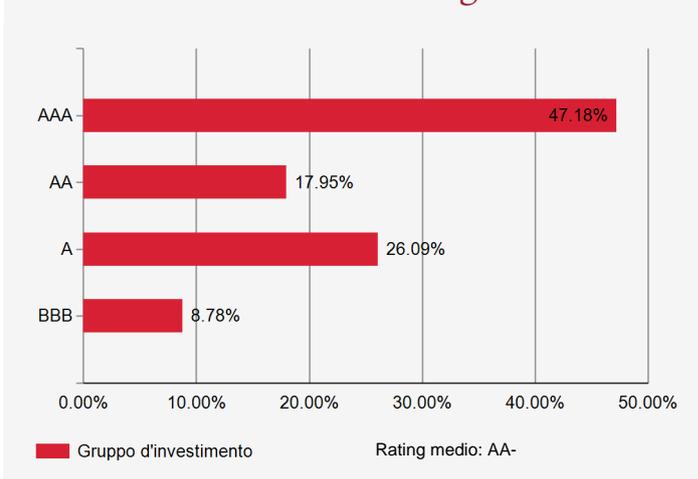
Ulteriori informazioni sui debitori

| | |
|-----------------------------------|-------|
| Numero di debitori | 80 |
| Quota di debitori senza benchmark | 0.29% |

Struttura della scadenza dei titoli



Investimenti secondo il rating



Durata e rendimento alla scadenza

| | Gruppo d'investimento | Benchmark |
|-----------------------------------|-----------------------|-----------|
| Modified Duration | 6.6 | 7.4 |
| Rendimento alla scadenza teorica* | 2.69% | 2.81% |

* prima copertura del rischio di cambio, prendendo in considerazione i derivati

Struttura del portafoglio per valute e la duration

| | Gruppo d'investimento | | Benchmark | |
|-------|-----------------------|----------|-----------|----------|
| | Peso | Duration | Peso | Duration |
| EUR | 34.60% | 4.77 | 21.68% | 7.22 |
| USD | 33.83% | 5.82 | 32.98% | 6.04 |
| JPY | 13.59% | 12.49 | 21.98% | 9.26 |
| GBP | 6.40% | 7.34 | 5.05% | 10.00 |
| Altri | 11.58% | 6.46 | 18.31% | 6.88 |

Struttura del portafoglio secondo il paese/regione

| | Gruppo d'investimento | Benchmark |
|--------------------------|-----------------------|-----------|
| STATI UNITI | 32.11% | 32.98% |
| GIAPPONE | 13.86% | 21.98% |
| GERMANIA | 7.73% | 3.97% |
| ITALIA | 6.64% | 4.69% |
| CANADA | 5.58% | 1.86% |
| CINA | 5.52% | 8.36% |
| AUSTRIA | 3.24% | 0.75% |
| REGIONE EUROPEA (EUR) | 13.38% | 11.94% |
| REGIONE EUROPEA (EX EUR) | 3.77% | 5.41% |
| REGIONE ASIA E PACIFICO | 1.32% | 1.51% |
| ALTRI | 3.77% | 6.57% |
| LIQUIDITÀ, COPERTURA | 3.08% | - |

Fondazione d'investimento Swiss Life

Obbligazioni Global Imprese Short Term (CHF hedged)

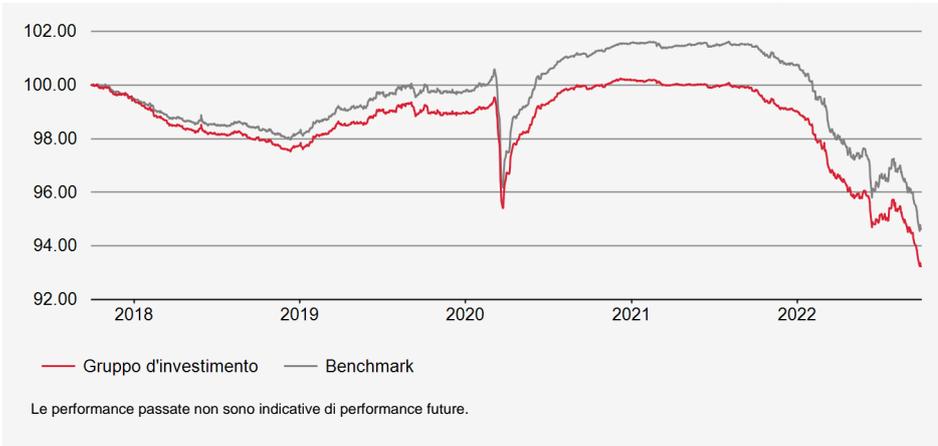


Patrimonio netto (NAV) in mio. CHF: 1,525.66
Valore d'inventario netto per diritto in CHF: 95.49

Strategia d'investimento

Investimenti in titoli di credito espressi in valute estere di società (agenzie e supranational incluse) con una durata residua breve (prevalentemente meno di 3 anni). Selezione attiva di titoli, gestione della duration e posizionamento della curva dei tassi d'interesse. Limitazione per debitore: 10%. Debitori esterni al benchmark: max. 10%. Rating medio: almeno BBB. I rischi valutari vengono coperti al 90% almeno contro il franco. Realizzazione tramite Swiss Life iFunds (CH) Bond Global Corporates Short Term (CHF hedged); Fondi d'investimento di diritto svizzero della categoria "altri fondi per investimenti tradizionali".

Evoluzione del valore nella valuta di riferimento (base 100)



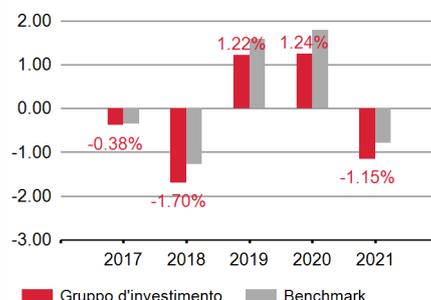
Performance nella valuta di riferimento

| | PERFORMANCE CUMULATA | | | | PERFORMANCE ANNUALIZZATA | | | |
|------------------------------|----------------------|--------|--------|--------|--------------------------|--------|---------|--------|
| | YTD | 1 MESE | 3 MESI | 1 ANNO | 3 ANNI | 5 ANNI | 10 ANNI | INIZIO |
| GRUPPO D'INVESTIMENTO | -5.84% | -1.46% | -1.82% | -6.55% | -2.00% | -1.39% | - | -0.51% |
| BENCHMARK | -6.09% | -1.53% | -1.82% | -6.70% | -1.74% | -1.09% | - | -0.38% |

Dati statistici (annualizzati)

| | 1 ANNO | 3 ANNI | 5 ANNI | 10 ANNI | INIZIO |
|---|--------|--------|--------|---------|--------|
| Volatilità Gruppo d'investimento (in %) | 2.19 | 2.48 | 1.98 | - | 1.60 |
| Volatilità del Benchmark (in %) | 2.41 | 2.65 | 2.11 | - | 1.64 |
| Tracking Error ex post (in %) | 0.29 | 0.24 | 0.20 | - | 0.32 |
| Information Ratio | 0.51 | -1.07 | -1.51 | - | -0.43 |
| Sharpe Ratio | -2.84 | -0.56 | -0.34 | - | 0.07 |
| Correlazione | 1.00 | 1.00 | 1.00 | - | 0.98 |
| Beta | 0.91 | 0.94 | 0.94 | - | 0.95 |
| Jensen alfa | -0.42 | -0.33 | -0.32 | - | -0.13 |
| Maximum Drawdown (in %) | -6.59 | -6.98 | -6.98 | - | -7.46 |
| Recovery Period (anni) | - | - | - | - | - |

Performance



Informazioni sul prodotto

Numero di valore: 22073699
ISIN: CH0220736992
LEI: 2549003DSGO0RN37K507
Codice Bloomberg: SWLOGNT SW
Benchmark: BLOOMBERG GLO AGG CORP 1-3 YR IND HEDGED CHF
Moneta: CHF
Domicilio: Svizzera
Data di creazione: 11/10/2013
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@: Swiss Life Asset Management SA

Controllo asset manager: PPCmetrics supporta il controllo costante dell'asset manager e la valutazione dei risultati d'investimento.

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

Quote spese operative TER KGAST
ex ante: 0.38%
ex post al: 30/09/2022 0.38%

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.

Tracking error ex ante: Il tracking error previsto per i prossimi 12 mesi corrisponde al Tracking error ex post degli ultimi 3 anni.

Fondazione d'investimento Swiss Life

Obbligazioni Global Imprese Short Term (CHF hedged)

Struttura del portafoglio per settore

| | Gruppo d'investimento | Benchmark |
|---------------------------------|-----------------------|-----------|
| FINANZA | 56.89% | 51.94% |
| CONSUMO NON CICLICO | 16.26% | 11.68% |
| CONSUMO CICLICO | 7.05% | 8.75% |
| ENERGIA | 3.98% | 4.40% |
| TECNOLOGIA | 3.63% | 3.96% |
| MATERIALI DI BASE | 3.58% | 2.05% |
| COMUNICAZIONE | 3.58% | 4.88% |
| SERVIZI DI PUBBLICA UTILITÀ | 2.51% | 5.83% |
| SUPERNAZIONALE | 0.83% | - |
| ALTRI | 2.43% | 6.52% |
| LIQUIDITÀ | 0.18% | - |
| COPERTURA DEL RISCHIO DI CAMBIO | -0.91% | - |

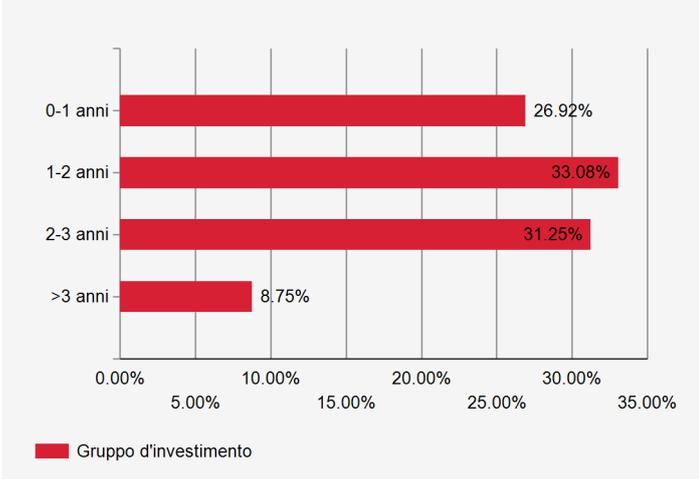
Principali debitori e rating

| | | Gruppo d'investimento |
|-----------------------------|------|-----------------------|
| Bank of America, New York | A- | 2.15% |
| Goldman Sachs Group Inc/The | BBB+ | 1.52% |
| Nestle SA | AA- | 1.51% |
| Morgan Stanley NE US | A- | 1.38% |
| Toronto-Dominion Bank/The | A | 1.32% |

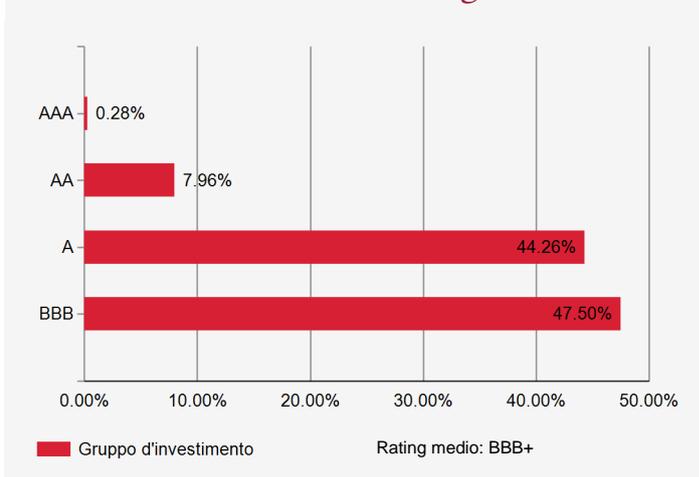
Ulteriori informazioni sui debitori

| | |
|-----------------------------------|-------|
| Numero di debitori | 182 |
| Quota di debitori senza benchmark | 5.94% |

Struttura della scadenza dei titoli



Investimenti secondo il rating



Durata e rendimento alla scadenza

| | Gruppo d'investimento | Benchmark |
|-----------------------------------|-----------------------|-----------|
| Modified Duration | 1.6 | 1.9 |
| Rendimento alla scadenza teorica* | 4.68% | 4.84% |

* prima copertura del rischio di cambio, prendendo in considerazione i derivati

Struttura del portafoglio per valute e la duration

| | Gruppo d'investimento | | Benchmark | |
|-------|-----------------------|----------|-----------|----------|
| | Peso | Duration | Peso | Duration |
| USD | 62.21% | 1.85 | 63.41% | 2.03 |
| EUR | 30.99% | 1.43 | 26.84% | 2.44 |
| GBP | 4.03% | 0.91 | 2.48% | 2.21 |
| CHF | 2.78% | 1.34 | 0.60% | 1.75 |
| Altri | - | - | 6.67% | 1.89 |

Struttura del portafoglio secondo il paese/regione

| | Gruppo d'investimento | Benchmark |
|---------------------------------|-----------------------|-----------|
| STATI UNITI | 38.65% | 44.62% |
| REGNO UNITO | 10.06% | 7.38% |
| FRANCIA | 7.06% | 7.11% |
| GIAPPONE | 6.47% | 5.43% |
| CANADA | 4.94% | 7.22% |
| GERMANIA | 4.61% | 6.05% |
| SVEZIA | 3.75% | 1.08% |
| REGIONE EUROPEA (EUR) | 10.61% | 9.41% |
| REGIONE EUROPEA (EX EUR) | 5.65% | 3.19% |
| MERCATI EMERGENTI ASIA PACIFICO | 3.96% | 2.69% |
| ALTRI | 4.97% | 5.82% |
| LIQUIDITÀ, COPERTURA | -0.73% | - |

Fondazione d'investimento Swiss Life

Obbligazioni Global Imprese (CHF hedged)

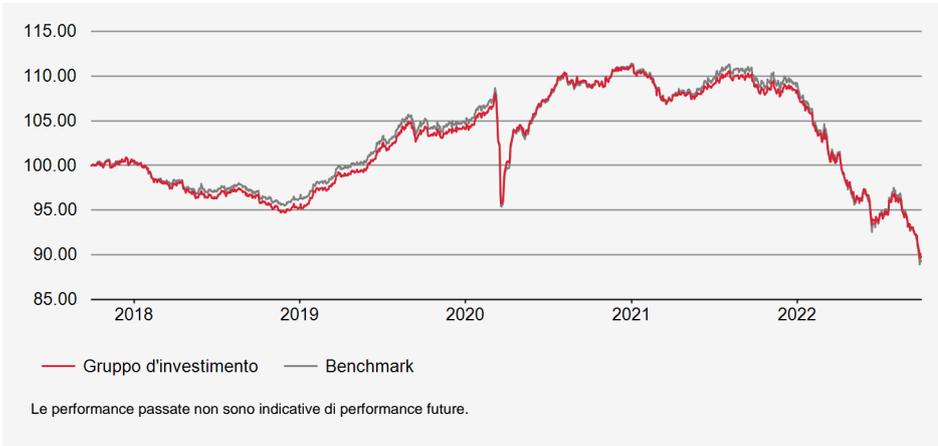


Patrimonio netto (NAV) in mio. CHF: 651.42
Valore d'inventario netto per diritto in CHF: 114.31

Strategia d'investimento

Investimenti in titoli di credito in valute estere di imprese, incl. agenzie ed enti sovranazionali. Selezione attiva di titoli, gestione della duration e posizionamento della curva dei tassi d'interesse. Debitori esterni al benchmark: max. 10%. Limitazioni per debitore: 10%. Rating medio: almeno BBB. I rischi valutari vengono coperti al 90% almeno contro il franco. Realizzazione tramite Swiss Life iFunds (CH) Bond Global Corporates (CHF hedged); fondo d'investimento di diritto svizzero della categoria "altri fondi per investimenti tradizionali".

Evoluzione del valore nella valuta di riferimento (base 100)



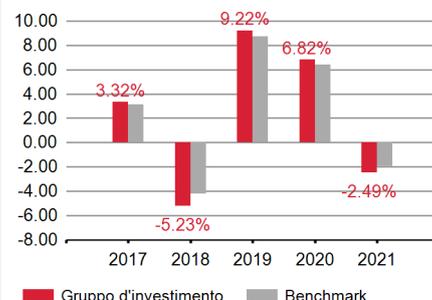
Performance nella valuta di riferimento

| | PERFORMANCE CUMULATA | | | | PERFORMANCE ANNUALIZZATA | | | |
|------------------------------|----------------------|---------------|---------------|----------------|--------------------------|---------------|--------------|--------------|
| | YTD | 1 MESE | 3 MESI | 1 ANNO | 3 ANNI | 5 ANNI | 10 ANNI | INIZIO |
| GRUPPO D'INVESTIMENTO | -17.20% | -4.30% | -4.56% | -17.49% | -4.74% | -2.13% | 0.14% | 1.14% |
| BENCHMARK | -18.26% | -4.78% | -5.11% | -18.47% | -5.16% | -2.24% | 0.15% | 1.00% |

Dati statistici (annualizzati)

| | 1 ANNO | 3 ANNI | 5 ANNI | 10 ANNI | INIZIO |
|---|--------|--------|--------|---------|--------|
| Volatilità Gruppo d'investimento (in %) | 7.24 | 7.28 | 6.10 | 5.05 | 5.07 |
| Volatilità del Benchmark (in %) | 8.05 | 8.00 | 6.58 | 5.25 | 5.12 |
| Tracking Error ex post (in %) | 1.01 | 0.93 | 0.83 | 0.86 | 0.96 |
| Information Ratio | 0.96 | 0.45 | 0.13 | -0.01 | 0.14 |
| Sharpe Ratio | -2.58 | -0.58 | -0.24 | 0.14 | 0.32 |
| Correlazione | 1.00 | 1.00 | 0.99 | 0.99 | 0.98 |
| Beta | 0.90 | 0.91 | 0.92 | 0.95 | 0.97 |
| Jensen alfa | -0.89 | 0.00 | -0.01 | 0.03 | 0.18 |
| Maximum Drawdown (in %) | -18.09 | -19.34 | -19.34 | -19.34 | -19.34 |
| Recovery Period (anni) | - | - | - | - | - |

Performance



Informazioni sul prodotto

Numero di valore: 11955702
ISIN: CH0119557020
LEI: 254900C3B00LU0UJ428
Codice Bloomberg: SWLGUNT SW
Benchmark: BLOOMBERG GLO AGG CORP IND HEDGED CHF
Moneta: CHF
Domicilio: Svizzera
Data di creazione: 14/12/2010
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@: Swiss Life Asset Management SA

Controllo asset manager: PPCmetrics supporta il controllo costante dell'asset manager e la valutazione dei risultati d'investimento.

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

Quote spese operative TER KGAST
ex ante: 0.53%
ex post al: 30/09/2022 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 logaritmicizzati mensili.

Tracking error ex ante: Il tracking error previsto per i prossimi 12 mesi corrisponde al Tracking error ex post degli ultimi 3 anni.

Fondazione d'investimento Swiss Life

Obbligazioni Global Imprese (CHF hedged)

Struttura del portafoglio per settore

| | Gruppo d'investimento | Benchmark |
|---------------------------------|-----------------------|-----------|
| FINANZA | 41.51% | 39.47% |
| CONSUMO NON CICLICO | 17.76% | 15.56% |
| SERVIZI DI PUBBLICA UTILITÀ | 7.56% | 8.35% |
| ENERGIA | 6.64% | 5.98% |
| CONSUMO CICLICO | 6.28% | 6.83% |
| BENI INDUSTRIALI | 5.97% | 7.09% |
| COMUNICAZIONE | 4.86% | 8.41% |
| TECNOLOGIA | 3.48% | 5.23% |
| ALTRI | 1.27% | 3.12% |
| LIQUIDITÀ | 5.33% | - |
| COPERTURA DEL RISCHIO DI CAMBIO | -0.67% | - |

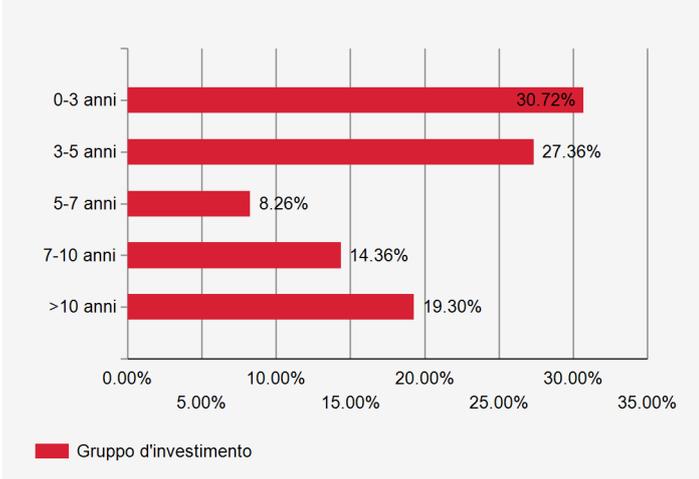
Principali debitori e rating

| | Gruppo d'investimento | |
|------------------------------|-----------------------|-------|
| Hyundai Motor Co | BBB+ | 1.95% |
| JPMorgan Chase & Co | A- | 1.92% |
| British American Tobacco PLC | BBB | 1.91% |
| Banco Santander SA, Madrid | BBB | 1.90% |
| Blackstone Inc | BBB | 1.85% |

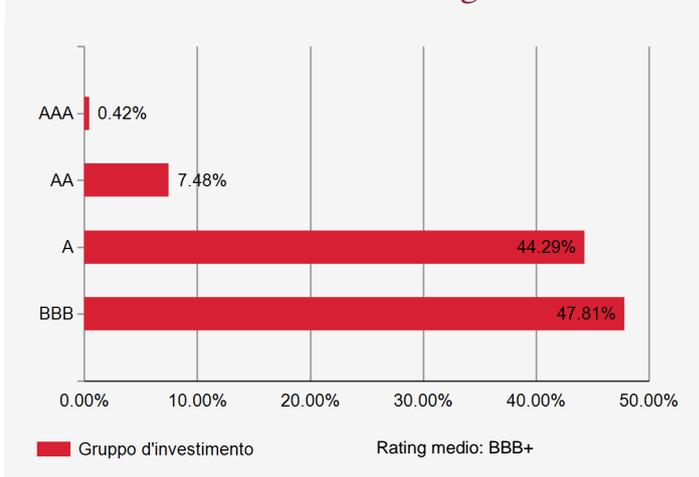
Ulteriori informazioni sui debitori

| | |
|-----------------------------------|-------|
| Numero di debitori | 189 |
| Quota di debitori senza benchmark | 4.64% |

Struttura della scadenza dei titoli



Investimenti secondo il rating



Durata e rendimento alla scadenza

| | Gruppo d'investimento | Benchmark |
|-----------------------------------|-----------------------|-----------|
| Modified Duration | 5.3 | 6.2 |
| Rendimento alla scadenza teorica* | 5.18% | 5.53% |

* prima copertura del rischio di cambio, prendendo in considerazione i derivati

Struttura del portafoglio per valute e la duration

| | Gruppo d'investimento | | Benchmark | |
|-------|-----------------------|----------|-----------|----------|
| | Peso | Duration | Peso | Duration |
| USD | 68.07% | 6.86 | 69.42% | 6.84 |
| EUR | 25.85% | 2.65 | 21.81% | 5.12 |
| JPY | 0.34% | 2.52 | 0.83% | 4.42 |
| Altri | 5.73% | 3.10 | 7.97% | 6.02 |

Struttura del portafoglio secondo il paese/regione

| | Gruppo d'investimento | Benchmark |
|---------------------------------|-----------------------|-----------|
| STATI UNITI | 41.62% | 55.51% |
| REGNO UNITO | 6.67% | 7.14% |
| GIAPPONE | 6.25% | 3.53% |
| FRANCIA | 5.98% | 5.94% |
| GERMANIA | 4.44% | 4.42% |
| CANADA | 3.99% | 5.48% |
| SPAGNA | 3.30% | 1.93% |
| REGIONE EUROPEA (EUR) | 8.16% | 5.65% |
| REGIONE EUROPEA (EX EUR) | 7.94% | 2.92% |
| MERCATI EMERGENTI ASIA PACIFICO | 3.63% | 2.20% |
| ALTRI | 3.36% | 5.28% |
| LIQUIDITÀ, COPERTURA | 4.66% | - |

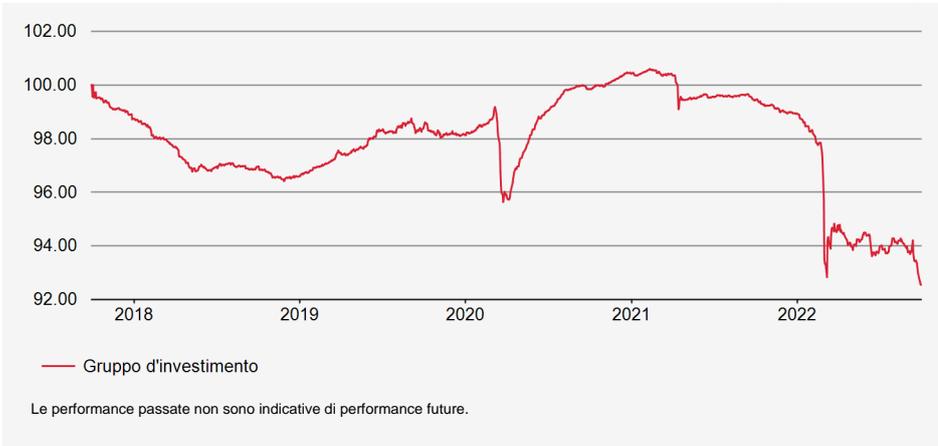


Patrimonio netto (NAV) in mio. CHF: 203.25
Valore d'inventario netto per diritto in CHF: 92.55

Strategia d'investimento

Investimenti in titoli di credito in dollari statunitensi o altre valute forti di imprese di Paesi di recente industrializzazione (Emerging Markets), inclusi agencies ed enti sovranazionali con una durata residua breve (prevalentemente meno di 3 anni). Selezione attiva di titoli, gestione della duration e posizionamento della curva dei tassi d'interesse. Limitazione per debitore: 10%. Rating medio: almeno BBB-. I rischi valutari vengono coperti al 90% almeno contro il franco. Realizzazione tramite Swiss Life Funds (LUX) Bond Emerging Markets Short Term CHF AM Cap; fondo d'investimento di diritto lussemburghese.

Evoluzione del valore nella valuta di riferimento (base 100)



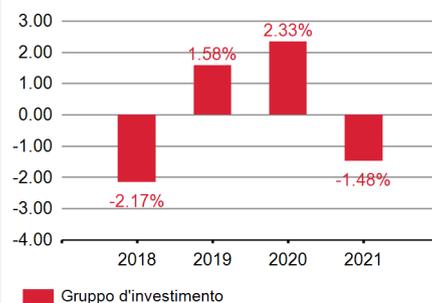
Performance nella valuta di riferimento

| | PERFORMANCE CUMULATA | | | | PERFORMANCE ANNUALIZZATA | | | |
|------------------------------|----------------------|--------|--------|--------|--------------------------|--------|---------|--------|
| | YTD | 1 MESE | 3 MESI | 1 ANNO | 3 ANNI | 5 ANNI | 10 ANNI | INIZIO |
| GRUPPO D'INVESTIMENTO | -6.45% | -1.42% | -1.41% | -6.92% | -2.01% | -1.53% | - | -1.53% |

Dati statistici (annualizzati)

| | 1 ANNO | 3 ANNI | 5 ANNI | 10 ANNI | INIZIO |
|---|--------|--------|--------|---------|--------|
| Volatilità Gruppo d'investimento (in %) | 2.93 | 2.92 | 2.35 | - | 2.33 |
| Sharpe Ratio | -2.26 | -0.48 | -0.35 | - | -0.35 |
| Maximum Drawdown (in %) | -6.96 | -8.00 | -8.00 | - | -8.00 |
| Recovery Period (anni) | - | - | - | - | - |

Performance



Informazioni sul prodotto

Numero di valore: 38013680
ISIN: CH0380136801
LEI: 254900EGYJLGZXIT6O90
Codice Bloomberg: SLOSTCH SW
Moneta: CHF
Domicilio: Svizzera
Data di creazione: 29/09/2017
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®: Swiss Life Asset Management SA
Controllo asset manager: PPCmetrics supporta il controllo costante dell'asset manager e la valutazione dei risultati d'investimento.
Pubblicazioni di corsi: Bloomberg: ASSL
www.swisslife.ch/fondazioneinvestimento
Quote spese operative TER KGAST ex ante: 0.50%
ex post al: 30/09/2022 0.50%

Fondazione d'investimento Swiss Life

Obbligazioni Emerging Markets Short Term (CHF hedged)

Struttura del portafoglio per settore

| | Gruppo d'investimento |
|---------------------------------|-----------------------|
| FINANZA | 34.27% |
| STATI E SIMILI | 12.22% |
| ENERGIA | 10.16% |
| MATERIALI DI BASE | 7.87% |
| SERVIZI DI PUBBLICA UTILITÀ | 7.65% |
| COMUNICAZIONE | 5.75% |
| CONSUMO CICLICO | 4.11% |
| BENI INDUSTRIALI | 3.45% |
| SUPERNAZIONALE | 2.04% |
| ALTRI | 4.90% |
| LIQUIDITÀ | 9.89% |
| COPERTURA DEL RISCHIO DI CAMBIO | -2.32% |

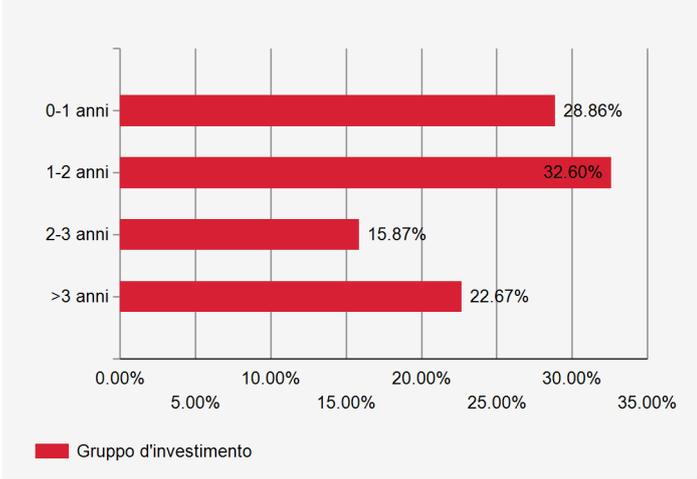
Principali debitori e rating

| | | Gruppo d'investimento |
|---|------|-----------------------|
| US Treasury N/B | AAA | 3.45% |
| Industrial & Commercial Bank of China Ltd | A | 3.38% |
| Ecopetrol SA | BB+ | 2.85% |
| Israel Electric Corp Ltd | BBB+ | 2.69% |
| Power Finance Corp Ltd | BBB- | 2.38% |

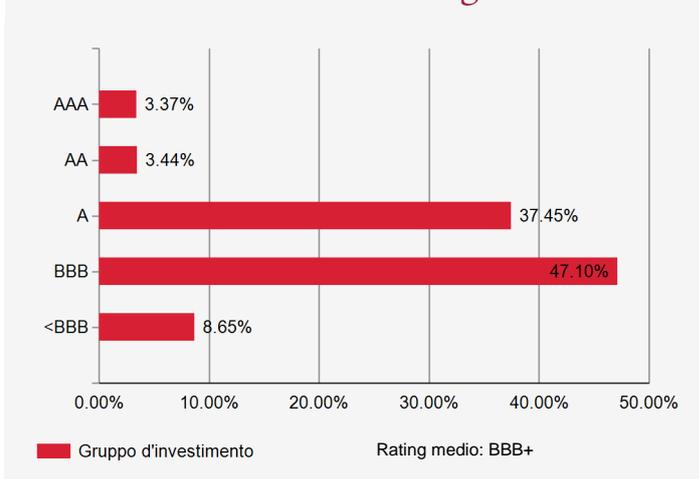
Ulteriori informazioni sui debitori

| | |
|--------------------|-----|
| Numero di debitori | 210 |
|--------------------|-----|

Struttura della scadenza dei titoli



Investimenti secondo il rating



Durata e rendimento alla scadenza

| | Gruppo d'investimento |
|-----------------------------------|-----------------------|
| Modified Duration | 1.8 |
| Rendimento alla scadenza teorica* | 5.63% |

* prima copertura del rischio di cambio, prendendo in considerazione i derivati

Struttura del portafoglio per valute e la duration

| | Gruppo d'investimento | |
|-----|-----------------------|----------|
| | Peso | Duration |
| USD | 100.00% | 1.76 |

Struttura del portafoglio secondo il paese/regione

| | Gruppo d'investimento |
|---------------------------------|-----------------------|
| CINA | 16.28% |
| INDIA | 8.86% |
| EMIRATI ARABI UNITI | 6.74% |
| CILE | 6.26% |
| STATI UNITI | 5.64% |
| COREA DEL SUD | 4.91% |
| QATAR | 4.64% |
| MERCATI EMERGENTI IN AMERICA | 12.72% |
| MERCATI EMERGENTI ASIA PACIFICO | 11.63% |
| MERCATI EMERGENTI MEDIO ORIENTE | 10.19% |
| ALTRI | 4.57% |
| LIQUIDITÀ, COPERTURA | 7.57% |

Fondazione d'investimento Swiss Life

Obbligazioni Emerging Markets Imprese (CHF hedged)

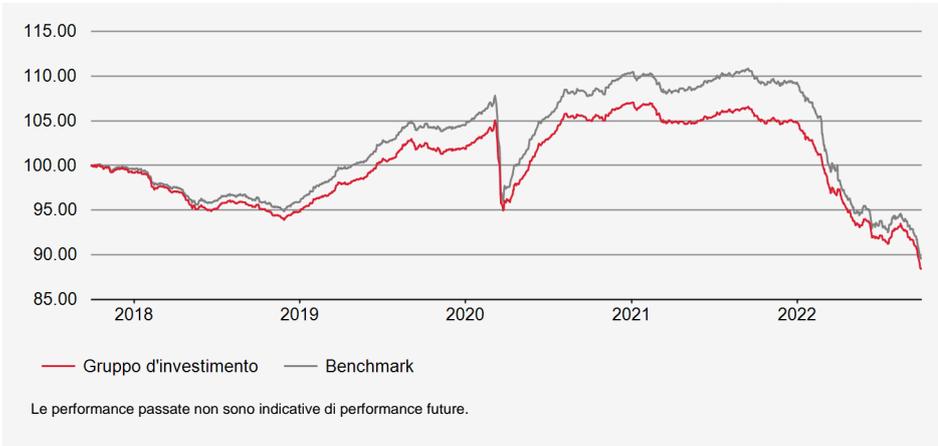


Patrimonio netto (NAV) in mio. CHF: 308.90
Valore d'inventario netto per diritto in CHF: 88.44

Strategia d'investimento

Investimenti in titoli di credito in dollari statunitensi o altre valute forti di imprese di Paesi di recente industrializzazione (Emerging Markets), inclusi agenzie ed enti sovranazionali. Selezione attiva di titoli, gestione della duration e posizionamento della curva dei tassi d'interesse. Debitori esterni al benchmark: max. 20%. Limitazioni per debitore: 10%. Rating medio: almeno BBB. I rischi valutari vengono coperti al 90% almeno contro il franco. Realizzazione tramite du Swiss Life Funds (LUX) Bond Emerging Markets Corporates CHF AM Cap ; fondo d'investimento di diritto lussemburghese.

Evoluzione del valore nella valuta di riferimento (base 100)



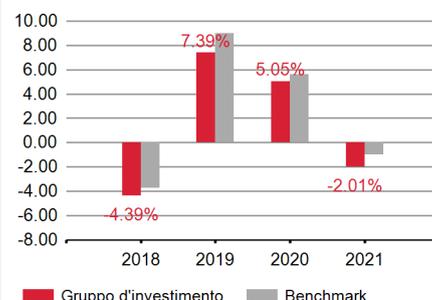
Performance nella valuta di riferimento

| | PERFORMANCE CUMULATA | | | | PERFORMANCE ANNUALIZZATA | | | |
|------------------------------|----------------------|--------|--------|---------|--------------------------|--------|---------|--------|
| | YTD | 1 MESE | 3 MESI | 1 ANNO | 3 ANNI | 5 ANNI | 10 ANNI | INIZIO |
| GRUPPO D'INVESTIMENTO | -15.65% | -4.25% | -3.81% | -16.21% | -4.70% | -2.42% | - | -2.42% |
| BENCHMARK | -18.02% | -4.25% | -4.21% | -18.36% | -4.93% | -2.17% | - | -2.17% |

Dati statistici (annualizzati)

| | 1 ANNO | 3 ANNI | 5 ANNI | 10 ANNI | INIZIO |
|---|--------|--------|--------|---------|--------|
| Volatilità Gruppo d'investimento (in %) | 5.57 | 6.89 | 5.69 | - | 5.64 |
| Volatilità del Benchmark (in %) | 6.38 | 7.83 | 6.40 | - | 6.35 |
| Tracking Error ex post (in %) | 2.05 | 1.54 | 1.25 | - | 1.23 |
| Information Ratio | 1.05 | 0.15 | -0.20 | - | -0.20 |
| Sharpe Ratio | -3.08 | -0.61 | -0.31 | - | -0.30 |
| Correlazione | 0.95 | 0.99 | 0.99 | - | 0.99 |
| Beta | 0.83 | 0.87 | 0.88 | - | 0.88 |
| Jensen alfa | -0.87 | -0.34 | -0.43 | - | -0.43 |
| Maximum Drawdown (in %) | -16.23 | -17.39 | -17.39 | - | -17.39 |
| Recovery Period (anni) | - | - | - | - | - |

Performance



Informazioni sul prodotto

Numero di valore: 36974875
ISIN: CH0369748758
LEI: 254900R4DORKK6JJUG51
Codice Bloomberg: SLOEMCH SW
Benchmark: JP Morgan CEMBI Broad Diversified IG Index (CHF Hedged)
Moneta: CHF
Domicilio: Svizzera
Data di creazione: 29/09/2017
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@: Swiss Life Asset Management SA

Controllo asset manager: PPCmetrics supporta il controllo costante dell'asset manager e la valutazione dei risultati d'investimento.

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

Quote spese operative TER KGAST
ex ante: 0.77%
ex post al: 30/09/2022 0.77%

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.

Tracking error ex ante: Il tracking error previsto per i prossimi 12 mesi corrisponde al Tracking error ex post degli ultimi 3 anni.

Fondazione d'investimento Swiss Life

Obbligazioni Emerging Markets Imprese (CHF hedged)

Struttura del portafoglio per settore

| | Gruppo d'investimento | Benchmark |
|---------------------------------|-----------------------|-----------|
| FINANZA | 30.02% | 38.22% |
| SERVIZI DI PUBBLICA UTILITÀ | 15.54% | 12.42% |
| ENERGIA | 13.34% | 10.70% |
| MATERIALI DI BASE | 8.69% | 9.34% |
| COMUNICAZIONE | 7.99% | 8.04% |
| BENI INDUSTRIALI | 5.63% | 4.06% |
| TECNOLOGIA | 4.99% | 5.27% |
| CONSUMO CICLICO | 4.70% | 2.18% |
| SUPERNAZIONALE | 3.51% | - |
| ALTRI | 7.73% | 9.77% |
| LIQUIDITÀ | 0.16% | - |
| COPERTURA DEL RISCHIO DI CAMBIO | -2.30% | - |

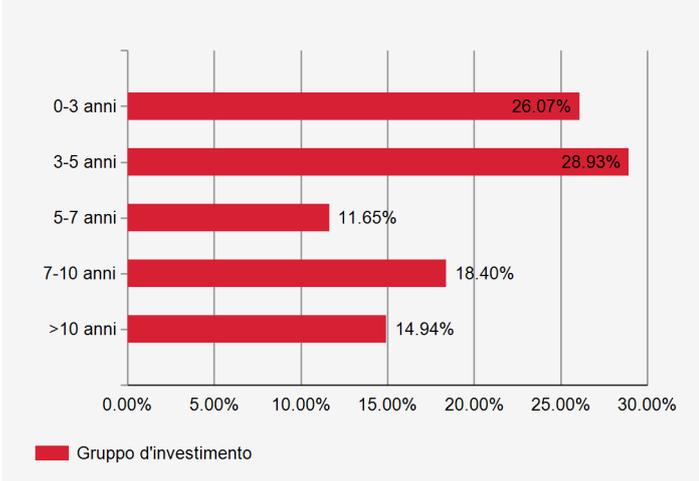
Principali debitori e rating

| | | Gruppo d'investimento |
|---|------|-----------------------|
| Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd | AA- | 3.67% |
| Saudi Arabian Oil Co | A- | 2.00% |
| Commercial Bank PSQC/The | A- | 1.73% |
| United Overseas Bank Ltd | BBB+ | 1.66% |
| Bangkok Bank PCL | BBB | 1.63% |

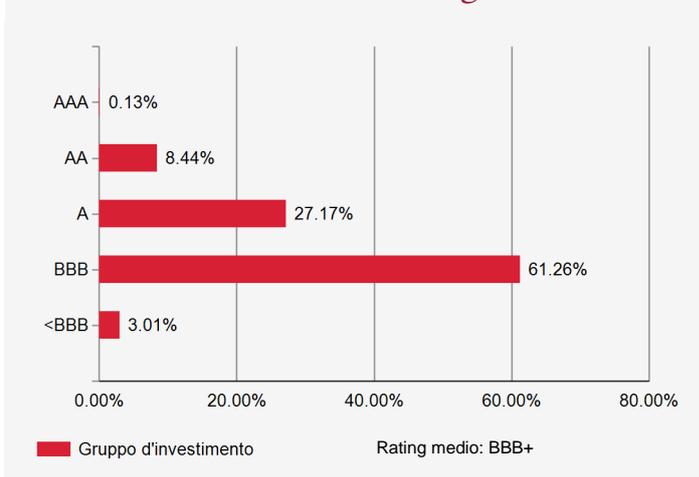
Ulteriori informazioni sui debitori

| | |
|-----------------------------------|-------|
| Numero di debitori | 210 |
| Quota di debitori senza benchmark | 9.94% |

Struttura della scadenza dei titoli



Investimenti secondo il rating



Durata e rendimento alla scadenza

| | Gruppo d'investimento | Benchmark |
|-----------------------------------|-----------------------|-----------|
| Modified Duration | 4.7 | 4.7 |
| Rendimento alla scadenza teorica* | 6.03% | 6.17% |

* prima copertura del rischio di cambio, prendendo in considerazione i derivati

Struttura del portafoglio per valute e la duration

| | Gruppo d'investimento | | Benchmark | |
|-----|-----------------------|----------|-----------|----------|
| | Peso | Duration | Peso | Duration |
| USD | 100.00% | 4.71 | 100.00% | 4.99 |

Struttura del portafoglio secondo il paese/regione

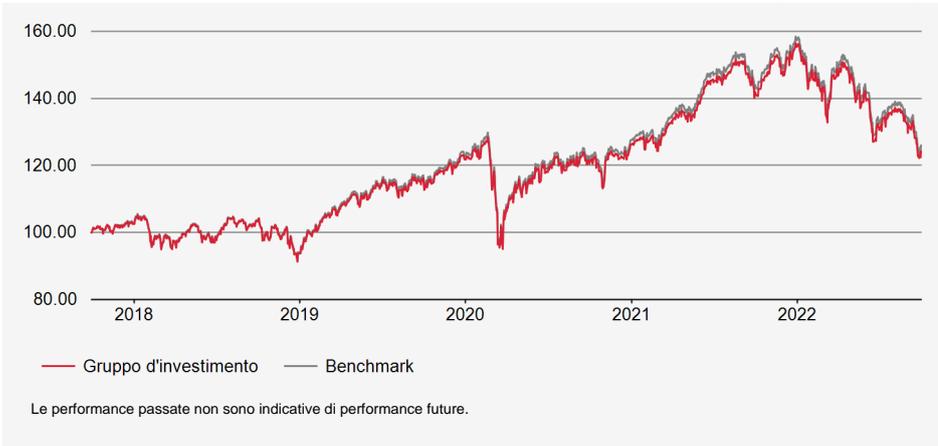
| | Gruppo d'investimento | Benchmark |
|---------------------------------|-----------------------|-----------|
| CINA | 11.72% | 11.98% |
| INDIA | 7.68% | 4.64% |
| COREA DEL SUD | 7.22% | 7.51% |
| QATAR | 6.74% | 6.04% |
| EMIRATI ARABI UNITI | 6.34% | 5.37% |
| TAILANDIA | 5.94% | 4.63% |
| CILE | 5.75% | 3.94% |
| MERCATI EMERGENTI ASIA PACIFICO | 20.09% | 22.29% |
| MERCATI EMERGENTI IN AMERICA | 10.44% | 13.19% |
| MERCATI EMERGENTI MEDIO ORIENTE | 8.72% | 10.33% |
| ALTRI | 11.49% | 10.08% |
| LIQUIDITÀ, COPERTURA | -2.14% | - |

Patrimonio netto (NAV) in mio. CHF: 397.68
Valore d'inventario netto per diritto in CHF: 289.91

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".

Evoluzione del valore nella valuta di riferimento (base 100)



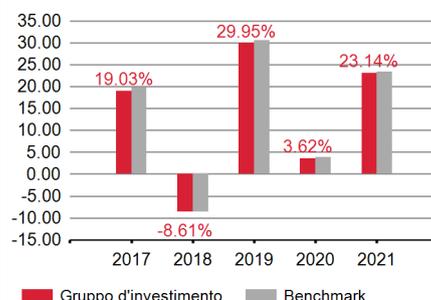
Performance nella valuta di riferimento

| | PERFORMANCE CUMULATA | | | | PERFORMANCE ANNUALIZZATA | | | |
|------------------------------|----------------------|--------|--------|---------|--------------------------|--------|---------|--------|
| | YTD | 1 MESE | 3 MESI | 1 ANNO | 3 ANNI | 5 ANNI | 10 ANNI | INIZIO |
| GRUPPO D'INVESTIMENTO | -20.05% | -6.00% | -4.84% | -12.37% | 2.26% | 4.43% | 7.76% | 5.20% |
| BENCHMARK | -19.93% | -5.98% | -4.83% | -12.48% | 2.48% | 4.73% | 8.15% | 5.73% |

Dati statistici (annualizzati)

| | 1 ANNO | 3 ANNI | 5 ANNI | 10 ANNI | INIZIO |
|---|--------|--------|--------|---------|--------|
| Volatilità Gruppo d'investimento (in %) | 15.52 | 14.23 | 12.92 | 11.86 | 13.07 |
| Volatilità del Benchmark (in %) | 15.50 | 14.28 | 12.97 | 11.90 | 13.41 |
| Tracking Error ex post (in %) | 0.34 | 0.32 | 0.31 | 0.31 | 1.28 |
| Information Ratio | 0.33 | -0.68 | -0.95 | -1.29 | -0.41 |
| Sharpe Ratio | -0.82 | 0.20 | 0.39 | 0.68 | 0.38 |
| Correlazione | 1.00 | 1.00 | 1.00 | 1.00 | 1.00 |
| Beta | 1.00 | 1.00 | 1.00 | 1.00 | 0.97 |
| Jensen alfa | 0.13 | -0.21 | -0.28 | -0.36 | -0.36 |
| Maximum Drawdown (in %) | -21.88 | -25.88 | -25.88 | -25.88 | -54.46 |
| Recovery Period (anni) | - | 0.83 | 0.83 | 0.83 | 4.97 |

Performance



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/fondazioneinvestimento

Quote spese operative TER KGAST

ex ante: 0.53%

ex post al: 30/09/2022 0.53%

Struttura del portafoglio per settore

| | Gruppo d'investimento | Benchmark |
|-----------------------------|-----------------------|-----------|
| SALUTE | 35.61% | 36.72% |
| GENERI DI CONSUMO | 27.15% | 27.61% |
| INDUSTRIE | 15.15% | 14.00% |
| FINANZA | 14.59% | 16.39% |
| MATERIALI DI BASE | 2.34% | 2.33% |
| TECNOLOGIA | 1.68% | 1.26% |
| TELECOMUNICAZIONI | 0.84% | 0.95% |
| SERVIZI PER IL CONSUMATORE | 0.69% | 0.55% |
| SERVIZI DI PUBBLICA UTILITÀ | 0.45% | 0.19% |
| PETROLIO E GAS | - | - |
| LIQUIDITÀ | 1.51% | - |

Le principali posizioni

| | Gruppo d'investimento | Benchmark |
|------------------------------|-----------------------|-----------|
| NESTLE SA-REG | 20.91% | 21.26% |
| ROCHE HOLDING AG | 16.14% | 16.40% |
| NOVARTIS AG-REG | 12.25% | 12.45% |
| ZURICH INSURANCE GROUP AG | 4.22% | 4.29% |
| CIE FINANCIERE RICHEMONT-REG | 3.50% | 3.55% |
| UBS GROUP AG-REG | 3.35% | 3.40% |
| ABB LTD-REG | 2.98% | 3.03% |
| LONZA GROUP AG-REG | 2.57% | 2.61% |
| SIKA AG | 2.19% | 2.23% |
| ALCON INC | 2.06% | 2.10% |

Struttura del portafoglio in base al volume dell'impresa

| | Gruppo d'investimento | | Benchmark | |
|-----------------|-----------------------|--------|-----------|--------|
| | Partecip. | Numero | Partecip. | Numero |
| Grandi imprese | 81.48% | 20 | 82.66% | 20 |
| Medie imprese | 16.05% | 48 | 15.52% | 79 |
| Liquidity | 1.28% | - | - | - |
| Piccole imprese | 0.97% | 6 | 1.82% | 120 |

Fondazione d'investimento Swiss Life Azioni Svizzera Large Caps Indicizzate

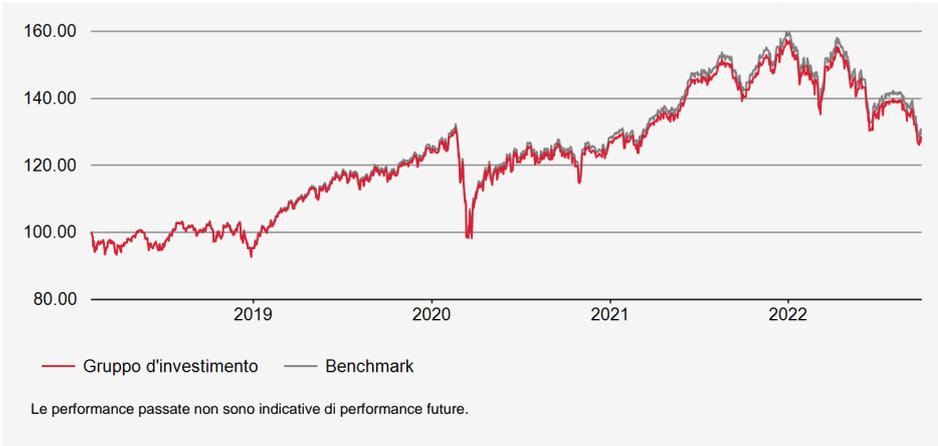


Patrimonio netto (NAV) in mio. CHF: 380.13
Valore d'inventario netto per diritto in CHF: 127.54

Strategia d'investimento

Investimenti in titoli di partecipazione di società rappresentate allo SPI 20. Implementazione indicizzata, l'indice di riferimento viene interamente riprodotto ("full replication"). La ponderazione di ogni singola società deve discostarsi al massimo di +/- 0,5 punti percentuali dalla ponderazione del benchmark. Realizzazione tramite Swiss Life iFunds (CH) Equity Switzerland (CHF); Fondi d'investimento di diritto svizzero della categoria "altri fondi per investimenti tradizionali".

Evoluzione del valore nella valuta di riferimento (base 100)



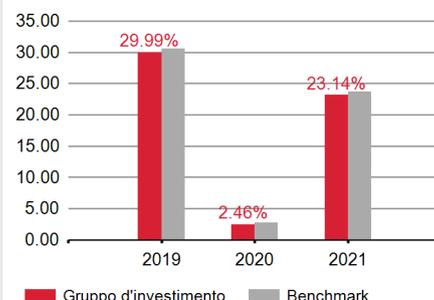
Performance nella valuta di riferimento

| | PERFORMANCE CUMULATA | | | | PERFORMANCE ANNUALIZZATA | | | |
|------------------------------|----------------------|--------|--------|--------|--------------------------|--------|---------|--------|
| | YTD | 1 MESE | 3 MESI | 1 ANNO | 3 ANNI | 5 ANNI | 10 ANNI | INIZIO |
| GRUPPO D'INVESTIMENTO | -17.73% | -5.24% | -4.18% | -8.98% | 2.64% | - | - | 5.36% |
| BENCHMARK | -17.54% | -5.22% | -4.10% | -8.67% | 3.03% | - | - | 5.76% |

Dati statistici (annualizzati)

| | 1 ANNO | 3 ANNI | 5 ANNI | 10 ANNI | INIZIO |
|---|--------|--------|--------|---------|--------|
| Volatilità Gruppo d'investimento (in %) | 15.10 | 13.69 | - | - | 13.07 |
| Volatilità del Benchmark (in %) | 15.14 | 13.74 | - | - | 13.11 |
| Tracking Error ex post (in %) | 0.05 | 0.07 | - | - | 0.07 |
| Information Ratio | -5.79 | -5.62 | - | - | -5.73 |
| Sharpe Ratio | -0.59 | 0.24 | - | - | 0.45 |
| Correlazione | 1.00 | 1.00 | - | - | 1.00 |
| Beta | 1.00 | 1.00 | - | - | 1.00 |
| Jensen alfa | -0.34 | -0.37 | - | - | -0.38 |
| Maximum Drawdown (in %) | -19.89 | -25.04 | - | - | -25.04 |
| Recovery Period (anni) | - | 1.00 | - | - | 1.00 |

Performance



Informazioni sul prodotto

Numero di valore: 39561885
ISIN: CH0395618850
LEI: 254900P0FZIREAGSUQ60
Codice Bloomberg: SLASLCI SW
Benchmark: SPI 20 Total Return®
Moneta: CHF
Domicilio: Svizzera
Data di creazione: 01/02/2018
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®: Pictet Asset Management SA
Consulenza esterna: PPCmetrics fornisce i seguenti servizi: consulenza sulla struttura idonea del mandato, 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
Quote spese operative TER KGAST ex ante: 0.35%
ex post al: 30/09/2022 0.35%

Struttura del portafoglio per settore

| | Gruppo d'investimento | Benchmark |
|-----------------------------|-----------------------|-----------|
| SALUTE | 41.58% | 41.59% |
| GENERI DI CONSUMO | 30.06% | 30.07% |
| FINANZA | 14.83% | 14.83% |
| INDUSTRIE | 9.73% | 9.73% |
| MATERIALI DI BASE | 2.09% | 2.09% |
| TELECOMUNICAZIONI | 1.03% | 1.03% |
| TECNOLOGIA | 0.66% | 0.66% |
| SERVIZI PER IL CONSUMATORE | - | - |
| PETROLIO E GAS | - | - |
| SERVIZI DI PUBBLICA UTILITÀ | - | - |
| LIQUIDITÀ | 0.03% | - |

Le principali posizioni

| | Gruppo d'investimento | Benchmark |
|------------------------------|-----------------------|-----------|
| NESTLE SA-REG | 25.75% | 25.76% |
| ROCHE HOLDING AG | 19.87% | 19.88% |
| NOVARTIS AG-REG | 15.08% | 15.09% |
| ZURICH INSURANCE GROUP AG | 5.20% | 5.20% |
| CIE FINANCIERE RICHEMONT-REG | 4.30% | 4.31% |
| UBS GROUP AG-REG | 4.12% | 4.13% |
| ABB LTD-REG | 3.67% | 3.67% |
| LONZA GROUP AG-REG | 3.17% | 3.17% |
| SIKA AG | 2.70% | 2.70% |
| ALCON INC | 2.54% | 2.54% |

Struttura del portafoglio in base al volume dell'impresa

| | Gruppo d'investimento | | Benchmark | |
|-----------------|-----------------------|--------|-----------|--------|
| | Partecip. | Numero | Partecip. | Numero |
| Grandi imprese | 98.28% | 18 | 98.31% | 18 |
| Medie imprese | 1.69% | 2 | 1.69% | 2 |
| Piccole imprese | - | - | - | - |
| Liquidità | 0.03% | - | - | - |

Fondazione d'investimento Swiss Life

Azioni Svizzera Small & Mid Caps

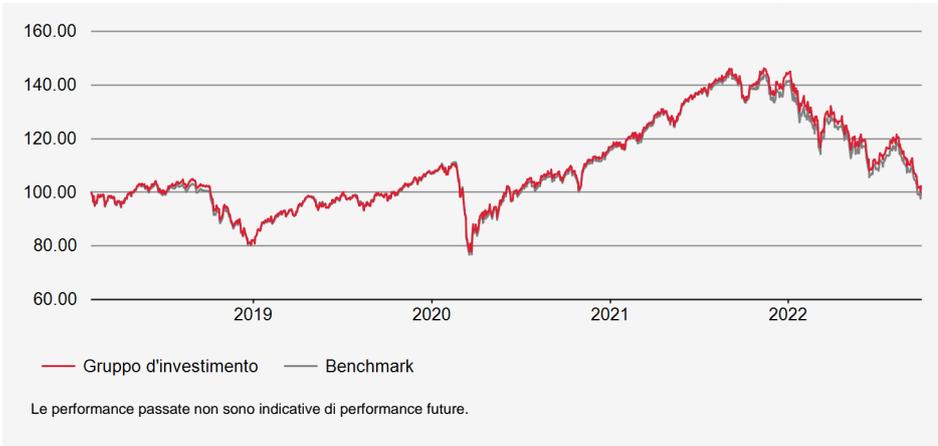


Patrimonio netto (NAV) in mio. CHF: 89.53
Valore d'inventario netto per diritto in CHF: 101.18

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); Fondi d'investimento di diritto svizzero della categoria "altri fondi per investimenti tradizionali".

Evoluzione del valore nella valuta di riferimento (base 100)



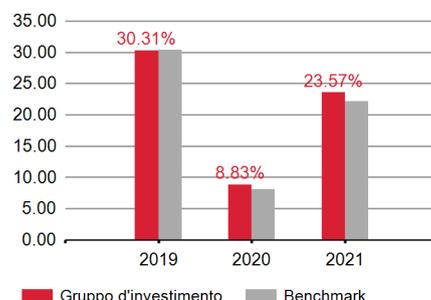
Performance nella valuta di riferimento

| | PERFORMANCE CUMULATA | | | | PERFORMANCE ANNUALIZZATA | | | |
|------------------------------|----------------------|---------------|---------------|----------------|--------------------------|----------|----------|---------------|
| | YTD | 1 MESE | 3 MESI | 1 ANNO | 3 ANNI | 5 ANNI | 10 ANNI | INIZIO |
| GRUPPO D'INVESTIMENTO | -28.93% | -9.18% | -7.56% | -24.81% | 0.97% | - | - | 0.25% |
| BENCHMARK | -29.20% | -9.17% | -7.90% | -26.38% | 0.21% | - | - | -0.27% |

Dati statistici (annualizzati)

| | 1 ANNO | 3 ANNI | 5 ANNI | 10 ANNI | INIZIO |
|---|--------|--------|--------|---------|--------|
| Volatilità Gruppo d'investimento (in %) | 18.70 | 18.15 | - | - | 16.94 |
| Volatilità del Benchmark (in %) | 18.36 | 18.35 | - | - | 16.95 |
| Tracking Error ex post (in %) | 1.63 | 1.52 | - | - | 1.48 |
| Information Ratio | 0.96 | 0.50 | - | - | 0.35 |
| Sharpe Ratio | -1.50 | 0.09 | - | - | 0.06 |
| Correlazione | 1.00 | 1.00 | - | - | 1.00 |
| Beta | 1.01 | 0.99 | - | - | 1.00 |
| Jensen alfa | 1.95 | 0.77 | - | - | 0.52 |
| Maximum Drawdown (in %) | -31.60 | -31.60 | - | - | -31.60 |
| Recovery Period (anni) | - | - | - | - | - |

Performance



Informazioni sul prodotto

Numero di valore: 39561890
ISIN: CH0395618900
LEI: 254900QGENUS1GIJ4549
Codice Bloomberg: SWLASM SW
Benchmark: SPI Extra TR Index (CHF)
Moneta: CHF
Domicilio: Svizzera
Data di creazione: 01/02/2018
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®: Privatbank Von Graffenried AG

Consulenza esterna: PPCmetrics fornisce i seguenti servizi: consulenza sulla struttura idonea del mandato, 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
Quote spese operative TER KGAST ex ante: 0.95%
ex post al: 30/09/2022 0.95%

Struttura del portafoglio per settore

| | Gruppo d'investimento | Benchmark |
|-----------------------------|-----------------------|-----------|
| INDUSTRIE | 39.02% | 34.12% |
| GENERI DI CONSUMO | 14.76% | 16.04% |
| FINANZA | 13.75% | 23.78% |
| SALUTE | 9.92% | 13.73% |
| TECNOLOGIA | 6.18% | 4.08% |
| SERVIZI PER IL CONSUMATORE | 3.69% | 3.16% |
| MATERIALI DI BASE | 3.44% | 3.45% |
| SERVIZI DI PUBBLICA UTILITÀ | 2.43% | 1.06% |
| PETROLIO E GAS | - | - |
| TELECOMUNICAZIONI | - | 0.59% |
| LIQUIDITÀ | 6.80% | - |

Le principali posizioni

| | Gruppo d'investimento | Benchmark |
|---------------------------------|-----------------------|-----------|
| LINDT & SPRUNGLI | 6.19% | 3.76% |
| SGS SA | 4.81% | 4.87% |
| KUEHNE + NAGEL INTERNATIONAL AG | 4.72% | 4.34% |
| JULIUS BAER GROUP LTD | 4.26% | 3.52% |
| STRAUMANN HOLDING AG | 4.14% | 3.93% |
| SCHINDLER HOLDING AG | 3.56% | 2.38% |
| BARRY CALLEBAUT AG | 3.17% | 2.52% |
| VAT GROUP AG | 2.88% | 2.07% |
| BALOISE HOLDING AG | 2.85% | 2.20% |
| SIG GROUP AG | 2.79% | 2.65% |

Struttura del portafoglio in base al volume dell'impresa

| | Gruppo d'investimento | | Benchmark | |
|-----------------|-----------------------|--------|-----------|--------|
| | Partecip. | Numero | Partecip. | Numero |
| Grandi imprese | 8.95% | 2 | 8.80% | 2 |
| Medie imprese | 79.03% | 46 | 80.77% | 77 |
| Piccole imprese | 5.22% | 6 | 10.42% | 120 |
| Liquidità | 6.80% | - | - | - |

Fondazione d'investimento Swiss Life

Azioni Svizzera Protect Flex



Patrimonio netto (NAV) in mio. CHF: 154.18
Valore d'inventario netto per diritto in CHF: 101.12

Strategia d'investimento

Strategia d'investimento indicizzata SMI con strategia di copertura delle opzioni a gestione attiva. L'universo d'investimento del gruppo d'investimento è composto da società dello SMI; ponderato per la capitalizzazione di mercato. Gli investimenti possono essere effettuati sotto forma di titoli di partecipazione, investimenti collettivi o strumenti derivati. L'impiego complementare di una strategia di copertura composta da opzioni determina, in caso di forte ribasso dei mercati, una riduzione delle perdite sulle quotazioni e, in caso di forte rialzo dei mercati, una limitazione del potenziale di crescita. A seconda della valutazione del mercato è possibile rinunciare alla vendita dell'opzione put e/o dell'opzione call. Realizzazione tramite SLF (CH) Equity Switzerland Protect Enhanced.

Evoluzione del valore nella valuta di riferimento (base 100)



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 | -13.66% | -3.09% | -2.90% | -7.11% | - | - | - | 0.63% |

Dati statistici (annualizzati)

| | 1 ANNO | 3 ANNI | 5 ANNI | 10 ANNI | INIZIO |
|---|--------|--------|--------|---------|--------|
| Volatilità Gruppo d'investimento (in %) | 10.51 | - | - | - | 10.13 |
| Sharpe Ratio | -0.65 | - | - | - | 0.12 |
| Maximum Drawdown (in %) | -15.35 | - | - | - | -15.35 |
| Recovery Period (anni) | - | - | - | - | - |

Performance



Informazioni sul prodotto

Numero di valore: 58002332
ISIN: CH0580023320
LEI: 254900ZUTROYHLYQ4E86
Codice Bloomberg: SLASFC SW
Moneta: CHF
Domicilio: Svizzera
Data di creazione: 18/12/2020
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 Asset Management SA
Pubblicazioni di corsi: Bloomberg: ASSL
www.swisslife.ch/fondazioneinvestimento
Quote spese operative TER KGAST
ex ante: 0.46%
ex post al: 30/09/2022 0.46%

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.

Tracking error ex ante: Il tracking error previsto per i prossimi 12 mesi corrisponde al Tracking error ex post degli ultimi 3 anni.

Struttura del portafoglio per settore

| | Gruppo d'investimento |
|------------------------------|-----------------------|
| SALUTE | 37.75% |
| BENI DI PRIMA NECESSITÀ | 15.86% |
| FINANZA | 14.66% |
| MATERIALI | 6.73% |
| INDUSTRIE | 4.95% |
| BENI VOLUTTUARI | 4.26% |
| FUTURE SU INDICE AZIONARIO | 1.61% |
| SERVIZI DI COMUNICAZIONE | 1.02% |
| TECNOLOGIA DELL'INFORMAZIONE | 0.65% |
| LIQUIDITÀ / PRESTITO | 12.50% |

Le principali posizioni

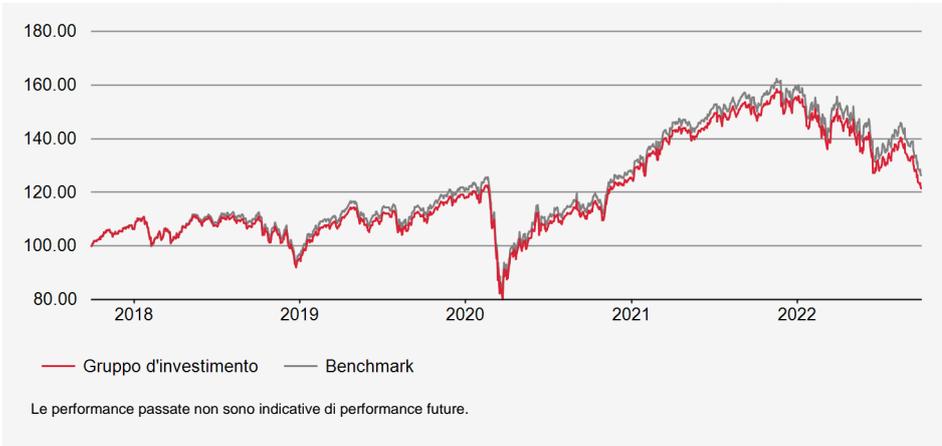
| | Gruppo d'investimento |
|------------------------------|-----------------------|
| ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN | 16.29% |
| NESTLE SA-REG | 15.86% |
| NOVARTIS AG-REG | 14.91% |
| ZURICH INSURANCE GROUP AG | 5.14% |
| CIE FINANCIERE RICHEMO-A REG | 4.26% |
| UBS GROUP AG-REG | 4.08% |
| ABB LTD-REG | 3.63% |
| LONZA GROUP AG-REG | 3.13% |
| SIKA AG-REG | 2.67% |
| ALCON INC | 2.51% |

Patrimonio netto (NAV) in mio. CHF: 295.68
Valore d'inventario netto per diritto in CHF: 175.07

Strategia d'investimento

Investimenti in titoli di partecipazione di società con domicilio all'estero. La copertura per i Large & Mid Caps è passiva, gli Small Caps e il settore dei mercati emergenti (Emerging Markets) vengono gestiti attivamente (core satellite). Limitazione per società: 5% (eccezione: se la ponderazione è superiore al 5% nell'indice; allora 10% massimo). Società straniere al benchmark: max. 10%. Realizzazione tramite Swiss Life iFunds (CH) Equity ESG Global ex Switzerland (CHF), Invesco Global Small Cap Equity Fund, Dimensional Global Small Cap Equity Fund e fondo Candriam Sustainable Equity Emerging Markets.

Evoluzione del valore nella valuta di riferimento (base 100)



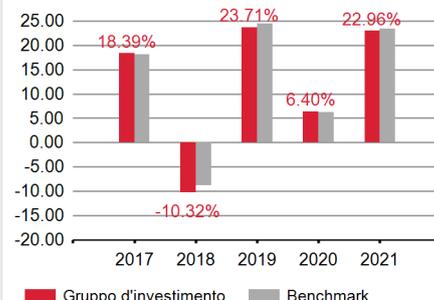
Performance nella valuta di riferimento

| | PERFORMANCE CUMULATA | | | | PERFORMANCE ANNUALIZZATA | | | |
|------------------------------|----------------------|---------------|---------------|----------------|--------------------------|--------------|--------------|--------------|
| | YTD | 1 MESE | 3 MESI | 1 ANNO | 3 ANNI | 5 ANNI | 10 ANNI | INIZIO |
| GRUPPO D'INVESTIMENTO | -21.31% | -8.76% | -5.18% | -18.36% | 2.81% | 3.95% | 7.39% | 2.70% |
| BENCHMARK | -20.13% | -8.80% | -4.74% | -17.05% | 3.45% | 4.78% | 8.15% | 3.89% |

Dati statistici (annualizzati)

| | 1 ANNO | 3 ANNI | 5 ANNI | 10 ANNI | INIZIO |
|---|--------|--------|--------|---------|--------|
| Volatilità Gruppo d'investimento (in %) | 15.91 | 18.62 | 16.79 | 14.17 | 15.71 |
| Volatilità del Benchmark (in %) | 16.01 | 18.58 | 16.73 | 14.13 | 15.95 |
| Tracking Error ex post (in %) | 0.35 | 0.48 | 0.54 | 0.66 | 1.44 |
| Information Ratio | -3.67 | -1.32 | -1.51 | -1.15 | -0.82 |
| Sharpe Ratio | -1.24 | 0.18 | 0.27 | 0.54 | 0.16 |
| Correlazione | 1.00 | 1.00 | 1.00 | 1.00 | 1.00 |
| Beta | 0.99 | 1.00 | 1.00 | 1.00 | 0.98 |
| Jensen alfa | -1.40 | -0.64 | -0.84 | -0.77 | -1.12 |
| Maximum Drawdown (in %) | -23.39 | -34.66 | -34.66 | -34.66 | -60.40 |
| Recovery Period (anni) | - | 0.67 | 0.67 | 0.67 | 7.84 |

Performance



Informazioni sul prodotto

Numero di valore: 1245539

ISIN: CH0012455397

LEI: 2549000B6X3SG0K4LZ68

Codice Bloomberg: SWAAKAU SW

Benchmark: 80% MSCI World ex CH ESG Leaders, 15% MSCI AC World Small Cap in CHF, 5% MSCI Emerging Markets in CHF

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&Mid Caps (passivo)

UBS SA

Small Caps (attivo)

50% Invesco / 50% Dimensional

Emerging Markets (attivo)

Candriam Investors Group

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

Quote spese operative TER KGAST

ex ante: 0.73%

ex post al: 30/09/2022 0.73%

Benchmark: Fino al 31.03.2022 80% MSCI World ex CH in CHF, 15% MSCI AC World Small Cap in CHF, 5% MSCI Emerging Markets in CHF - Fino al 31.12.2009 100% MSCI World, ex CH, in CHF.

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.

Tracking error ex ante: Il tracking error previsto per i prossimi 12 mesi corrisponde al Tracking error ex post degli ultimi 3 anni.

Struttura del portafoglio per settore

| | Gruppo d'investimento | Benchmark |
|------------------------------|-----------------------|-----------|
| TECNOLOGIA DELL'INFORMAZIONE | 19.64% | 19.83% |
| FINANZA | 14.81% | 14.59% |
| SALUTE | 13.34% | 13.25% |
| BENI VOLUTTUARI | 11.82% | 11.56% |
| INDUSTRIE | 11.52% | 11.12% |
| SERVIZI DI TELECOMUNICAZIONE | 7.68% | 7.67% |
| BENI DI PRIMA NECESSITÀ | 7.00% | 7.30% |
| MATERIALI | 4.72% | 5.07% |
| ENERGIA | 3.41% | 3.74% |
| IMMOBILI | 3.19% | 3.75% |
| SERVIZI DI PUBBLICA UTILITÀ | 1.92% | 2.12% |
| LIQUIDITÀ | 0.96% | - |

Le principali posizioni

| | Gruppo d'investimento | Benchmark |
|------------------------|-----------------------|-----------|
| MICROSOFT CORP. | 5.98% | 5.97% |
| ALPHABET INC | 4.04% | 4.03% |
| TESLA INC | 2.53% | 2.53% |
| JOHNSON & JOHNSON | 1.55% | 1.55% |
| NVIDIA | 1.09% | 1.10% |
| PROCTER & GAMBLE | 1.09% | 1.09% |
| VISA INC | 1.06% | 1.06% |
| HOME DEPOT | 1.02% | 1.02% |
| ELI LILLY & CO. | 0.94% | 0.94% |
| MASTERCARD INC-CLASS A | 0.89% | 0.89% |

Struttura del portafoglio secondo il paese/regione

| | Gruppo d'investimento | Benchmark |
|-------------------|-----------------------|-----------|
| USA | 65.55% | 65.50% |
| GIAPPONE | 6.50% | 6.74% |
| GRAN BRETAGNA | 4.28% | 4.25% |
| CANADA | 3.35% | 3.53% |
| FRANCIA | 2.64% | 2.55% |
| GERMANIA | 1.59% | 1.53% |
| RESTO DELL'EUROPA | 6.58% | 6.20% |
| ALTRI PAESI ASIA | 6.32% | 7.06% |
| ALTRI | 2.24% | 2.64% |
| LIQUIDITÀ | 0.96% | - |

Ulteriori informazioni sulle società

| | |
|----------------------------------|-------|
| Numero di società | 7,526 |
| Quota di società senza benchmark | 3.90% |

30 settembre 2022

Fondazione d'investimento Swiss Life

Azioni Estero ESG Indicizzate



Patrimonio netto (NAV) in mio. CHF: 142.35
Valore d'inventario netto per diritto in CHF: 83.00

Strategia d'investimento

Investimenti in titoli di partecipazione di società comprese nell'MSCI World ex Switzerland ESG Leaders, in CHF. Sono ammessi anche titoli di partecipazione di società che, a seguito degli adeguamenti del benchmark, non sono ancora o non sono più comprese nel benchmark (variazione max. +0,5 punti percentuali). Attuazione tramite Swiss Life iFunds (CH) Equity ESG Global ex Switzerland (CHF).

Evoluzione del valore nella valuta di riferimento (base 100)



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 | - | -8.58% | -5.09% | - | - | - | - | - |
| BENCHMARK | - | -8.54% | -4.89% | - | - | - | - | - |

Dati statistici (annualizzati)

| | 1 ANNO | 3 ANNI | 5 ANNI | 10 ANNI | INIZIO |
|---|--------|--------|--------|---------|--------|
| Volatilità Gruppo d'investimento (in %) | - | - | - | - | 18.30 |
| Volatilità del Benchmark (in %) | - | - | - | - | 18.31 |
| Tracking Error ex post (in %) | - | - | - | - | 0.15 |
| Information Ratio | - | - | - | - | -4.31 |
| Sharpe Ratio | - | - | - | - | -1.72 |
| Correlazione | - | - | - | - | 1.00 |
| Beta | - | - | - | - | 1.00 |
| Jensen alfa | - | - | - | - | -0.73 |
| Maximum Drawdown (in %) | - | - | - | - | -18.04 |
| Recovery Period (anni) | - | - | - | - | - |

Performance

Storia insufficiente di dati

Informazioni sul prodotto

Numero di valore: 117189932
ISIN: CH1171899326
LEI: 254900Q154AKVWL8UQ41
Codice Bloomberg: SWAEICI SW
Benchmark: MSCI World ex Switzerland ESG Leaders (CHF)
Moneta: CHF
Domicilio: Svizzera
Data di creazione: 31/03/2022
Prezzo di prima emissione: 100.00
Chiusura d'esercizio: 30.09
Emissione/Riscatto: giornalmente
Termine d'accettazione: 30.12.1899 14:30:00
Commissione d'emissione/riscatto: nessuna
Prassi di distribuzione: Capitalizzazione
Asset Manager in base al: Swiss Life Asset Management SA
Pubblicazioni di corsi: Bloomberg: ASSL www.swisslife.ch/fondazioneinvestimento
Quote spese operative TER KGAST ex ante: 0.52%
ex post al: 30/09/2022 0.52%

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.

Tracking error ex ante: Il tracking error previsto per i prossimi 12 mesi corrisponde al Tracking error ex post degli ultimi 3 anni.

Struttura del portafoglio per settore

| | Gruppo d'investimento | Benchmark |
|------------------------------|-----------------------|-----------|
| TECNOLOGIA DELL'INFORMAZIONE | 21.49% | 21.48% |
| FINANZA | 14.25% | 14.20% |
| SALUTE | 14.21% | 14.21% |
| BENI VOLUTTUARI | 11.27% | 11.31% |
| INDUSTRIE | 10.09% | 10.10% |
| SERVIZI DI TELECOMUNICAZIONE | 8.46% | 8.46% |
| BENI DI PRIMA NECESSITÀ | 7.76% | 7.77% |
| MATERIALI | 4.36% | 4.35% |
| ENERGIA | 3.42% | 3.41% |
| IMMOBILI | 2.86% | 2.85% |
| SERVIZI DI PUBBLICA UTILITÀ | 1.84% | 1.85% |
| LIQUIDITÀ | - | - |

Le principali posizioni

| | Gruppo d'investimento | Benchmark |
|------------------------|-----------------------|-----------|
| MICROSOFT CORP. | 7.48% | 7.47% |
| ALPHABET INC | 5.05% | 5.04% |
| TESLA INC | 3.16% | 3.16% |
| JOHNSON & JOHNSON | 1.94% | 1.94% |
| NVIDIA | 1.37% | 1.37% |
| PROCTER & GAMBLE | 1.37% | 1.37% |
| VISA INC | 1.32% | 1.32% |
| HOME DEPOT | 1.28% | 1.28% |
| ELI LILLY & CO. | 1.18% | 1.18% |
| MASTERCARD INC-CLASS A | 1.11% | 1.11% |

Struttura del portafoglio secondo il paese/regione

| | Gruppo d'investimento | Benchmark |
|-------------------|-----------------------|-----------|
| USA | 71.16% | 71.08% |
| GIAPPONE | 6.48% | 6.46% |
| GRAN BRETAGNA | 4.33% | 4.42% |
| CANADA | 3.71% | 3.70% |
| FRANCIA | 2.91% | 2.98% |
| GERMANIA | 1.66% | 1.66% |
| RESTO DELL'EUROPA | 6.24% | 6.19% |
| ALTRI PAESI ASIA | 3.45% | 3.46% |
| ALTRI | 0.06% | 0.06% |
| LIQUIDITÀ | - | - |

Patrimonio netto (NAV) in mio. CHF: 40.85
Valore d'inventario netto per diritto in CHF: 79.78

Strategia d'investimento

Il gruppo d'investimento persegue una strategia core-satellite. La parte "core" del portafoglio, con circa il 70%, viene gestita attivamente, investe in prevalenza in large e mid cap e si contraddistingue per un forte profilo ESG. L'attuazione compete a Swiss Life Funds (LUX) Equity ESG Global. La parte "satellite" del portafoglio, con circa il 30%, investe prevalentemente in small e mid cap che realizzano la maggior parte dei loro introiti tramite prodotti e servizi che promuovono la sostenibilità ambientale. I satelliti vengono implementati, per circa il 10% ciascuno, da Swiss Life Funds (LUX) Equity Climate Impact, Swiss Life Funds (LUX) Equity Green Buildings & Infrastructure Impact e Swiss Life Funds (LUX) Equity Environment & Biodiversity Impact. Le percentuali possono oscillare all'interno di margini prestabiliti. Il limite per società ammonta al 5%.

Evoluzione del valore nella valuta di riferimento (base 100)



— Gruppo d'investimento

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 | -21.40% | -8.98% | -4.37% | - | - | - | - | - |

Dati statistici (annualizzati)

| | 1 ANNO | 3 ANNI | 5 ANNI | 10 ANNI | INIZIO |
|---|--------|--------|--------|---------|--------|
| Volatilità Gruppo d'investimento (in %) | - | - | - | - | 17.42 |
| Sharpe Ratio | - | - | - | - | -1.50 |
| Maximum Drawdown (in %) | - | - | - | - | -21.96 |
| Recovery Period (anni) | - | - | - | - | - |

Performance

Storia insufficiente di dati

Informazioni sul prodotto

Numero di valore: 113873862

ISIN: CH1138738625

LEI: 254900RNJ8UYJ3OTB72

Codice Bloomberg: SWAGECI SW

Moneta: CHF

Domicilio: Svizzera

Data di creazione: 30/11/2021

Prezzo di prima emissione: 100.00

Chiusura d'esercizio: 30.9

Emissione/Riscatto: giornalmente

Termine d'accettazione: 11:00

Commissione d'emissione/riscatto: nessuna

Prassi di distribuzione: Capitalizzazione

Asset Manager

Swiss Life Asset Management SA

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

Quote spese operative TER KGAST

ex ante: 0.67%

ex post al: 30/09/2022 0.67%

Struttura del portafoglio per settore

| | Gruppo d'investimento |
|------------------------------|-----------------------|
| TECNOLOGIA DELL'INFORMAZIONE | 22.34% |
| INDUSTRIE | 19.74% |
| FINANZA | 10.70% |
| SALUTE | 8.33% |
| BENI VOLUTTUARI | 7.70% |
| BENI DI PRIMA NECESSITÀ | 7.38% |
| SERVIZI DI PUBBLICA UTILITÀ | 7.11% |
| MATERIALI | 5.13% |
| IMMOBILI | 4.04% |
| SERVIZI DI COMUNICAZIONE | 3.05% |
| ENERGIA | 2.28% |
| EQUITY INDEX FUTURE | 1.78% |
| LIQUIDITÀ | 0.43% |

Le principali posizioni

| | Gruppo d'investimento |
|-------------------------|-----------------------|
| APPLE INC | 3.04% |
| MICROSOFT CORP | 2.98% |
| ALPABET INC-CL | 1.37% |
| AMAZON.COM INC | 1.26% |
| UNITEDHEALTH GROUP INC | 0.95% |
| TESLA INC | 0.75% |
| HOME DEPOT INC | 0.66% |
| VISA INC-CLASS A SHARES | 0.66% |
| PFIZER INC | 0.60% |
| FIRST SOLAR INC | 0.56% |

Struttura del portafoglio secondo il
paese/regione

| | Gruppo d'investimento |
|---------------------------------|-----------------------|
| USA E CANADA | 62.69% |
| REGIONE EUROPEA (EUR) | 14.13% |
| REGIONE ASIA E PACIFICO | 10.12% |
| REGIONE EUROPEA (EX EUR) | 9.47% |
| FUTURE SU INDICE AZIONARIO | 1.78% |
| MERCATI EMERGENTI ASIA PACIFICO | 0.93% |
| ALTRI | 0.44% |
| LIQUIDITÀ | 0.43% |

Fondazione d'investimento Swiss Life

Azioni Global Small Caps

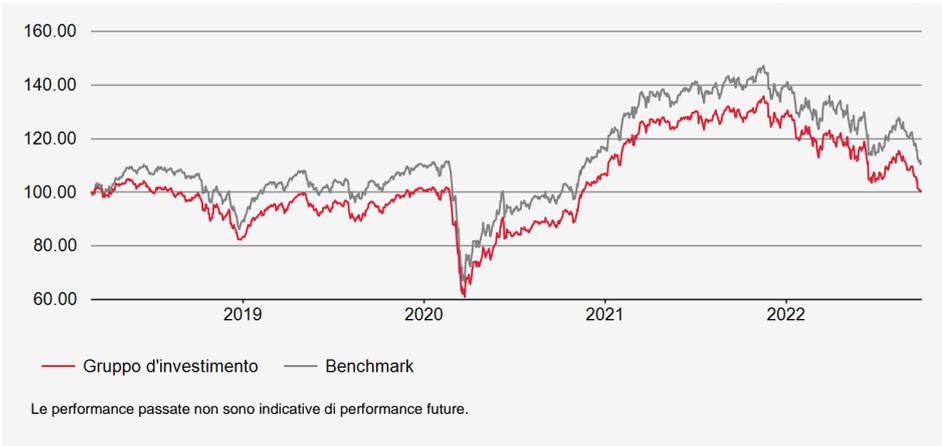


Patrimonio netto (NAV) in mio. CHF: 193.67
Valore d'inventario netto per diritto in CHF: 100.25

Strategia d'investimento

Investimenti in titoli di partecipazione di società a piccola capitalizzazione a livello mondiale. Selezione attiva di Paesi, settori e titoli. Limitazione per società: 5%. Realizzazione tramite Invesco Global Small Cap Equity Fund e Dimensional Global Small Cap Equity Fund.

Evoluzione del valore nella valuta di riferimento (base 100)



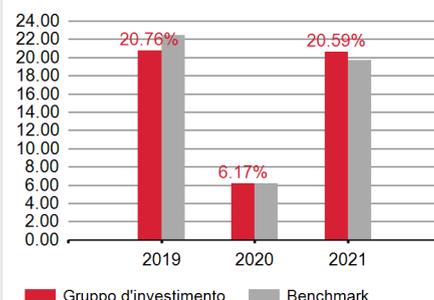
Performance nella valuta di riferimento

| | PERFORMANCE CUMULATA | | | | PERFORMANCE ANNUALIZZATA | | | |
|-----------------------|----------------------|--------|--------|---------|--------------------------|--------|---------|--------|
| | YTD | 1 MESE | 3 MESI | 1 ANNO | 3 ANNI | 5 ANNI | 10 ANNI | INIZIO |
| GRUPPO D'INVESTIMENTO | -22.32% | -9.04% | -3.55% | -22.00% | 1.86% | - | - | 0.05% |
| BENCHMARK | -20.46% | -9.47% | -2.61% | -20.66% | 2.51% | - | - | 2.29% |

Dati statistici (annualizzati)

| | 1 ANNO | 3 ANNI | 5 ANNI | 10 ANNI | INIZIO |
|---|--------|--------|--------|---------|--------|
| Volatilità Gruppo d'investimento (in %) | 17.25 | 23.36 | - | - | 20.92 |
| Volatilità del Benchmark (in %) | 17.61 | 22.81 | - | - | 20.56 |
| Tracking Error ex post (in %) | 1.77 | 1.96 | - | - | 2.52 |
| Information Ratio | -0.76 | -0.33 | - | - | -0.87 |
| Sharpe Ratio | -1.41 | 0.11 | - | - | 0.04 |
| Correlazione | 1.00 | 1.00 | - | - | 0.99 |
| Beta | 0.97 | 1.02 | - | - | 1.01 |
| Jensen alfa | -1.85 | -0.72 | - | - | -2.26 |
| Maximum Drawdown (in %) | -26.19 | -40.05 | - | - | -41.83 |
| Recovery Period (anni) | - | 0.67 | - | - | 0.73 |

Performance



Informazioni sul prodotto

Numero di valore: 40068789
ISIN: CH0400687890
LEI: 254900XCUD9NTWJQU706
Codice Bloomberg: SWLAGSC SW
Benchmark: MSCI AC World Small Cap, in CHF
Moneta: CHF
Domicilio: Svizzera
Data di creazione: 28/02/2018
Prezzo di prima emissione: 100.00
Chiusura d'esercizio: 30.09
Emissione/Riscatto: giornalmente
Termine d'accettazione: 11.00
Commissione d'emissione/riscatto: nessuna
Prassi di distribuzione: Capitalizzazione
Asset Manager in base al Swiss Life Best Select Invest Plus@: 50% Invesco / 50% Dimensional
Consulenza esterna: PPCmetrics fornisce i seguenti servizi: consulenza sulla struttura idonea del mandato, 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
Quote spese operative TER KGAST ex ante: 0.92%
ex post al: 30/09/2022 0.92%

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.

Tracking error ex ante: Il tracking error previsto per i prossimi 12 mesi corrisponde al Tracking error ex post degli ultimi 3 anni.

Fondazione d'investimento Swiss Life

Azioni Global Small Caps



Struttura del portafoglio per settore

| | Gruppo d'investimento | Benchmark |
|------------------------------|-----------------------|-----------|
| INDUSTRIE | 20.05% | 18.34% |
| FINANZA | 15.76% | 13.98% |
| BENI VOLUTTUARI | 13.22% | 12.11% |
| TECNOLOGIA DELL'INFORMAZIONE | 11.40% | 11.55% |
| SALUTE | 10.86% | 11.23% |
| MATERIALI | 6.71% | 7.69% |
| IMMOBILI | 5.97% | 9.15% |
| ENERGIA | 4.47% | 4.97% |
| BENI DI PRIMA NECESSITÀ | 3.57% | 4.99% |
| SERVIZI DI TELECOMUNICAZIONE | 2.71% | 2.79% |
| SERVIZI DI PUBBLICA UTILITÀ | 2.39% | 3.18% |
| LIQUIDITÀ | 2.85% | - |

Struttura del portafoglio secondo il paese/regione

| | Gruppo d'investimento | Benchmark |
|-------------------|-----------------------|-----------|
| USA | 57.30% | 57.58% |
| GIAPPONE | 8.77% | 10.53% |
| GRAN BRETAGNA | 5.40% | 4.80% |
| CANADA | 2.51% | 3.82% |
| FRANCIA | 2.10% | 1.11% |
| GERMANIA | 1.70% | 1.35% |
| RESTO DELL'EUROPA | 10.48% | 8.31% |
| ALTRI PAESI ASIA | 5.36% | 7.76% |
| ALTRI | 3.50% | 4.74% |
| LIQUIDITÀ | 2.85% | - |

Le principali posizioni

| | Gruppo d'investimento | Benchmark |
|----------------------|-----------------------|-----------|
| ARISTON HLDG | 0.49% | 0.01% |
| WEATHERFORD INTERNAT | 0.48% | 0.01% |
| WILLSCOT MOBILE MINI | 0.45% | 0.06% |
| CHART INDS | 0.40% | 0.05% |
| COFACE | 0.40% | 0.01% |
| PINNACLE FINL PARTNE | 0.38% | 0.04% |
| CACTUS INC | 0.37% | 0.02% |
| HURON CONSULTING GRP | 0.37% | 0.01% |
| VISTEON CORP | 0.36% | 0.02% |
| RGA | 0.34% | 0.06% |

Ulteriori informazioni sulle società

| | |
|----------------------------------|--------|
| Numero di società | 6,745 |
| Quota di società senza benchmark | 21.35% |

30 settembre 2022

Fondazione d'investimento Swiss Life

Azioni Emerging Markets ESG



Patrimonio netto (NAV) in mio. CHF: 197.82
Valore d'inventario netto per diritto in CHF: 80.61

Strategia d'investimento

Investimenti in titoli di partecipazione di società domiciliate in Paesi emergenti. Selezione attiva di Paesi, settori e titoli. Limitazione per società: 5% Società straniere al benchmark: max. 15%. Realizzazione tramite Candriam Sustainable Equity Emerging Markets; SICAV di diritto lussemburghese secondo l'OICVM.

Evoluzione del valore nella valuta di riferimento (base 100)



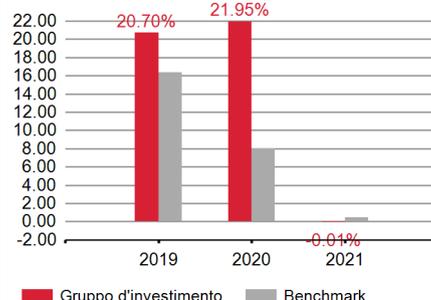
Performance nella valuta di riferimento

| | PERFORMANCE CUMULATA | | | | PERFORMANCE ANNUALIZZATA | | | |
|------------------------------|----------------------|----------------|----------------|----------------|--------------------------|----------|----------|---------------|
| | YTD | 1 MESE | 3 MESI | 1 ANNO | 3 ANNI | 5 ANNI | 10 ANNI | INIZIO |
| GRUPPO D'INVESTIMENTO | -28.46% | -10.82% | -11.46% | -32.65% | -2.00% | - | - | -4.52% |
| BENCHMARK | -21.31% | -10.97% | -9.09% | -24.15% | -2.49% | - | - | -3.78% |

Dati statistici (annualizzati)

| | 1 ANNO | 3 ANNI | 5 ANNI | 10 ANNI | INIZIO |
|---|--------|--------|--------|---------|--------|
| Volatilità Gruppo d'investimento (in %) | 12.48 | 18.85 | - | - | 18.01 |
| Volatilità del Benchmark (in %) | 13.37 | 17.86 | - | - | 16.76 |
| Tracking Error ex post (in %) | 5.67 | 5.65 | - | - | 5.50 |
| Information Ratio | -1.50 | 0.09 | - | - | -0.13 |
| Sharpe Ratio | -3.12 | -0.07 | - | - | -0.22 |
| Correlazione | 0.91 | 0.95 | - | - | 0.95 |
| Beta | 0.85 | 1.01 | - | - | 1.02 |
| Jensen alfa | -12.14 | 0.50 | - | - | -0.66 |
| Maximum Drawdown (in %) | -34.00 | -39.36 | - | - | -39.36 |
| Recovery Period (anni) | - | - | - | - | - |

Performance



Informazioni sul prodotto

Numero di valore: 39561902
ISIN: CH0395619023
LEI: 254900OLXTUB1EYJLV86
Codice Bloomberg: SWLAKEM SW
Benchmark: MSCI Emerging Markets, in CHF
Moneta: CHF
Domicilio: Svizzera
Data di creazione: 01/02/2018
Prezzo di prima emissione: 100.00
Chiusura d'esercizio: 30.09
Emissione/Riscatto: giornalmente
Termine d'accettazione: 11.00
Commissione d'emissione/riscatto: nessuna
Prassi di distribuzione: Capitalizzazione
Asset Manager in base al Swiss Life Best Select Invest Plus@: Candriam Investors Group
Consulenza esterna: PPCmetrics fornisce i seguenti servizi: consulenza sulla struttura idonea del mandato, 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
Quote spese operative TER KGAST ex ante: 0.95%
ex post al: 30/09/2022 0.95%

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.
Tracking error ex ante: Il tracking error previsto per i prossimi 12 mesi corrisponde al Tracking error ex post degli ultimi 3 anni.

Fondazione d'investimento Swiss Life

Azioni Emerging Markets ESG

Struttura del portafoglio per settore

| | Gruppo d'investimento | Benchmark |
|------------------------------|-----------------------|-----------|
| FINANZA | 21.41% | 22.60% |
| BENI VOLUTTUARI | 16.91% | 13.96% |
| TECNOLOGIA DELL'INFORMAZIONE | 15.40% | 18.27% |
| SERVIZI DI TELECOMUNICAZIONE | 10.63% | 9.69% |
| INDUSTRIE | 8.78% | 5.79% |
| SALUTE | 7.14% | 3.89% |
| BENI DI PRIMA NECESSITÀ | 5.36% | 6.60% |
| MATERIALI | 4.49% | 8.74% |
| SERVIZI DI PUBBLICA UTILITÀ | 1.87% | 3.16% |
| IMMOBILI | - | 2.02% |
| ENERGIA | - | 5.29% |
| LIQUIDITÀ | 7.90% | - |

Le principali posizioni

| | Gruppo d'investimento | Benchmark |
|---|-----------------------|-----------|
| TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFACTURING CO LTD | 5.67% | 5.71% |
| ALIBABA GROUP HOLDING LTD | 4.18% | 2.63% |
| TENCENT HOLDINGS LTD | 3.21% | 3.70% |
| HOUSING DEVELOPMENT FINANCE CORP LTD | 2.58% | 0.85% |
| MEITUAN | 2.56% | 1.62% |
| BHARTI AIRTEL LTD | 1.91% | 0.38% |
| SK HYNIX INC | 1.90% | 0.55% |
| ASIAN PAINTS LTD | 1.84% | 0.27% |
| EICHER MOTORS LTD | 1.76% | 0.11% |
| JAFRON BIOMEDICAL CO LTD | 1.76% | 0.01% |

Struttura del portafoglio secondo il paese/regione

| | Gruppo d'investimento | Benchmark |
|--------------------|-----------------------|-----------|
| CINA | 30.87% | 31.35% |
| INDIA | 16.71% | 15.33% |
| TAIWAN | 12.01% | 13.82% |
| BRASILIE | 8.56% | 5.76% |
| COREA | 6.68% | 10.66% |
| AFRICA DEL SUD | 2.61% | 3.46% |
| ALTRI PAESI ASIA | 7.84% | 6.57% |
| ALTRI PAESI EMEA | 1.02% | 9.84% |
| ALTR PAESI AMERICA | 5.70% | 3.22% |
| LIQUIDITÀ | 7.90% | - |

Ulteriori informazioni sulle società

| | |
|----------------------------------|--------|
| Numero di società | 85 |
| Quota di società senza benchmark | 13.95% |

Fondazione d'investimento Swiss Life

Azioni Global Protect Flex (CHF hedged)

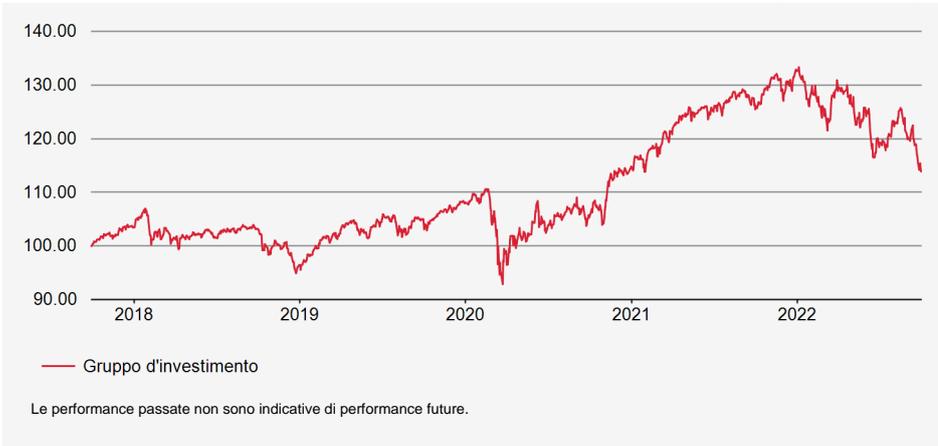


Patrimonio netto (NAV) in mio. CHF: 1,165.01
Valore d'inventario netto per diritto in CHF: 124.82

Strategia d'investimento

Strategia azionaria attiva basata su regole con strategia di copertura complementare. L'universo d'investimento del gruppo d'investimento è composto da società dei maggiori indici borsistici stranieri (in particolare S&P 500, Euro Stoxx 50, FTSE 100 e Nikkei 225) nonché l'SMI; ponderato per la capitalizzazione di mercato o a uno schema di ponderazione alternativo (p.es. processo di riequilibrio o minimo di volatilità). I rischi valutari vengono coperti al 90 % almeno contro il franco. Gli investimenti possono essere effettuati sotto forma di titoli di partecipazione, investimenti collettivi o strumenti derivati. L'impiego complementare di una strategia di copertura composta da opzioni determina, in caso di forte ribasso dei mercati, una riduzione delle perdite sulle quotazioni e, in caso di forte rialzo dei mercati, una limitazione del potenziale di crescita ("put spread collar"). A seconda della valutazione del mercato è possibile rinunciare alla vendita dell'opzione put e/o dell'opzione call. Realizzazione tramite SLF (CH) Equity Global Protect Enhanced (CHF hedged).

Evoluzione del valore nella valuta di riferimento (base 100)



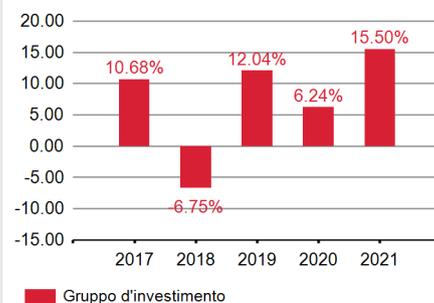
Performance nella valuta di riferimento

| | PERFORMANCE CUMULATA | | | | PERFORMANCE ANNUALIZZATA | | | |
|------------------------------|----------------------|--------|--------|--------|--------------------------|--------|---------|--------|
| | YTD | 1 MESE | 3 MESI | 1 ANNO | 3 ANNI | 5 ANNI | 10 ANNI | INIZIO |
| GRUPPO D'INVESTIMENTO | -14.14% | -5.02% | -3.84% | -9.24% | 2.73% | 2.63% | - | 3.51% |

Dati statistici (annualizzati)

| | 1 ANNO | 3 ANNI | 5 ANNI | 10 ANNI | INIZIO |
|---|--------|--------|--------|---------|--------|
| Volatilità Gruppo d'investimento (in %) | 11.83 | 10.40 | 9.17 | - | 8.24 |
| Sharpe Ratio | -0.77 | 0.32 | 0.36 | - | 0.50 |
| Maximum Drawdown (in %) | -14.58 | -15.99 | -15.99 | - | -15.99 |
| Recovery Period (anni) | - | 0.63 | 0.63 | - | 0.63 |

Performance



Informazioni sul prodotto

Numero di valore: 31952442
ISIN: CH0319524424
LEI: 254900LUAQC3MC0MWL48
Codice Bloomberg: SLAGPCH SW
Moneta: CHF
Domicilio: Svizzera
Data di creazione: 29/04/2016
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 Asset Management SA
Pubblicazioni di corsi: Bloomberg: ASSL
www.swisslife.ch/fondazioneinvestimento
Quote spese operative TER KGAST
ex ante: 0.60%
ex post al: 30/09/2022 0.60%

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.

Tracking error ex ante: Il tracking error previsto per i prossimi 12 mesi corrisponde al Tracking error ex post degli ultimi 3 anni.

Fondazione d'investimento Swiss Life

Azioni Global Protect Flex (CHF hedged)

Struttura del portafoglio per settore

| | Gruppo d'investimento |
|------------------------------|-----------------------|
| FINANZA | 13.38% |
| TECNOLOGIA DELL'INFORMAZIONE | 11.20% |
| INDUSTRIE | 9.86% |
| SALUTE | 9.70% |
| BENI VOLUTTUARI | 8.41% |
| BENI DI PRIMA NECESSITÀ | 8.13% |
| FUTURE SU INDICE AZIONARIO | 6.30% |
| SERVIZI DI COMUNICAZIONE | 6.19% |
| IMMOBILI | 5.05% |
| SERVIZI DI PUBBLICA UTILITÀ | 4.82% |
| MATERIALI | 4.60% |
| ENERGIA | 3.22% |
| LIQUIDITÀ / PRESTITO | 9.15% |

Le principali posizioni

| | Gruppo d'investimento |
|-----------------------|-----------------------|
| ELI LILLY & CO | 1.53% |
| ALPHABET INC-CL C | 1.19% |
| WASTE CONNECTIONS INC | 0.80% |
| HOME DEPOT INC | 0.79% |
| FAST RETAILING CO LTD | 0.73% |
| CHEVRON CORP | 0.69% |
| MICROSOFT CORP | 0.69% |
| EXXON MOBIL CORP | 0.66% |
| JOHNSON & JOHNSON | 0.65% |
| ON SEMICONDUCTOR | 0.61% |

Struttura del portafoglio secondo il paese/regione

| | Gruppo d'investimento |
|---------------------------------|-----------------------|
| USA E CANADA | 56.36% |
| REGIONE EUROPEA (EUR) | 13.65% |
| REGIONE EUROPEA (EX EUR) | 8.32% |
| FUTURE SU INDICE AZIONARIO | 6.30% |
| REGIONE ASIA E PACIFICO | 5.95% |
| MERCATI EMERGENTI ASIA PACIFICO | 0.28% |
| LIQUIDITÀ / PRESTITO | 9.15% |

Patrimonio netto (NAV) in mio. CHF: 3,333.31
Valore d'inventario netto per diritto in CHF: 196.37

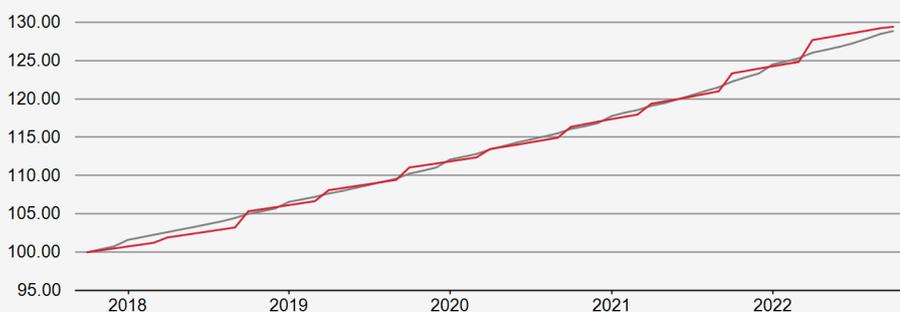


GRESB è un'impresa guidata dall'industria che valuta la performance di fondi immobiliari in termini ambientali, sociali e di gestione aziendale. GRESB verifica annualmente la performance della sostenibilità degli investimenti immobiliari nei portafogli di Swiss Life Asset Managers.

Strategia d'investimento

Gli investimenti sono attuati su immobili direttamente posseduti. Gestione attiva del portafoglio immobiliare. Diversificazione a livello di ubicazione, tipo di utilizzazione, dimensioni ed età (Abitazione 65-100%, Uso commerciale 0-35%, Sviluppo progetti 0-20%). Obiettivo il grado di finanziamento esterno: 0-30%.

Evoluzione del valore nella valuta di riferimento (base 100)



— Gruppo d'investimento — Benchmark

Le performance passate non sono indicative di performance future.

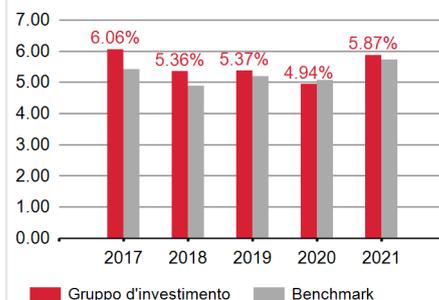
Performance nella valuta di riferimento

| | PERFORMANCE CUMULATA | | | | PERFORMANCE ANNUALIZZATA | | | |
|-----------------------|----------------------|--------|--------|--------|--------------------------|--------|---------|--------|
| | YTD | 1 MESE | 3 MESI | 1 ANNO | 3 ANNI | 5 ANNI | 10 ANNI | INIZIO |
| GRUPPO D'INVESTIMENTO | 4.14% | 0.15% | 0.65% | 4.93% | 5.21% | 5.29% | 5.73% | 5.62% |
| BENCHMARK | 3.49% | 0.31% | 1.26% | 5.39% | 5.31% | 5.20% | 5.42% | 5.53% |

Dati statistici (annualizzati)

| | 1 ANNO | 3 ANNI | 5 ANNI | 10 ANNI | INIZIO |
|---|--------|--------|--------|---------|--------|
| Volatilità Gruppo d'investimento (in %) | 2.04 | 1.67 | 1.64 | 1.73 | 1.63 |
| Volatilità del Benchmark (in %) | 0.64 | 0.56 | 0.53 | 0.55 | 0.58 |
| Tracking Error ex post (in %) | 1.98 | 1.61 | 1.59 | 1.66 | 1.59 |
| Information Ratio | -0.23 | -0.06 | 0.06 | 0.19 | 0.05 |
| Sharpe Ratio | 2.63 | 3.44 | 3.58 | 3.56 | 3.59 |
| Correlazione | 0.26 | 0.28 | 0.26 | 0.30 | 0.29 |
| Beta | 0.83 | 0.82 | 0.80 | 0.90 | 0.79 |
| Jensen alfa | 0.52 | 0.98 | 1.27 | 0.88 | 1.31 |
| Maximum Drawdown (in %) | -0.09 | -0.09 | -0.09 | -0.09 | -0.76 |
| Recovery Period (anni) | - | - | - | - | 0.24 |

Performance



Informazioni sul prodotto

Numero di valore: 10615013

ISIN: CH0106150136

LEI: 254900H9DY0IX7641Z92

Codice Bloomberg: SWLIMMS SW

Benchmark: KGAST Immo-Index (CHF)

Moneta: CHF

Domicilio: Svizzera

Data di creazione: 30/11/2009

Prezzo di prima emissione: 100.00

Chiusura d'esercizio: 30.09

Emissione: Attualmente chiuso per le sottoscrizioni

Riscatto: attualmente giornalmente

Termine d'accettazione: 14.30

Commissione di riscatto: 1.50%

Prassi di distribuzione: Capitalizzazione

Asset Manager

Swiss Life Asset Management SA

Pubblicazioni di corsi: Bloomberg: ASSL

www.swisslife.ch/fondazioneinvestimento

Management Fee: 0.50%

Amministrazione immobiliare in % degli introiti netti delle pigioni max. 4.50%

Commissione di transazione per acquisizioni e disinvestimenti in % del prezzo d'acquisto/di vendita max. 2.00%

Onorario per costruzione e ristrutturazione in % dei costi di costruzione max. 3.00%

Spese accessorie come imposte sul passaggio di proprietà, stime, ecc. in base all'onere effettivo

Quote spese operative TER ISA

Base CIC al: 30/09/2022 0.70%

Base CIN al: 30/09/2022 0.82%

Riscatto: Riscatto alla fine di ogni trimestre con un periodo di preavviso di 6 mesi; max. 30 milioni di CHF per investitore per trimestre (Cap). A causa delle attuali possibilità di sostituzione, i riscatti sono possibili su base giornaliera.

Commissione di riscatto: Se le diritti possono essere collocate ulteriormente con valuta corretta, non subentrano la commissione di riscatto.

Management Fee: Contiene le spese amministrative per la gestione del portafoglio, gestione, contabilità, calcolo NAV, revisione ord., alta vigilanza e rapporti.

Quote spese operative TER ISA: La quota spese operative TER ISA 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.

Tracking error ex ante: Il tracking error previsto per i prossimi 12 mesi corrisponde al Tracking error ex post degli ultimi 3 anni.

Ricavi da immobili secondo l'utilizzo

| | |
|------------------------------|--------|
| ABITAZIONE | 67.06% |
| UFFICIO | 8.09% |
| VENDITA | 15.63% |
| PARCHEGGIO | 6.69% |
| UTILIZZAZIONE ACCESSORIA | 2.52% |
| DI CUI SVILUPPO DI PROGETTI* | 1.91% |

*in % del valore di mercato

Ripartizione geografica degli immobili*

| | |
|--------------------------|--------|
| ZURIGO | 38.23% |
| BERNA | 5.96% |
| SVIZZERA CENTRALE | 4.70% |
| SVIZZERA OCCIDENTALE | 4.04% |
| SVIZZERA NORDOCCIDENTALE | 16.68% |
| SVIZZERA ORIENTALE | 7.52% |
| TICINO | 4.48% |
| LAGO DI GINEVRA | 18.39% |

*secondo il monitoring delle regioni di Wüest Partner AG

Cifre chiave relative agli immobili

| | |
|-----------------------|----------|
| VALORE VENALE* | 3'807.14 |
| NUMERO DEGLI IMMOBILI | 236 |
| QUOTA DI LOCAZIONE | 97.86% |

*in milioni CHF

Ulteriori cifre salienti

| | |
|--------------------------------|--------|
| FINANZIAMENTO ESTERNO* | 402.8 |
| GRADO DI FINANZIAMENTO ESTERNO | 10.58% |
| LIQUIDITÀ* | 62.7 |

*in milioni CHF

Classificazione degli immobili in base all'età

| | |
|----------------|--------|
| 2020-2022 | 4.90% |
| 2010-2019 | 13.99% |
| 2000-2009 | 10.14% |
| 1990-1999 | 10.14% |
| 1980-1989 | 10.35% |
| 1970-1979 | 21.73% |
| 1960-1969 | 9.11% |
| PRIMA DEL 1960 | 19.65% |

Patrimonio netto (NAV) in mio. CHF: 399.11
Valore d'inventario netto per diritto in CHF: 129.55

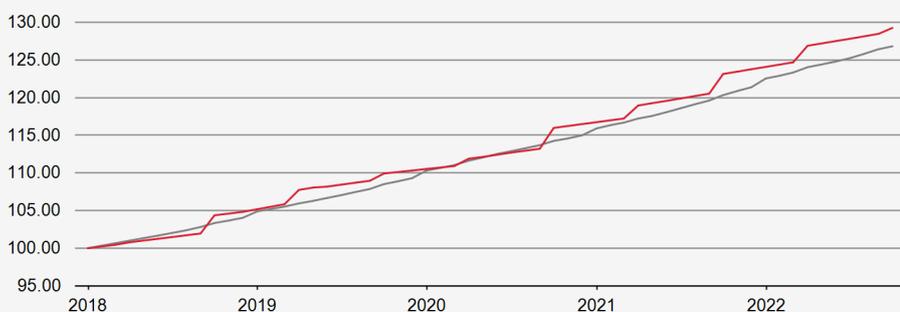


GRESB è un'impresa guidata dall'industria che valuta la performance di fondi immobiliari in termini ambientali, sociali e di gestione aziendale. GRESB verifica annualmente la performance della sostenibilità degli investimenti immobiliari nei portafogli di Swiss Life Asset Managers.

Strategia d'investimento

Gli investimenti sono attuati su immobili direttamente posseduti in Svizzera nel settore terza età e sanità. Abitazioni senza offerta di assistenza stazionaria: 20-70%, strutture di cura e case per anziani: 0-50%, immobili sanitari (strutture paramediche, centri di riabilitazione, poliambulatori, ospedali ecc.): 0-50%, altri usi: 0-50%.
 Grado di finanziamento da terzi: 0-30%.

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 | 4.17% | 0.61% | 1.13% | 4.97% | 5.53% | - | - | 5.50% |
| BENCHMARK | 3.49% | 0.31% | 1.26% | 5.39% | 5.31% | - | - | 5.22% |

Dati statistici (annualizzati)

| | 1 ANNO | 3 ANNI | 5 ANNI | 10 ANNI | INIZIO |
|---|--------|--------|--------|---------|--------|
| Volatilità Gruppo d'investimento (in %) | 1.51 | 1.95 | - | - | 1.92 |
| Volatilità del Benchmark (in %) | 0.64 | 0.56 | - | - | 0.54 |
| Tracking Error ex post (in %) | 1.53 | 1.91 | - | - | 1.88 |
| Information Ratio | -0.28 | 0.11 | - | - | 0.15 |
| Sharpe Ratio | 3.58 | 3.09 | - | - | 3.17 |
| Correlazione | 0.18 | 0.22 | - | - | 0.24 |
| Beta | 0.43 | 0.77 | - | - | 0.90 |
| Jensen alfa | 2.98 | 1.61 | - | - | 0.86 |
| Maximum Drawdown (in %) | 0.00 | 0.00 | - | - | - |
| Recovery Period (anni) | - | - | - | - | - |

Strategia d'investimento: Durante la fase di costruzione del portfolio potrebbe essere deviato da questi obiettivi.

Riscatto: Riscatto alla fine di ogni trimestre con un periodo di preavviso di 6 mesi; max. 2 milioni di CHF per investitore per trimestre (Cap). A causa delle attuali possibilità di sostituzione, i riscatti sono possibili su base giornaliera.

Commissione di riscatto: Se le diritti possono essere collocate ulteriormente con valuta corretta, non subentrano la commissione di riscatto.

Management Fee: Contiene le spese amministrative per la gestione del portafoglio, gestione, contabilità, calcolo NAV, revisione ord., alta vigilanza e rapporti.

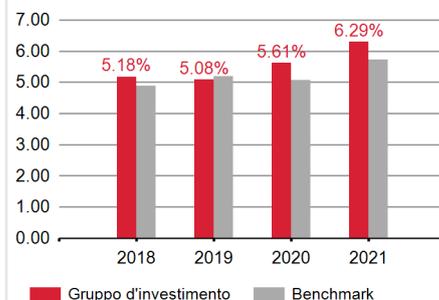
Quote spese operative TER ISA: La quota spese operative TER ISA copre tutti i costi, eccezione fatta per i costi di transazione e i tributi fiscali legati alla transazione.

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.

Tracking error ex ante: Il tracking error previsto per i prossimi 12 mesi corrisponde al Tracking error ex post degli ultimi 3 anni.

Performance



Informazioni sul prodotto

Numero di valore: 38555648

ISIN: CH0385556482

LEI: 254900NECAZFGP93OC21

Codice Bloomberg: SLISAUG SW

Benchmark: KGAST Immo-Index (CHF)

Moneta: CHF

Domicilio: Svizzera

Data di creazione: 30/11/2017

Prezzo di prima emissione: 100.00

Chiusura d'esercizio: 30.09

Emissione: Attualmente chiuso per le sottoscrizioni

Riscatto: attualmente giornalmente

Termine d'accettazione: 14.30

Commissione di riscatto: 1.50%

Prassi di distribuzione: Capitalizzazione

Asset Manager

Swiss Life Asset Management SA

Pubblicazioni di corsi: Bloomberg: ASSL

www.swisslife.ch/fondazioneinvestimento

Management Fee: 0.60%

Amministrazione immobiliare in % degli introiti netti delle pigioni max. 4.50%

Commissione di transazione per acquisizioni e disinvestimenti in % del prezzo d'acquisto/di vendita max. 2.00%

Onorario per costruzione e ristrutturazione in % dei costi di costruzione max. 3.00%

Spese accessorie come imposte sul passaggio di proprietà, stime, ecc. in base all'onere effettivo

Quote spese operative TER ISA

Base CIC al: 30/09/2022 0.79%

Base CIN al: 30/09/2022 0.96%

Ricavi da immobili secondo l'utilizzo

| | |
|--|--------|
| ABITAZIONI SENZA OFFERTA DI ASSISTENZA STAZIONARIA | 76.86% |
| STRUTTURE DI CURA E CASE PER ANZIANI | 10.47% |
| IMMOBILI SANITARI | - |
| SERVIZIO E VENDITA | 6.62% |
| UTILIZZAZIONE ACCESSORIA E PARCHEGGIO | 6.05% |
| DI CUI SVILUPPO DI PROGETTI* | 5.51% |

*in % del valore di mercato

Ripartizione geografica degli immobili*

| | |
|--------------------------|--------|
| ZURIGO | 55.70% |
| BERNA | 5.34% |
| SVIZZERA CENTRALE | - |
| SVIZZERA OCCIDENTALE | - |
| SVIZZERA NORDOCCIDENTALE | 27.11% |
| SVIZZERA ORIENTALE | 2.94% |
| TICINO | 8.92% |
| LAGO DI GINEVRA | - |

*secondo il monitoring delle regioni di Wüest Partner AG

Cifre chiave relative agli immobili

| | |
|-----------------------|--------|
| VALORE VENALE* | 479.64 |
| NUMERO DEGLI IMMOBILI | 14 |
| QUOTA DI LOCAZIONE | 98.57% |

*in milioni CHF

Ulteriori cifre salienti

| | |
|--------------------------------|--------|
| FINANZIAMENTO ESTERNO* | 65.8 |
| GRADO DI FINANZIAMENTO ESTERNO | 13.72% |
| LIQUIDITÀ* | 1.8 |

*in milioni CHF

Classificazione degli immobili in base all'età

| | |
|----------------|--------|
| 2020-2022 | 48.76% |
| 2010-2019 | 25.02% |
| 2000-2009 | 21.60% |
| 1990-1999 | 1.05% |
| 1980-1989 | - |
| 1970-1979 | - |
| 1960-1969 | - |
| PRIMA DEL 1960 | 3.56% |

Patrimonio netto (NAV) in mio. CHF: 1,894.08
Valore d'inventario netto per diritto in CHF: 173.12

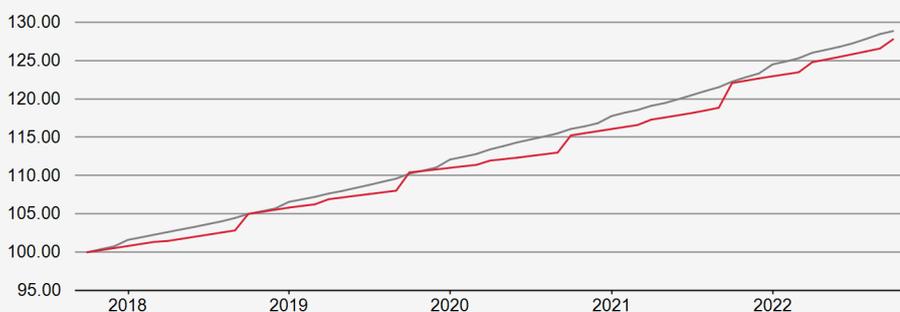


GRESB è un'impresa guidata dall'industria che valuta la performance di fondi immobiliari in termini ambientali, sociali e di gestione aziendale. GRESB verifica annualmente la performance della sostenibilità degli investimenti immobiliari nei portafogli di Swiss Life Asset Managers.

Strategia d'investimento

Gli investimenti sono attuati su immobili direttamente posseduti. Gestione attiva del portafoglio immobiliare. Diversificazione a livello di ubicazione, tipo di utilizzazione, dimensioni ed età (uso commerciale 60-90%, uso abitazione 10-40%, sviluppo progetti 0-20%).
 Grado di finanziamento da terzi: 0-30%.

Evoluzione del valore nella valuta di riferimento (base 100)



— Gruppo d'investimento — Benchmark

Le performance passate non sono indicative di performance future.

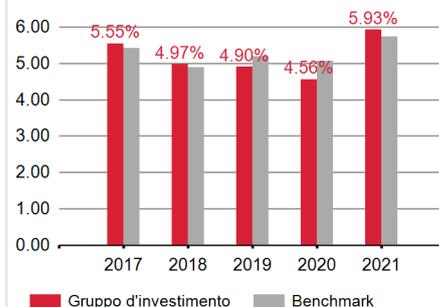
Performance nella valuta di riferimento

| | PERFORMANCE CUMULATA | | | | PERFORMANCE ANNUALIZZATA | | | |
|-----------------------|----------------------|--------|--------|--------|--------------------------|--------|---------|--------|
| | YTD | 1 MESE | 3 MESI | 1 ANNO | 3 ANNI | 5 ANNI | 10 ANNI | INIZIO |
| GRUPPO D'INVESTIMENTO | 3.93% | 0.96% | 1.55% | 4.68% | 4.97% | 5.02% | 5.19% | 5.15% |
| BENCHMARK | 3.49% | 0.31% | 1.26% | 5.39% | 5.31% | 5.20% | 5.42% | 5.53% |

Dati statistici (annualizzati)

| | 1 ANNO | 3 ANNI | 5 ANNI | 10 ANNI | INIZIO |
|---|--------|--------|--------|---------|--------|
| Volatilità Gruppo d'investimento (in %) | 1.02 | 1.79 | 1.80 | 1.52 | 1.51 |
| Volatilità del Benchmark (in %) | 0.64 | 0.56 | 0.53 | 0.55 | 0.59 |
| Tracking Error ex post (in %) | 1.20 | 1.76 | 1.75 | 1.48 | 1.50 |
| Information Ratio | -0.59 | -0.20 | -0.10 | -0.16 | -0.26 |
| Sharpe Ratio | 5.00 | 3.08 | 3.13 | 3.71 | 3.65 |
| Correlazione | 0.00 | 0.19 | 0.24 | 0.25 | 0.24 |
| Beta | -0.01 | 0.60 | 0.80 | 0.67 | 0.61 |
| Jensen alfa | 5.27 | 2.02 | 1.02 | 1.74 | 1.97 |
| Maximum Drawdown (in %) | 0.00 | 0.00 | -0.15 | -0.15 | -0.15 |
| Recovery Period (anni) | - | - | 0.05 | 0.05 | 0.05 |

Performance



Informazioni sul prodotto

Numero di valore: 13683758

ISIN: CH0136837587

LEI: 254900ZBV80MWE4EZ391

Codice Bloomberg: SWLGSCH SW

Benchmark: KGAST Immo-Index (CHF)

Moneta: CHF

Domicilio: Svizzera

Data di creazione: 31/10/2011

Prezzo di prima emissione: 100.00

Chiusura d'esercizio: 30.09

Emissione: Attualmente chiuso per le sottoscrizioni

Riscatto: attualmente giornalmente

Termine d'accettazione: 14.30

Commissione di riscatto: 1.50%

Prassi di distribuzione: Capitalizzazione

Asset Manager

Swiss Life Asset Management SA

Pubblicazioni di corsi: Bloomberg: ASSL

www.swisslife.ch/fondazioneinvestimento

Management Fee: 0.50%

Amministrazione immobiliare in % degli introiti netti delle pigioni max. 4.50%

Commissione di transazione per acquisizioni e disinvestimenti in % del prezzo d'acquisto/di vendita max. 2.00%

Onorario per costruzione e ristrutturazione in % dei costi di costruzione max. 3.00%

Spese accessorie come imposte sul passaggio di proprietà, stime, ecc. in base all'onere effettivo

Quote spese operative TER ISA

Base CIC al: 30/09/2022 0.68%

Base CIN al: 30/09/2022 0.89%

Riscatto: Riscatto alla fine di ogni trimestre con un periodo di preavviso di 6 mesi; max. 20 milioni di CHF per investitore per trimestre (Cap). A causa delle attuali possibilità di sostituzione, i riscatti sono possibili su base giornaliera.

Commissione di riscatto: Se le diritti possono essere collocate ulteriormente con valuta corretta, non subentrano la commissione di riscatto.

Management Fee: Contiene le spese amministrative per la gestione del portafoglio, gestione, contabilità, calcolo NAV, revisione ord., alta vigilanza e rapporti.

Quote spese operative TER ISA: La quota spese operative TER ISA 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.

Tracking error ex ante: Il tracking error previsto per i prossimi 12 mesi corrisponde al Tracking error ex post degli ultimi 3 anni.

Ricavi da immobili secondo l'utilizzo

| | |
|------------------------------|--------|
| ABITAZIONE | 13.13% |
| UFFICIO | 37.58% |
| VENDITA | 38.24% |
| PARCHEGGIO | 4.55% |
| UTILIZZAZIONE ACCESSORIA | 6.50% |
| DI CUI SVILUPPO DI PROGETTI* | 2.24% |

*in % del valore di mercato

Ripartizione geografica degli immobili*

| | |
|--------------------------|--------|
| ZURIGO | 42.74% |
| BERNA | 5.95% |
| SVIZZERA CENTRALE | 11.60% |
| SVIZZERA OCCIDENTALE | 3.17% |
| SVIZZERA NORDOCCIDENTALE | 8.56% |
| SVIZZERA ORIENTALE | 6.93% |
| TICINO | 1.89% |
| LAGO DI GINEVRA | 19.17% |

*secondo il monitoring delle regioni di Wüest Partner AG

Cifre chiave relative agli immobili

| | |
|-----------------------|----------|
| VALORE VENALE* | 2'361.48 |
| NUMERO DEGLI IMMOBILI | 111 |
| QUOTA DI LOCAZIONE | 96.86% |

*in milioni CHF

Ulteriori cifre salienti

| | |
|--------------------------------|--------|
| FINANZIAMENTO ESTERNO* | 409.8 |
| GRADO DI FINANZIAMENTO ESTERNO | 17.35% |
| LIQUIDITÀ* | 7.2 |

*in milioni CHF

Classificazione degli immobili in base all'età

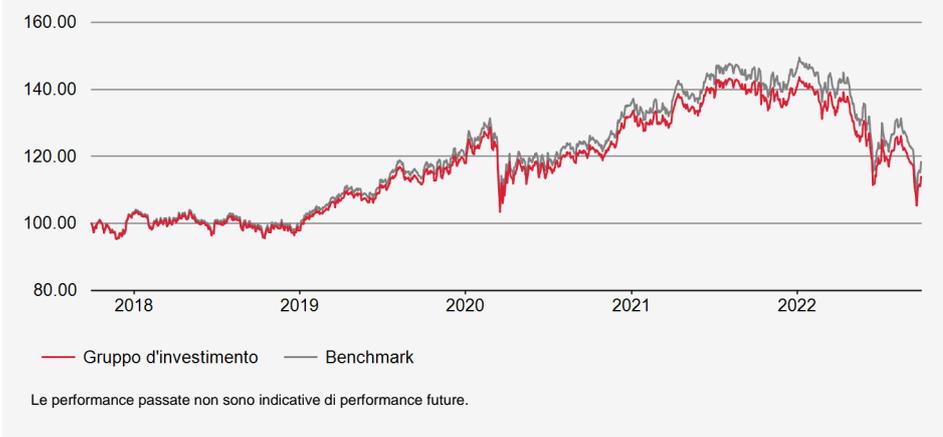
| | |
|----------------|--------|
| 2020-2022 | 2.24% |
| 2010-2019 | 3.06% |
| 2000-2009 | 1.74% |
| 1990-1999 | 15.85% |
| 1980-1989 | 15.67% |
| 1970-1979 | 26.18% |
| 1960-1969 | 10.17% |
| PRIMA DEL 1960 | 25.09% |

Patrimonio netto (NAV) in mio. CHF: 340.04
Valore d'inventario netto per diritto in CHF: 148.05

Strategia d'investimento

Il gruppo d'investimento colloca il proprio patrimonio in fondi d'investimento immobiliari di diritto svizzero, in franchi, ed esclusivamente in immobili svizzeri. Selezione attiva dei fondi d'investimento immobiliari. Realizzazione tramite Swiss Life Funds (CH) Real Estate Switzerland Fund of Funds.

Evoluzione del valore nella valuta di riferimento (base 100)



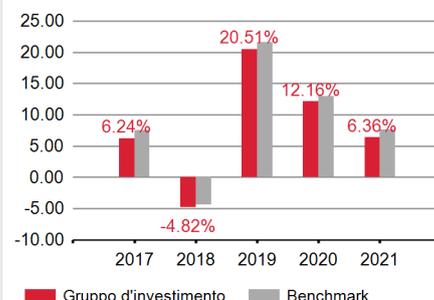
Performance nella valuta di riferimento

| | PERFORMANCE CUMULATA | | | | PERFORMANCE ANNUALIZZATA | | | |
|-----------------------|----------------------|--------|--------|---------|--------------------------|--------|---------|--------|
| | YTD | 1 MESE | 3 MESI | 1 ANNO | 3 ANNI | 5 ANNI | 10 ANNI | INIZIO |
| GRUPPO D'INVESTIMENTO | -19.03% | -5.11% | -3.74% | -18.57% | 0.44% | 2.65% | 3.48% | 3.44% |
| BENCHMARK | -19.02% | -5.21% | -3.74% | -17.83% | 1.16% | 3.43% | 4.32% | 4.28% |

Dati statistici (annualizzati)

| | 1 ANNO | 3 ANNI | 5 ANNI | 10 ANNI | INIZIO |
|---|--------|--------|--------|---------|--------|
| Volatilità Gruppo d'investimento (in %) | 11.17 | 10.85 | 9.70 | 8.72 | 8.27 |
| Volatilità del Benchmark (in %) | 11.72 | 11.13 | 9.94 | 9.01 | 8.53 |
| Tracking Error ex post (in %) | 0.69 | 0.44 | 0.36 | 0.53 | 0.50 |
| Information Ratio | -1.08 | -1.63 | -2.17 | -1.58 | -1.65 |
| Sharpe Ratio | -1.79 | 0.10 | 0.34 | 0.46 | 0.47 |
| Correlazione | 1.00 | 1.00 | 1.00 | 1.00 | 1.00 |
| Beta | 0.95 | 0.97 | 0.98 | 0.97 | 0.97 |
| Jensen alfa | -1.55 | -0.67 | -0.68 | -0.68 | -0.68 |
| Maximum Drawdown (in %) | -26.64 | -26.64 | -26.64 | -26.64 | -26.64 |
| Recovery Period (anni) | - | - | - | - | - |

Performance



Informazioni sul prodotto

Numero di valore: 12468379
ISIN: CH0124683795
LEI: 254900VB5XEQLYLQJ518
Codice Bloomberg: SWLIMSC SW
Benchmark: SXI Swiss Real Estate Funds TR Index
Moneta: CHF
Domicilio: Svizzera
Data di creazione: 28/02/2011
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: Swiss Life Asset Management SA
Pubblicazioni di corsi: Bloomberg: ASSL
www.swisslife.ch/fondazionedinvestimento
Quote spese operative TER KGAST
ex ante: 1.16%
ex post al: 30/09/2022 1.15%

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.

Tracking error ex ante: Il tracking error previsto per i prossimi 12 mesi corrisponde al Tracking error ex post degli ultimi 3 anni.

Immobili secondo il tipo di utilizzazione*

| | Gruppo d'investimento | Benchmark |
|-------------------------------|-----------------------|-----------|
| ABITAZIONE | 57.40% | 57.40% |
| UFFICIO | 33.90% | 34.10% |
| MISTI | 8.10% | 8.00% |
| TERRENI EDIFICABILI, PROGETTI | 0.60% | 0.50% |

*in base agli ultimi dati disponibili

Ripartizione geografica degli immobili*

| | Gruppo d'investimento | Benchmark |
|--------------------------|-----------------------|-----------|
| ZURIGO | 34.70% | 35.30% |
| BERNA | 6.80% | 6.70% |
| SVIZZERA CENTRALE | 6.30% | 6.40% |
| SVIZZERA OCCIDENTALE | 4.20% | 4.20% |
| SVIZZERA NORDOCCIDENTALE | 18.00% | 18.10% |
| SVIZZERA ORIENTALE | 5.30% | 5.40% |
| TICINO | 1.80% | 1.90% |
| LAGO DI GINEVRA | 22.90% | 22.00% |

*in base agli ultimi dati disponibili

Le principali posizioni

| | Gruppo d'investimento | Benchmark |
|-----------------------|-----------------------|-----------|
| UBS SWISS SIMA | 29.80% | 30.00% |
| CS REF SIAT | 10.80% | 10.80% |
| CS REF LIVING PLUS | 9.30% | 9.20% |
| UBS SWISS ANFOS | 9.30% | 9.20% |
| CS REF GREEN PROPERTY | 9.20% | 9.10% |

Fondazione d'investimento Swiss Life

Immobili Europa Industria e Logistica ESG (CHF)

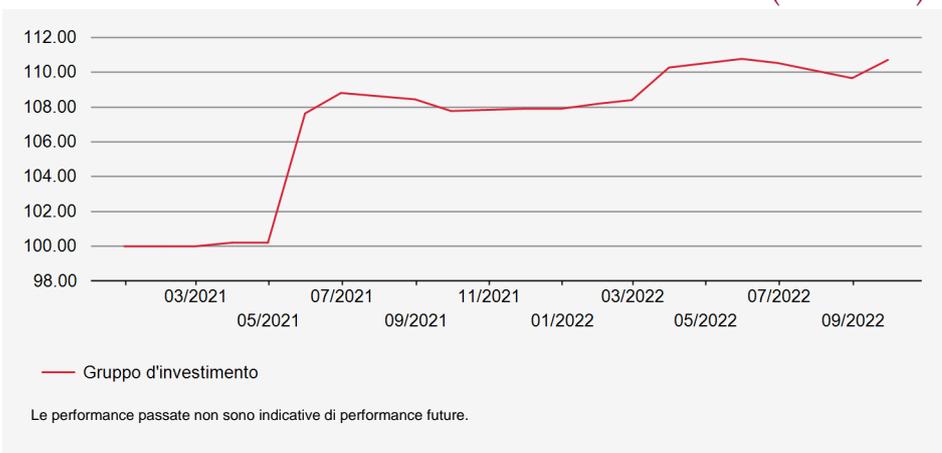


Patrimonio netto (NAV) in mio. CHF: 18.32
Valore d'inventario netto per diritto in CHF: 110.77

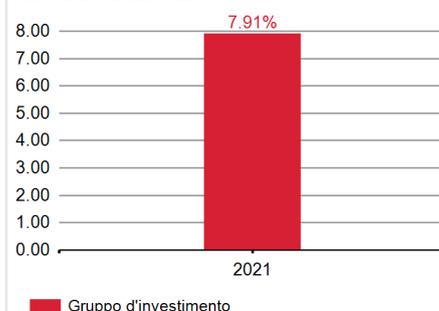
Strategia d'investimento

Investimenti in immobili industriali e logistici. Allocazione prevista in entrambi i tipi di utilizzazione rispettivamente del 40-60%. Priorità a Germania e Francia e con integrazione del resto d'Europa, in particolare Regno Unito, Benelux e Svizzera. Grado di finanziamento esterno target: 30%. I rischi di valuta vengono coperti almeno all'80% contro il franco svizzero. Gestione attiva del portafoglio immobiliare nel fondo target. Attuazione con l'impiego di Swiss Life Real Estate Funds (LUX) S.A., SICAV-SIF – ESG European Industrial & Logistics; SICAV secondo il diritto lussemburghese.

Evoluzione del valore nella valuta di riferimento (base 100)



Performance



Informazioni sul prodotto

Numero di valore: 56847985

ISIN: CH0568479858

LEI: 254900A0BOVBYIND4J79

Codice Bloomberg: SLIEILC SW

Moneta: CHF

Domicilio: Svizzera

Data di creazione: 11/12/2020

Prezzo di prima emissione: 100.00

Chiusura d'esercizio: 30.09

Commissione di riscatto: 1.00%

Emissione: Trimestrale, cinque giorni lavorativi bancari prima della fine del trimestre (ultimo -5)

Riscatto: 31.03. / 30.09. con un termine di disdetta di sette mesi

Prassi di distribuzione: Capitalizzazione

Asset Manager

Swiss Life Asset Management SA

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

Quote spese operative TER KGAST

ex ante: 1.83%

ex post al: 30/09/2022 1.83%

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 | 2.60% | 0.96% | 0.16% | 2.73% | - | - | - | 5.84% |

Dati statistici (annualizzati)

| | 1 ANNO | 3 ANNI | 5 ANNI | 10 ANNI | INIZIO |
|---|--------|--------|--------|---------|--------|
| Volatilità Gruppo d'investimento (in %) | 2.18 | - | - | - | 5.51 |
| Sharpe Ratio | 1.48 | - | - | - | 1.11 |
| Maximum Drawdown (in %) | -1.00 | - | - | - | -1.32 |
| Recovery Period (anni) | - | - | - | - | 0.42 |

Commissione di riscatto: Commissione di riscatto variabili in base al periodo di detenzione (durante la fase d'investimento: fino al 5%), 24 mesi dopo il completamento dell'appello di capitali (max. 3 anni) la commissione di riscatto ammonta all'1.00%. Nessuna commissione di riscatto è addebitata su diritti che sono rivenduti entro la relativa data valuta.

Quote spese operative TER KGAST: Valore indicativo tra 1.00% e 1.40%.

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.

Tracking error ex ante: Il tracking error previsto per i prossimi 12 mesi corrisponde al Tracking error ex post degli ultimi 3 anni.

Ricavi da immobili secondo l'utilizzo

| | |
|-----------|--------|
| INDUSTRIA | 41.10% |
| LOGISTICA | 58.90% |

Ripartizione geografica degli immobili

| | |
|-------------|--------|
| GERMANIA | 63.00% |
| AUSTRIA | 17.50% |
| FRANCIA | 11.50% |
| PAESI BASSI | 8.00% |
| REGNO UNITO | - |

Cifre chiave relative agli immobili

| | |
|-----------------------|--------|
| VALORE VENALE* | 616.2 |
| NUMERO DEGLI IMMOBILI | 20 |
| QUOTA DI LOCAZIONE | 97.90% |

*in milioni EUR

Ulteriori cifre salienti

| | |
|--------------------------------|--------|
| GRADO DI FINANZIAMENTO ESTERNO | 31.70% |
|--------------------------------|--------|

I dati su questa pagina si riferiscono al fondo target al 30/09/2022. A livello di gruppo d'investimento possono variare leggermente a causa della possibile detenzione di liquidità.

30 settembre 2022

Fondazione d'investimento Swiss Life Immobili Europa Industria e Logistica ESG (EUR)

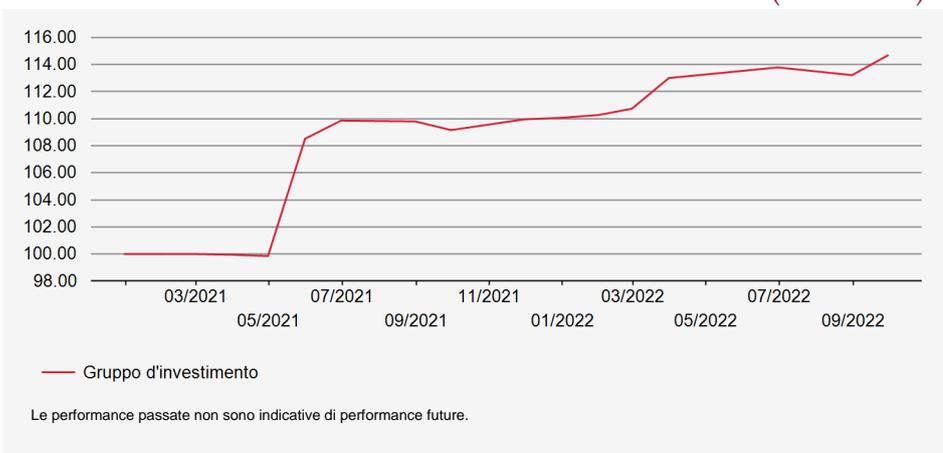


Patrimonio netto (NAV) in mio. EUR: 193.26
Valore d'inventario netto per diritto in EUR: 114.69

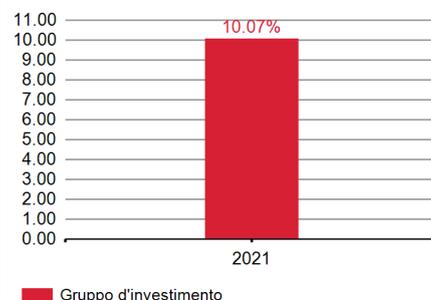
Strategia d'investimento

Investimenti in immobili industriali e logistici. Allocazione prevista in entrambi i tipi di utilizzazione rispettivamente del 40-60%. Priorità a Germania e Francia, con integrazione del resto d'Europa, in particolare Regno Unito, Benelux e Svizzera. Grado di finanziamento esterno target: 30%. Gestione attiva del portafoglio immobiliare nel fondo target. Attuazione con l'impiego di Swiss Life Real Estate Funds (LUX) S.A., SICAV-SIF – ESG European Industrial & Logistics; SICAV secondo il diritto lussemburghese.

Evoluzione del valore nella valuta di riferimento (base 100)



Performance



Informazioni sul prodotto

Numero di valore: 56848140
ISIN: CH0568481409
LEI: 254900I0ML8QYK4H7G51
Codice Bloomberg: SLIELE SW
Moneta: EUR
Domicilio: Svizzera
Data di creazione: 11/12/2020
Prezzo di prima emissione: 100.00
Chiusura d'esercizio: 30.09
Commissione di riscatto: 1.00%
Emissione: Trimestrale, cinque giorni lavorativi bancari prima della fine del trimestre (ultimo -5)
Riscatto: 31.03. / 30.09. con un termine di disdetta di sette mesi
Prassi di distribuzione: Distribuzione
Asset Manager
Swiss Life Asset Management SA
Pubblicazioni di corsi: Bloomberg: ASSL
www.swisslife.ch/fondazioneinvestimento
Quote spese operative TER KGAST
ex ante: 2.05%
ex post al: 30/09/2022 2.05%

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 | 4.20% | 1.30% | 0.79% | 5.07% | - | - | - | 7.90% |

Dati statistici (annualizzati)

| | 1 ANNO | 3 ANNI | 5 ANNI | 10 ANNI | INIZIO |
|---|--------|--------|--------|---------|--------|
| Volatilità Gruppo d'investimento (in %) | 2.31 | - | - | - | 6.44 |
| Sharpe Ratio | 2.33 | - | - | - | 1.29 |
| Maximum Drawdown (in %) | -0.50 | - | - | - | -0.70 |
| Recovery Period (anni) | 0.08 | - | - | - | 0.09 |

Commissione di riscatto: Commissione di riscatto variabili in base al periodo di detenzione (durante la fase d'investimento: fino al 5%), 24 mesi dopo il completamento dell'appello di capitali (max. 3 anni) la commissione di riscatto ammonta all'1.00%. Nessuna commissione di riscatto è addebitata su diritti che sono rivenduti entro la relativa data valuta.

Quote spese operative TER KGAST: Valore indicativo tra 1.00% e 1.40%.

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.

Tracking error ex ante: Il tracking error previsto per i prossimi 12 mesi corrisponde al Tracking error ex post degli ultimi 3 anni.

Fondazione d'investimento Swiss Life

Immobili Europa Industria e Logistica ESG (EUR)



Ricavi da immobili secondo l'utilizzo

| | |
|-----------|--------|
| INDUSTRIA | 41.10% |
| LOGISTICA | 58.90% |

Ripartizione geografica degli immobili

| | |
|-------------|--------|
| GERMANIA | 63.00% |
| AUSTRIA | 17.50% |
| FRANCIA | 11.50% |
| PAESI BASSI | 8.00% |
| REGNO UNITO | - |

Cifre chiave relative agli immobili

| | |
|-----------------------|--------|
| VALORE VENALE* | 616.2 |
| NUMERO DEGLI IMMOBILI | 20 |
| QUOTA DI LOCAZIONE | 97.90% |

*in milioni EUR

Ulteriori cifre salienti

| | |
|--------------------------------|--------|
| GRADO DI FINANZIAMENTO ESTERNO | 31.70% |
|--------------------------------|--------|

I dati su questa pagina si riferiscono al fondo target al 30/09/2022. A livello di gruppo d'investimento possono variare leggermente a causa della possibile detenzione di liquidità.

30 settembre 2022

Fondazione d'investimento Swiss Life Infrastruttura globale ESG (CHF hedged)



Patrimonio netto (NAV) in mio. CHF: 80.21
Valore d'inventario netto per diritto in CHF: 106.89

Commento di management e prospettive

Il gruppo d'investimento Infrastruttura globale ESG (CHF hedged) ha collocato ulteriori CHF 26,8 mio. nel gruppo d'investimento Infrastruttura globale (EUR). Gruppo d'investimento Infrastruttura globale ESG (EUR): circa EUR 61,5 mio. allocati in ulteriori investimenti. Si tratta di due investimenti diretti (co-investimenti) nei settori trasporto ed energie rinnovabili. A tale scopo è stato sottoscritto per la prima volta il fondo target FONTAVIS SCS SICAV-RAIF- Fontavis ESG Renewable Infrastructure Fund II. Le chiamate di capitale da parte degli investimenti target del gruppo d'investimento Infrastruttura globale ESG (EUR) ammontavano a EUR 78,2 mio. Oltre a un'ampia diversificazione, il portafoglio vanta un'ottima evoluzione nonostante la fase di accumulo ancora in corso. Nel T4 2022 Portfolio Management prevede diverse chiamate di capitale presso gli investitori. Inoltre, nel T4 verranno consultati per la prima volta i sottoscrittori del secondo periodo.

Strategia d'investimento

Acquisizione di diritti del gruppo d'investimento Infrastruttura globale ESG (EUR) e attuazione di coperture valutarie per ridurre i relativi rischi di cambio. Il gruppo d'investimento detiene la liquidità necessaria per la copertura valutaria. Il reddito d'investimento della classe d'investimento EUR viene conseguito mediante collocamenti in investimenti infrastrutturali. L'obiettivo è quello di coprire uno spettro di rischio / rendimento da conservativo a equilibrato (cfr. prospetto del gruppo d'investimento Infrastruttura globale ESG [CHF hedged], punto 2.3).

Performance nella valuta di riferimento

| | PERFORMANCE CUMULATA | | | PERFORMANCE ANNUALIZZATA | | | |
|------------------------------|----------------------|--------------|--------------|--------------------------|--------|---------|--------------|
| | YTD | 3 MESI | 1 ANNO | 3 ANNI | 5 ANNI | 10 ANNI | INIZIO |
| GRUPPO D'INVESTIMENTO | 4.44% | 3.87% | 4.91% | - | - | - | 5.07% |

Principali dati indicativi

| | |
|--|-------|
| Capitale impegnato* | 182.7 |
| Capitale richiamato* | 75.9 |
| Patrimonio netto (NAV)* | 80.2 |
| Impegni di capitale in investimenti del portafoglio* | 159.4 |
| Numero di investimenti del portafoglio (panoramica) | 1 |
| Numero di partecipazioni (panoramica) | 26 |

*in milioni CHF

Informazioni sul prodotto

Numero di valore: 56897992
ISIN: CH0568979923
LEI: 254900U5QZLUQLIN2205
Codice Bloomberg: SWGCHCH SW
Moneta: CHF
Domicilio: Svizzera
Data di creazione: 26/05/2021
Prezzo di prima emissione: 100.00
Chiusura d'esercizio: 30.9
Prassi di distribuzione: Distribuzione
Asset Manager:
Swiss Life Asset Management SA
Amministratore:
Northern Trust Switzerland SA
Ufficio di revisione:
PricewaterhouseCoopers SA
Depotbank:
UBS Switzerland AG
Pubblicazioni di corsi: Bloomberg: ASSL
www.swisslife.ch/fondazioneinvestimento
Quote spese operative TER KGAST
ex ante: 2.19%
ex post al: 30/09/2022 2.42%

Riscatto di diritti: Il riscatto di diritti avviene ogni anno il 30 settembre (termine di riscatto), osservando un termine di disdetta di nove mesi, per la prima volta il 30 settembre 2025, tenendo conto dei limiti di riscatto del gruppo d'investimento Infrastruttura globale (EUR).

Commissione di riscatto sul NAV a favore del gruppo d'investimento: 5.00% Se i diritti possono essere ricollocati con valuta corretta, la commissione di riscatto non viene addebitata.

Investimenti del portafoglio*

| | Impegni di capitale | Patrimonio netto |
|--|---------------------|------------------|
| Co-Investment Almaviva Santé SAS via SL Vie LUXCO S.À R.L. | 4.37% | 10.09% |
| Co-Investment Altitude Infrastructure THD via Owl BidCo S.À R.L. | 2.70% | 5.57% |
| Co-Investment BCP Battery Holding S.À R.L. | 3.81% | 1.65% |
| Co-Investment JFK via JLC Terminal One Co-Invest L.P. | 4.69% | 0.31% |
| Co-Investment Saffir (offshore Norway) | 5.69% | - |
| Co-Investment TTT via Bazalgette (Investments) Ltd | 5.12% | 10.09% |
| Swiss Life Funds (LUX) ESG GIO III Co-Invest | 15.64% | 17.56% |
| Swiss Life Funds (LUX) ESG Global Infrastructure Opportunities III | 41.22% | 44.49% |
| Co-Investment Energy Assets Group limited via SLAM EAG LUXCO S.À R.L. | 2.56% | 7.37% |
| FONTAVIS SCS SICAV-RAIF- FONTAVIS ESG Renewable Infrastructure Fund Europe («FORTE») | 7.11% | 2.86% |
| FONTAVIS SCS SICAV-RAIF- FONTAVIS ESG Renewable Infrastructure Fund II («FORTE II») | 7.11% | - |

*Senza liquidità

Attività per settore*

| | |
|-------------------------------|--------|
| Comunicazione | 39.10% |
| Servizi di pubblica utilità | 24.00% |
| Trasporto | 22.20% |
| Infrastrutture sociali | 10.10% |
| Energie rinnovabili / Energia | 4.60% |
| Altri | - |

*Senza liquidità

Asset per regione*

| | |
|------------------------------|--------|
| Europa (incl. Gran Bretagna) | 73.34% |
| America del Nord | 26.66% |
| Svizzera | - |
| Altre regioni | - |

*Senza liquidità

Attività per stadio*

| | |
|------------|--------|
| Brownfield | 96.30% |
| Greenfield | 3.70% |

*Senza liquidità

Attività per valuta*

| | |
|-----|--------|
| EUR | 55.50% |
| USD | 26.66% |
| GBP | 17.80% |

*Senza liquidità

30 settembre 2022

Fondazione d'investimento Swiss Life Infrastruttura globale ESG (EUR)



Patrimonio netto (NAV) in mio. EUR: 169.95
Valore d'inventario netto per diritto in EUR: 110.52

Commento di management e prospettive

Nel T3 2022 il gruppo d'investimento Infrastruttura globale ESG (EUR) ha allocato circa 61,5 milioni di euro in ulteriori investimenti. Si tratta di due investimenti diretti (co-investimenti) nei settori trasporto ed energie rinnovabili. A tale scopo è stato sottoscritto per la prima volta il fondo target FONTAVIS SCS SICAV-RAIF- Fontavis ESG Renewable Infrastructure Fund II. Le chiamate di capitale da parte di investimenti target ammontavano a 78,2 mio. di euro. Oltre a un'ampia diversificazione, il portafoglio vanta un'ottima evoluzione nonostante la fase di accumulo ancora in corso. Nel T4 2022 Portfolio Management prevede diverse chiamate di capitale presso gli investitori del gruppo d'investimento. Inoltre, nel T4 verranno consultati per la prima volta i sottoscrittori del secondo periodo.

Strategia d'investimento

Partecipazione a diversi fondi infrastrutturali e investimenti diretti diversificati nei Paesi OCSE gestiti da Swiss Life. Concentrazione su strategie Core / Core+ e distribuzioni regolari provenienti dall'attività operativa. Diversificazione per Paesi, regioni, sedi, settori, tecnologie, età degli impianti e profili di cashflow. Il processo d'investimento tiene conto dei fattori di rischio e finanziari e criteri ESG (cfr. prospetto del gruppo d'investimento Infrastruttura globale ESG [EUR], punto 2.3).

Performance nella valuta di riferimento

| | PERFORMANCE CUMULATA | | | PERFORMANCE ANNUALIZZATA | | | |
|------------------------------|----------------------|--------------|--------------|--------------------------|--------|---------|--------------|
| | YTD | 3 MESI | 1 ANNO | 3 ANNI | 5 ANNI | 10 ANNI | INIZIO |
| GRUPPO D'INVESTIMENTO | 5.95% | 4.90% | 7.95% | - | - | - | 7.71% |

Principali dati indicativi

| | |
|--|-------|
| Capitale impegnato* | 353.9 |
| Capitale richiamato* | 158.6 |
| Patrimonio netto (NAV)* | 170.0 |
| Impegni di capitale in investimenti del portafoglio* | 351.8 |
| Numero di investimenti del portafoglio (panoramica) | 9 |
| Numero di partecipazioni (panoramica) | 26 |

*in milioni EUR

Informazioni sul prodotto

Numero di valore: 56897994
ISIN: CH0568979949
LEI: 2549009VUGU2MJGSXI62
Codice Bloomberg: SWLIGE1 SW
Moneta: EUR
Domicilio: Svizzera
Data di creazione: 26/05/2021
Prezzo di prima emissione: 100.00
Chiusura d'esercizio: 30.9
Prassi di distribuzione: Distribuzione
Asset Manager:
Swiss Life Asset Management SA
Amministratore:
Northern Trust Switzerland SA
Ufficio di revisione:
PricewaterhouseCoopers SA
Depotbank:
UBS Switzerland AG
Pubblicazioni di corsi: Bloomberg: ASSL
www.swisslife.ch/fondazioneinvestimento
Quote spese operative TER KGAST
ex ante: 2.24%
ex post al: 30/09/2022 2.47%

Riscatto di diritti: Il riscatto dei diritti avviene ogni anno al 30 settembre (termine di riscatto), osservando un termine di disdetta di sei mesi, per la prima volta il 30 settembre 2025; i riscatti annuali sono limitati al 20% (o al massimo a 50 milioni di euro) del capitale investito.

Commissione di riscatto sul NAV a favore del gruppo d'investimento: 5.00% Se i diritti possono essere ricollocati con valuta corretta, la commissione di riscatto non viene addebitata.

Investimenti del portafoglio*

| | Impegni di capitale | Patrimonio netto |
|--|---------------------|------------------|
| Co-Investment Almaviva Santé SAS via SL Vie LUXCO S.À R.L. | 4.37% | 10.09% |
| Co-Investment Altitude Infrastructure THD via Owl BidCo S.À R.L. | 2.70% | 5.57% |
| Co-Investment BCP Battery Holding S.À R.L. | 3.81% | 1.65% |
| Co-Investment JFK via JLC Terminal One Co-Invest L.P. | 4.69% | 0.31% |
| Co-Investment Saffir (offshore Norway) | 5.69% | - |
| Co-Investment TTT via Bazalgette (Investments) Ltd | 5.12% | 10.09% |
| Swiss Life Funds (LUX) ESG GIO III Co-Invest | 15.64% | 17.56% |
| Swiss Life Funds (LUX) ESG Global Infrastructure Opportunities III | 41.22% | 44.49% |
| Co-Investment Energy Assets Group limited via SLAM EAG LUXCO S.À R.L. | 2.56% | 7.37% |
| FONTAVIS SCS SICAV-RAIF- FONTAVIS ESG Renewable Infrastructure Fund Europe («FORTE») | 7.11% | 2.86% |
| FONTAVIS SCS SICAV-RAIF- FONTAVIS ESG Renewable Infrastructure Fund II («FORTE II») | 7.11% | - |

*Senza liquidità

Attività per settore*

| | |
|-------------------------------|--------|
| Comunicazione | 39.10% |
| Servizi di pubblica utilità | 24.00% |
| Trasporto | 22.20% |
| Infrastrutture sociali | 10.10% |
| Energie rinnovabili / Energia | 4.60% |
| Altri | - |

*Senza liquidità

Asset per regione*

| | |
|------------------------------|--------|
| Europa (incl. Gran Bretagna) | 73.34% |
| America del Nord | 26.66% |
| Svizzera | - |
| Altre regioni | - |

*Senza liquidità

Attività per stadio*

| | |
|------------|--------|
| Brownfield | 96.30% |
| Greenfield | 3.70% |

*Senza liquidità

Attività per valuta*

| | |
|-----|--------|
| EUR | 55.50% |
| USD | 26.66% |
| GBP | 17.80% |

*Senza liquidità

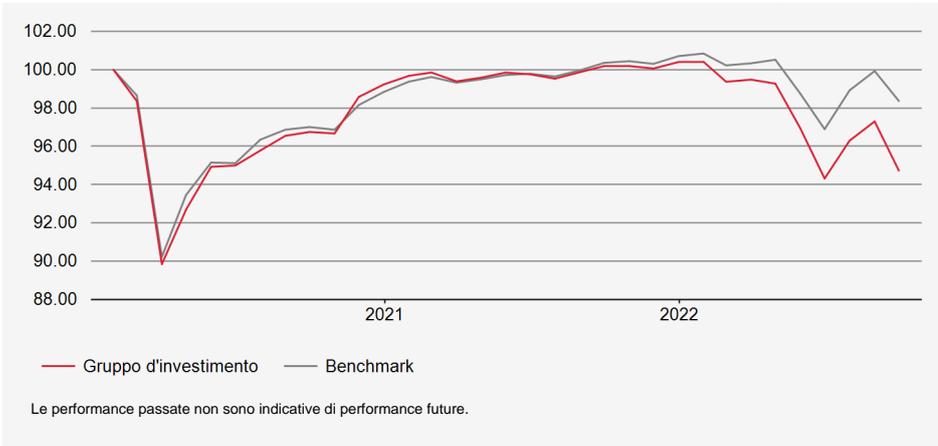
Fondazione d'investimento Swiss Life Senior Secured Loans (CHF hedged)

Patrimonio netto (NAV) in mio. CHF: 101.94
Valore d'inventario netto per diritto in CHF: 94.73

Strategia d'investimento

Il gruppo d'investimento mira a rendimenti stabili e elevati con una volatilità dei prezzi minima e una duration dei tassi di interesse bassa. Il gruppo d'investimento investe principalmente in prestiti garantiti Senior Secured Loans da società dei paesi sviluppati. Almeno l'85% sarà investito in Senior Secured Loans garantiti. Limitazioni per debitore per singola impresa: 5%. Al massimo il 25% è investito nello stesso settore industriale. I rischi valutari vengono coperti al 90% almeno contro il franco. Realizzazione tramite du Swiss Life Loan Fund (LUX) S.A., SICAV-SIF Senior Secured Loans V AM-Shares (CHF hedged); fondo d'investimento di diritto lussemburghese.

Evoluzione del valore nella valuta di riferimento (base 100)



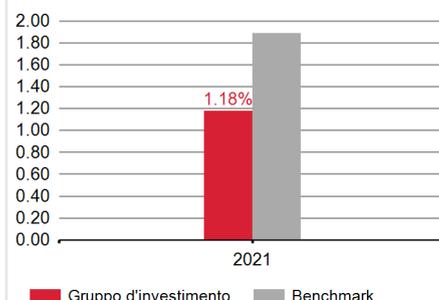
Performance nella valuta di riferimento

| | PERFORMANCE CUMULATA | | | | PERFORMANCE ANNUALIZZATA | | | |
|-----------------------|----------------------|--------|--------|--------|--------------------------|--------|---------|--------|
| | YTD | 1 MESE | 3 MESI | 1 ANNO | 3 ANNI | 5 ANNI | 10 ANNI | INIZIO |
| GRUPPO D'INVESTIMENTO | -5.65% | -2.64% | 0.43% | -5.45% | - | - | - | -2.01% |
| BENCHMARK | -2.33% | -1.56% | 1.52% | -1.99% | - | - | - | -0.62% |

Dati statistici (annualizzati)

| | 1 ANNO | 3 ANNI | 5 ANNI | 10 ANNI | INIZIO |
|---|--------|--------|--------|---------|--------|
| Volatilità Gruppo d'investimento (in %) | 5.15 | - | - | - | 7.05 |
| Volatilità del Benchmark (in %) | 4.02 | - | - | - | 6.63 |
| Tracking Error ex post (in %) | 1.31 | - | - | - | 1.16 |
| Information Ratio | -2.65 | - | - | - | -1.16 |
| Sharpe Ratio | -0.98 | - | - | - | -0.19 |
| Correlazione | 0.99 | - | - | - | 0.99 |
| Beta | 1.27 | - | - | - | 1.05 |
| Jensen alfa | -3.07 | - | - | - | -1.40 |
| Maximum Drawdown (in %) | -6.07 | - | - | - | -10.15 |
| Recovery Period (anni) | - | - | - | - | 1.50 |

Performance



Informazioni sul prodotto

Numero di valore: 51215713
ISIN: CH0512157139
LEI: 254900TFN2RL5B1QJ986
Codice Bloomberg: SWSSLCH SW
Benchmark: 80% JPM US LL UT (CHFh)
20% JPM EU LL UT (CHFh)
Moneta: CHF
Domicilio: Svizzera
Data di creazione: 31/01/2020
Prezzo di prima emissione: 100.00
Chiusura d'esercizio: 30.09
Emissione/Riscatto: mensile
Termine d'accettazione: 14.30
Sottoscrizione: Ultimo -2
Riscatti: Ultimo -5

Commissione d'emissione/riscatto:
nessuna

Prassi di distribuzione: Capitalizzazione

**Asset Manager in base al
Swiss Life Best Select Invest Plus®:**
Swiss Life Asset Management SA

Controllo asset manager:
PPCmetrics supporta il controllo costante dell'asset manager e la valutazione dei risultati d'investimento.

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

Quote spese operative TER KGAST

ex ante: 0.64%

ex post al: 30/09/2022 0.64%

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.

Termine di accettazione: Ultimo = ultimo giorno lavorativo bancario del mese

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.

Tracking error ex ante: Il tracking error previsto per i prossimi 12 mesi corrisponde al Tracking error ex post degli ultimi 3 anni.

Fondazione d'investimento Swiss Life Senior Secured Loans (CHF hedged)

Struttura del portafoglio per settore

| | Gruppo d'investimento | Benchmark |
|-------------------------|-----------------------|-----------|
| SERVIZI | 13.79% | 7.16% |
| SALUTE | 10.54% | 12.61% |
| TECNOLOGIA | 9.82% | 8.93% |
| CAVO E SATELLITE | 6.89% | 7.70% |
| CHIMICA | 6.53% | 8.22% |
| ALIMENTAZIONE E BEVANDE | 5.63% | 2.65% |
| EDILIZIA | 4.58% | 3.20% |
| FINANZA | 4.34% | 5.62% |
| GIOCHI/TEMPO LIBERO | 4.09% | 9.32% |
| AUTOMOBILE | 3.88% | 2.17% |
| ALTRI | 25.22% | 32.42% |
| LIQUIDITÀ | 4.70% | - |

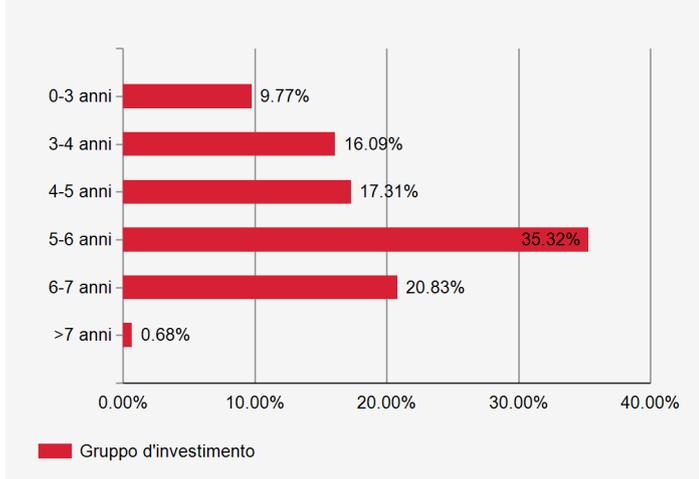
Principali debitori e rating

| | Gruppo d'investimento | Benchmark |
|--------------------|-----------------------|-----------|
| Altice USA | BB- | 1.91% |
| Warner Music Group | BB- | 1.71% |
| CenturyLink | BBB- | 1.70% |
| Belron | BB+ | 1.47% |
| Virgin/O2 | BB- | 1.46% |

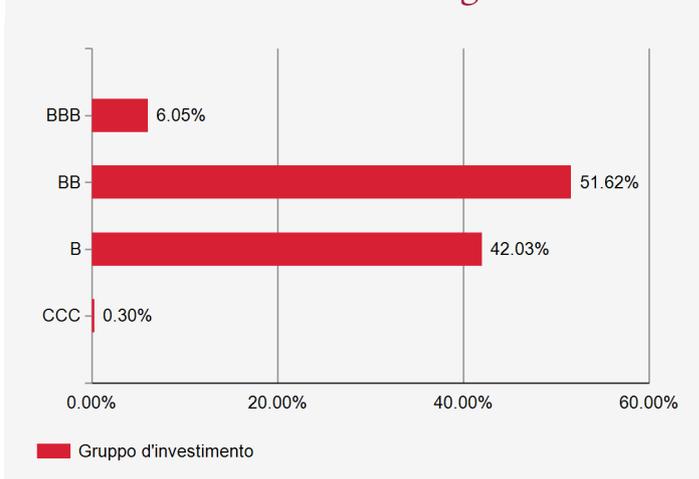
Ulteriori informazioni sui debitori

| | |
|--------------------|-----|
| Numero di debitori | 237 |
|--------------------|-----|

Struttura della scadenza dei titoli



Investimenti secondo il rating



Struttura del portafoglio per valute e rendimento (senza liquidità)

| | Gruppo d'investimento | | Benchmark | |
|-------|-----------------------|------------|-----------|------------|
| | Peso | Rendimento | Peso | Rendimento |
| USD | 61.54% | 8.50% | 80.00% | 7.81% |
| EUR | 38.46% | 8.36% | 20.00% | 7.08% |
| Media | - | 8.45% | - | 7.66% |

Struttura del portafoglio secondo il paese/regione

| | Gruppo d'investimento | Benchmark |
|-------------|-----------------------|-----------|
| STATI UNITI | 56.66% | 80.42% |
| REGNO UNITO | 8.75% | 4.25% |
| PAESI BASSI | 7.19% | 2.40% |
| LUSSEMBURGO | 6.26% | 0.57% |
| GERMANIA | 3.05% | 1.33% |
| BELGIO | 2.91% | 1.62% |
| FRANCIA | 2.46% | 0.33% |
| SPAGNA | 2.17% | 1.14% |
| IRLANDA | 1.85% | 3.88% |
| SVEZIA | 1.29% | - |
| ALTRI | 2.70% | 4.07% |
| LIQUIDITÀ | 4.70% | - |

30 settembre 2022

Fondazione d'investimento Swiss Life Ipoteche Svizzera ESG

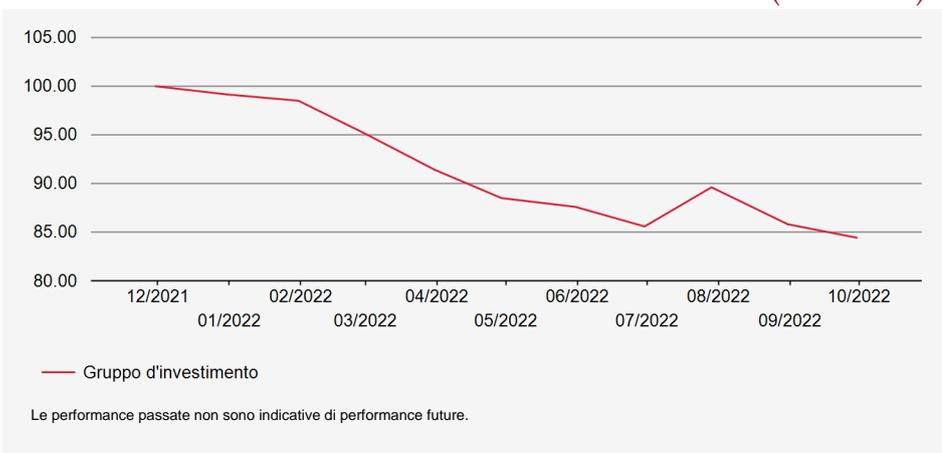


Patrimonio netto (NAV) in mio. CHF: 188.35
Valore d'inventario netto per diritto in CHF: 84.45

Strategia d'investimento

Investimenti in ipoteche svizzere sostenibili: almeno l'85%. Duration target di 8. Attuazione con l'impiego del segmento patrimoniale "Swiss Life ESG Mortgage Fund" del fondo Swiss Life Mortgage Fund, un fondo a ombrello contrattuale di diritto svizzero.

Evoluzione del valore nella valuta di riferimento (base 100)



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 | -14.83% | -1.62% | -1.35% | - | - | - | - | - |

Dati statistici

| | |
|---|-------|
| Durata residua media (anni) | 9.07 |
| Modified Duration (excl. ipoteche a termine)* | 7.25 |
| Modified Duration (incl. ipoteche a termine)* | 7.96 |
| Rendimento lordo alla scadenza | 2.65% |
| Anticipo medio | 58% |
| Numero ipoteche | 311 |
| Differenza di rendimento rispetto ai titoli di Stato svizzeri | 1.54% |

*incl. liquidità

Performance

Storia insufficiente di dati

Informazioni sul prodotto

Numero di valore: 112778762

ISIN: CH1127787625

LEI: 254900V4K2D79T13EF45

Codice Bloomberg: SLHSECH SW

Moneta: CHF

Domicilio: Svizzera

Data di creazione: 30/11/2021

Prezzo di prima emissione: 100.00

Chiusura d'esercizio: 30.9

Emissione/Riscatto: mensile

Commissione d'emissione/riscatto:
nessuna

Prassi di distribuzione: Capitalizzazione

Asset Manager:

Swiss Life Asset Management SA

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

Quote spese operative TER KGAST

ex ante: 0.57%

ex post al: 30/09/2022 0.57%

Emissione: Mensile, nel rispetto di un periodo di sottoscrizione di un mese.

Riscatto: Mensile, nel rispetto di un termine di disdetta di sei mesi. Il primo riscatto di diritti è possibile al 30 gennaio 2024, osservando il termine di preavviso di sei mesi.

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 patrimoniale (%)

| | |
|--------------|--------|
| IPOTECHE | 78.75% |
| LIQUIDITÀ | 17.66% |
| OBBLIGAZIONI | 3.59% |
| DERIVATI | 0.00% |

Distribuzione in base all'ammontare dell'anticipo (%)

| | |
|----------|--------|
| <40% | 11.18% |
| 40 - 50% | 12.95% |
| 50 - 60% | 10.46% |
| 60 - 70% | 58.16% |
| >70% | 7.24% |

Tipo di oggetti messi in pegno (%)

| | |
|----------------------------|--------|
| CASE UNIFAMILIARE | 26.46% |
| PROPRIETÀ PER PIANI | 50.27% |
| CASE PLURIFAMILIARI | 13.50% |
| IMMOBILI A USO COMMERCIALE | 9.77% |

Quota tipi d'ipoteca (%)

| | |
|----------------------------|--------|
| IPOTECHE A TASSO FISSO | 98.90% |
| IPOTECHE SARON | 1.06% |
| IPOTECHE A TASSO VARIABILE | 0.05% |

Ripartizione geografica degli immobili

| | |
|--------------------------|--------|
| ZURIGO | 21.05% |
| ESPACE MITTELLAND | 11.42% |
| SVIZZERA CENTRALE | 12.59% |
| SVIZZERA NORDOCCIDENTALE | 5.26% |
| SVIZZERA ORIENTALE | 1.95% |
| TICINO | 0.85% |
| REGIONE DEL LEMANO | 46.89% |

Struttura alla scadenza delle ipoteche (%)

| | |
|------------|--------|
| 1-3 ANNI | 9.38% |
| 3-5 ANNI | 10.08% |
| 5-7 ANNI | 19.82% |
| 7-10 ANNI | 25.82% |
| 10-15 ANNI | 19.36% |
| >15 ANNI | 15.54% |

Ipotecche con pagamenti scoperti di ben 90 giorni

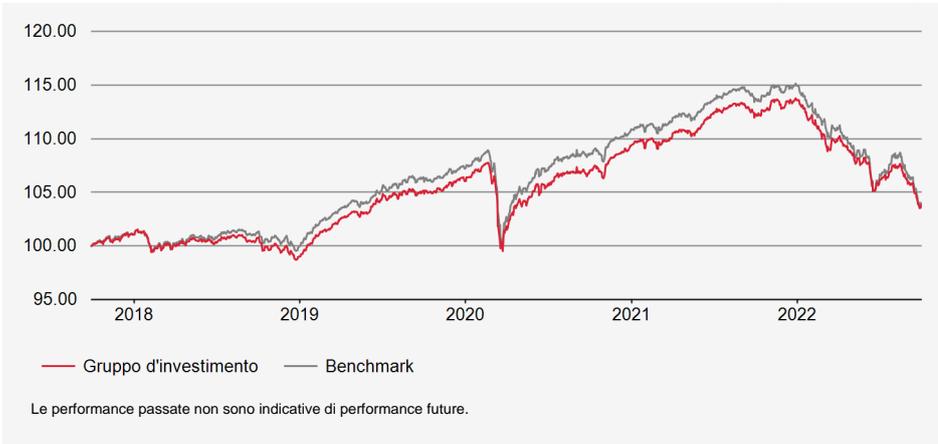
| | |
|---|---|
| NUMERO DEBITORI IPOTECARI | - |
| RELATIVO VALORE GLOBALE DELLE IPOTECHE CON PAGAMENTI SCOPERTI | - |
| ANTICIPO MEDIO | - |

Patrimonio netto (NAV) in mio. CHF: 218.75
Valore d'inventario netto per diritto in CHF: 162.02

Strategia d'investimento

Investimenti in tutte le categorie d'investimento ammesse dalla LPP (quota di azioni strategica: 15%). Asset Allocation attiva. Limitazione per titoli di partecipazione: 20%, limitazione per valute estere: 30% Rating medio delle obbligazioni: almeno BBB+. Realizzazione tramite investimenti collettivi dedicati a singole classi di attivi. Riserve di perequazione raccomandate: oltre il 6,5%.

Evoluzione del valore nella valuta di riferimento (base 100)



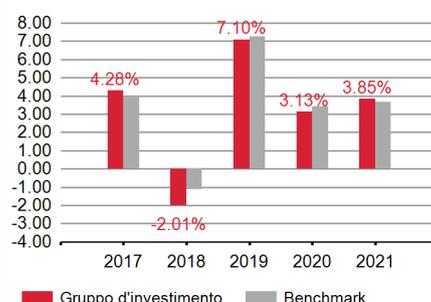
Performance nella valuta di riferimento

| | PERFORMANCE CUMULATA | | | | PERFORMANCE ANNUALIZZATA | | | |
|------------------------------|----------------------|--------|--------|--------|--------------------------|--------|---------|--------|
| | YTD | 1 MESE | 3 MESI | 1 ANNO | 3 ANNI | 5 ANNI | 10 ANNI | INIZIO |
| GRUPPO D'INVESTIMENTO | -8.62% | -2.16% | -1.93% | -7.56% | -0.44% | 0.75% | 2.20% | 2.54% |
| BENCHMARK | -9.53% | -2.54% | -2.05% | -8.50% | -0.76% | 0.79% | 2.25% | 2.82% |

Dati statistici (annualizzati)

| | 1 ANNO | 3 ANNI | 5 ANNI | 10 ANNI | INIZIO |
|---|--------|--------|--------|---------|--------|
| Volatilità Gruppo d'investimento (in %) | 3.95 | 4.24 | 3.55 | 2.95 | 2.83 |
| Volatilità del Benchmark (in %) | 4.69 | 4.59 | 3.79 | 3.02 | 2.85 |
| Tracking Error ex post (in %) | 0.90 | 0.63 | 0.56 | 0.51 | 0.58 |
| Information Ratio | 1.05 | 0.52 | -0.07 | -0.11 | -0.48 |
| Sharpe Ratio | -1.85 | 0.04 | 0.41 | 0.93 | 0.87 |
| Correlazione | 0.99 | 0.99 | 0.99 | 0.99 | 0.98 |
| Beta | 0.84 | 0.92 | 0.93 | 0.97 | 0.98 |
| Jensen alfa | -0.34 | 0.31 | 0.07 | 0.04 | -0.21 |
| Maximum Drawdown (in %) | -9.00 | -9.00 | -9.00 | -9.00 | -9.00 |
| Recovery Period (anni) | - | - | - | - | - |

Performance



Informazioni sul prodotto

Numero di valore: 1564965
ISIN: CH0015649657
LEI: 254900RW4KJYAQTH6Y97
Codice Bloomberg: SWABM15 SW
Benchmark: Customized
Moneta: CHF
Domicilio: Svizzera
Data di creazione: 30/06/2003
Prezzo di prima emissione: 100.00
Chiusura d'esercizio: 30.09
Emissione/Riscatto: giornalmente
Termine d'accettazione: 14.00
Commissione d'emissione/riscatto: nessuna
Prassi di distribuzione: Capitalizzazione
Asset Manager:
Asset allocation tattica
 Swiss Life Asset Management SA
Gruppi d'investimento puri impiegati
 Diversi in base al
 Swiss Life Best Select Invest Plus®
Consulenza esterna:
 PPCmetrics fornisce i seguenti servizi all'interno dei gruppi d'investimento puri: consulenza sulla struttura idonea del mandato, 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
Quote spese operative TER KGAST
ex ante: 0.56%
ex post al: 30/09/2022 0.59%

Struttura del portafoglio per gruppo d'investimento

| | Gruppo d'investimento | Benchmark | max. OPP2 |
|---|-----------------------|-----------|-----------|
| Liquidità | 5.76% | 2.00% | - |
| Ipotecche Svizzera | 12.03% | 13.00% | - |
| Obbligazioni CHF Svizzera | 10.07% | 13.00% | - |
| Obbligazioni CHF Estero | 3.90% | 6.00% | - |
| Obbligazioni valute estere (CHF hedged) | 29.80% | 28.00% | - |
| Azioni Svizzera | 7.20% | 8.00% | - |
| Azioni Estero | 5.20% | 7.00% | - |
| Azioni Estero (CHF hedged) | 1.44% | - | - |
| Immobili Svizzera | 18.45% | 15.00% | 30.00% |
| Immobili estero (CHF hedged) | 3.90% | 3.00% | 10.00% |
| Investimenti alternativi (CHF hedged) | 2.25% | 5.00% | 15.00% |
| Totale azioni (Svizzera ed Estero) | 13.84% | 15.00% | 50.00% |
| Totale valute estere | 5.20% | 7.00% | 30.00% |

Struttura del portafoglio secondo le valute

| | |
|-------|--------|
| CHF | 94.80% |
| USD | 3.75% |
| EUR | 0.53% |
| JPY | 0.32% |
| ALTRI | 0.60% |

Composizione del benchmark

| | |
|---|--------|
| 1M SARON | 2.00% |
| SBI DOMESTIC AAA-A 1-3Y | 13.00% |
| SBI DOMESTIC AAA-BBB | 13.00% |
| SBI FOREIGN AAA-BBB | 6.00% |
| BLOOMBERG GL. AGG. TREAS. EX CH TR (CHF HEDGED) | 5.00% |
| BLOOMBERG GL. AGG. CORP. TR (CHF HEDGED) | 12.00% |
| BLOOMBERG GL. AGG. CORP. SHORT TERM TR (CHF HEDGED) | 7.00% |
| JP MORGAN CEMBI BROAD DIV IG INDEX (CHF HEDGED) | 4.00% |
| SWISS PERFORMANCE INDEX | 8.00% |
| MSCI WORLD EX CH ESG LEADERS, IN CHF | 5.60% |
| MSCI AC WORLD SMALL CAP, IN CHF | 1.05% |
| MSCI EMERGING MARKETS, IN CHF | 0.35% |
| KGAST IMMO-INDEX | 15.00% |
| SL REF (LUX) GERMAN CORE REAL ESTATE (CHF HEDGED) | 3.00% |
| HFRX GLOBAL HEDGE FUNDS (CHF HEDGED) | 5.00% |

Qualità degli investimenti a reddito fisso

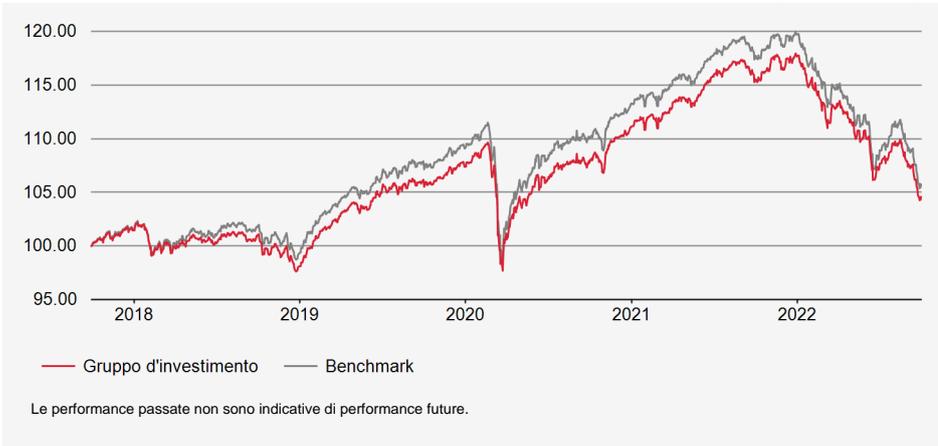
| | |
|-------------------|------|
| Modified Duration | 3.88 |
| Rating medio | A+ |

Patrimonio netto (NAV) in mio. CHF: 761.53
Valore d'inventario netto per diritto in CHF: 180.11

Strategia d'investimento

Investimenti in tutte le categorie d'investimento ammesse dalla LPP (quota di azioni strategica: 25%). Asset Allocation attiva. Limitazione per titoli di partecipazione: 35%, limitazione per valute estere: 30% Rating medio delle obbligazioni: almeno BBB+. Realizzazione tramite investimenti collettivi dedicati a singole classi di attivi. Riserve di perequazione raccomandate: oltre il 10%.

Evoluzione del valore nella valuta di riferimento (base 100)



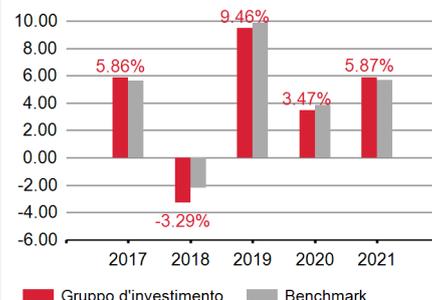
Performance nella valuta di riferimento

| | PERFORMANCE CUMULATA | | | | PERFORMANCE ANNUALIZZATA | | | |
|------------------------------|----------------------|---------------|---------------|----------------|--------------------------|--------------|--------------|--------------|
| | YTD | 1 MESE | 3 MESI | 1 ANNO | 3 ANNI | 5 ANNI | 10 ANNI | INIZIO |
| GRUPPO D'INVESTIMENTO | -11.11% | -2.96% | -2.45% | -9.48% | -0.50% | 0.90% | 2.74% | 2.84% |
| BENCHMARK | -11.66% | -3.28% | -2.43% | -10.14% | -0.67% | 1.12% | 2.98% | 3.31% |

Dati statistici (annualizzati)

| | 1 ANNO | 3 ANNI | 5 ANNI | 10 ANNI | INIZIO |
|---|--------|--------|--------|---------|--------|
| Volatilità Gruppo d'investimento (in %) | 5.53 | 5.79 | 4.90 | 4.15 | 4.12 |
| Volatilità del Benchmark (in %) | 6.09 | 6.19 | 5.18 | 4.21 | 4.10 |
| Tracking Error ex post (in %) | 0.82 | 0.63 | 0.56 | 0.53 | 0.59 |
| Information Ratio | 0.80 | 0.27 | -0.40 | -0.45 | -0.79 |
| Sharpe Ratio | -1.70 | 0.02 | 0.33 | 0.79 | 0.65 |
| Correlazione | 0.99 | 1.00 | 1.00 | 0.99 | 0.99 |
| Beta | 0.90 | 0.93 | 0.94 | 0.98 | 1.00 |
| Jensen alfa | -0.27 | 0.16 | -0.11 | -0.16 | -0.46 |
| Maximum Drawdown (in %) | -11.59 | -11.59 | -11.59 | -11.59 | -14.16 |
| Recovery Period (anni) | - | - | - | - | 0.98 |

Performance



Informazioni sul prodotto

Numero di valore: 1245601
ISIN: CH0012456015
LEI: 254900JNOBNDNHDGRO53
Codice Bloomberg: SWABM25 SW
Benchmark: Customized
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: 14.00
Commissione d'emissione/riscatto: nessuna
Prassi di distribuzione: Capitalizzazione
Asset Manager:
Asset allocation tattica
 Swiss Life Asset Management SA
Gruppi d'investimento puri impiegati
 Diversi in base al
 Swiss Life Best Select Invest Plus®
Consulenza esterna:
 PPCmetrics fornisce i seguenti servizi all'interno dei gruppi d'investimento puri: consulenza sulla struttura idonea del mandato, 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
Quote spese operative TER KGAST
ex ante: 0.56%
ex post al: 30/09/2022 0.59%

Struttura del portafoglio per gruppo d'investimento

| | Gruppo d'investimento | Benchmark | max. OPP2 |
|---|-----------------------|-----------|-----------|
| Liquidità | 4.73% | 2.00% | - |
| Ipotecche Svizzera | 0.76% | - | - |
| Obbligazioni CHF Svizzera | 13.53% | 16.00% | - |
| Obbligazioni CHF Estero | 6.85% | 9.00% | - |
| Obbligazioni valute estere (CHF hedged) | 29.20% | 28.00% | - |
| Azioni Svizzera | 12.03% | 13.00% | - |
| Azioni Estero | 9.72% | 12.00% | - |
| Azioni Estero (CHF hedged) | 1.74% | - | - |
| Immobili Svizzera | 15.86% | 13.00% | 30.00% |
| Immobili estero (CHF hedged) | 3.27% | 2.00% | 10.00% |
| Investimenti alternativi (CHF hedged) | 2.32% | 5.00% | 15.00% |
| Totale azioni (Svizzera ed Estero) | 23.49% | 25.00% | 50.00% |
| Totale valute estere | 9.72% | 12.00% | 30.00% |

Struttura del portafoglio secondo le valute

| | |
|-------|--------|
| CHF | 90.28% |
| USD | 6.92% |
| EUR | 1.02% |
| JPY | 0.61% |
| ALTRI | 1.17% |

Composizione del benchmark

| | |
|---|--------|
| 1M SARON | 2.00% |
| SBI DOMESTIC AAA-BBB | 16.00% |
| SBI FOREIGN AAA-BBB | 9.00% |
| BLOOMBERG GL. AGG. TREAS. EX CH TR (CHF HEDGED) | 4.00% |
| BLOOMBERG GL. AGG. CORP. TR (CHF HEDGED) | 9.00% |
| BLOOMBERG GL. AGG. CORP. SHORT TERM TR (CHF HEDGED) | 9.00% |
| JP MORGAN CEMBI BROAD DIV IG INDEX (CHF HEDGED) | 6.00% |
| SWISS PERFORMANCE INDEX | 13.00% |
| MSCI WORLD EX CH ESG LEADERS, IN CHF | 9.60% |
| MSCI AC WORLD SMALL CAP, IN CHF | 1.80% |
| MSCI EMERGING MARKETS, IN CHF | 0.60% |
| KGAST IMMO-INDEX | 13.00% |
| SL REF (LUX) GERMAN CORE REAL ESTATE (CHF HEDGED) | 2.00% |
| HFRX GLOBAL HEDGE FUNDS (CHF HEDGED) | 5.00% |

Qualità degli investimenti a reddito fisso

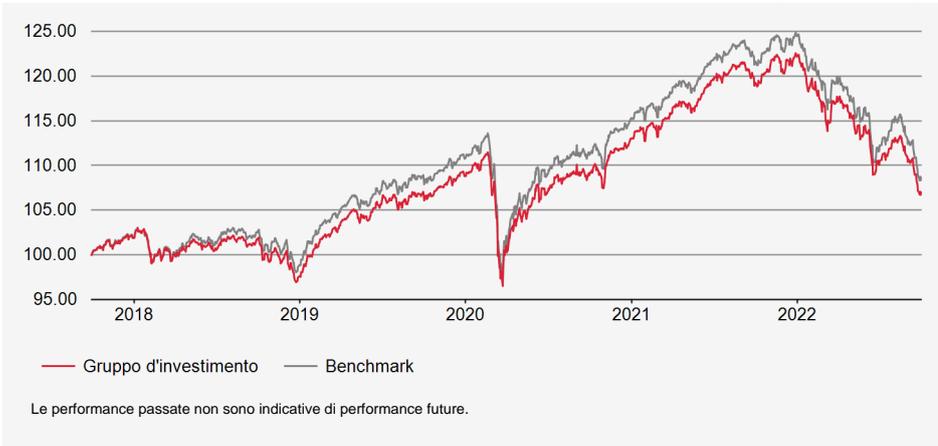
| | |
|-------------------|------|
| Modified Duration | 5.11 |
| Rating medio | A |

Patrimonio netto (NAV) in mio. CHF: 287.74
Valore d'inventario netto per diritto in CHF: 188.37

Strategia d'investimento

Investimenti in tutte le categorie d'investimento ammesse dalla LPP (quota di azioni strategica: 35%). Asset Allocation attiva. Limitazione per titoli di partecipazione: 45%, limitazione per valute estere: 30% Rating medio delle obbligazioni: almeno BBB+. Realizzazione tramite investimenti collettivi dedicati a singole classi di attivi. Riserve di perequazione raccomandate: oltre il 15%.

Evoluzione del valore nella valuta di riferimento (base 100)



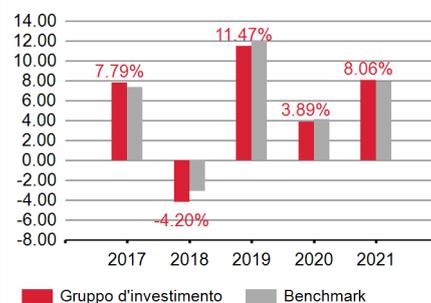
Performance nella valuta di riferimento

| | PERFORMANCE CUMULATA | | | | PERFORMANCE ANNUALIZZATA | | | |
|------------------------------|----------------------|---------------|---------------|----------------|--------------------------|--------------|--------------|--------------|
| | YTD | 1 MESE | 3 MESI | 1 ANNO | 3 ANNI | 5 ANNI | 10 ANNI | INIZIO |
| GRUPPO D'INVESTIMENTO | -12.41% | -3.49% | -2.80% | -10.27% | -0.02% | 1.36% | 3.43% | 3.06% |
| BENCHMARK | -12.72% | -3.81% | -2.70% | -10.65% | -0.09% | 1.67% | 3.71% | 3.58% |

Dati statistici (annualizzati)

| | 1 ANNO | 3 ANNI | 5 ANNI | 10 ANNI | INIZIO |
|---|--------|--------|--------|---------|--------|
| Volatilità Gruppo d'investimento (in %) | 6.67 | 6.89 | 5.94 | 5.11 | 5.26 |
| Volatilità del Benchmark (in %) | 7.20 | 7.34 | 6.25 | 5.16 | 5.24 |
| Tracking Error ex post (in %) | 0.86 | 0.72 | 0.64 | 0.59 | 0.65 |
| Information Ratio | 0.45 | 0.10 | -0.48 | -0.48 | -0.80 |
| Sharpe Ratio | -1.54 | 0.09 | 0.35 | 0.77 | 0.55 |
| Correlazione | 1.00 | 1.00 | 1.00 | 0.99 | 0.99 |
| Beta | 0.92 | 0.94 | 0.95 | 0.98 | 1.00 |
| Jensen alfa | -0.41 | 0.11 | -0.18 | -0.21 | -0.52 |
| Maximum Drawdown (in %) | -12.91 | -13.41 | -13.41 | -13.41 | -21.36 |
| Recovery Period (anni) | - | 0.65 | 0.65 | 0.65 | 3.00 |

Performance



Informazioni sul prodotto

Numero di valore: 1245606
ISIN: CH0012456064
LEI: 254900SR5GM6HP44F130
Codice Bloomberg: SWABM35 SW
Benchmark: Customized
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: 14.00
Commissione d'emissione/riscatto: nessuna
Prassi di distribuzione: Capitalizzazione
Asset Manager:
Asset allocation tattica
 Swiss Life Asset Management SA
Gruppi d'investimento puri impiegati
 Diversi in base al
 Swiss Life Best Select Invest Plus®
Consulenza esterna:
 PPCmetrics fornisce i seguenti servizi all'interno dei gruppi d'investimento puri: consulenza sulla struttura idonea del mandato, 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
Quote spese operative TER KGAST
ex ante: 0.57%
ex post al: 30/09/2022 0.58%

Struttura del portafoglio per gruppo d'investimento

| | Gruppo d'investimento | Benchmark | max. OPP2 |
|---|-----------------------|-----------|-----------|
| Liquidità | 5.22% | 2.00% | - |
| Ipoteche Svizzera | 0.77% | - | - |
| Obbligazioni CHF Svizzera | 11.61% | 14.00% | - |
| Obbligazioni CHF Estero | 4.53% | 7.00% | - |
| Obbligazioni valute estere (CHF hedged) | 26.97% | 24.00% | - |
| Azioni Svizzera | 16.88% | 18.00% | - |
| Azioni Estero | 14.17% | 17.00% | - |
| Azioni Estero (CHF hedged) | 1.94% | - | - |
| Immobili Svizzera | 12.42% | 11.00% | 30.00% |
| Immobili estero (CHF hedged) | 3.18% | 2.00% | 10.00% |
| Investimenti alternativi (CHF hedged) | 2.31% | 5.00% | 15.00% |
| Totale azioni (Svizzera ed Estero) | 32.99% | 35.00% | 50.00% |
| Totale valute estere | 14.17% | 17.00% | 30.00% |

Struttura del portafoglio secondo le valute

| | |
|-------|--------|
| CHF | 85.83% |
| USD | 10.06% |
| EUR | 1.50% |
| JPY | 0.90% |
| ALTRI | 1.71% |

Composizione del benchmark

| | |
|---|--------|
| 1M SARON | 2.00% |
| SBI DOMESTIC AAA-BBB | 14.00% |
| SBI FOREIGN AAA-BBB | 7.00% |
| BLOOMBERG GL. AGG. TREAS. EX CH TR (CHF HEDGED) | 3.50% |
| BLOOMBERG GL. AGG. CORP. TR (CHF HEDGED) | 7.50% |
| BLOOMBERG GL. AGG. CORP. SHORT TERM TR (CHF HEDGED) | 8.00% |
| JP MORGAN CEMBI BROAD DIV IG INDEX (CHF HEDGED) | 5.00% |
| SWISS PERFORMANCE INDEX | 18.00% |
| MSCI WORLD EX CH ESG LEADERS, IN CHF | 13.60% |
| MSCI AC WORLD SMALL CAP, IN CHF | 2.55% |
| MSCI EMERGING MARKETS, IN CHF | 0.85% |
| KGAST IMMO-INDEX | 11.00% |
| SL REF (LUX) GERMAN CORE REAL ESTATE (CHF HEDGED) | 2.00% |
| HFRX GLOBAL HEDGE FUNDS (CHF HEDGED) | 5.00% |

Qualità degli investimenti a reddito fisso

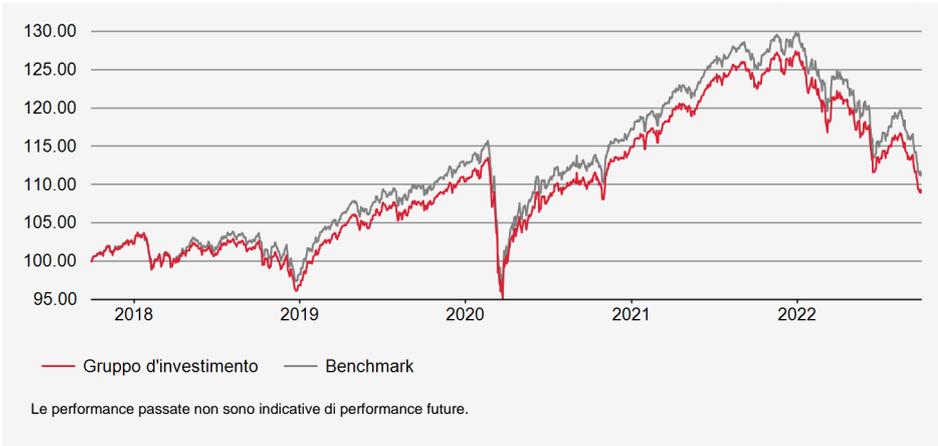
| | |
|-------------------|------|
| Modified Duration | 4.99 |
| Rating medio | A |

Patrimonio netto (NAV) in mio. CHF: 527.45
Valore d'inventario netto per diritto in CHF: 193.77

Strategia d'investimento

Investimenti in tutte le categorie d'investimento ammesse dalla LPP (quota di azioni strategica: 45%). Asset Allocation attiva. Limitazione per titoli di partecipazione: 50%, limitazione per valute estere: 30% Rating medio delle obbligazioni: almeno BBB+. Realizzazione tramite investimenti collettivi dedicati a singole classi di attivi. Riserve di perequazione raccomandate: oltre il 20%.

Evoluzione del valore nella valuta di riferimento (base 100)



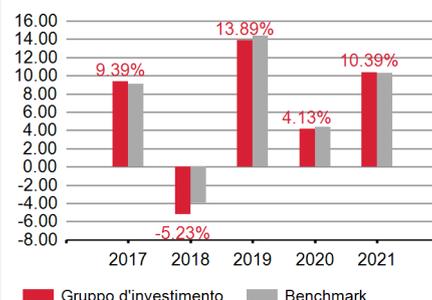
Performance nella valuta di riferimento

| | PERFORMANCE CUMULATA | | | | PERFORMANCE ANNUALIZZATA | | | |
|------------------------------|----------------------|--------|--------|---------|--------------------------|--------|---------|--------|
| | YTD | 1 MESE | 3 MESI | 1 ANNO | 3 ANNI | 5 ANNI | 10 ANNI | INIZIO |
| GRUPPO D'INVESTIMENTO | -13.92% | -4.07% | -3.19% | -11.25% | 0.42% | 1.78% | 4.07% | 3.20% |
| BENCHMARK | -13.80% | -4.34% | -2.99% | -11.21% | 0.47% | 2.20% | 4.43% | 3.83% |

Dati statistici (annualizzati)

| | 1 ANNO | 3 ANNI | 5 ANNI | 10 ANNI | INIZIO |
|---|--------|--------|--------|---------|--------|
| Volatilità Gruppo d'investimento (in %) | 7.93 | 8.22 | 7.18 | 6.22 | 6.54 |
| Volatilità del Benchmark (in %) | 8.39 | 8.57 | 7.41 | 6.21 | 6.50 |
| Tracking Error ex post (in %) | 0.80 | 0.65 | 0.61 | 0.58 | 0.69 |
| Information Ratio | -0.05 | -0.08 | -0.69 | -0.63 | -0.92 |
| Sharpe Ratio | -1.44 | 0.13 | 0.35 | 0.73 | 0.47 |
| Correlazione | 1.00 | 1.00 | 1.00 | 1.00 | 0.99 |
| Beta | 0.94 | 0.96 | 0.97 | 1.00 | 1.00 |
| Jensen alfa | -0.66 | -0.01 | -0.32 | -0.35 | -0.64 |
| Maximum Drawdown (in %) | -14.50 | -16.22 | -16.22 | -16.22 | -28.27 |
| Recovery Period (anni) | - | 0.67 | 0.67 | 0.67 | 3.76 |

Performance



Informazioni sul prodotto

Numero di valore: 1245607
ISIN: CH0012456072
LEI: 2549001XL79VZWO5Q69
Codice Bloomberg: SWABM45 SW
Benchmark: Customized
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: 14.00
Commissione d'emissione/riscatto: nessuna
Prassi di distribuzione: Capitalizzazione
Asset Manager:
Asset allocation tattica
 Swiss Life Asset Management SA
Gruppi d'investimento puri impiegati
 Diversi in base al
 Swiss Life Best Select Invest Plus®
Consulenza esterna:
 PPCmetrics fornisce i seguenti servizi all'interno dei gruppi d'investimento puri: consulenza sulla struttura idonea del mandato, 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
Quote spese operative TER KGAST
ex ante: 0.58%
ex post al: 30/09/2022 0.59%

Struttura del portafoglio per gruppo d'investimento

| | Gruppo d'investimento | Benchmark | max. OPP2 |
|---|-----------------------|-----------|-----------|
| Liquidità | 5.70% | 2.00% | - |
| Ipotecche Svizzera | 0.69% | - | - |
| Obbligazioni CHF Svizzera | 8.76% | 12.00% | - |
| Obbligazioni CHF Estero | 4.42% | 5.00% | - |
| Obbligazioni valute estere (CHF hedged) | 24.67% | 20.00% | - |
| Azioni Svizzera | 21.40% | 23.00% | - |
| Azioni Estero | 18.60% | 22.00% | - |
| Azioni Estero (CHF hedged) | 1.92% | - | - |
| Immobili Svizzera | 8.92% | 9.00% | 30.00% |
| Immobili estero (CHF hedged) | 2.57% | 2.00% | 10.00% |
| Investimenti alternativi (CHF hedged) | 2.34% | 5.00% | 15.00% |
| Totale azioni (Svizzera ed Estero) | 41.91% | 45.00% | 50.00% |
| Totale valute estere | 18.60% | 22.00% | 30.00% |

Struttura del portafoglio secondo le valute

| | |
|-------|--------|
| CHF | 81.40% |
| USD | 13.17% |
| EUR | 1.98% |
| JPY | 1.19% |
| ALTRI | 2.26% |

Composizione del benchmark

| | |
|---|--------|
| 1M SARON | 2.00% |
| SBI DOMESTIC AAA-BBB | 12.00% |
| SBI FOREIGN AAA-BBB | 5.00% |
| BLOOMBERG GL. AGG. TREAS. EX CH TR (CHF HEDGED) | 2.50% |
| BLOOMBERG GL. AGG. CORP. TR (CHF HEDGED) | 6.50% |
| BLOOMBERG GL. AGG. CORP. SHORT TERM TR (CHF HEDGED) | 7.00% |
| JP MORGAN CEMBI BROAD DIV IG INDEX (CHF HEDGED) | 4.00% |
| SWISS PERFORMANCE INDEX | 23.00% |
| MSCI WORLD EX CH ESG LEADERS, IN CHF | 17.60% |
| MSCI AC WORLD SMALL CAP, IN CHF | 3.30% |
| MSCI EMERGING MARKETS, IN CHF | 1.10% |
| KGAST IMMO-INDEX | 9.00% |
| SL REF (LUX) GERMAN CORE REAL ESTATE (CHF HEDGED) | 2.00% |
| HFRX GLOBAL HEDGE FUNDS (CHF HEDGED) | 5.00% |

Qualità degli investimenti a reddito fisso

| | |
|-------------------|------|
| Modified Duration | 4.83 |
| Rating medio | A |

Fondazione d'investimento Swiss Life LPP-Mix 75



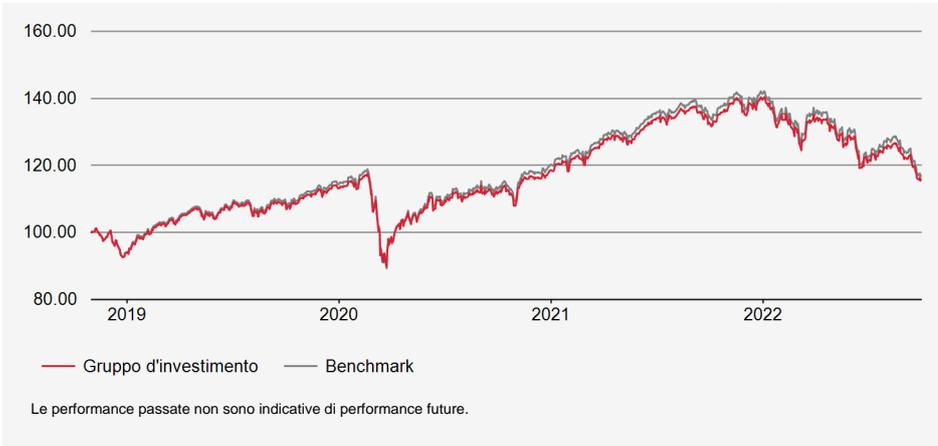
(superamento quota azionaria e in valuta estera secondo OPP 2)

Patrimonio netto (NAV) in mio. CHF: 97.26
Valore d'inventario netto per diritto in CHF: 115.86

Strategia d'investimento

Investimenti in tutte le categorie d'investimento ammesse dalla LPP (quota di azioni strategica: 75%). Asset Allocation attiva. Limitazione per titoli di partecipazione: 85%. Limitazione per valute estere: 50%. Rating medio delle obbligazioni: almeno BBB. Realizzazione tramite investimenti collettivi puri. A seguito della maggiore quota azionaria e in valuta estera, questo gruppo d'investimento comporta un rischio più elevato rispetto un LPP-Mix con quota azionaria del 50% e quota in valuta estera del 30% al massimo.

Evoluzione del valore nella valuta di riferimento (base 100)



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 | -16.99% | -5.61% | -4.09% | -12.71% | 2.03% | - | - | 3.83% |
| BENCHMARK | -17.16% | -6.01% | -3.96% | -13.05% | 2.14% | - | - | 4.11% |

Dati statistici (annualizzati)

| | 1 ANNO | 3 ANNI | 5 ANNI | 10 ANNI | INIZIO |
|---|--------|--------|--------|---------|--------|
| Volatilità Gruppo d'investimento (in %) | 11.56 | 11.86 | - | - | 11.49 |
| Volatilità del Benchmark (in %) | 12.12 | 12.46 | - | - | 11.97 |
| Tracking Error ex post (in %) | 0.99 | 1.04 | - | - | 0.92 |
| Information Ratio | 0.34 | -0.10 | - | - | -0.30 |
| Sharpe Ratio | -1.13 | 0.22 | - | - | 0.38 |
| Correlazione | 1.00 | 1.00 | - | - | 1.00 |
| Beta | 0.95 | 0.95 | - | - | 0.96 |
| Jensen alfa | -0.28 | 0.04 | - | - | -0.08 |
| Maximum Drawdown (in %) | -17.76 | -23.54 | - | - | -23.54 |
| Recovery Period (anni) | - | 0.74 | - | - | 0.74 |

Performance



Informazioni sul prodotto

Numero di valore: 43583002
ISIN: CH0435830028
LEI: 2549007MI5RG5X8NMB06
Codice Bloomberg: SWABM75 SW
Benchmark: Customized
Moneta: CHF
Domicilio: Svizzera
Data di creazione: 31/10/2018
Prezzo di prima emissione: 100.00
Chiusura d'esercizio: 30.09
Emissione/Riscatto: giornalmente
Termine d'accettazione: 14.00
Commissione d'emissione/riscatto: nessuna
Prassi di distribuzione: Capitalizzazione
Asset Manager:
Asset allocation tattica
Swiss Life Asset Management SA
Gruppi d'investimento puri impiegati
Diversi in base al
Swiss Life Best Select Invest Plus®
Consulenza esterna:
PPCmetrics fornisce i seguenti servizi all'interno dei gruppi d'investimento puri: consulenza sulla struttura idonea del mandato, 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
Quote spese operative TER KGAST
ex ante: 0.64%
ex post al: 30/09/2022 0.62%

Fondazione d'investimento Swiss Life

LPP-Mix 75

(superamento quota azionaria e in valuta estera secondo OPP 2)

Struttura del portafoglio per gruppo d'investimento

| | Gruppo d'investimento | Benchmark | max. OPP2 |
|---|-----------------------|---------------|---------------|
| Liquidità | 4.78% | 2.00% | - |
| Ipotecche Svizzera | 0.66% | - | - |
| Obbligazioni valute estere (CHF hedged) | 13.83% | 13.00% | - |
| Azioni Svizzera | 37.15% | 38.00% | - |
| Azioni Estero | 31.98% | 37.00% | - |
| Azioni Estero (CHF hedged) | 3.44% | - | - |
| Immobili Svizzera | 4.95% | 5.00% | 30.00% |
| Immobili estero (CHF hedged) | 0.82% | - | 10.00% |
| Investimenti alternativi (CHF hedged) | 2.39% | 5.00% | 15.00% |
| Totale azioni (Svizzera ed Estero) | 72.57% | 75.00% | 50.00% |
| Totale valute estere | 31.98% | 37.00% | 30.00% |

Struttura del portafoglio secondo le valute

| | |
|-------|--------|
| CHF | 68.02% |
| USD | 22.54% |
| EUR | 3.44% |
| JPY | 2.07% |
| ALTRI | 3.93% |

Composizione del benchmark

| | |
|---|--------|
| 1M SARON | 2.00% |
| BLOOMBERG GL. AGG. TREAS. EX CH TR (CHF HEDGED) | 2.00% |
| BLOOMBERG GL. AGG. CORP. TR (CHF HEDGED) | 4.00% |
| BLOOMBERG GL. AGG. CORP. SHORT TERM TR (CHF HEDGED) | 4.00% |
| JP MORGAN CEMBI BROAD DIV IG INDEX (CHF HEDGED) | 3.00% |
| SWISS PERFORMANCE INDEX | 38.00% |
| MSCI WORLD EX CH ESG LEADERS, IN CHF | 29.60% |
| MSCI AC WORLD SMALL CAP, IN CHF | 5.55% |
| MSCI EMERGING MARKETS, IN CHF | 1.85% |
| KGAST IMMO-INDEX | 5.00% |
| HFRX GLOBAL HEDGE FUNDS (CHF HEDGED) | 5.00% |

Qualità degli investimenti a reddito fisso

| | |
|-------------------|------|
| Modified Duration | 3.82 |
| Rating medio | A- |

Fondazione d'investimento Swiss Life

LPP-Mix 25 P

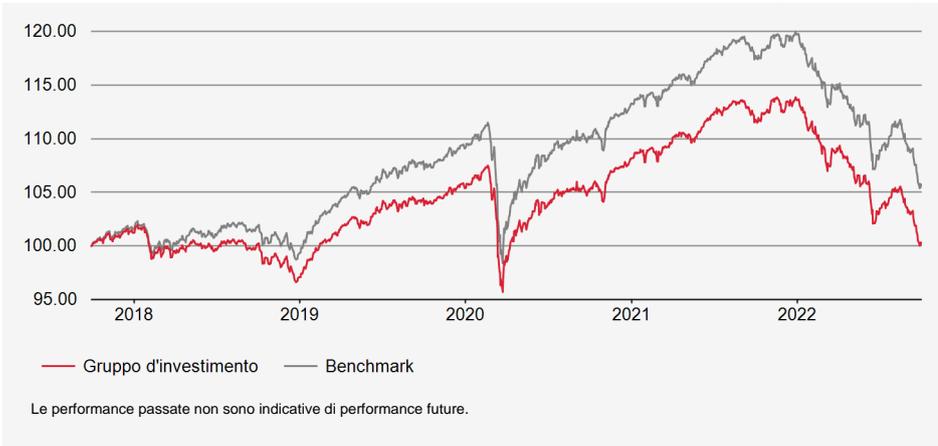


Patrimonio netto (NAV) in mio. CHF: 761.53
Valore d'inventario netto per diritto in CHF: 155.41

Strategia d'investimento

Il gruppo d'investimento LPP-Mix 25 P investe in media ca. il 25% in azioni. Un po' più della metà di questa quota in azioni viene investita in titoli a reddito variabile svizzeri, mentre il resto è destinato a società estere. In media il 53% del patrimonio viene investito in obbligazioni. Sono posti i seguenti limiti massimi: 35% azioni, 30% valute estere. LPP-Mix 25 P è adatta per investitori disposti ad assumersi oscillazioni dei corsi. Raccomandiamo di optare per una durata dell'investimento superiore a cinque anni.

Evoluzione del valore nella valuta di riferimento (base 100)



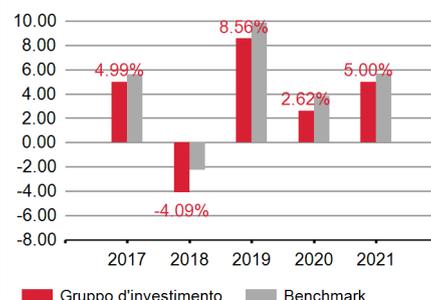
Performance nella valuta di riferimento

| | PERFORMANCE CUMULATA | | | | PERFORMANCE ANNUALIZZATA | | | |
|------------------------------|----------------------|--------|--------|---------|--------------------------|--------|---------|--------|
| | YTD | 1 MESE | 3 MESI | 1 ANNO | 3 ANNI | 5 ANNI | 10 ANNI | INIZIO |
| GRUPPO D'INVESTIMENTO | -11.66% | -3.03% | -2.66% | -10.23% | -1.32% | 0.07% | 1.89% | 2.23% |
| BENCHMARK | -11.66% | -3.28% | -2.43% | -10.14% | -0.67% | 1.12% | 2.98% | 3.52% |

Dati statistici (annualizzati)

| | 1 ANNO | 3 ANNI | 5 ANNI | 10 ANNI | INIZIO |
|---|--------|--------|--------|---------|--------|
| Volatilità Gruppo d'investimento (in %) | 5.53 | 5.79 | 4.90 | 4.16 | 4.13 |
| Volatilità del Benchmark (in %) | 6.09 | 6.19 | 5.18 | 4.21 | 4.11 |
| Tracking Error ex post (in %) | 0.82 | 0.63 | 0.56 | 0.53 | 0.60 |
| Information Ratio | -0.11 | -1.04 | -1.88 | -2.06 | -2.16 |
| Sharpe Ratio | -1.85 | -0.12 | 0.16 | 0.59 | 0.52 |
| Correlazione | 0.99 | 1.00 | 1.00 | 0.99 | 0.99 |
| Beta | 0.90 | 0.93 | 0.94 | 0.98 | 1.00 |
| Jensen alfa | -1.01 | -0.66 | -0.95 | -1.01 | -1.28 |
| Maximum Drawdown (in %) | -12.14 | -12.14 | -12.14 | -12.14 | -15.36 |
| Recovery Period (anni) | - | - | - | - | 1.67 |

Performance



Informazioni sul prodotto

Numero di valore: 1436904
ISIN: CH0014369042
LEI: 5493000KUC3Z24U77V93
Codice Bloomberg: SLVOR25 SW
Benchmark: Customized
Moneta: CHF
Domicilio: Svizzera
Data di creazione: 30/09/2002
Prezzo di prima emissione: 100.00
Chiusura d'esercizio: 30.09
Emissione/Riscatto: giornalmente
Termine d'accettazione: 14.00
Commissione d'emissione/riscatto: nessuna
Prassi di distribuzione: Capitalizzazione
Asset Manager:
Asset allocation tattica
 Swiss Life Asset Management SA
Gruppi d'investimento puri impiegati
 Diversi in base al
 Swiss Life Best Select Invest Plus®
Consulenza esterna:
 PPCmetrics fornisce i seguenti servizi all'interno dei gruppi d'investimento puri: consulenza sulla struttura idonea del mandato, 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
Quote spese operative TER KGAST ex ante: 1.38%
ex post al: 30/09/2022 1.42%

Struttura del portafoglio per gruppo d'investimento

| | Gruppo d'investimento | Benchmark | max. OPP2 |
|---|-----------------------|-----------|-----------|
| Liquidità | 4.73% | 2.00% | - |
| Ipotecche Svizzera | 0.76% | - | - |
| Obbligazioni CHF Svizzera | 13.53% | 16.00% | - |
| Obbligazioni CHF Estero | 6.85% | 9.00% | - |
| Obbligazioni valute estere (CHF hedged) | 29.20% | 28.00% | - |
| Azioni Svizzera | 12.03% | 13.00% | - |
| Azioni Estero | 9.72% | 12.00% | - |
| Azioni Estero (CHF hedged) | 1.74% | - | - |
| Immobili Svizzera | 15.86% | 13.00% | 30.00% |
| Immobili estero (CHF hedged) | 3.27% | 2.00% | 10.00% |
| Investimenti alternativi (CHF hedged) | 2.32% | 5.00% | 15.00% |
| Totale azioni (Svizzera ed Estero) | 23.49% | 25.00% | 50.00% |
| Totale valute estere | 9.72% | 12.00% | 30.00% |

Struttura del portafoglio secondo le valute

| | |
|-------|--------|
| CHF | 90.28% |
| USD | 6.92% |
| EUR | 1.02% |
| JPY | 0.61% |
| ALTRI | 1.17% |

Maggiori posizioni azionarie

| | Gruppo d'investimento |
|------------------------------|-----------------------|
| NESTLE SA-REG | 2.52% |
| ROCHE HOLDING AG | 1.94% |
| NOVARTIS AG-REG | 1.47% |
| MICROSOFT CORP. | 0.56% |
| ZURICH INSURANCE GROUP AG | 0.51% |
| CIE FINANCIERE RICHEMONT-REG | 0.42% |
| UBS GROUP AG-REG | 0.40% |
| ALPHABET INC | 0.38% |
| ABB LTD-REG | 0.36% |
| LONZA GROUP AG-REG | 0.31% |

Qualità degli investimenti a reddito fisso

| | |
|-------------------|------|
| Modified Duration | 5.11 |
| Rating medio | A |

Fondazione d'investimento Swiss Life

LPP-Mix 35 P

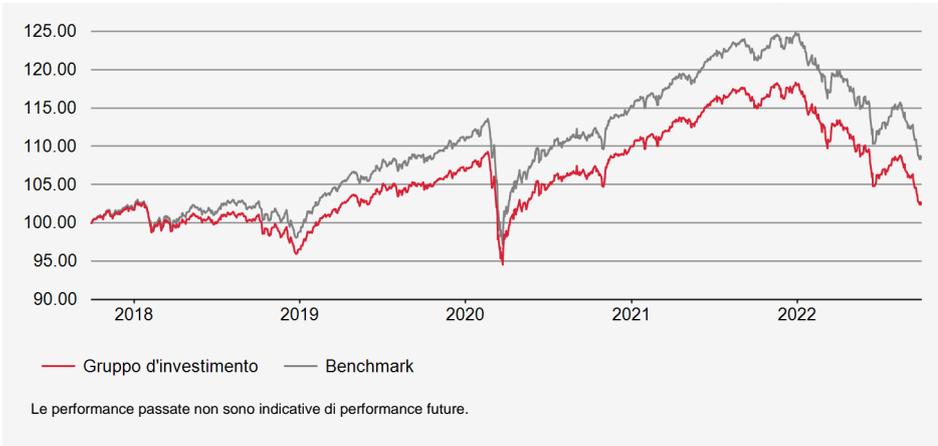


Patrimonio netto (NAV) in mio. CHF: 287.74
Valore d'inventario netto per diritto in CHF: 166.63

Strategia d'investimento

Il gruppo d'investimento LPP-Mix 35 P investe in media ca. il 35% in azioni. Un po' più della metà di questa quota in azioni viene investita in titoli a reddito variabile svizzeri, mentre il resto è destinato a società estere. In media il 45% del patrimonio viene investito in obbligazioni. Sono posti i seguenti limiti massimi: 45% azioni, 30% valute estere. LPP-Mix 35 P è adatta per investitori disposti ad assumersi oscillazioni dei corsi medie. Raccomandiamo di optare per una durata dell'investimento superiore a sette anni.

Evoluzione del valore nella valuta di riferimento (base 100)



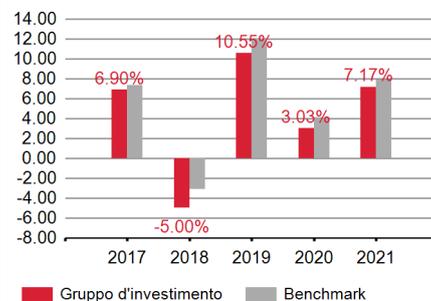
Performance nella valuta di riferimento

| | PERFORMANCE CUMULATA | | | | PERFORMANCE ANNUALIZZATA | | | |
|------------------------------|----------------------|--------|--------|---------|--------------------------|--------|---------|--------|
| | YTD | 1 MESE | 3 MESI | 1 ANNO | 3 ANNI | 5 ANNI | 10 ANNI | INIZIO |
| GRUPPO D'INVESTIMENTO | -12.96% | -3.55% | -3.00% | -11.01% | -0.84% | 0.52% | 2.58% | 2.58% |
| BENCHMARK | -12.72% | -3.81% | -2.70% | -10.65% | -0.09% | 1.67% | 3.71% | 3.97% |

Dati statistici (annualizzati)

| | 1 ANNO | 3 ANNI | 5 ANNI | 10 ANNI | INIZIO |
|---|--------|--------|--------|---------|--------|
| Volatilità Gruppo d'investimento (in %) | 6.67 | 6.89 | 5.94 | 5.11 | 5.23 |
| Volatilità del Benchmark (in %) | 7.20 | 7.34 | 6.25 | 5.16 | 5.20 |
| Tracking Error ex post (in %) | 0.85 | 0.71 | 0.64 | 0.58 | 0.67 |
| Information Ratio | -0.41 | -1.06 | -1.80 | -1.94 | -2.06 |
| Sharpe Ratio | -1.67 | -0.03 | 0.21 | 0.61 | 0.48 |
| Correlazione | 1.00 | 1.00 | 1.00 | 0.99 | 0.99 |
| Beta | 0.92 | 0.94 | 0.95 | 0.98 | 1.00 |
| Jensen alfa | -1.14 | -0.72 | -1.02 | -1.06 | -1.38 |
| Maximum Drawdown (in %) | -13.46 | -13.47 | -13.47 | -13.47 | -22.51 |
| Recovery Period (anni) | - | 0.74 | 0.74 | 0.74 | 3.44 |

Performance



Informazioni sul prodotto

Numero di valore: 1436916
ISIN: CH0014369166
LEI:
Codice Bloomberg: SLVOR35 SW
Benchmark: Customized
Moneta: CHF
Domicilio: Svizzera
Data di creazione: 30/09/2002
Prezzo di prima emissione: 100.00
Chiusura d'esercizio: 30.09
Emissione/Riscatto: giornalmente
Termine d'accettazione: 14.00
Commissione d'emissione/riscatto: nessuna
Prassi di distribuzione: Capitalizzazione
Asset Manager:
Asset allocation tattica
 Swiss Life Asset Management SA
Gruppi d'investimento puri impiegati
 Diversi in base al
 Swiss Life Best Select Invest Plus®
Consulenza esterna:
 PPCmetrics fornisce i seguenti servizi all'interno dei gruppi d'investimento puri: consulenza sulla struttura idonea del mandato, 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
Quote spese operative TER KGAST ex ante: 1.40%
ex post al: 30/09/2022 1.41%

Struttura del portafoglio per gruppo d'investimento

| | Gruppo d'investimento | Benchmark | max. OPP2 |
|---|-----------------------|-----------|-----------|
| Liquidità | 5.22% | 2.00% | - |
| Ipoteche Svizzera | 0.77% | - | - |
| Obbligazioni CHF Svizzera | 11.61% | 14.00% | - |
| Obbligazioni CHF Estero | 4.53% | 7.00% | - |
| Obbligazioni valute estere (CHF hedged) | 26.97% | 24.00% | - |
| Azioni Svizzera | 16.88% | 18.00% | - |
| Azioni Estero | 14.17% | 17.00% | - |
| Azioni Estero (CHF hedged) | 1.94% | - | - |
| Immobili Svizzera | 12.42% | 11.00% | 30.00% |
| Immobili estero (CHF hedged) | 3.18% | 2.00% | 10.00% |
| Investimenti alternativi (CHF hedged) | 2.31% | 5.00% | 15.00% |
| Totale azioni (Svizzera ed Estero) | 32.99% | 35.00% | 50.00% |
| Totale valute estere | 14.17% | 17.00% | 30.00% |

Struttura del portafoglio secondo le valute

| | |
|-------|--------|
| CHF | 85.83% |
| USD | 10.06% |
| EUR | 1.50% |
| JPY | 0.90% |
| ALTRI | 1.71% |

Maggiori posizioni azionarie

| | Gruppo d'investimento |
|------------------------------|-----------------------|
| NESTLE SA-REG | 3.53% |
| ROCHE HOLDING AG | 2.72% |
| NOVARTIS AG-REG | 2.07% |
| MICROSOFT CORP. | 0.83% |
| ZURICH INSURANCE GROUP AG | 0.71% |
| CIE FINANCIERE RICHEMONT-REG | 0.59% |
| UBS GROUP AG-REG | 0.57% |
| ALPHABET INC | 0.56% |
| ABB LTD-REG | 0.50% |
| LONZA GROUP AG-REG | 0.43% |

Qualità degli investimenti a reddito fisso

| | |
|-------------------|------|
| Modified Duration | 4.99 |
| Rating medio | A |

Fondazione d'investimento Swiss Life

LPP-Mix 45 P

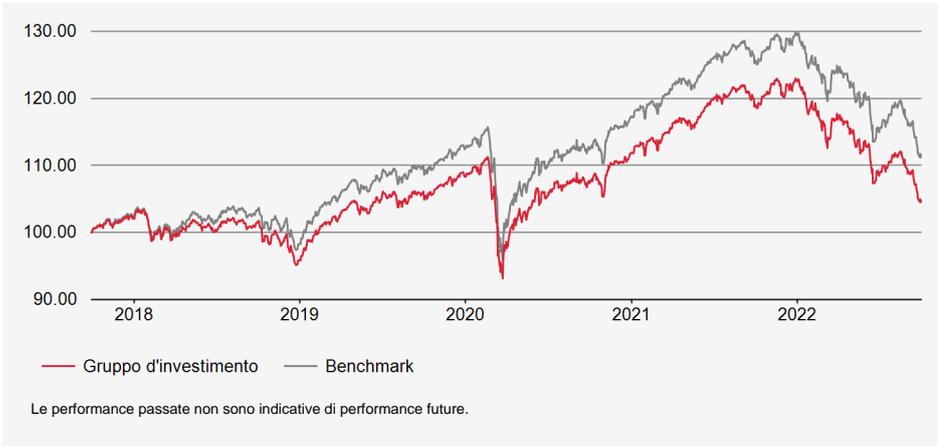


Patrimonio netto (NAV) in mio. CHF: 527.45
Valore d'inventario netto per diritto in CHF: 177.12

Strategia d'investimento

Il gruppo d'investimento LPP-Mix 45 P investe in media ca. il 45% in azioni. Un po' più della metà di questa quota in azioni viene investita in titoli a reddito variabile svizzeri, mentre il resto è destinato a società estere. In media il 37% del patrimonio viene investito in obbligazioni. Sono posti i seguenti limiti massimi: 50% azioni, 30% valute estere. LPP-Mix 45 P è adatta per investitori disposti ad assumersi importanti oscillazioni dei corsi. Raccomandiamo di optare per una durata dell'investimento superiore a dieci anni.

Evoluzione del valore nella valuta di riferimento (base 100)



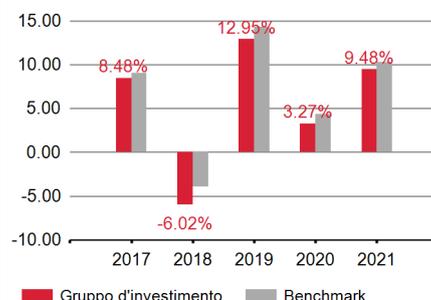
Performance nella valuta di riferimento

| | PERFORMANCE CUMULATA | | | | PERFORMANCE ANNUALIZZATA | | | |
|-----------------------|----------------------|--------|--------|---------|--------------------------|--------|---------|--------|
| | YTD | 1 MESE | 3 MESI | 1 ANNO | 3 ANNI | 5 ANNI | 10 ANNI | INIZIO |
| GRUPPO D'INVESTIMENTO | -14.45% | -4.14% | -3.39% | -11.98% | -0.41% | 0.94% | 3.21% | 2.90% |
| BENCHMARK | -13.80% | -4.34% | -2.99% | -11.21% | 0.47% | 2.20% | 4.43% | 4.40% |

Dati statistici (annualizzati)

| | 1 ANNO | 3 ANNI | 5 ANNI | 10 ANNI | INIZIO |
|---|--------|--------|--------|---------|--------|
| Volatilità Gruppo d'investimento (in %) | 7.93 | 8.22 | 7.18 | 6.22 | 6.45 |
| Volatilità del Benchmark (in %) | 8.39 | 8.57 | 7.41 | 6.21 | 6.41 |
| Tracking Error ex post (in %) | 0.80 | 0.65 | 0.61 | 0.58 | 0.70 |
| Information Ratio | -0.97 | -1.36 | -2.08 | -2.11 | -2.16 |
| Sharpe Ratio | -1.54 | 0.03 | 0.23 | 0.60 | 0.44 |
| Correlazione | 1.00 | 1.00 | 1.00 | 1.00 | 0.99 |
| Beta | 0.94 | 0.96 | 0.97 | 1.00 | 1.00 |
| Jensen alfa | -1.39 | -0.84 | -1.16 | -1.21 | -1.51 |
| Maximum Drawdown (in %) | -15.03 | -16.28 | -16.28 | -16.28 | -29.17 |
| Recovery Period (anni) | - | 0.74 | 0.74 | 0.74 | 3.98 |

Performance



Informazioni sul prodotto

Numero di valore: 1436925
ISIN: CH0014369257
LEI: 2549001XL79VZWJO5Q69
Codice Bloomberg: SLVOR45 SW
Benchmark: Customized
Moneta: CHF
Domicilio: Svizzera
Data di creazione: 30/09/2002
Prezzo di prima emissione: 100.00
Chiusura d'esercizio: 30.09
Emissione/Riscatto: giornalmente
Termine d'accettazione: 14.00
Commissione d'emissione/riscatto: nessuna
Prassi di distribuzione: Capitalizzazione
Asset Manager:
Asset allocation tattica
 Swiss Life Asset Management SA
Gruppi d'investimento puri impiegati
 Diversi in base al
 Swiss Life Best Select Invest Plus®
Consulenza esterna:
 PPCmetrics fornisce i seguenti servizi all'interno dei gruppi d'investimento puri: consulenza sulla struttura idonea del mandato, 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
Quote spese operative TER KGAST ex ante: 1.41%
ex post al: 30/09/2022 1.42%

Struttura del portafoglio per gruppo d'investimento

| | Gruppo d'investimento | Benchmark | max. OPP2 |
|---|-----------------------|-----------|-----------|
| Liquidità | 5.70% | 2.00% | - |
| Ipotecche Svizzera | 0.69% | - | - |
| Obbligazioni CHF Svizzera | 8.76% | 12.00% | - |
| Obbligazioni CHF Estero | 4.42% | 5.00% | - |
| Obbligazioni valute estere (CHF hedged) | 24.67% | 20.00% | - |
| Azioni Svizzera | 21.40% | 23.00% | - |
| Azioni Estero | 18.60% | 22.00% | - |
| Azioni Estero (CHF hedged) | 1.92% | - | - |
| Immobili Svizzera | 8.92% | 9.00% | 30.00% |
| Immobili estero (CHF hedged) | 2.57% | 2.00% | 10.00% |
| Investimenti alternativi (CHF hedged) | 2.34% | 5.00% | 15.00% |
| Totale azioni (Svizzera ed Estero) | 41.91% | 45.00% | 50.00% |
| Totale valute estere | 18.60% | 22.00% | 30.00% |

Struttura del portafoglio secondo le valute

| | |
|-------|--------|
| CHF | 81.40% |
| USD | 13.17% |
| EUR | 1.98% |
| JPY | 1.19% |
| ALTRI | 2.26% |

Maggiori posizioni azionarie

| | Gruppo d'investimento |
|------------------------------|-----------------------|
| NESTLE SA-REG | 4.48% |
| ROCHE HOLDING AG | 3.45% |
| NOVARTIS AG-REG | 2.62% |
| MICROSOFT CORP. | 1.09% |
| ZURICH INSURANCE GROUP AG | 0.90% |
| CIE FINANCIERE RICHEMONT-REG | 0.75% |
| ALPHABET INC | 0.74% |
| UBS GROUP AG-REG | 0.72% |
| ABB LTD-REG | 0.64% |
| LONZA GROUP AG-REG | 0.55% |

Qualità degli investimenti a reddito fisso

| | |
|-------------------|------|
| Modified Duration | 4.83 |
| Rating medio | A |

Fondazione d'investimento Swiss Life

Obbligazioni CHF Svizzera PM



Patrimonio netto (NAV) in mio. CHF: 535.16
Valore d'inventario netto per diritto in CHF: 131.10

Strategia d'investimento

Investimenti in titoli di credito in CHF di debitori domiciliati in Svizzera. Selezione attiva di titoli, gestione della duration e posizionamento della curva dei tassi d'interesse. Limitazione per debitore: 10% (eccezioni: istituti di credito fondiario 25%, Confederazione senza limitazione). Debitori esterni al benchmark: max. 10%. Rating medio: almeno A+. Realizzazione tramite Swiss Life iFunds (CH) Bond Swiss Francs Domestic (CHF); fondo d'investimento di diritto svizzero della categoria "altri fondi per investimenti tradizionali".

Evoluzione del valore nella valuta di riferimento (base 100)



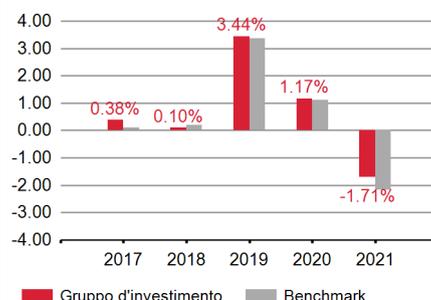
Performance nella valuta di riferimento

| | PERFORMANCE CUMULATA | | | | PERFORMANCE ANNUALIZZATA | | | |
|------------------------------|----------------------|---------------|---------------|----------------|--------------------------|---------------|---------------|--------------|
| | YTD | 1 MESE | 3 MESI | 1 ANNO | 3 ANNI | 5 ANNI | 10 ANNI | INIZIO |
| GRUPPO D'INVESTIMENTO | -12.97% | -2.42% | -1.93% | -13.01% | -5.34% | -2.07% | -0.05% | 1.78% |
| BENCHMARK | -12.09% | -2.17% | -1.54% | -12.15% | -5.19% | -1.95% | -0.13% | 1.66% |

Dati statistici (annualizzati)

| | 1 ANNO | 3 ANNI | 5 ANNI | 10 ANNI | INIZIO |
|---|--------|--------|--------|---------|--------|
| Volatilità Gruppo d'investimento (in %) | 7.08 | 6.17 | 5.33 | 4.43 | 3.99 |
| Volatilità del Benchmark (in %) | 6.89 | 5.83 | 5.09 | 4.30 | 3.94 |
| Tracking Error ex post (in %) | 0.32 | 0.48 | 0.39 | 0.35 | 0.43 |
| Information Ratio | -2.66 | -0.32 | -0.29 | 0.23 | 0.28 |
| Sharpe Ratio | -1.89 | -0.79 | -0.26 | 0.12 | 0.48 |
| Correlazione | 1.00 | 1.00 | 1.00 | 1.00 | 0.99 |
| Beta | 1.03 | 1.06 | 1.05 | 1.03 | 1.01 |
| Jensen alfa | -0.54 | 0.10 | -0.06 | 0.07 | 0.11 |
| Maximum Drawdown (in %) | -15.46 | -17.43 | -18.65 | -18.65 | -18.65 |
| Recovery Period (anni) | - | - | - | - | - |

Performance



Informazioni sul prodotto

Numero di valore: 3026053
ISIN: CH0030260530
LEI: 254900M0YGKYAE29FA28
Codice Bloomberg: SLOCIPM SW
Benchmark: SBI Domestic AAA - BBB TR
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®: Swiss Life Asset Management SA
Controllo asset manager: PPCmetrics supporta il controllo costante dell'asset manager e la valutazione dei risultati d'investimento.
Pubblicazioni di corsi: Bloomberg: ASSL
www.swisslife.ch/fondazioneinvestimento
Quote spese operative TER KGAST ex ante: 0.08%
ex post al: 30/09/2022 0.08%

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.

Tracking error ex ante: Il tracking error previsto per i prossimi 12 mesi corrisponde al Tracking error ex post degli ultimi 3 anni.

Struttura del portafoglio per settore

| | Gruppo d'investimento | Benchmark |
|-----------------------------|-----------------------|-----------|
| INSTITUTI LETTERE DI PEGNO | 31.17% | 39.17% |
| STATI E SIMILI | 24.15% | 30.84% |
| FINANZA | 21.61% | 16.58% |
| CONSUMO NON CICLICO | 6.71% | 5.08% |
| SERVIZI DI PUBBLICA UTILITÀ | 5.06% | 2.65% |
| BENI INDUSTRIALI | 4.73% | 2.86% |
| CONSUMO CICLICO | 1.00% | 0.37% |
| MATERIALI DI BASE | 0.87% | 0.88% |
| SUPERNAZIONALE | 0.24% | - |
| ALTRI | 1.11% | 1.56% |
| LIQUIDITÀ | 3.33% | - |

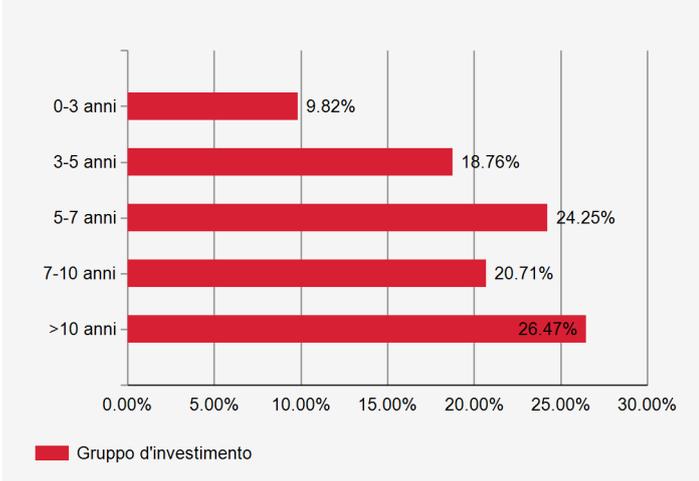
Principali debitori e rating

| | Rating | Gruppo d'investimento |
|---------------------------|--------|-----------------------|
| Pfandbriefbank | AAA | 16.25% |
| Pfandbriefzentrale | AAA | 14.50% |
| Confederazione | AAA | 14.16% |
| Banca cantonale di Zurigo | AAA | 2.80% |
| Cantone Ginevra | AA- | 1.64% |

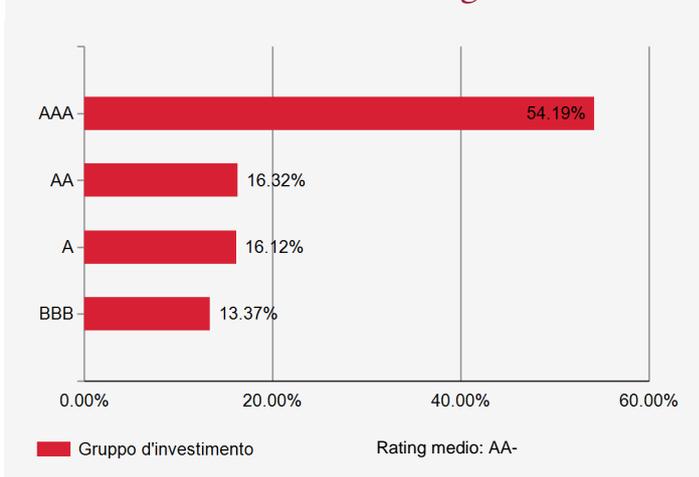
Ulteriori informazioni sui debitori

| | |
|-----------------------------------|-------|
| Numero di debitori | 117 |
| Quota di debitori senza benchmark | 1.57% |

Struttura della scadenza dei titoli



Investimenti secondo il rating



Durata e rendimento alla scadenza

| | Gruppo d'investimento | Benchmark |
|-----------------------------------|-----------------------|-----------|
| Modified Duration | 7.7 | 7.6 |
| Rendimento alla scadenza teorica* | 2.03% | 1.79% |

* prima copertura del rischio di cambio, prendendo in considerazione i derivati

Fondazione d'investimento Swiss Life

Obbligazioni CHF Estero PM

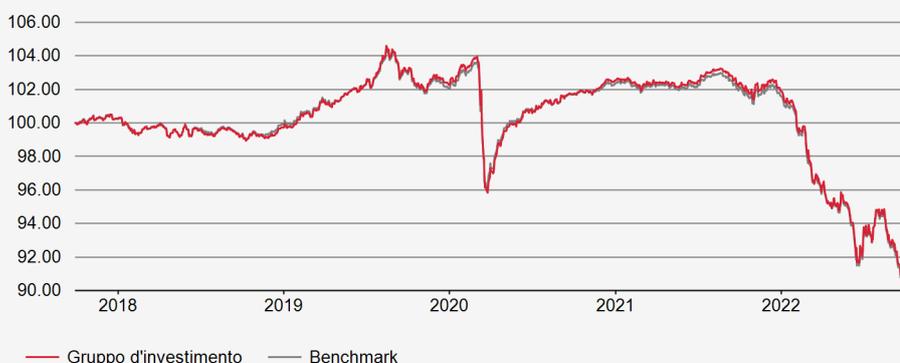


Patrimonio netto (NAV) in mio. CHF: 316.41
Valore d'inventario netto per diritto in CHF: 123.32

Strategia d'investimento

Investimenti in titoli di credito in CHF di debitori domiciliati prevalentemente all'estero. Selezione attiva di titoli, gestione della duration e posizionamento della curva dei tassi d'interesse. Limitazione per debitore: 10%. Debitori esterni al benchmark: max. 20%. Rating medio: almeno A. Realizzazione tramite Swiss Life iFunds (CH) Bond Swiss Francs Foreign (CHF); fondo d'investimento di diritto svizzero della categoria "altri fondi per investimenti tradizionali".

Evoluzione del valore nella valuta di riferimento (base 100)



Le performance passate non sono indicative di performance future.

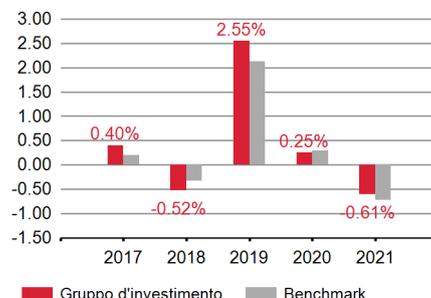
Performance nella valuta di riferimento

| | PERFORMANCE CUMULATA | | | | PERFORMANCE ANNUALIZZATA | | | |
|------------------------------|----------------------|--------|--------|---------|--------------------------|--------|---------|--------|
| | YTD | 1 MESE | 3 MESI | 1 ANNO | 3 ANNI | 5 ANNI | 10 ANNI | INIZIO |
| GRUPPO D'INVESTIMENTO | -10.40% | -1.73% | -1.98% | -10.74% | -3.96% | -1.80% | 0.00% | 1.38% |
| BENCHMARK | -10.12% | -1.53% | -1.83% | -10.50% | -3.93% | -1.80% | -0.13% | 1.28% |

Dati statistici (annualizzati)

| | 1 ANNO | 3 ANNI | 5 ANNI | 10 ANNI | INIZIO |
|---|--------|--------|--------|---------|--------|
| Volatilità Gruppo d'investimento (in %) | 4.37 | 5.16 | 4.20 | 3.26 | 3.55 |
| Volatilità del Benchmark (in %) | 4.40 | 4.87 | 3.98 | 3.11 | 3.30 |
| Tracking Error ex post (in %) | 0.37 | 0.43 | 0.35 | 0.36 | 1.01 |
| Information Ratio | -0.63 | -0.08 | 0.00 | 0.36 | 0.09 |
| Sharpe Ratio | -2.47 | -0.66 | -0.26 | 0.18 | 0.43 |
| Correlazione | 1.00 | 1.00 | 1.00 | 0.99 | 0.96 |
| Beta | 0.99 | 1.06 | 1.05 | 1.04 | 1.03 |
| Jensen alfa | -0.33 | 0.16 | 0.06 | 0.11 | 0.05 |
| Maximum Drawdown (in %) | -11.70 | -12.86 | -13.39 | -13.39 | -13.39 |
| Recovery Period (anni) | - | - | - | - | - |

Performance



Informazioni sul prodotto

Numero di valore: 3026054
ISIN: CH0030260548
LEI: 2549002XPEQH1AZYBW05
Codice Bloomberg: SLOCAPM SW
Benchmark: SBI Foreign AAA - BBB TR
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®:
 Swiss Life Asset Management SA
Controllo asset manager:
 PPCmetrics supporta il controllo costante dell'asset manager e la valutazione dei risultati d'investimento.
Pubblicazioni di corsi: Bloomberg: ASSL
www.swisslife.ch/fondazioneinvestimento
Quote spese operative TER KGAST
ex ante: 0.08%
ex post al: 30/09/2022 0.08%

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.

Tracking error ex ante: Il tracking error previsto per i prossimi 12 mesi corrisponde al Tracking error ex post degli ultimi 3 anni.

Struttura del portafoglio per settore

| | Gruppo d'investimento | Benchmark |
|-----------------------------|-----------------------|-----------|
| FINANZA | 58.66% | 49.68% |
| ISTITUTI LETTERE DI PEGNO | 10.34% | 11.55% |
| ENERGIA | 3.54% | 3.21% |
| CONSUMO NON CICLICO | 3.25% | 4.59% |
| STATI E SIMILI | 3.08% | 17.14% |
| COMUNICAZIONE | 3.04% | 2.79% |
| BENI INDUSTRIALI | 2.48% | 4.93% |
| SERVIZI DI PUBBLICA UTILITÀ | 1.84% | 2.19% |
| SUPERNAZIONALE | 7.12% | - |
| ALTRI | 2.63% | 3.92% |
| LIQUIDITÀ | 4.03% | - |

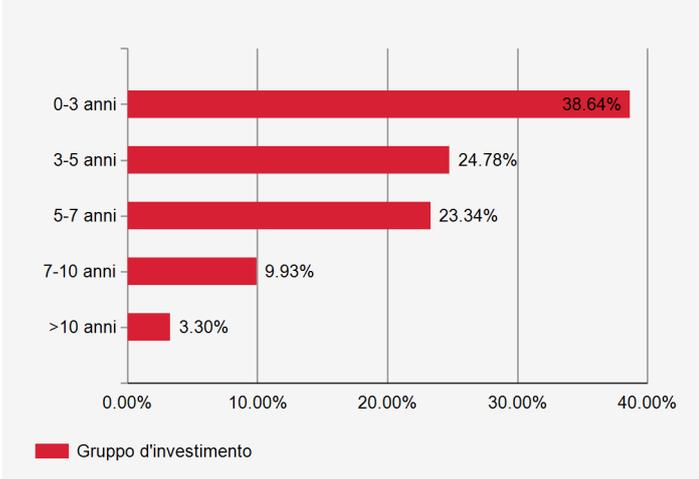
Principali debitori e rating

| | Rating | Gruppo d'investimento |
|--------------------------------|--------|-----------------------|
| Müchner Hypothekbank | AA- | 3.70% |
| Credit Agricole Group | AA- | 3.24% |
| Pfandbriefbank | AAA | 2.84% |
| Pfandbriefzentrale | AAA | 2.59% |
| Commonwealth Bank of Australia | AA | 2.51% |

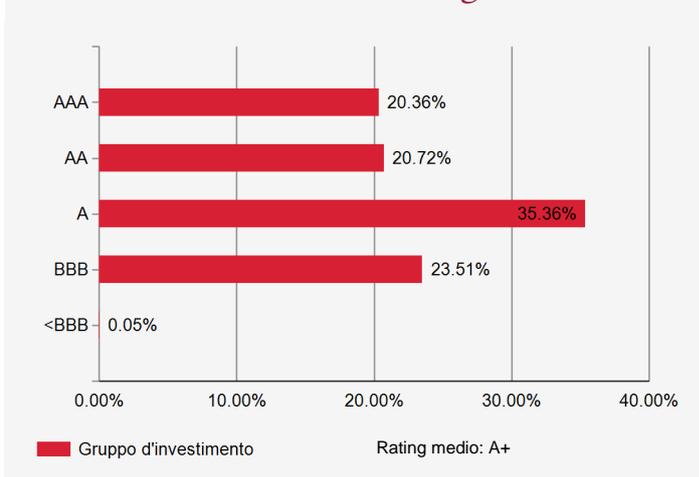
Ulteriori informazioni sui debitori

| | |
|-----------------------------------|-------|
| Numero di debitori | 121 |
| Quota di debitori senza benchmark | 9.23% |

Struttura della scadenza dei titoli



Investimenti secondo il rating



Durata e rendimento alla scadenza

| | Gruppo d'investimento | Benchmark |
|-----------------------------------|-----------------------|-----------|
| Modified Duration | 4.3 | 4.3 |
| Rendimento alla scadenza teorica* | 2.58% | 2.40% |

* prima copertura del rischio di cambio, prendendo in considerazione i derivati

Struttura del portafoglio secondo il paese/regione

| | Gruppo d'investimento | Benchmark |
|---------------------------------|-----------------------|-----------|
| STATI UNITI | 16.48% | 16.16% |
| FRANCIA | 12.91% | 14.40% |
| GERMANIA | 9.41% | 11.08% |
| AUSTRALIA | 8.40% | 7.83% |
| SVIZZERA | 7.23% | 0.54% |
| CANADA | 6.95% | 9.15% |
| REGNO UNITO | 6.19% | 4.83% |
| REGIONE EUROPEA (EUR) | 8.21% | 17.24% |
| MERCATI EMERGENTI IN AMERICA | 6.67% | 5.93% |
| MERCATI EMERGENTI MEDIO ORIENTE | 4.89% | 2.21% |
| ALTRI | 8.63% | 10.63% |
| LIQUIDITÀ, COPERTURA | 4.03% | - |

Fondazione d'investimento Swiss Life

Obbligazioni Global PM (CHF hedged)

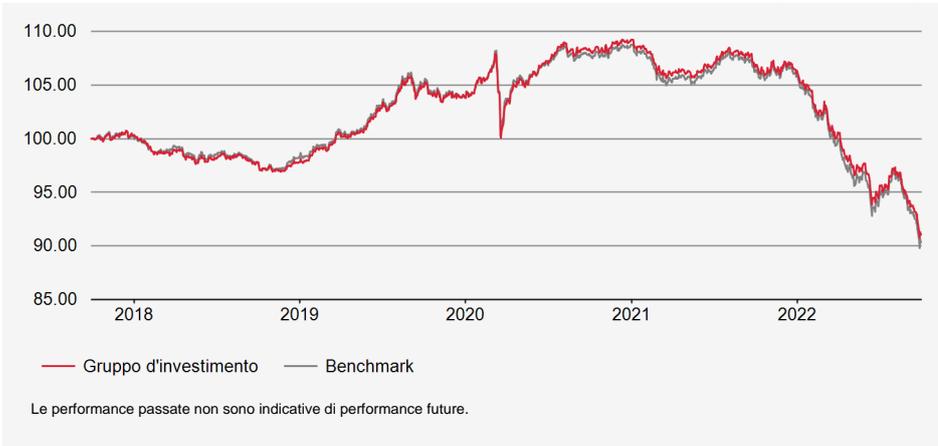


Patrimonio netto (NAV) in mio. CHF: 41.14
Valore d'inventario netto per diritto in CHF: 116.74

Strategia d'investimento

Investimenti in titoli di credito in valute estere di debitori domiciliati in Svizzera o all'estero (dal 1.1.2011 CHF hedged). Selezione attiva di titoli, gestione della duration e posizionamento della curva dei tassi d'interesse. Limitazione per debitore: 10% (eccezione: se rappresentati nel benchmark, max. 5%-punti in più della ponderazione del benchmark). Debitori esterni al benchmark: max. 10%. Rating medio: almeno A-. I rischi valutari vengono coperti al 90% almeno contro il franco. Realizzazione tramite Swiss Life iFunds (CH) Bond Global Government+ (CHF hedged) e Swiss Life iFunds (CH) Bond Global Corporates (CHF hedged); fondi d'investimento di diritto svizzero della categoria "altri fondi per investimenti tradizionali".

Evoluzione del valore nella valuta di riferimento (base 100)



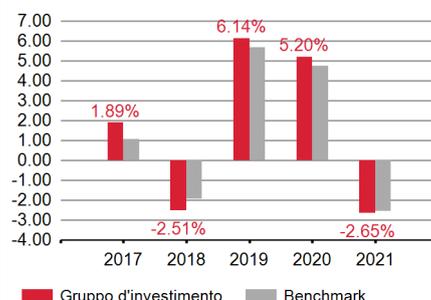
Performance nella valuta di riferimento

| | PERFORMANCE CUMULATA | | | | PERFORMANCE ANNUALIZZATA | | | |
|-----------------------|----------------------|--------|--------|---------|--------------------------|--------|---------|--------|
| | YTD | 1 MESE | 3 MESI | 1 ANNO | 3 ANNI | 5 ANNI | 10 ANNI | INIZIO |
| GRUPPO D'INVESTIMENTO | -14.31% | -3.52% | -4.21% | -14.60% | -4.56% | -1.84% | 0.24% | 1.01% |
| BENCHMARK | -14.74% | -3.70% | -4.33% | -14.92% | -4.91% | -2.00% | 0.04% | 0.71% |

Dati statistici (annualizzati)

| | 1 ANNO | 3 ANNI | 5 ANNI | 10 ANNI | INIZIO |
|---|--------|--------|--------|---------|--------|
| Volatilità Gruppo d'investimento (in %) | 5.71 | 5.15 | 4.43 | 3.86 | 5.65 |
| Volatilità del Benchmark (in %) | 6.22 | 5.28 | 4.55 | 3.86 | 5.64 |
| Tracking Error ex post (in %) | 0.71 | 0.50 | 0.49 | 0.62 | 1.45 |
| Information Ratio | 0.45 | 0.69 | 0.33 | 0.32 | 0.21 |
| Sharpe Ratio | -2.67 | -0.79 | -0.26 | 0.21 | 0.20 |
| Correlazione | 1.00 | 1.00 | 0.99 | 0.99 | 0.97 |
| Beta | 0.92 | 0.97 | 0.97 | 0.99 | 0.97 |
| Jensen alfa | -0.90 | 0.22 | 0.12 | 0.21 | 0.32 |
| Maximum Drawdown (in %) | -15.42 | -16.94 | -16.94 | -16.94 | -16.94 |
| Recovery Period (anni) | - | - | - | - | - |

Performance



Informazioni sul prodotto

Numero di valore: 3026055
ISIN: CH0030260555
LEI: 254900F82G5L48XPDV74
Codice Bloomberg: SLOFGPM SW
Benchmark: 40% Bloomberg Global Aggregate Corporates 60% Bloomberg Global Aggregate Treasuries ex CH (Indici CHF hedged)
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®: Swiss Life Asset Management SA
Controllo asset manager: PPCmetrics supporta il controllo costante dell'asset manager e la valutazione dei risultati d'investimento.
Pubblicazioni di corsi: Bloomberg: ASSL www.swisslife.ch/fondazioneinvestimento
Quote spese operative TER KGAST ex ante: 0.15%
ex post al: 30/09/2022 0.15%

PM tranche: L'acquisto di questa tranche è possibile solo nell'ambito di un accordo speciale con Swiss Life Asset Management SA.

Benchmark: Il benchmark è stato modificato al 1° luglio 2012. Per informazioni relative al precedente benchmark potete rivolgervi alla Fondazione d'investimento Swiss Life.

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.

Tracking error ex ante: Il tracking error previsto per i prossimi 12 mesi corrisponde al Tracking error ex post degli ultimi 3 anni.

Struttura del portafoglio per settore

| | Gruppo d'investimento | Benchmark |
|---------------------------------|-----------------------|-----------|
| STATI E SIMILI | 48.86% | 60.00% |
| FINANZA | 22.08% | 15.79% |
| CONSUMO NON CICLICO | 7.36% | 6.22% |
| SERVIZI DI PUBBLICA UTILITÀ | 3.01% | 3.34% |
| ENERGIA | 2.64% | 2.39% |
| CONSUMO CICLICO | 2.50% | 2.73% |
| BENI INDUSTRIALI | 2.44% | 2.83% |
| COMUNICAZIONE | 1.93% | 3.36% |
| TECNOLOGIA | 1.38% | 2.09% |
| SUPERNAZIONALE | 3.45% | - |
| OTHER | 0.51% | 1.25% |
| LIQUIDITÀ | 3.52% | - |
| COPERTURA DEL RISCHIO DI CAMBIO | 0.33% | - |

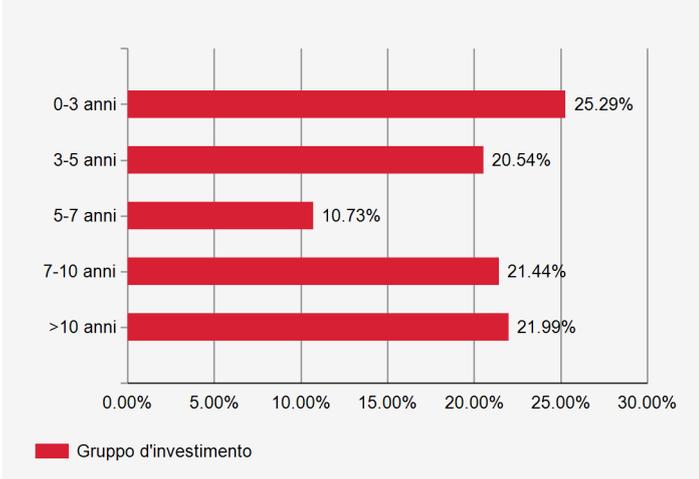
Principali debitori e rating

| | Gruppo d'investimento | Benchmark |
|---------------------------------|-----------------------|-----------|
| US Treasury N/B | AA+ | 19.28% |
| Giappone | A+ | 7.79% |
| Italia | BBB- | 4.00% |
| People's Republic of China | A+ | 3.32% |
| Kreditanstalt fuer Wiederaufbau | AAA | 2.46% |

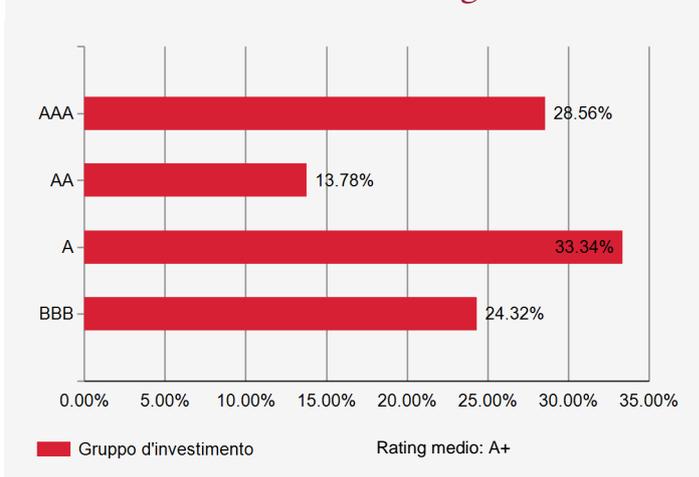
Ulteriori informazioni sui debitori

| | |
|-----------------------------------|-------|
| Numero di debitori | 269 |
| Quota di debitori senza benchmark | 2.02% |

Struttura della scadenza dei titoli



Investimenti secondo il rating



Durata e rendimento alla scadenza

| | Gruppo d'investimento | Benchmark |
|-----------------------------------|-----------------------|-----------|
| Modified Duration | 6.1 | 6.9 |
| Rendimento alla scadenza teorica* | 3.68% | 3.90% |

* prima copertura del rischio di cambio, prendendo in considerazione i derivati

Struttura del portafoglio per valute e la duration

| | Gruppo d'investimento | | Benchmark | |
|-------|-----------------------|----------|-----------|----------|
| | Peso | Duration | Peso | Duration |
| USD | 47.40% | 6.23 | 47.56% | 6.36 |
| EUR | 31.07% | 3.92 | 21.73% | 6.38 |
| JPY | 8.30% | 8.51 | 13.52% | 7.32 |
| Altri | 13.23% | 9.52 | 17.20% | 12.53 |

Struttura del portafoglio secondo il paese/regione

| | Gruppo d'investimento | Benchmark |
|---------------------------------|-----------------------|-----------|
| STATI UNITI | 35.85% | 41.99% |
| GIAPPONE | 10.81% | 14.60% |
| GERMANIA | 6.41% | 4.15% |
| CANADA | 4.94% | 3.31% |
| ITALIA | 3.99% | 2.81% |
| CINA | 3.32% | 5.02% |
| REGNO UNITO | 2.65% | 2.86% |
| REGIONE EUROPEA (EUR) | 11.29% | 9.42% |
| REGIONE EUROPEA (EX EUR) | 5.42% | 4.41% |
| MERCATI EMERGENTI ASIA PACIFICO | 1.45% | 0.88% |
| ALTRI | 10.03% | 10.55% |
| LIQUIDITÀ, COPERTURA | 3.85% | - |

Fondazione d'investimento Swiss Life

Obbligazioni Global Stati+ PM (CHF hedged)



Patrimonio netto (NAV) in mio. CHF: 569.64
Valore d'inventario netto per diritto in CHF: 109.79

Strategia d'investimento

Investimenti in titoli di credito espressi in valute estere di Stati e istituzioni vicine allo Stato. Selezione attiva di titoli, gestione della duration e posizionamento della curva dei tassi d'interesse. Limitazione per debitore: 10% (eccezione: se rappresentati nel benchmark, max. 5%-punti in più della ponderazione del benchmark). Debitori esterni al benchmark: max. 10%. Rating medio: almeno A+. I rischi valutari vengono coperti al 90% almeno contro il franco. Realizzazione tramite Swiss Life iFunds (CH) Bond Global Government+ (CHF hedged); fondo d'investimento di diritto svizzero della categoria "altri fondi per investimenti tradizionali".

Evoluzione del valore nella valuta di riferimento (base 100)



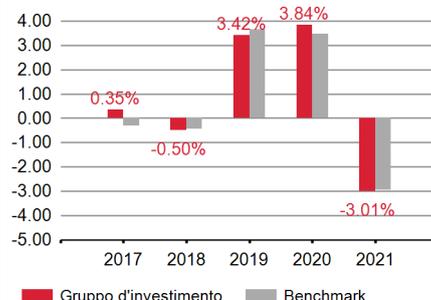
Performance nella valuta di riferimento

| | PERFORMANCE CUMULATA | | | | PERFORMANCE ANNUALIZZATA | | | |
|------------------------------|----------------------|--------|--------|---------|--------------------------|--------|---------|--------|
| | YTD | 1 MESE | 3 MESI | 1 ANNO | 3 ANNI | 5 ANNI | 10 ANNI | INIZIO |
| GRUPPO D'INVESTIMENTO | -12.59% | -3.04% | -4.06% | -12.93% | -4.80% | -1.94% | -0.02% | 0.79% |
| BENCHMARK | -12.35% | -2.98% | -3.82% | -12.50% | -4.80% | -1.89% | -0.05% | 0.54% |

Dati statistici (annualizzati)

| | 1 ANNO | 3 ANNI | 5 ANNI | 10 ANNI | INIZIO |
|---|--------|--------|--------|---------|--------|
| Volatilità Gruppo d'investimento (in %) | 4.92 | 4.09 | 3.66 | 3.37 | 3.40 |
| Volatilità del Benchmark (in %) | 5.21 | 4.14 | 3.78 | 3.39 | 3.33 |
| Tracking Error ex post (in %) | 0.62 | 0.64 | 0.56 | 0.62 | 0.72 |
| Information Ratio | -0.70 | 0.01 | -0.10 | 0.06 | 0.35 |
| Sharpe Ratio | -2.71 | -1.05 | -0.34 | 0.16 | 0.37 |
| Correlazione | 0.99 | 0.99 | 0.99 | 0.98 | 0.98 |
| Beta | 0.94 | 0.98 | 0.96 | 0.98 | 1.00 |
| Jensen alfa | -1.16 | -0.10 | -0.11 | 0.05 | 0.26 |
| Maximum Drawdown (in %) | -13.96 | -16.26 | -16.26 | -16.26 | -16.26 |
| Recovery Period (anni) | - | - | - | - | - |

Performance



Informazioni sul prodotto

Numero di valore: 11956107
ISIN: CH0119561071
LEI: 254900H7WEVS3K9ANR90
Codice Bloomberg: SWLGSPM SW
Benchmark: BLOOMBERG GLOBAL AGG TREAS EX CHF TR HEDGED CHF
Moneta: CHF
Domicilio: Svizzera
Data di creazione: 14/12/2010
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@: Swiss Life Asset Management SA
Controllo asset manager: PPCmetrics supporta il controllo costante dell'asset manager e la valutazione dei risultati d'investimento.
Pubblicazioni di corsi: Bloomberg: ASSL www.swisslife.ch/fondazioneinvestimento
Quote spese operative TER KGAST ex ante: 0.15%
ex post al: 30/09/2022 0.15%

PM tranche: L'acquisto di questa tranche è possibile solo nell'ambito di un accordo speciale con Swiss Life Asset Management SA.

Benchmark: Il benchmark è stato modificato al 1° luglio 2012. Per informazioni relative al precedente benchmark potete rivolgervi alla Fondazione d'investimento Swiss Life.

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.

Tracking error ex ante: Il tracking error previsto per i prossimi 12 mesi corrisponde al Tracking error ex post degli ultimi 3 anni.

Fondazione d'investimento Swiss Life

Obbligazioni Global Stati+ PM (CHF hedged)

Struttura del portafoglio per settore

| | Gruppo d'investimento | Benchmark |
|---------------------------------|-----------------------|-----------|
| STATI E SIMILI | 81.32% | 100.00% |
| FINANZA | 9.26% | - |
| CONSUMO NON CICLICO | 0.49% | - |
| BENI INDUSTRIALI | 0.11% | - |
| SUPERNAZIONALE | 5.74% | - |
| LIQUIDITÀ | 2.09% | - |
| COPERTURA DEL RISCHIO DI CAMBIO | 0.99% | - |

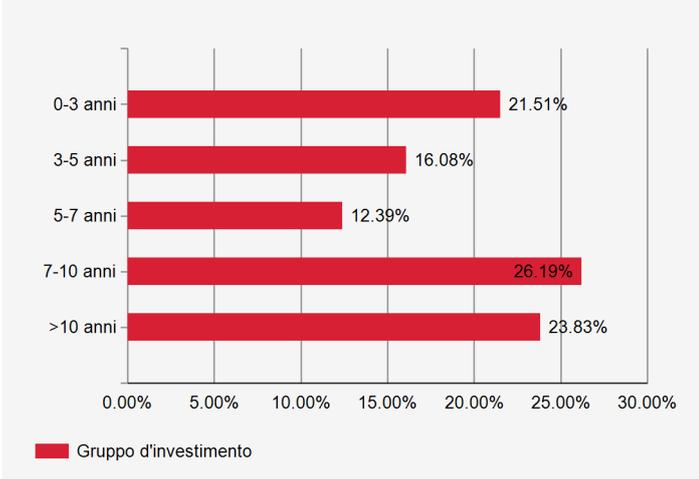
Principali debitori e rating

| | Rating | Gruppo d'investimento |
|---------------------------------|--------|-----------------------|
| US Treasury N/B | AA+ | 32.09% |
| Giappone | A+ | 12.97% |
| Italia | BBB- | 6.65% |
| People's Republic of China | A+ | 5.53% |
| Kreditanstalt fuer Wiederaufbau | AAA | 4.09% |

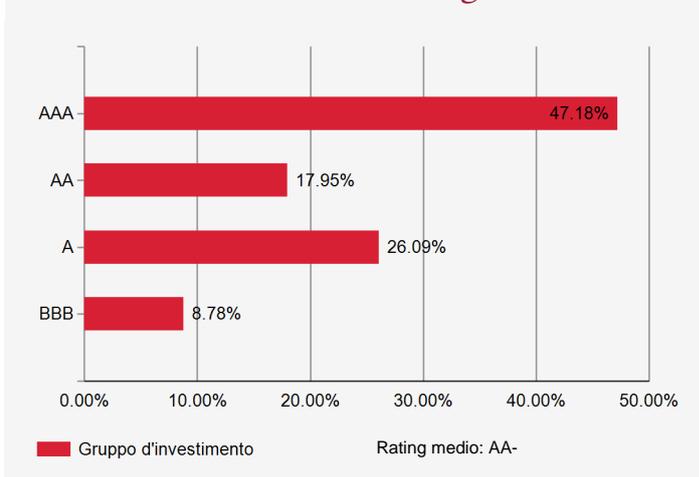
Ulteriori informazioni sui debitori

| | |
|-----------------------------------|-------|
| Numero di debitori | 80 |
| Quota di debitori senza benchmark | 0.29% |

Struttura della scadenza dei titoli



Investimenti secondo il rating



Durata e rendimento alla scadenza

| | Gruppo d'investimento | Benchmark |
|-----------------------------------|-----------------------|-----------|
| Modified Duration | 6.6 | 7.4 |
| Rendimento alla scadenza teorica* | 2.69% | 2.81% |

* prima copertura del rischio di cambio, prendendo in considerazione i derivati

Struttura del portafoglio per valute e la duration

| | Gruppo d'investimento | | Benchmark | |
|-------|-----------------------|----------|-----------|----------|
| | Peso | Duration | Peso | Duration |
| EUR | 34.60% | 4.77 | 21.68% | 7.22 |
| USD | 33.83% | 5.82 | 32.98% | 6.04 |
| JPY | 13.59% | 12.49 | 21.98% | 9.26 |
| GBP | 6.40% | 7.34 | 5.05% | 10.00 |
| Altri | 11.58% | 6.46 | 18.31% | 6.88 |

Struttura del portafoglio secondo il paese/regione

| | Gruppo d'investimento | Benchmark |
|--------------------------|-----------------------|-----------|
| STATI UNITI | 32.11% | 32.98% |
| GIAPPONE | 13.86% | 21.98% |
| GERMANIA | 7.73% | 3.97% |
| ITALIA | 6.64% | 4.69% |
| CANADA | 5.58% | 1.86% |
| CINA | 5.52% | 8.36% |
| AUSTRIA | 3.24% | 0.75% |
| REGIONE EUROPEA (EUR) | 13.38% | 11.94% |
| REGIONE EUROPEA (EX EUR) | 3.77% | 5.41% |
| REGIONE ASIA E PACIFICO | 1.32% | 1.51% |
| ALTRI | 3.77% | 6.57% |
| LIQUIDITÀ, COPERTURA | 3.08% | - |



Fondazione d'investimento Swiss Life

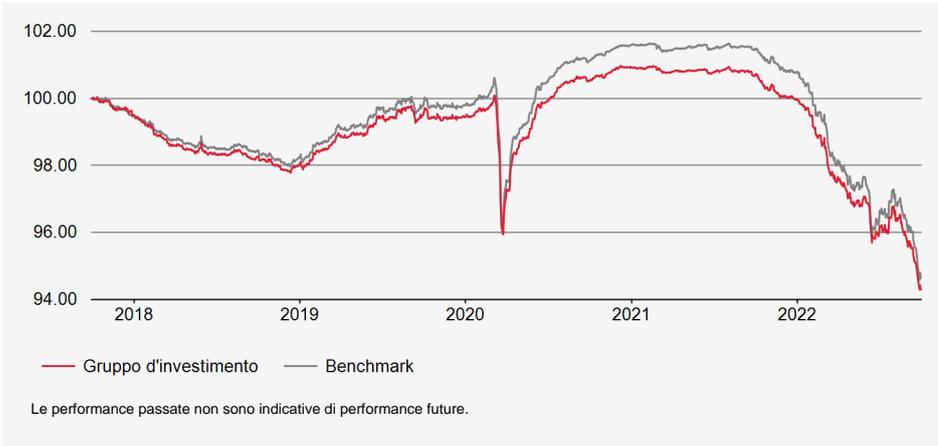
Obbligazioni Global Imprese Short Term PM (CHF hedged) SwissLife

Patrimonio netto (NAV) in mio. CHF: 1,525.66
Valore d'inventario netto per diritto in CHF: 97.44

Strategia d'investimento

Investimenti in titoli di credito espressi in valute estere di società (agenzie e supranational incluse) con una durata residua breve (prevalentemente meno di 3 anni). Selezione attiva di titoli, gestione della duration e posizionamento della curva dei tassi d'interesse. Limitazione per debitore: 10%. Debitori esterni al benchmark: max. 10%. Rating medio: almeno BBB. I rischi valutari vengono coperti al 90% almeno contro il franco. Realizzazione tramite Swiss Life iFunds (CH) Bond Global Corporates Short Term (CHF hedged); Fondi d'investimento di diritto svizzero della categoria "altri fondi per investimenti tradizionali".

Evoluzione del valore nella valuta di riferimento (base 100)



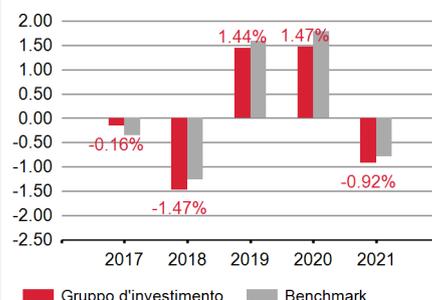
Performance nella valuta di riferimento

| | PERFORMANCE CUMULATA | | | | PERFORMANCE ANNUALIZZATA | | | |
|------------------------------|----------------------|--------|--------|--------|--------------------------|--------|---------|--------|
| | YTD | 1 MESE | 3 MESI | 1 ANNO | 3 ANNI | 5 ANNI | 10 ANNI | INIZIO |
| GRUPPO D'INVESTIMENTO | -5.68% | -1.44% | -1.76% | -6.33% | -1.77% | -1.17% | - | -0.29% |
| BENCHMARK | -6.09% | -1.53% | -1.82% | -6.70% | -1.74% | -1.09% | - | -0.38% |

Dati statistici (annualizzati)

| | 1 ANNO | 3 ANNI | 5 ANNI | 10 ANNI | INIZIO |
|---|--------|--------|--------|---------|--------|
| Volatilità Gruppo d'investimento (in %) | 2.20 | 2.48 | 1.98 | - | 1.60 |
| Volatilità del Benchmark (in %) | 2.41 | 2.65 | 2.11 | - | 1.64 |
| Tracking Error ex post (in %) | 0.30 | 0.24 | 0.20 | - | 0.32 |
| Information Ratio | 1.21 | -0.14 | -0.37 | - | 0.27 |
| Sharpe Ratio | -2.73 | -0.47 | -0.23 | - | 0.21 |
| Correlazione | 1.00 | 1.00 | 1.00 | - | 0.98 |
| Beta | 0.91 | 0.94 | 0.94 | - | 0.95 |
| Jensen alfa | -0.20 | -0.10 | -0.10 | - | 0.10 |
| Maximum Drawdown (in %) | -6.38 | -6.60 | -6.60 | - | -6.60 |
| Recovery Period (anni) | - | - | - | - | - |

Performance



Informazioni sul prodotto

Numero di valore: 22073695
ISIN: CH0220736950
LEI: 2549003DSGO0RN37K507
Codice Bloomberg: SWLOGPM SW
Benchmark: BLOOMBERG GLO AGG CORP 1-3 YR IND HEDGED CHF
Moneta: CHF
Domicilio: Svizzera
Data di creazione: 11/10/2013
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@: Swiss Life Asset Management SA

Controllo asset manager: PPCmetrics supporta il controllo costante dell'asset manager e la valutazione dei risultati d'investimento.

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

Quote spese operative TER KGAST ex ante: 0.15%
ex post al: 30/09/2022 0.15%

Fondazione d'investimento Swiss Life

Obbligazioni Global Imprese Short Term PM (CHF hedged)

Struttura del portafoglio per settore

| | Gruppo d'investimento | Benchmark |
|---------------------------------|-----------------------|-----------|
| FINANZA | 56.89% | 51.94% |
| CONSUMO NON CICLICO | 16.26% | 11.68% |
| CONSUMO CICLICO | 7.05% | 8.78% |
| ENERGIA | 3.98% | 4.40% |
| TECNOLOGIA | 3.63% | 3.96% |
| MATERIALI DI BASE | 3.58% | 2.05% |
| COMUNICAZIONE | 3.58% | 4.88% |
| SERVIZI DI PUBBLICA UTILITÀ | 2.51% | 5.83% |
| SUPERNAZIONALE | 0.83% | - |
| ALTRI | 2.43% | 6.49% |
| LIQUIDITÀ | 0.18% | - |
| COPERTURA DEL RISCHIO DI CAMBIO | -0.91% | - |

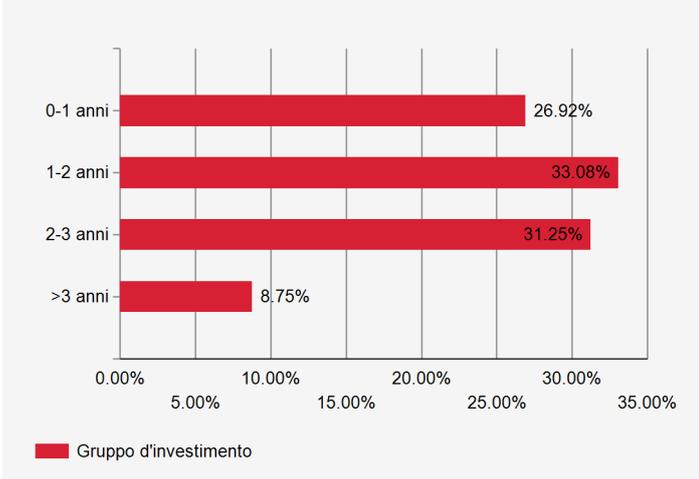
Principali debitori e rating

| | | Gruppo d'investimento |
|-----------------------------|------|-----------------------|
| Bank of America, New York | A- | 2.15% |
| Goldman Sachs Group Inc/The | BBB+ | 1.52% |
| Nestle SA | AA- | 1.51% |
| Morgan Stanley NE US | A- | 1.38% |
| Toronto-Dominion Bank/The | A | 1.32% |

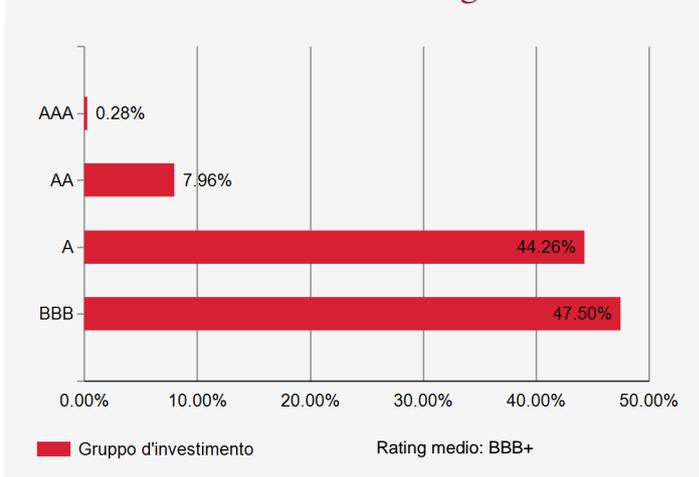
Ulteriori informazioni sui debitori

| | |
|-----------------------------------|-------|
| Numero di debitori | 182 |
| Quota di debitori senza benchmark | 5.94% |

Struttura della scadenza dei titoli



Investimenti secondo il rating



Durata e rendimento alla scadenza

| | Gruppo d'investimento | Benchmark |
|-----------------------------------|-----------------------|-----------|
| Modified Duration | 1.6 | 1.9 |
| Rendimento alla scadenza teorica* | 4.68% | 4.84% |

* prima copertura del rischio di cambio, prendendo in considerazione i derivati

Struttura del portafoglio per valute e la duration

| | Gruppo d'investimento | | Benchmark | |
|-------|-----------------------|----------|-----------|----------|
| | Peso | Duration | Peso | Duration |
| USD | 62.21% | 1.85 | 63.41% | 2.03 |
| EUR | 30.99% | 1.43 | 26.84% | 2.44 |
| GBP | 4.03% | 0.91 | 2.48% | 2.21 |
| CHF | 2.78% | 1.34 | 0.60% | 1.75 |
| Altri | - | - | 6.67% | 1.89 |

Struttura del portafoglio secondo il paese/regione

| | Gruppo d'investimento | Benchmark |
|---------------------------------|-----------------------|-----------|
| STATI UNITI | 38.65% | 44.62% |
| REGNO UNITO | 10.06% | 7.38% |
| FRANCIA | 7.06% | 7.11% |
| GIAPPONE | 6.47% | 5.43% |
| CANADA | 4.94% | 7.22% |
| GERMANIA | 4.61% | 6.05% |
| SVEZIA | 3.75% | 1.08% |
| REGIONE EUROPEA (EUR) | 10.61% | 9.41% |
| REGIONE EUROPEA (EX EUR) | 5.65% | 3.19% |
| MERCATI EMERGENTI ASIA PACIFICO | 3.96% | 2.69% |
| ALTRI | 4.97% | 5.82% |
| LIQUIDITÀ, COPERTURA | -0.73% | - |

Fondazione d'investimento Swiss Life

Obbligazioni Global Imprese PM (CHF hedged)

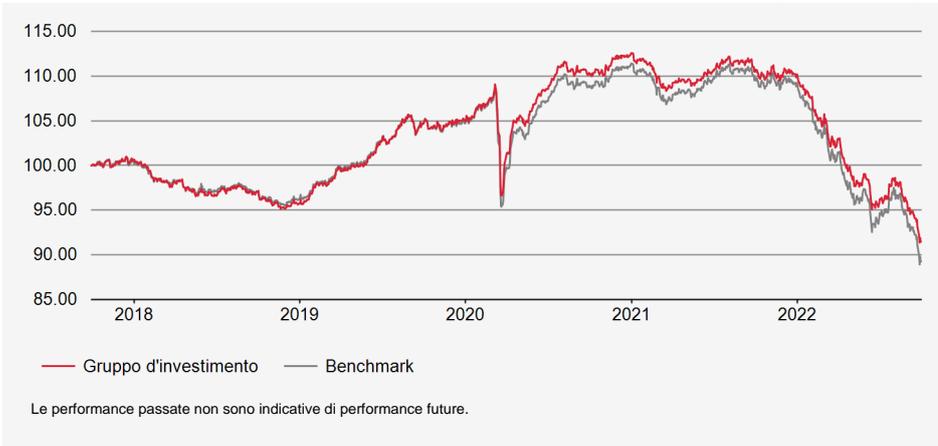


Patrimonio netto (NAV) in mio. CHF: 651.42
Valore d'inventario netto per diritto in CHF: 119.71

Strategia d'investimento

Investimenti in titoli di credito in valute estere di imprese, incl. agenzie ed enti sovranazionali. Selezione attiva di titoli, gestione della duration e posizionamento della curva dei tassi d'interesse. Debitori esterni al benchmark: max. 10%. Limitazioni per debitore: 10%. Rating medio: almeno BBB. I rischi valutari vengono coperti al 90% almeno contro il franco. Realizzazione tramite Swiss Life iFunds (CH) Bond Global Corporates (CHF hedged); fondo d'investimento di diritto svizzero della categoria "altri fondi per investimenti tradizionali".

Evoluzione del valore nella valuta di riferimento (base 100)



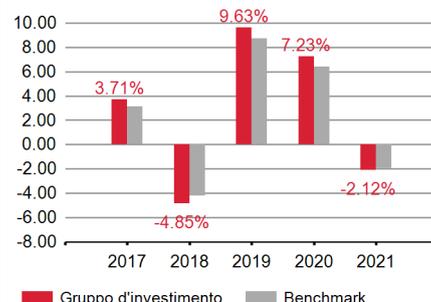
Performance nella valuta di riferimento

| | PERFORMANCE CUMULATA | | | | PERFORMANCE ANNUALIZZATA | | | |
|------------------------------|----------------------|---------------|---------------|----------------|--------------------------|---------------|--------------|--------------|
| | YTD | 1 MESE | 3 MESI | 1 ANNO | 3 ANNI | 5 ANNI | 10 ANNI | INIZIO |
| GRUPPO D'INVESTIMENTO | -16.96% | -4.26% | -4.47% | -17.18% | -4.38% | -1.76% | 0.53% | 1.54% |
| BENCHMARK | -18.26% | -4.78% | -5.11% | -18.47% | -5.16% | -2.24% | 0.15% | 1.00% |

Dati statistici (annualizzati)

| | 1 ANNO | 3 ANNI | 5 ANNI | 10 ANNI | INIZIO |
|---|--------|--------|--------|---------|--------|
| Volatilità Gruppo d'investimento (in %) | 7.23 | 7.28 | 6.09 | 5.05 | 5.06 |
| Volatilità del Benchmark (in %) | 8.05 | 8.00 | 6.58 | 5.25 | 5.12 |
| Tracking Error ex post (in %) | 1.02 | 0.93 | 0.83 | 0.87 | 0.96 |
| Information Ratio | 1.26 | 0.84 | 0.58 | 0.44 | 0.55 |
| Sharpe Ratio | -2.53 | -0.53 | -0.17 | 0.22 | 0.39 |
| Correlazione | 1.00 | 1.00 | 0.99 | 0.99 | 0.98 |
| Beta | 0.90 | 0.91 | 0.92 | 0.95 | 0.97 |
| Jensen alfa | -0.59 | 0.36 | 0.36 | 0.41 | 0.57 |
| Maximum Drawdown (in %) | -17.82 | -18.81 | -18.81 | -18.81 | -18.81 |
| Recovery Period (anni) | - | - | - | - | - |

Performance



Informazioni sul prodotto

Numero di valore: 11956108
ISIN: CH0119561089
LEI: 254900C3B00LU0UJ428
Codice Bloomberg: SWLGUPM SW
Benchmark: BLOOMBERG GLO AGG CORP IND HEDGED CHF
Moneta: CHF
Domicilio: Svizzera
Data di creazione: 14/12/2010
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@: Swiss Life Asset Management SA

Controllo asset manager: PPCmetrics supporta il controllo costante dell'asset manager e la valutazione dei risultati d'investimento.

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

Quote spese operative TER KGAST
ex ante: 0.15%
ex post al: 30/09/2022 0.15%

PM tranches: 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.

Tracking error ex ante: Il tracking error previsto per i prossimi 12 mesi corrisponde al Tracking error ex post degli ultimi 3 anni.

Fondazione d'investimento Swiss Life

Obbligazioni Global Imprese PM (CHF hedged)

Struttura del portafoglio per settore

| | Gruppo d'investimento | Benchmark |
|---------------------------------|-----------------------|-----------|
| FINANZA | 41.51% | 39.47% |
| CONSUMO NON CICLICO | 17.76% | 15.56% |
| SERVIZI DI PUBBLICA UTILITÀ | 7.56% | 8.35% |
| ENERGIA | 6.64% | 5.98% |
| CONSUMO CICLICO | 6.28% | 6.83% |
| BENI INDUSTRIALI | 5.97% | 7.09% |
| COMUNICAZIONE | 4.86% | 8.41% |
| TECNOLOGIA | 3.48% | 5.23% |
| ALTRI | 1.27% | 3.12% |
| LIQUIDITÀ | 5.33% | - |
| COPERTURA DEL RISCHIO DI CAMBIO | -0.67% | - |

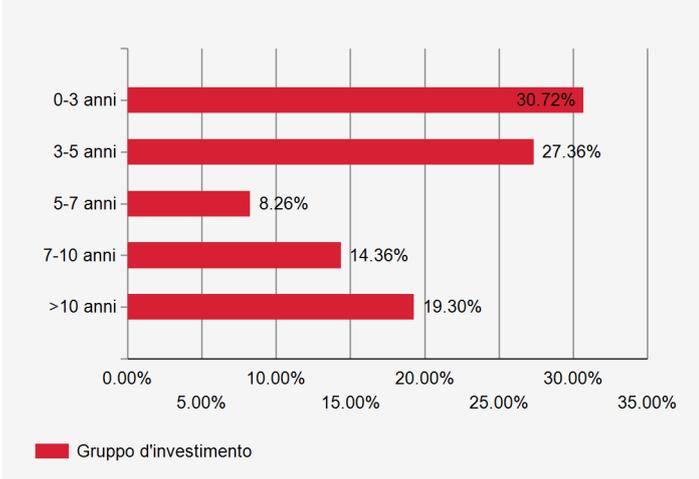
Principali debitori e rating

| | Gruppo d'investimento | |
|------------------------------|-----------------------|-------|
| Hyundai Motor Co | BBB+ | 1.95% |
| JPMorgan Chase & Co | A- | 1.92% |
| British American Tobacco PLC | BBB | 1.91% |
| Banco Santander SA, Madrid | BBB | 1.90% |
| Blackstone Inc | BBB | 1.85% |

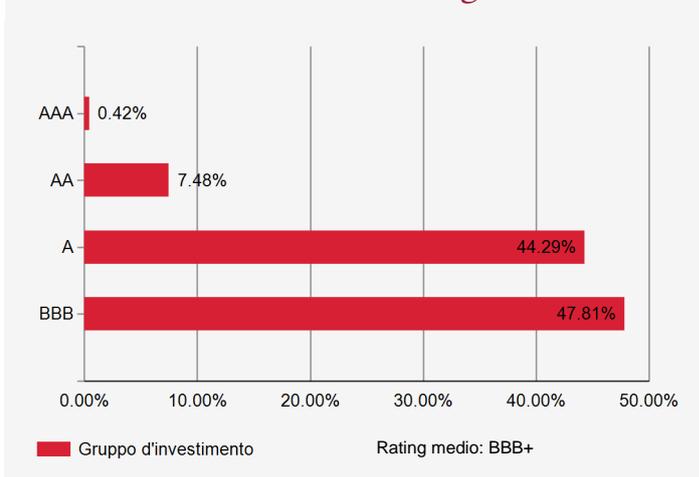
Ulteriori informazioni sui debitori

| | |
|-----------------------------------|-------|
| Numero di debitori | 189 |
| Quota di debitori senza benchmark | 4.64% |

Struttura della scadenza dei titoli



Investimenti secondo il rating



Durata e rendimento alla scadenza

| | Gruppo d'investimento | Benchmark |
|-----------------------------------|-----------------------|-----------|
| Modified Duration | 5.3 | 6.2 |
| Rendimento alla scadenza teorica* | 5.18% | 5.53% |

* prima copertura del rischio di cambio, prendendo in considerazione i derivati

Struttura del portafoglio per valute e la duration

| | Gruppo d'investimento | | Benchmark | |
|-------|-----------------------|----------|-----------|----------|
| | Peso | Duration | Peso | Duration |
| USD | 68.07% | 6.86 | 69.42% | 6.84 |
| EUR | 25.85% | 2.65 | 21.81% | 5.12 |
| JPY | 0.34% | 2.52 | 0.83% | 4.42 |
| Altri | 5.73% | 3.10 | 7.97% | 6.02 |

Struttura del portafoglio secondo il paese/regione

| | Gruppo d'investimento | Benchmark |
|---------------------------------|-----------------------|-----------|
| STATI UNITI | 41.62% | 55.51% |
| REGNO UNITO | 6.67% | 7.14% |
| GIAPPONE | 6.25% | 3.53% |
| FRANCIA | 5.98% | 5.94% |
| GERMANIA | 4.44% | 4.42% |
| CANADA | 3.99% | 5.48% |
| SPAGNA | 3.30% | 1.93% |
| REGIONE EUROPEA (EUR) | 8.16% | 5.65% |
| REGIONE EUROPEA (EX EUR) | 7.94% | 2.92% |
| MERCATI EMERGENTI ASIA PACIFICO | 3.63% | 2.20% |
| ALTRI | 3.36% | 5.28% |
| LIQUIDITÀ, COPERTURA | 4.66% | - |

Fondazione d'investimento Swiss Life

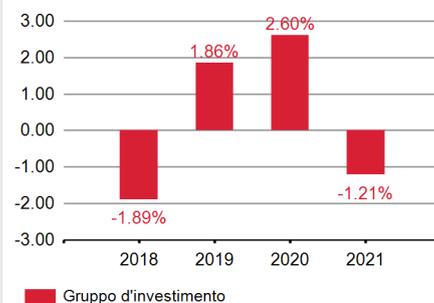
Obbligazioni Emerging Markets Short Term PM (CHF hedged)

Patrimonio netto (NAV) in mio. CHF: 203.25
Valore d'inventario netto per diritto in CHF: 93.80

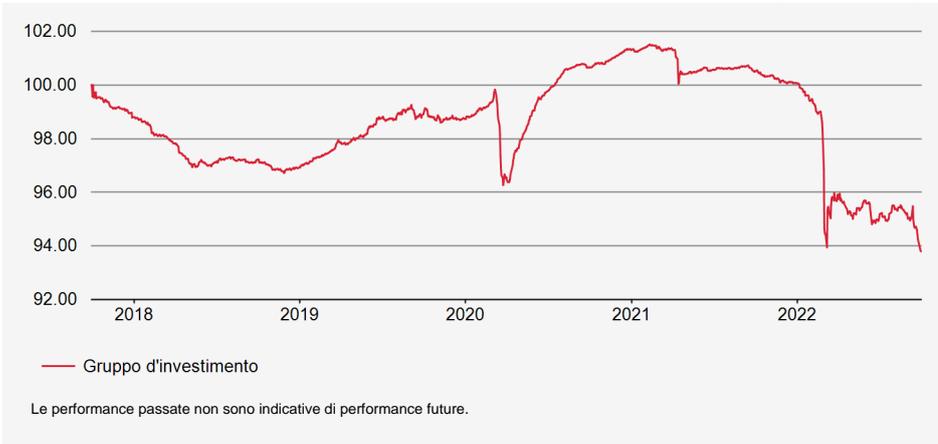
Strategia d'investimento

Investimenti in titoli di credito in dollari statunitensi o altre valute forti di imprese di Paesi di recente industrializzazione (Emerging Markets), inclusi agencies ed enti sovranazionali con una durata residua breve (prevalentemente meno di 3 anni). Selezione attiva di titoli, gestione della duration e posizionamento della curva dei tassi d'interesse. Limitazione per debitore: 10%. Rating medio: almeno BBB-. I rischi valutari vengono coperti al 90% almeno contro il franco. Realizzazione tramite Swiss Life Funds (LUX) Bond Emerging Markets Short Term CHF AM Cap; fondo d'investimento di diritto lussemburghese.

Performance



Evoluzione del valore nella valuta di riferimento (base 100)



Informazioni sul prodotto

Numero di valore: 38013685
ISIN: CH0380136850
LEI: 254900EGYJLGZXIT6O90
Codice Bloomberg: SLOSTPM SW
Moneta: CHF
Domicilio: Svizzera
Data di creazione: 29/09/2017
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®: Swiss Life Asset Management SA
Controllo asset manager: PPCmetrics supporta il controllo costante dell'asset manager e la valutazione dei risultati d'investimento.
Pubblicazioni di corsi: Bloomberg: ASSL
www.swisslife.ch/fondazioneinvestimento
Quote spese operative TER KGAST ex ante: 0.23%
ex post al: 30/09/2022 0.23%

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 | -6.27% | -1.40% | -1.34% | -6.67% | -1.75% | -1.27% | - | -1.27% |

Dati statistici (annualizzati)

| | 1 ANNO | 3 ANNI | 5 ANNI | 10 ANNI | INIZIO |
|---|--------|--------|--------|---------|--------|
| Volatilità Gruppo d'investimento (in %) | 2.94 | 2.92 | 2.36 | - | 2.34 |
| Sharpe Ratio | -2.16 | -0.39 | -0.24 | - | -0.23 |
| Maximum Drawdown (in %) | -6.71 | -7.60 | -7.60 | - | -7.60 |
| Recovery Period (anni) | - | - | - | - | - |

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.

Tracking error ex ante: Il tracking error previsto per i prossimi 12 mesi corrisponde al Tracking error ex post degli ultimi 3 anni.

Fondazione d'investimento Swiss Life

Obbligazioni Emerging Markets Short Term PM (CHF hedged)

Struttura del portafoglio per settore

| | Gruppo d'investimento |
|---------------------------------|-----------------------|
| FINANZA | 34.27% |
| STATI E SIMILI | 12.22% |
| ENERGIA | 10.16% |
| MATERIALI DI BASE | 7.87% |
| SERVIZI DI PUBBLICA UTILITÀ | 7.65% |
| COMUNICAZIONE | 5.75% |
| CONSUMO CICLICO | 4.11% |
| BENI INDUSTRIALI | 3.45% |
| SUPERNAZIONALE | 2.04% |
| ALTRI | 4.90% |
| LIQUIDITÀ | 9.89% |
| COPERTURA DEL RISCHIO DI CAMBIO | -2.32% |

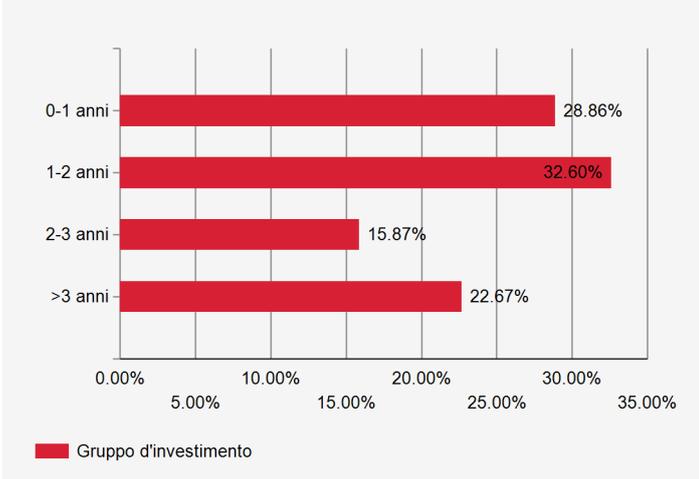
Principali debitori e rating

| | | Gruppo d'investimento |
|---|------|-----------------------|
| US Treasury N/B | AAA | 3.45% |
| Industrial & Commercial Bank of China Ltd | A | 3.38% |
| Ecopetrol SA | BB+ | 2.85% |
| Israel Electric Corp Ltd | BBB+ | 2.69% |
| Power Finance Corp Ltd | BBB- | 2.38% |

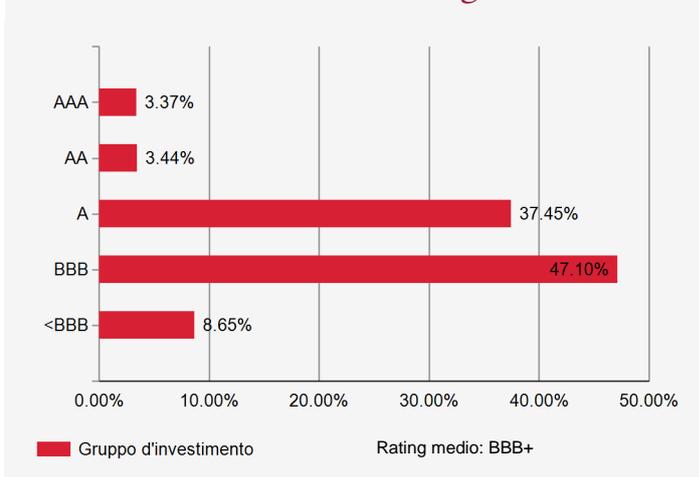
Ulteriori informazioni sui debitori

| | |
|--------------------|-----|
| Numero di debitori | 210 |
|--------------------|-----|

Struttura della scadenza dei titoli



Investimenti secondo il rating



Durata e rendimento alla scadenza

| | Gruppo d'investimento |
|-----------------------------------|-----------------------|
| Modified Duration | 1.8 |
| Rendimento alla scadenza teorica* | 5.63% |

* prima copertura del rischio di cambio, prendendo in considerazione i derivati

Struttura del portafoglio per valute e la duration

| | Gruppo d'investimento | |
|-----|-----------------------|----------|
| | Peso | Duration |
| USD | 100.00% | 1.76 |

Struttura del portafoglio secondo il paese/regione

| | Gruppo d'investimento |
|---------------------------------|-----------------------|
| CINA | 16.28% |
| INDIA | 8.86% |
| EMIRATI ARABI UNITI | 6.74% |
| CILE | 6.26% |
| STATI UNITI | 5.64% |
| COREA DEL SUD | 4.91% |
| QATAR | 4.64% |
| MERCATI EMERGENTI IN AMERICA | 12.72% |
| MERCATI EMERGENTI ASIA PACIFICO | 11.63% |
| MERCATI EMERGENTI MEDIO ORIENTE | 10.19% |
| ALTRI | 4.57% |
| LIQUIDITÀ, COPERTURA | 7.57% |

Fondazione d'investimento Swiss Life

Obbligazioni Emerging Markets Imprese PM (CHF hedged)

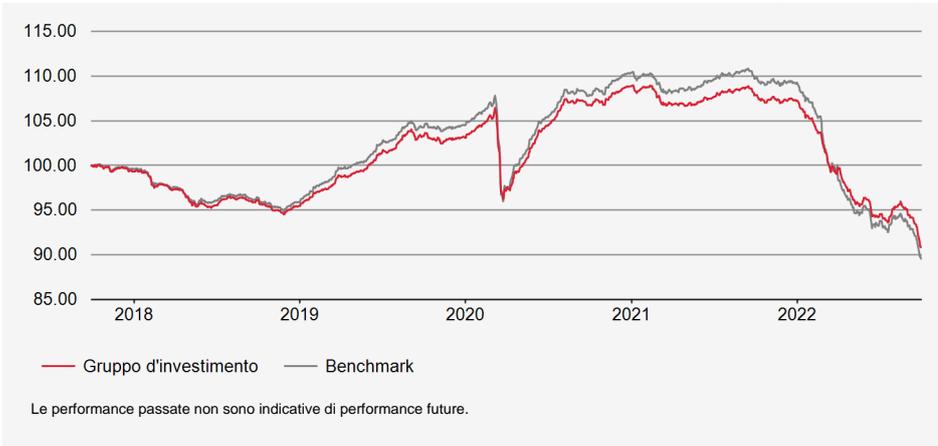

SwissLife

Patrimonio netto (NAV) in mio. CHF: 308.90
Valore d'inventario netto per diritto in CHF: 90.86

Strategia d'investimento

Investimenti in titoli di credito in dollari statunitensi o altre valute forti di imprese di Paesi di recente industrializzazione (Emerging Markets), inclusi agencies ed enti sovranazionali. Selezione attiva di titoli, gestione della duration e posizionamento della curva dei tassi d'interesse. Debitori esterni al benchmark: max. 20%. Limitazioni per debitore: 10%. Rating medio: almeno BBB. I rischi valutari vengono coperti al 90% almeno contro il franco. Realizzazione tramite du Swiss Life Funds (LUX) Bond Emerging Markets Corporates CHF AM Cap; fondo d'investimento di diritto lussemburghese.

Evoluzione del valore nella valuta di riferimento (base 100)



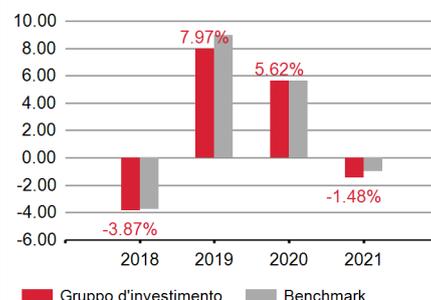
Performance nella valuta di riferimento

| | PERFORMANCE CUMULATA | | | | PERFORMANCE ANNUALIZZATA | | | |
|------------------------------|----------------------|--------|--------|---------|--------------------------|--------|---------|--------|
| | YTD | 1 MESE | 3 MESI | 1 ANNO | 3 ANNI | 5 ANNI | 10 ANNI | INIZIO |
| GRUPPO D'INVESTIMENTO | -15.31% | -4.21% | -3.67% | -15.75% | -4.19% | -1.90% | - | -1.90% |
| BENCHMARK | -18.02% | -4.25% | -4.21% | -18.36% | -4.93% | -2.17% | - | -2.17% |

Dati statistici (annualizzati)

| | 1 ANNO | 3 ANNI | 5 ANNI | 10 ANNI | INIZIO |
|---|--------|--------|--------|---------|--------|
| Volatilità Gruppo d'investimento (in %) | 5.58 | 6.89 | 5.69 | - | 5.64 |
| Volatilità del Benchmark (in %) | 6.38 | 7.83 | 6.40 | - | 6.35 |
| Tracking Error ex post (in %) | 2.05 | 1.54 | 1.25 | - | 1.24 |
| Information Ratio | 1.27 | 0.48 | 0.22 | - | 0.22 |
| Sharpe Ratio | -2.97 | -0.53 | -0.21 | - | -0.21 |
| Correlazione | 0.95 | 0.99 | 0.99 | - | 0.99 |
| Beta | 0.83 | 0.87 | 0.88 | - | 0.88 |
| Jensen alfa | -0.39 | 0.17 | 0.10 | - | 0.10 |
| Maximum Drawdown (in %) | -15.78 | -16.61 | -16.61 | - | -16.61 |
| Recovery Period (anni) | - | - | - | - | - |

Performance



Informazioni sul prodotto

Numero di valore: 36974878
ISIN: CH0369748782
LEI: 254900R4DORKK6JJUG51
Codice Bloomberg: SLOEMPM SW
Benchmark: JP Morgan CEMBI Broad Diversified IG Index (CHF Hedged)
Moneta: CHF
Domicilio: Svizzera
Data di creazione: 29/09/2017
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@: Swiss Life Asset Management SA

Controllo asset manager: PPCmetrics supporta il controllo costante dell'asset manager e la valutazione dei risultati d'investimento.

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

Quote spese operative TER KGAST ex ante: 0.23%
ex post al: 30/09/2022 0.23%

PM tranches: 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.

Tracking error ex ante: Il tracking error previsto per i prossimi 12 mesi corrisponde al Tracking error ex post degli ultimi 3 anni.

Fondazione d'investimento Swiss Life

Obbligazioni Emerging Markets Imprese PM (CHF hedged)

Struttura del portafoglio per settore

| | Gruppo d'investimento | Benchmark |
|---------------------------------|-----------------------|-----------|
| FINANZA | 30.02% | 38.22% |
| SERVIZI DI PUBBLICA UTILITÀ | 15.54% | 12.42% |
| ENERGIA | 13.34% | 10.70% |
| MATERIALI DI BASE | 8.69% | 9.34% |
| COMUNICAZIONE | 7.99% | 8.04% |
| BENI INDUSTRIALI | 5.63% | 4.06% |
| TECNOLOGIA | 4.99% | 5.27% |
| CONSUMO CICLICO | 4.70% | 2.18% |
| SUPERNAZIONALE | 3.51% | - |
| ALTRI | 7.73% | 9.77% |
| LIQUIDITÀ | 0.16% | - |
| COPERTURA DEL RISCHIO DI CAMBIO | -2.30% | - |

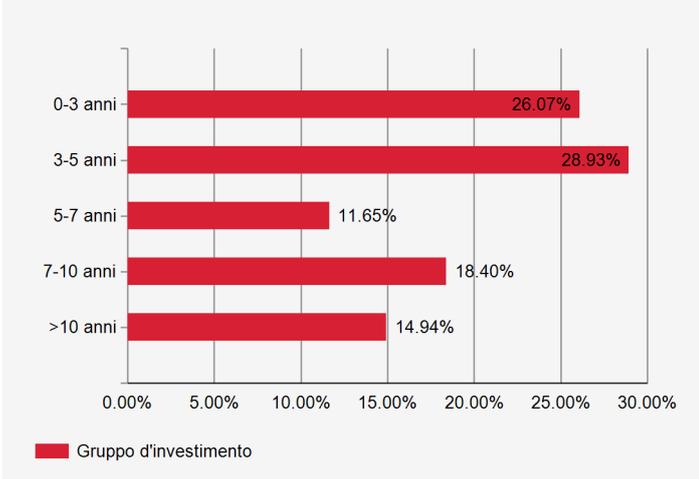
Principali debitori e rating

| | | Gruppo d'investimento |
|---|------|-----------------------|
| Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd | AA- | 3.67% |
| Saudi Arabian Oil Co | A- | 2.00% |
| Commercial Bank PSQC/The | A- | 1.73% |
| United Overseas Bank Ltd | BBB+ | 1.66% |
| Bangkok Bank PCL | BBB | 1.63% |

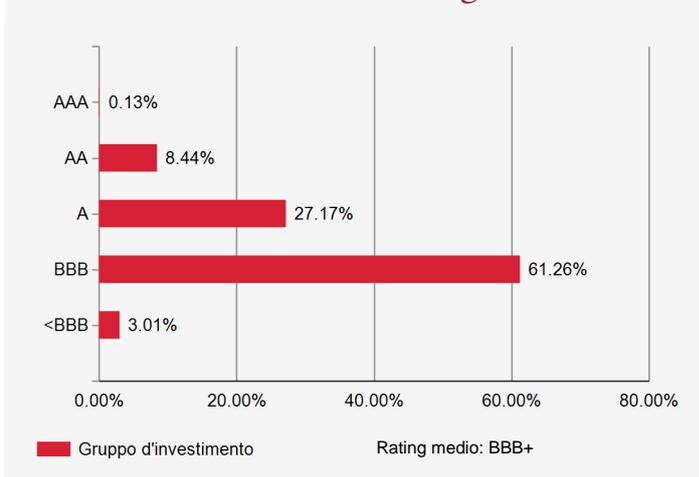
Ulteriori informazioni sui debitori

| | |
|-----------------------------------|-------|
| Numero di debitori | 210 |
| Quota di debitori senza benchmark | 9.94% |

Struttura della scadenza dei titoli



Investimenti secondo il rating



Durata e rendimento alla scadenza

| | Gruppo d'investimento | Benchmark |
|-----------------------------------|-----------------------|-----------|
| Modified Duration | 4.7 | 4.7 |
| Rendimento alla scadenza teorica* | 6.03% | 6.17% |

* prima copertura del rischio di cambio, prendendo in considerazione i derivati

Struttura del portafoglio per valute e la duration

| | Gruppo d'investimento | | Benchmark | |
|-----|-----------------------|----------|-----------|----------|
| | Peso | Duration | Peso | Duration |
| USD | 100.00% | 4.71 | 100.00% | 4.99 |

Struttura del portafoglio secondo il paese/regione

| | Gruppo d'investimento | Benchmark |
|---------------------------------|-----------------------|-----------|
| CINA | 11.72% | 11.98% |
| INDIA | 7.68% | 4.64% |
| COREA DEL SUD | 7.22% | 7.51% |
| QATAR | 6.74% | 6.04% |
| EMIRATI ARABI UNITI | 6.34% | 5.37% |
| TAILANDIA | 5.94% | 4.63% |
| CILE | 5.75% | 3.94% |
| MERCATI EMERGENTI ASIA PACIFICO | 20.09% | 22.29% |
| MERCATI EMERGENTI IN AMERICA | 10.44% | 13.19% |
| MERCATI EMERGENTI MEDIO ORIENTE | 8.72% | 10.33% |
| ALTRI | 11.49% | 10.08% |
| LIQUIDITÀ, COPERTURA | -2.14% | - |

Fondazione d'investimento Swiss Life

Azioni Svizzera PM

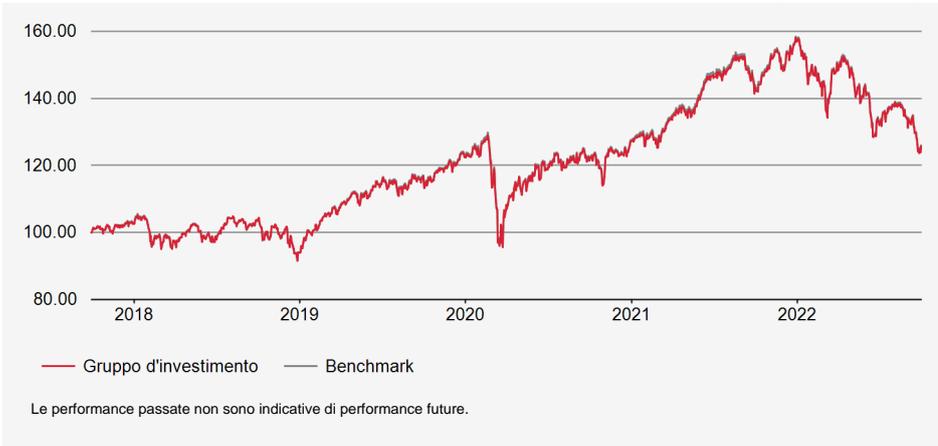


Patrimonio netto (NAV) in mio. CHF: 397.68
Valore d'inventario netto per diritto in CHF: 164.50

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".

Evoluzione del valore nella valuta di riferimento (base 100)



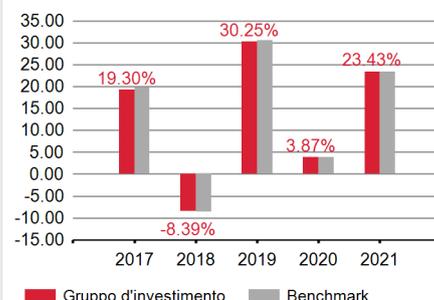
Performance nella valuta di riferimento

| | PERFORMANCE CUMULATA | | | | PERFORMANCE ANNUALIZZATA | | | |
|------------------------------|----------------------|---------------|---------------|----------------|--------------------------|--------------|--------------|--------------|
| | YTD | 1 MESE | 3 MESI | 1 ANNO | 3 ANNI | 5 ANNI | 10 ANNI | INIZIO |
| GRUPPO D'INVESTIMENTO | -19.90% | -5.98% | -4.78% | -12.16% | 2.50% | 4.68% | 8.01% | 3.30% |
| BENCHMARK | -19.93% | -5.98% | -4.83% | -12.48% | 2.48% | 4.73% | 8.15% | 3.57% |

Dati statistici (annualizzati)

| | 1 ANNO | 3 ANNI | 5 ANNI | 10 ANNI | INIZIO |
|---|--------|--------|--------|---------|--------|
| Volatilità Gruppo d'investimento (in %) | 15.52 | 14.22 | 12.92 | 11.86 | 13.08 |
| Volatilità del Benchmark (in %) | 15.50 | 14.28 | 12.97 | 11.90 | 13.07 |
| Tracking Error ex post (in %) | 0.34 | 0.32 | 0.31 | 0.30 | 0.70 |
| Information Ratio | 0.95 | 0.08 | -0.16 | -0.46 | -0.39 |
| Sharpe Ratio | -0.80 | 0.22 | 0.41 | 0.70 | 0.26 |
| Correlazione | 1.00 | 1.00 | 1.00 | 1.00 | 1.00 |
| Beta | 1.00 | 1.00 | 1.00 | 1.00 | 1.00 |
| Jensen alfa | 0.33 | 0.04 | -0.03 | -0.11 | -0.27 |
| Maximum Drawdown (in %) | -21.74 | -25.86 | -25.86 | -25.86 | -54.13 |
| Recovery Period (anni) | - | 0.83 | 0.83 | 0.83 | 4.84 |

Performance



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/fondazioneinvestimento

Quote spese operative TER KGAST ex ante: 0.30%
ex post al: 30/09/2022 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 logaritmicizzati mensili.

Struttura del portafoglio per settore

| | Gruppo d'investimento | Benchmark |
|-----------------------------|-----------------------|-----------|
| SALUTE | 35.61% | 36.72% |
| GENERI DI CONSUMO | 27.15% | 27.61% |
| INDUSTRIE | 15.15% | 14.00% |
| FINANZA | 14.59% | 16.39% |
| MATERIALI DI BASE | 2.34% | 2.33% |
| TECNOLOGIA | 1.68% | 1.26% |
| TELECOMUNICAZIONI | 0.84% | 0.95% |
| SERVIZI PER IL CONSUMATORE | 0.69% | 0.55% |
| SERVIZI DI PUBBLICA UTILITÀ | 0.45% | 0.19% |
| PETROLIO E GAS | - | - |
| LIQUIDITÀ | 1.51% | - |

Le principali posizioni

| | Gruppo d'investimento | Benchmark |
|------------------------------|-----------------------|-----------|
| NESTLE SA-REG | 20.91% | 21.26% |
| ROCHE HOLDING AG | 16.14% | 16.40% |
| NOVARTIS AG-REG | 12.25% | 12.45% |
| ZURICH INSURANCE GROUP AG | 4.22% | 4.29% |
| CIE FINANCIERE RICHEMONT-REG | 3.50% | 3.55% |
| UBS GROUP AG-REG | 3.35% | 3.40% |
| ABB LTD-REG | 2.98% | 3.03% |
| LONZA GROUP AG-REG | 2.57% | 2.61% |
| SIKA AG | 2.19% | 2.23% |
| ALCON INC | 2.06% | 2.10% |

Struttura del portafoglio in base al volume dell'impresa

| | Gruppo d'investimento | | Benchmark | |
|-----------------|-----------------------|--------|-----------|--------|
| | Partecip. | Numero | Partecip. | Numero |
| Grandi imprese | 81.48% | 20 | 82.66% | 20 |
| Medie imprese | 16.05% | 48 | 15.52% | 79 |
| Liquidity | 1.28% | - | - | - |
| Piccole imprese | 0.97% | 6 | 1.82% | 120 |

Fondazione d'investimento Swiss Life

Azioni Svizzera Large Caps Indicizzate PM

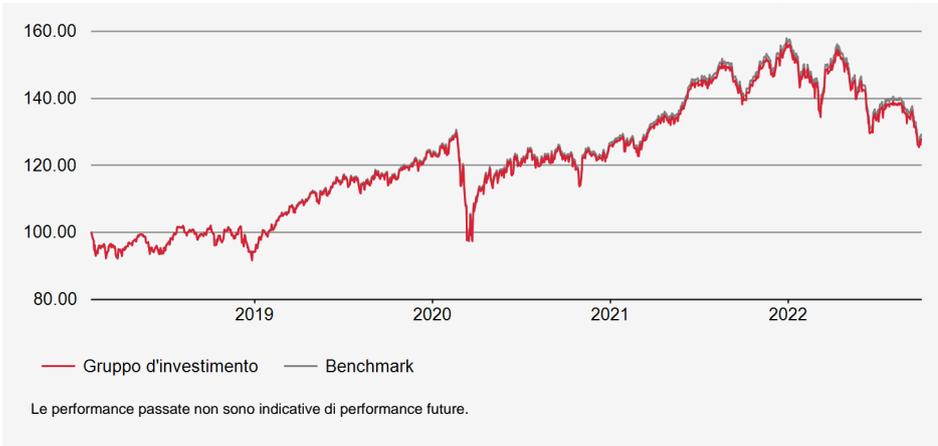


Patrimonio netto (NAV) in mio. CHF: 380.13
Valore d'inventario netto per diritto in CHF: 127.87

Strategia d'investimento

Investimenti in titoli di partecipazione di società rappresentate allo SPI 20. Implementazione indicizzata, l'indice di riferimento viene interamente riprodotto ("full replication"). La ponderazione di ogni singola società deve discostarsi al massimo di +/- 0,5 punti percentuali dalla ponderazione del benchmark. Realizzazione tramite Swiss Life iFunds (CH) Equity Switzerland (CHF); Fondi d'investimento di diritto svizzero della categoria "altri fondi per investimenti tradizionali".

Evoluzione del valore nella valuta di riferimento (base 100)



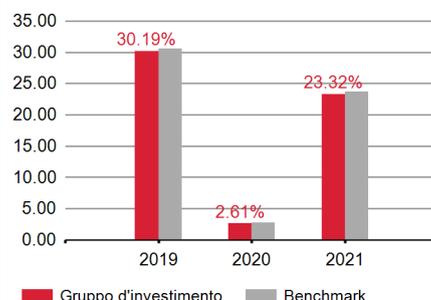
Performance nella valuta di riferimento

| | PERFORMANCE CUMULATA | | | | PERFORMANCE ANNUALIZZATA | | | |
|------------------------------|----------------------|--------|--------|--------|--------------------------|--------|---------|--------|
| | YTD | 1 MESE | 3 MESI | 1 ANNO | 3 ANNI | 5 ANNI | 10 ANNI | INIZIO |
| GRUPPO D'INVESTIMENTO | -17.64% | -5.23% | -4.15% | -8.85% | 2.80% | - | - | 5.41% |
| BENCHMARK | -17.54% | -5.22% | -4.10% | -8.67% | 3.03% | - | - | 5.65% |

Dati statistici (annualizzati)

| | 1 ANNO | 3 ANNI | 5 ANNI | 10 ANNI | INIZIO |
|---|--------|--------|--------|---------|--------|
| Volatilità Gruppo d'investimento (in %) | 15.09 | 13.69 | - | - | 12.99 |
| Volatilità del Benchmark (in %) | 15.14 | 13.74 | - | - | 13.04 |
| Tracking Error ex post (in %) | 0.06 | 0.07 | - | - | 0.07 |
| Information Ratio | -3.01 | -3.35 | - | - | -3.41 |
| Sharpe Ratio | -0.58 | 0.25 | - | - | 0.45 |
| Correlazione | 1.00 | 1.00 | - | - | 1.00 |
| Beta | 1.00 | 1.00 | - | - | 1.00 |
| Jensen alfa | -0.20 | -0.22 | - | - | -0.22 |
| Maximum Drawdown (in %) | -19.80 | -25.03 | - | - | -25.03 |
| Recovery Period (anni) | - | 1.00 | - | - | 1.00 |

Performance



Informazioni sul prodotto

Numero di valore: 39561886
ISIN: CH0395618868
LEI: 254900P0FZIREAGSUQ60
Codice Bloomberg: SLASLPM SW
Benchmark: SPI 20 Total Return®
Moneta: CHF
Domicilio: Svizzera
Data di creazione: 31/01/2018
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®: Pictet Asset Management AG
Consulenza esterna: PPCmetrics fornisce i seguenti servizi: consulenza sulla struttura idonea del mandato, 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
Quote spese operative TER KGAST ex ante: 0.20%
ex post al: 30/09/2022 0.20%

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.

Fondazione d'investimento Swiss Life

Azioni Svizzera Large Caps Indicizzate PM



Struttura del portafoglio per settore

| | Gruppo d'investimento | Benchmark |
|-----------------------------|-----------------------|-----------|
| SALUTE | 41.58% | 41.59% |
| GENERI DI CONSUMO | 30.06% | 30.07% |
| FINANZA | 14.83% | 14.83% |
| INDUSTRIE | 9.73% | 9.73% |
| MATERIALI DI BASE | 2.09% | 2.09% |
| TELECOMUNICAZIONI | 1.03% | 1.03% |
| TECNOLOGIA | 0.66% | 0.66% |
| SERVIZI PER IL CONSUMATORE | - | - |
| PETROLIO E GAS | - | - |
| SERVIZI DI PUBBLICA UTILITÀ | - | - |
| LIQUIDITÀ | 0.03% | - |

Le principali posizioni

| | Gruppo d'investimento | Benchmark |
|------------------------------|-----------------------|-----------|
| NESTLE SA-REG | 25.75% | 25.76% |
| ROCHE HOLDING AG | 19.87% | 19.88% |
| NOVARTIS AG-REG | 15.08% | 15.09% |
| ZURICH INSURANCE GROUP AG | 5.20% | 5.20% |
| CIE FINANCIERE RICHEMONT-REG | 4.30% | 4.31% |
| UBS GROUP AG-REG | 4.12% | 4.13% |
| ABB LTD-REG | 3.67% | 3.67% |
| LONZA GROUP AG-REG | 3.17% | 3.17% |
| SIKA AG | 2.70% | 2.70% |
| ALCON INC | 2.54% | 2.54% |

Struttura del portafoglio in base al volume dell'impresa

| | Gruppo d'investimento | | Benchmark | |
|-----------------|-----------------------|--------|-----------|--------|
| | Partecip. | Numero | Partecip. | Numero |
| Grandi imprese | 98.28% | 18 | 98.31% | 18 |
| Medie imprese | 1.69% | 2 | 1.69% | 2 |
| Piccole imprese | - | - | - | - |
| Liquidità | 0.03% | - | - | - |

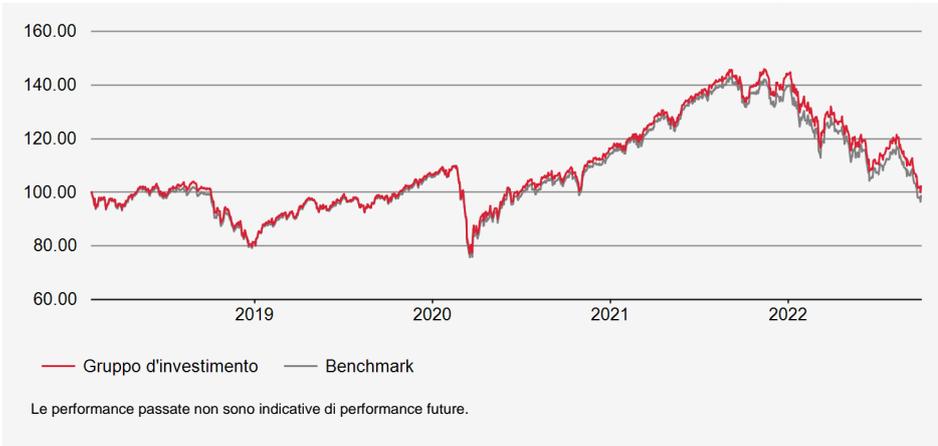
Fondazione d'investimento Swiss Life Azioni Svizzera Small & Mid Caps PM

Patrimonio netto (NAV) in mio. CHF: 89.53
Valore d'inventario netto per diritto in CHF: 102.35

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); Fondi d'investimento di diritto svizzero della categoria "altri fondi per investimenti tradizionali".

Evoluzione del valore nella valuta di riferimento (base 100)



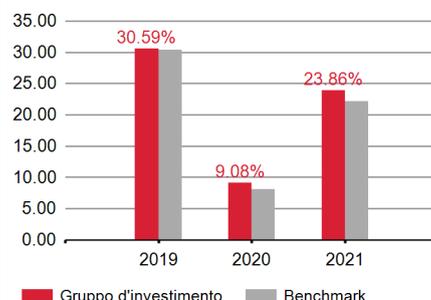
Performance nella valuta di riferimento

| | PERFORMANCE CUMULATA | | | | PERFORMANCE ANNUALIZZATA | | | |
|------------------------------|----------------------|--------|--------|---------|--------------------------|--------|---------|--------|
| | YTD | 1 MESE | 3 MESI | 1 ANNO | 3 ANNI | 5 ANNI | 10 ANNI | INIZIO |
| GRUPPO D'INVESTIMENTO | -28.82% | -9.18% | -7.52% | -24.64% | 1.19% | - | - | 0.50% |
| BENCHMARK | -29.20% | -9.17% | -7.90% | -26.38% | 0.21% | - | - | -0.27% |

Dati statistici (annualizzati)

| | 1 ANNO | 3 ANNI | 5 ANNI | 10 ANNI | INIZIO |
|---|--------|--------|--------|---------|--------|
| Volatilità Gruppo d'investimento (in %) | 18.71 | 18.15 | - | - | 16.78 |
| Volatilità del Benchmark (in %) | 18.36 | 18.35 | - | - | 16.80 |
| Tracking Error ex post (in %) | 1.63 | 1.53 | - | - | 1.47 |
| Information Ratio | 1.06 | 0.65 | - | - | 0.51 |
| Sharpe Ratio | -1.48 | 0.10 | - | - | 0.07 |
| Correlazione | 1.00 | 1.00 | - | - | 1.00 |
| Beta | 1.02 | 0.99 | - | - | 1.00 |
| Jensen alfa | 2.12 | 1.00 | - | - | 0.77 |
| Maximum Drawdown (in %) | -31.46 | -31.46 | - | - | -31.46 |
| Recovery Period (anni) | - | - | - | - | - |

Performance



Informazioni sul prodotto

Numero di valore: 39561897
ISIN: CH0395618975
LEI: 254900QGENUS1GIJ4549
Codice Bloomberg: SWLSMPM SW
Benchmark: SPI Extra TR Index (CHF)
Moneta: CHF
Domicilio: Svizzera
Data di creazione: 31/01/2018
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®: Privatbank Von Graffenried AG
Consulenza esterna: PPCmetrics fornisce i seguenti servizi: consulenza sulla struttura idonea del mandato, 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
Quote spese operative TER KGAST ex ante: 0.72%
ex post al: 30/09/2022 0.72%

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 |
|-----------------------------|-----------------------|-----------|
| INDUSTRIE | 39.02% | 34.12% |
| GENERI DI CONSUMO | 14.76% | 16.04% |
| FINANZA | 13.75% | 23.78% |
| SALUTE | 9.92% | 13.73% |
| TECNOLOGIA | 6.18% | 4.08% |
| SERVIZI PER IL CONSUMATORE | 3.69% | 3.16% |
| MATERIALI DI BASE | 3.44% | 3.45% |
| SERVIZI DI PUBBLICA UTILITÀ | 2.43% | 1.06% |
| PETROLIO E GAS | - | - |
| TELECOMUNICAZIONI | - | 0.59% |
| LIQUIDITÀ | 6.80% | - |

Le principali posizioni

| | Gruppo d'investimento | Benchmark |
|---------------------------------|-----------------------|-----------|
| LINDT & SPRUNGLI | 6.19% | 3.76% |
| SGS SA | 4.81% | 4.87% |
| KUEHNE + NAGEL INTERNATIONAL AG | 4.72% | 4.34% |
| JULIUS BAER GROUP LTD | 4.26% | 3.52% |
| STRAUMANN HOLDING AG | 4.14% | 3.93% |
| SCHINDLER HOLDING AG | 3.56% | 2.38% |
| BARRY CALLEBAUT AG | 3.17% | 2.52% |
| VAT GROUP AG | 2.88% | 2.07% |
| BALOISE HOLDING AG | 2.85% | 2.20% |
| SIG GROUP AG | 2.79% | 2.65% |

Struttura del portafoglio in base al volume dell'impresa

| | Gruppo d'investimento | | Benchmark | |
|-----------------|-----------------------|--------|-----------|--------|
| | Partecip. | Numero | Partecip. | Numero |
| Grandi imprese | 8.95% | 2 | 8.80% | 2 |
| Medie imprese | 79.03% | 46 | 80.77% | 77 |
| Piccole imprese | 5.22% | 6 | 10.42% | 120 |
| Liquidità | 6.80% | - | - | - |

30 settembre 2022

Fondazione d'investimento Swiss Life Azioni Svizzera Protect Flex PM

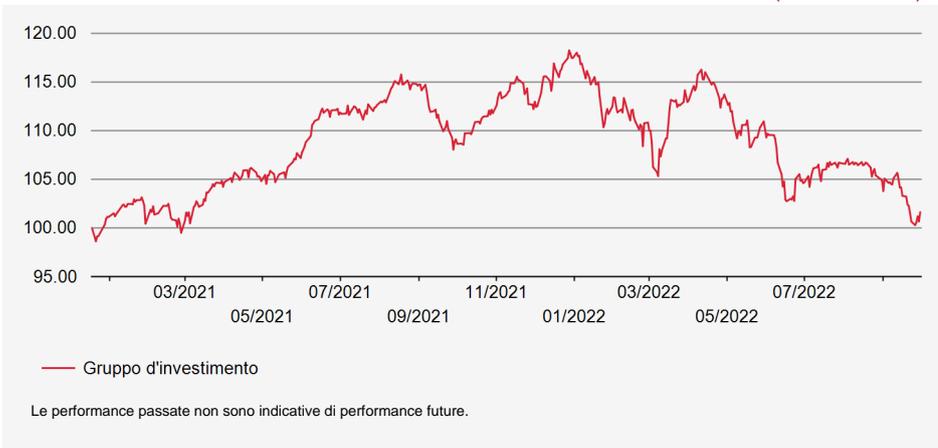


Patrimonio netto (NAV) in mio. CHF: 154.18
Valore d'inventario netto per diritto in CHF: 101.66

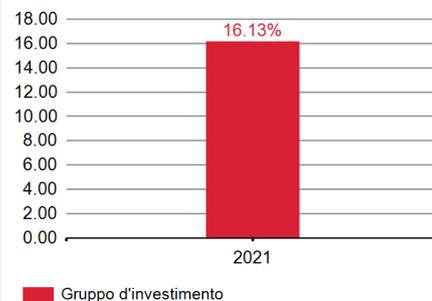
Strategia d'investimento

Strategia d'investimento indicizzata SMI con strategia di copertura delle opzioni a gestione attiva. L'universo d'investimento del gruppo d'investimento è composto da società dello SMI; ponderato per la capitalizzazione di mercato. Gli investimenti possono essere effettuati sotto forma di titoli di partecipazione, investimenti collettivi o strumenti derivati. L'impiego complementare di una strategia di copertura composta da opzioni determina, in caso di forte ribasso dei mercati, una riduzione delle perdite sulle quotazioni e, in caso di forte rialzo dei mercati, una limitazione del potenziale di crescita. A seconda della valutazione del mercato è possibile rinunciare alla vendita dell'opzione put e/o dell'opzione call. Realizzazione tramite SLF (CH) Equity Switzerland Protect Enhanced.

Evoluzione del valore nella valuta di riferimento (base 100)



Performance



Informazioni sul prodotto

Numero di valore: 58002364
ISIN: CH0580023643
LEI: 254900ZUTROYHLYQ4E86
Codice Bloomberg: SLSPFPM SW
Moneta: CHF
Domicilio: Svizzera
Data di creazione: 18/12/2020
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 Asset Management SA
Pubblicazioni di corsi: Bloomberg: ASSL
www.swisslife.ch/fondazioneinvestimento
Quote spese operative TER KGAST ex ante: 0.16%
ex post al: 30/09/2022 0.16%

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 | -13.47% | -3.06% | -2.83% | -6.84% | - | - | - | 0.93% |

Dati statistici (annualizzati)

| | 1 ANNO | 3 ANNI | 5 ANNI | 10 ANNI | INIZIO |
|---|--------|--------|--------|---------|--------|
| Volatilità Gruppo d'investimento (in %) | 10.51 | - | - | - | 10.13 |
| Sharpe Ratio | -0.62 | - | - | - | 0.14 |
| Maximum Drawdown (in %) | -15.16 | - | - | - | -15.16 |
| Recovery Period (anni) | - | - | - | - | - |

PM tranche: L'acquisto di questa tranche è possibile solo nell'ambito di un accordo speciale con Swiss Life Asset Management SA.

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.

Tracking error ex ante: Il tracking error previsto per i prossimi 12 mesi corrisponde al Tracking error ex post degli ultimi 3 anni.

Struttura del portafoglio per settore

| | Gruppo d'investimento |
|------------------------------|-----------------------|
| SALUTE | 37.75% |
| BENI DI PRIMA NECESSITÀ | 15.86% |
| FINANZA | 14.66% |
| MATERIALI | 6.73% |
| INDUSTRIE | 4.95% |
| BENI VOLUTTUARI | 4.26% |
| FUTURE SU INDICE AZIONARIO | 1.61% |
| SERVIZI DI COMUNICAZIONE | 1.02% |
| TECNOLOGIA DELL'INFORMAZIONE | 0.65% |
| LIQUIDITÀ / PRESTITO | 12.50% |

Le principali posizioni

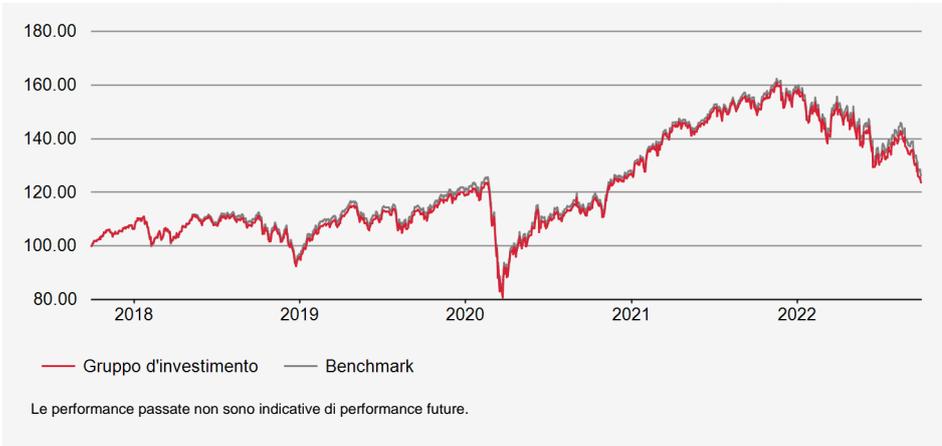
| | Gruppo d'investimento |
|------------------------------|-----------------------|
| ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN | 16.29% |
| NESTLE SA-REG | 15.86% |
| NOVARTIS AG-REG | 14.91% |
| ZURICH INSURANCE GROUP AG | 5.14% |
| CIE FINANCIERE RICHEMO-A REG | 4.26% |
| UBS GROUP AG-REG | 4.08% |
| ABB LTD-REG | 3.63% |
| LONZA GROUP AG-REG | 3.13% |
| SIKA AG-REG | 2.67% |
| ALCON INC | 2.51% |

Patrimonio netto (NAV) in mio. CHF: 295.68
Valore d'inventario netto per diritto in CHF: 143.20

Strategia d'investimento

Investimenti in titoli di partecipazione di società con domicilio all'estero. La copertura per i Large & Mid Caps è passiva, gli Small Caps e il settore dei mercati emergenti (Emerging Markets) vengono gestiti attivamente (core satellite). Limitazione per società: 5% (eccezione: se la ponderazione è superiore al 5% nell'indice; allora 10% massimo). Società straniere al benchmark: max. 10%. Realizzazione tramite Swiss Life iFunds (CH) Equity ESG Global ex Switzerland (CHF), Invesco Global Small Cap Equity Fund, Dimensional Global Small Cap Equity Fund e fondo Candriam Sustainable Equity Emerging Markets.

Evoluzione del valore nella valuta di riferimento (base 100)



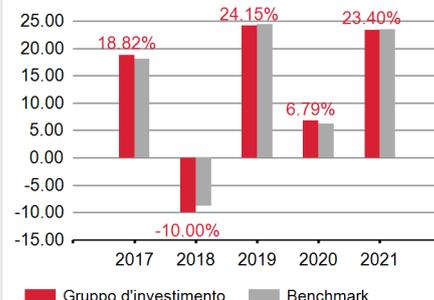
Performance nella valuta di riferimento

| | PERFORMANCE CUMULATA | | | | PERFORMANCE ANNUALIZZATA | | | |
|------------------------------|----------------------|---------------|---------------|----------------|--------------------------|--------------|--------------|--------------|
| | YTD | 1 MESE | 3 MESI | 1 ANNO | 3 ANNI | 5 ANNI | 10 ANNI | INIZIO |
| GRUPPO D'INVESTIMENTO | -21.10% | -8.73% | -5.10% | -18.06% | 3.18% | 4.33% | 7.78% | 2.37% |
| BENCHMARK | -20.13% | -8.80% | -4.74% | -17.05% | 3.45% | 4.78% | 8.15% | 2.86% |

Dati statistici (annualizzati)

| | 1 ANNO | 3 ANNI | 5 ANNI | 10 ANNI | INIZIO |
|---|--------|--------|--------|---------|--------|
| Volatilità Gruppo d'investimento (in %) | 15.91 | 18.62 | 16.79 | 14.17 | 16.11 |
| Volatilità del Benchmark (in %) | 16.01 | 18.58 | 16.73 | 14.13 | 16.12 |
| Tracking Error ex post (in %) | 0.36 | 0.48 | 0.54 | 0.66 | 0.96 |
| Information Ratio | -2.84 | -0.55 | -0.83 | -0.57 | -0.52 |
| Sharpe Ratio | -1.22 | 0.20 | 0.30 | 0.57 | 0.15 |
| Correlazione | 1.00 | 1.00 | 1.00 | 1.00 | 1.00 |
| Beta | 0.99 | 1.00 | 1.00 | 1.00 | 1.00 |
| Jensen alfa | -1.11 | -0.27 | -0.47 | -0.39 | -0.49 |
| Maximum Drawdown (in %) | -23.15 | -34.64 | -34.64 | -34.64 | -59.96 |
| Recovery Period (anni) | - | 0.67 | 0.67 | 0.67 | 7.75 |

Performance



Informazioni sul prodotto

Numero di valore: 3026051
ISIN: CH0030260514
LEI: 2549000B6X3SG0K4LZ68
Codice Bloomberg: SLAAUPM SW
Benchmark: 80% MSCI World ex CH ESG Leaders, 15% MSCI AC World Small Cap in CHF, 5% MSCI Emerging Markets in CHF
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&Mid Caps (passivo)
 UBS SA
Small Caps (attivo)
 50% Invesco / 50% Dimensional
Emerging Markets (attivo)
 Candriam Investors Group
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
Quote spese operative TER KGAST
ex ante: 0.37%
ex post al: 30/09/2022 0.37%

PM tranche: L'acquisto di questa tranche è possibile solo nell'ambito di un accordo speciale con Swiss Life Asset Management SA.

Benchmark: Fino al 31.03.2022 80% MSCI World ex CH in CHF, 15% MSCI AC World Small Cap in CHF, 5% MSCI Emerging Markets in CHF - Fino al 31.12.2009 100% MSCI World, ex CH, in CHF.

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.

Tracking error ex ante: Il tracking error previsto per i prossimi 12 mesi corrisponde al Tracking error ex post degli ultimi 3 anni.

Struttura del portafoglio per settore

| | Gruppo d'investimento | Benchmark |
|------------------------------|-----------------------|-----------|
| TECNOLOGIA DELL'INFORMAZIONE | 19.64% | 19.83% |
| FINANZA | 14.81% | 14.59% |
| SALUTE | 13.34% | 13.25% |
| BENI VOLUTTUARI | 11.82% | 11.56% |
| INDUSTRIE | 11.52% | 11.12% |
| SERVIZI DI TELECOMUNICAZIONE | 7.68% | 7.67% |
| BENI DI PRIMA NECESSITÀ | 7.00% | 7.30% |
| MATERIALI | 4.72% | 5.07% |
| ENERGIA | 3.41% | 3.74% |
| IMMOBILI | 3.19% | 3.75% |
| SERVIZI DI PUBBLICA UTILITÀ | 1.92% | 2.12% |
| LIQUIDITÀ | 0.96% | - |

Struttura del portafoglio secondo il paese/regione

| | Gruppo d'investimento | Benchmark |
|-------------------|-----------------------|-----------|
| USA | 65.55% | 65.50% |
| GIAPPONE | 6.50% | 6.74% |
| GRAN BRETAGNA | 4.28% | 4.25% |
| CANADA | 3.35% | 3.53% |
| FRANCIA | 2.64% | 2.55% |
| GERMANIA | 1.59% | 1.53% |
| RESTO DELL'EUROPA | 6.58% | 6.20% |
| ALTRI PAESI ASIA | 6.32% | 7.06% |
| ALTRI | 2.24% | 2.64% |
| LIQUIDITÀ | 0.96% | - |

Le principali posizioni

| | Gruppo d'investimento | Benchmark |
|------------------------|-----------------------|-----------|
| MICROSOFT CORP. | 5.98% | 5.97% |
| ALPHABET INC | 4.04% | 4.03% |
| TESLA INC | 2.53% | 2.53% |
| JOHNSON & JOHNSON | 1.55% | 1.55% |
| NVIDIA | 1.09% | 1.10% |
| PROCTER & GAMBLE | 1.09% | 1.09% |
| VISA INC | 1.06% | 1.06% |
| HOME DEPOT | 1.02% | 1.02% |
| ELI LILLY & CO. | 0.94% | 0.94% |
| MASTERCARD INC-CLASS A | 0.89% | 0.89% |

Ulteriori informazioni sulle società

| | |
|----------------------------------|-------|
| Numero di società | 7,526 |
| Quota di società senza benchmark | 3.90% |

30 settembre 2022

Fondazione d'investimento Swiss Life

Azioni Estero ESG Indicizzate PM



Patrimonio netto (NAV) in mio. CHF: 142.35
Valore d'inventario netto per diritto in CHF: 83.08

Strategia d'investimento

Investimenti in titoli di partecipazione di società comprese nell'MSCI World ex Switzerland ESG Leaders, in CHF. Sono ammessi anche titoli di partecipazione di società che, a seguito degli adeguamenti del benchmark, non sono ancora o non sono più comprese nel benchmark (variazione max. +0,5 punti percentuali). Attuazione tramite Swiss Life iFunds (CH) Equity ESG Global ex Switzerland (CHF).

Evoluzione del valore nella valuta di riferimento (base 100)



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 | - | -8.56% | -5.05% | - | - | - | - | - |
| BENCHMARK | - | -8.54% | -4.89% | - | - | - | - | - |

Dati statistici (annualizzati)

| | 1 ANNO | 3 ANNI | 5 ANNI | 10 ANNI | INIZIO |
|---|--------|--------|--------|---------|--------|
| Volatilità Gruppo d'investimento (in %) | - | - | - | - | 18.28 |
| Volatilità del Benchmark (in %) | - | - | - | - | 18.31 |
| Tracking Error ex post (in %) | - | - | - | - | 0.14 |
| Information Ratio | - | - | - | - | -3.86 |
| Sharpe Ratio | - | - | - | - | -1.72 |
| Correlazione | - | - | - | - | 1.00 |
| Beta | - | - | - | - | 1.00 |
| Jensen alfa | - | - | - | - | -0.63 |
| Maximum Drawdown (in %) | - | - | - | - | -17.96 |
| Recovery Period (anni) | - | - | - | - | - |

Performance

Storia insufficiente di dati

Informazioni sul prodotto

Numero di valore: 117189938
ISIN: CH1171899383
LEI: 254900Q154AKVWL8UQ41
Codice Bloomberg: SWAEIPC SW
Benchmark: MSCI World ex Switzerland ESG Leaders (CHF)
Moneta: CHF
Domicilio: Svizzera
Data di creazione: 31/03/2022
Prezzo di prima emissione: 100.00
Chiusura d'esercizio: 30.09
Emissione/Riscatto: giornalmente
Termine d'accettazione: 30.12.1899 14:30:00
Commissione d'emissione/riscatto: nessuna
Prassi di distribuzione: Capitalizzazione
Asset Manager in base al: Swiss Life Asset Management SA
Pubblicazioni di corsi: Bloomberg: ASSL www.swisslife.ch/fondazioneinvestimento
Quote spese operative TER KGAST ex ante: 0.32%
ex post al: 30/09/2022 0.32%

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.

Tracking error ex ante: Il tracking error previsto per i prossimi 12 mesi corrisponde al Tracking error ex post degli ultimi 3 anni.

Struttura del portafoglio per settore

| | Gruppo d'investimento | Benchmark |
|------------------------------|-----------------------|-----------|
| TECNOLOGIA DELL'INFORMAZIONE | 21.49% | 21.48% |
| FINANZA | 14.25% | 14.20% |
| SALUTE | 14.21% | 14.21% |
| BENI VOLUTTUARI | 11.27% | 11.31% |
| INDUSTRIE | 10.09% | 10.10% |
| SERVIZI DI TELECOMUNICAZIONE | 8.46% | 8.46% |
| BENI DI PRIMA NECESSITÀ | 7.76% | 7.77% |
| MATERIALI | 4.36% | 4.35% |
| ENERGIA | 3.42% | 3.41% |
| IMMOBILI | 2.86% | 2.85% |
| SERVIZI DI PUBBLICA UTILITÀ | 1.84% | 1.85% |
| LIQUIDITÀ | - | - |

Le principali posizioni

| | Gruppo d'investimento | Benchmark |
|------------------------|-----------------------|-----------|
| MICROSOFT CORP. | 7.48% | 7.47% |
| ALPHABET INC | 5.05% | 5.04% |
| TESLA INC | 3.16% | 3.16% |
| JOHNSON & JOHNSON | 1.94% | 1.94% |
| NVIDIA | 1.37% | 1.37% |
| PROCTER & GAMBLE | 1.37% | 1.37% |
| VISA INC | 1.32% | 1.32% |
| HOME DEPOT | 1.28% | 1.28% |
| ELI LILLY & CO. | 1.18% | 1.18% |
| MASTERCARD INC-CLASS A | 1.11% | 1.11% |

Struttura del portafoglio secondo il paese/regione

| | Gruppo d'investimento | Benchmark |
|-------------------|-----------------------|-----------|
| USA | 71.16% | 71.08% |
| GIAPPONE | 6.48% | 6.46% |
| GRAN BRETAGNA | 4.33% | 4.42% |
| CANADA | 3.71% | 3.70% |
| FRANCIA | 2.91% | 2.98% |
| GERMANIA | 1.66% | 1.66% |
| RESTO DELL'EUROPA | 6.24% | 6.19% |
| ALTRI PAESI ASIA | 3.45% | 3.46% |
| ALTRI | 0.06% | 0.06% |
| LIQUIDITÀ | - | - |

30 settembre 2022

Fondazione d'investimento Swiss Life

Azioni Global ESG PM



Patrimonio netto (NAV) in mio. CHF: 40.85
Valore d'inventario netto per diritto in CHF: 80.04

Strategia d'investimento

Il gruppo d'investimento persegue una strategia core-satellite. La parte "core" del portafoglio, con circa il 70%, viene gestita attivamente, investe in prevalenza in large e mid cap e si contraddistingue per un forte profilo ESG. L'attuazione compete a Swiss Life Funds (LUX) Equity ESG Global. La parte "satellite" del portafoglio, con circa il 30%, investe prevalentemente in small e mid cap che realizzano la maggior parte dei loro introiti tramite prodotti e servizi che promuovono la sostenibilità ambientale. I satelliti vengono implementati, per circa il 10% ciascuno, da Swiss Life Funds (LUX) Equity Climate Impact, Swiss Life Funds (LUX) Equity Green Buildings & Infrastructure Impact e Swiss Life Funds (LUX) Equity Environment & Biodiversity Impact. Le percentuali possono oscillare all'interno di margini prestabiliti. Il limite per società ammonta al 5%.

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 | -21.17% | -8.95% | -4.28% | - | - | - | - | - |

Dati statistici (annualizzati)

| | 1 ANNO | 3 ANNI | 5 ANNI | 10 ANNI | INIZIO |
|---|--------|--------|--------|---------|--------|
| Volatilità Gruppo d'investimento (in %) | - | - | - | - | 17.41 |
| Sharpe Ratio | - | - | - | - | -1.48 |
| Maximum Drawdown (in %) | - | - | - | - | -21.73 |
| Recovery Period (anni) | - | - | - | - | - |

Performance

Storia insufficiente di dati

Informazioni sul prodotto

Numero di valore: 113873878

ISIN: CH1138738781

LEI: 254900RNJ8UYJ3OTB72

Codice Bloomberg: SWAGEPC SW

Moneta: CHF

Domicilio: Svizzera

Data di creazione: 30/11/2021

Prezzo di prima emissione: 100.00

Chiusura d'esercizio: 30.9

Emissione/Riscatto: giornalmente

Termine d'accettazione: 11:00

Commissione d'emissione/riscatto: nessuna

Prassi di distribuzione: Capitalizzazione

Asset Manager

Swiss Life Asset Management SA

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

Quote spese operative TER KGAST

ex ante: 0.27%

ex post al: 30/09/2022 0.27%

PM tranche: Il cerchio degli investitori è limitato a investitori qualificati, che hanno stipulato un contratto di gestione patrimoniale o un altro contratto di servizi finanziari a titolo oneroso con Swiss Life Asset Management SA oppure con una società appartenente al gruppo Swiss Life.

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 |
|------------------------------|-----------------------|
| TECNOLOGIA DELL'INFORMAZIONE | 22.34% |
| INDUSTRIE | 19.74% |
| FINANZA | 10.70% |
| SALUTE | 8.33% |
| BENI VOLUTTUARI | 7.70% |
| BENI DI PRIMA NECESSITÀ | 7.38% |
| SERVIZI DI PUBBLICA UTILITÀ | 7.11% |
| MATERIALI | 5.13% |
| IMMOBILI | 4.04% |
| SERVIZI DI COMUNICAZIONE | 3.05% |
| ENERGIA | 2.28% |
| EQUITY INDEX FUTURE | 1.78% |
| LIQUIDITÀ | 0.43% |

Le principali posizioni

| | Gruppo d'investimento |
|-------------------------|-----------------------|
| APPLE INC | 3.04% |
| MICROSOFT CORP | 2.98% |
| ALPABET INC-CL | 1.37% |
| AMAZON.COM INC | 1.26% |
| UNITEDHEALTH GROUP INC | 0.95% |
| TESLA INC | 0.75% |
| HOME DEPOT INC | 0.66% |
| VISA INC-CLASS A SHARES | 0.66% |
| PFIZER INC | 0.60% |
| FIRST SOLAR INC | 0.56% |

Struttura del portafoglio secondo il paese/regione

| | Gruppo d'investimento |
|---------------------------------|-----------------------|
| USA E CANADA | 62.69% |
| REGIONE EUROPEA (EUR) | 14.13% |
| REGIONE ASIA E PACIFICO | 10.12% |
| REGIONE EUROPEA (EX EUR) | 9.47% |
| FUTURE SU INDICE AZIONARIO | 1.78% |
| MERCATI EMERGENTI ASIA PACIFICO | 0.93% |
| ALTRI | 0.44% |
| LIQUIDITÀ | 0.43% |

30 settembre 2022

Fondazione d'investimento Swiss Life

Azioni Global Small Caps PM

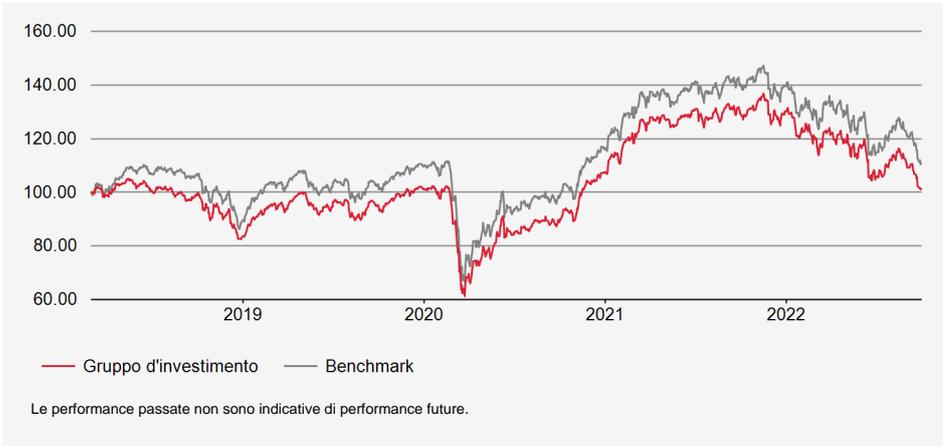


Patrimonio netto (NAV) in mio. CHF: 193.67
Valore d'inventario netto per diritto in CHF: 101.07

Strategia d'investimento

Investimenti in titoli di partecipazione di società a piccola capitalizzazione a livello mondiale. Selezione attiva di Paesi, settori e titoli. Limitazione per società: 5%. Realizzazione tramite Invesco Global Small Cap Equity Fund e Dimensional Global Small Cap Equity Fund.

Evoluzione del valore nella valuta di riferimento (base 100)



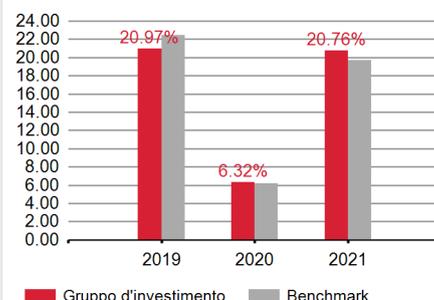
Performance nella valuta di riferimento

| | PERFORMANCE CUMULATA | | | | PERFORMANCE ANNUALIZZATA | | | |
|-----------------------|----------------------|--------|--------|---------|--------------------------|--------|---------|--------|
| | YTD | 1 MESE | 3 MESI | 1 ANNO | 3 ANNI | 5 ANNI | 10 ANNI | INIZIO |
| GRUPPO D'INVESTIMENTO | -22.24% | -9.02% | -3.51% | -21.89% | 2.00% | - | - | 0.23% |
| BENCHMARK | -20.46% | -9.47% | -2.61% | -20.66% | 2.51% | - | - | 2.29% |

Dati statistici (annualizzati)

| | 1 ANNO | 3 ANNI | 5 ANNI | 10 ANNI | INIZIO |
|---|--------|--------|--------|---------|--------|
| Volatilità Gruppo d'investimento (in %) | 17.25 | 23.36 | - | - | 20.92 |
| Volatilità del Benchmark (in %) | 17.61 | 22.81 | - | - | 20.56 |
| Tracking Error ex post (in %) | 1.77 | 1.97 | - | - | 2.51 |
| Information Ratio | -0.70 | -0.26 | - | - | -0.80 |
| Sharpe Ratio | -1.40 | 0.11 | - | - | 0.04 |
| Correlazione | 1.00 | 1.00 | - | - | 0.99 |
| Beta | 0.97 | 1.02 | - | - | 1.01 |
| Jensen alfa | -1.75 | -0.57 | - | - | -2.08 |
| Maximum Drawdown (in %) | -26.10 | -40.04 | - | - | -41.60 |
| Recovery Period (anni) | - | 0.67 | - | - | 0.73 |

Performance



Informazioni sul prodotto

Numero di valore: 40068790
ISIN: CH0400687908
LEI: 254900XCUD9NTWJQU706
Codice Bloomberg: SLAGSPM SW
Benchmark: MSCI AC World Small Cap, in CHF
Moneta: CHF
Domicilio: Svizzera
Data di creazione: 28/02/2018
Prezzo di prima emissione: 100.00
Chiusura d'esercizio: 30.09
Emissione/Riscatto: giornalmente
Termine d'accettazione: 11.00
Commissione d'emissione/riscatto: nessuna
Prassi di distribuzione: Capitalizzazione
Asset Manager in base al Swiss Life Best Select Invest Plus@: 50% Invesco / 50% Dimensional
Consulenza esterna: PPCmetrics fornisce i seguenti servizi: consulenza sulla struttura idonea del mandato, 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
Quote spese operative TER KGAST ex ante: 0.78%
ex post al: 30/09/2022 0.78%

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.
Tracking error ex ante: Il tracking error previsto per i prossimi 12 mesi corrisponde al Tracking error ex post degli ultimi 3 anni.

Struttura del portafoglio per settore

| | Gruppo d'investimento | Benchmark |
|------------------------------|-----------------------|-----------|
| INDUSTRIE | 20.05% | 18.34% |
| FINANZA | 15.76% | 13.98% |
| BENI VOLUTTUARI | 13.22% | 12.11% |
| TECNOLOGIA DELL'INFORMAZIONE | 11.40% | 11.55% |
| SALUTE | 10.86% | 11.23% |
| MATERIALI | 6.71% | 7.69% |
| IMMOBILI | 5.97% | 9.15% |
| ENERGIA | 4.47% | 4.97% |
| BENI DI PRIMA NECESSITÀ | 3.57% | 4.99% |
| SERVIZI DI TELECOMUNICAZIONE | 2.71% | 2.79% |
| SERVIZI DI PUBBLICA UTILITÀ | 2.39% | 3.18% |
| LIQUIDITÀ | 2.85% | - |

Struttura del portafoglio secondo il paese/regione

| | Gruppo d'investimento | Benchmark |
|-------------------|-----------------------|-----------|
| USA | 57.30% | 57.58% |
| GIAPPONE | 8.77% | 10.53% |
| GRAN BRETAGNA | 5.40% | 4.80% |
| CANADA | 2.51% | 3.82% |
| FRANCIA | 2.10% | 1.11% |
| GERMANIA | 1.70% | 1.35% |
| RESTO DELL'EUROPA | 10.48% | 8.31% |
| ALTRI PAESI ASIA | 5.36% | 7.76% |
| ALTRI | 3.50% | 4.74% |
| LIQUIDITÀ | 2.85% | - |

Le principali posizioni

| | Gruppo d'investimento | Benchmark |
|----------------------|-----------------------|-----------|
| ARISTON HLDG | 0.49% | 0.01% |
| WEATHERFORD INTERNAT | 0.48% | 0.01% |
| WILLSCOT MOBILE MINI | 0.45% | 0.06% |
| CHART INDS | 0.40% | 0.05% |
| COFACE | 0.40% | 0.01% |
| PINNACLE FINL PARTNE | 0.38% | 0.04% |
| CACTUS INC | 0.37% | 0.02% |
| HURON CONSULTING GRP | 0.37% | 0.01% |
| VISTEON CORP | 0.36% | 0.02% |
| RGA | 0.34% | 0.06% |

Ulteriori informazioni sulle società

| | |
|----------------------------------|--------|
| Numero di società | 6,745 |
| Quota di società senza benchmark | 21.35% |

30 settembre 2022

Fondazione d'investimento Swiss Life Azioni Emerging Markets ESG PM



Patrimonio netto (NAV) in mio. CHF: 197.82
Valore d'inventario netto per diritto in CHF: 81.44

Strategia d'investimento

Investimenti in titoli di partecipazione di società domiciliate in Paesi emergenti. Selezione attiva di Paesi, settori e titoli. Limitazione per società: 5% Società straniere al benchmark: max. 15%. Realizzazione tramite Candriam Sustainable Equity Emerging Markets; SICAV di diritto lussemburghese secondo l'OICVM.

Evoluzione del valore nella valuta di riferimento (base 100)



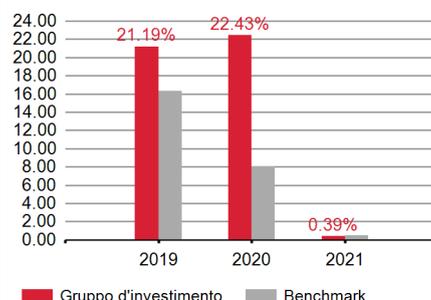
Performance nella valuta di riferimento

| | PERFORMANCE CUMULATA | | | | PERFORMANCE ANNUALIZZATA | | | |
|------------------------------|----------------------|----------------|----------------|----------------|--------------------------|----------|----------|---------------|
| | YTD | 1 MESE | 3 MESI | 1 ANNO | 3 ANNI | 5 ANNI | 10 ANNI | INIZIO |
| GRUPPO D'INVESTIMENTO | -28.25% | -10.78% | -11.37% | -32.38% | -1.61% | - | - | -4.30% |
| BENCHMARK | -21.31% | -10.97% | -9.09% | -24.15% | -2.49% | - | - | -3.90% |

Dati statistici (annualizzati)

| | 1 ANNO | 3 ANNI | 5 ANNI | 10 ANNI | INIZIO |
|---|--------|--------|--------|---------|--------|
| Volatilità Gruppo d'investimento (in %) | 12.46 | 18.85 | - | - | 17.87 |
| Volatilità del Benchmark (in %) | 13.37 | 17.86 | - | - | 16.63 |
| Tracking Error ex post (in %) | 5.67 | 5.65 | - | - | 5.45 |
| Information Ratio | -1.45 | 0.16 | - | - | -0.07 |
| Sharpe Ratio | -3.10 | -0.05 | - | - | -0.20 |
| Correlazione | 0.91 | 0.95 | - | - | 0.95 |
| Beta | 0.84 | 1.01 | - | - | 1.02 |
| Jensen alfa | -11.90 | 0.89 | - | - | -0.33 |
| Maximum Drawdown (in %) | -33.77 | -38.97 | - | - | -38.97 |
| Recovery Period (anni) | - | - | - | - | - |

Performance



Informazioni sul prodotto

Numero di valore: 39561964
ISIN: CH0395619643
LEI: 254900OLXTUB1EYJLV86
Codice Bloomberg: SWLAEPM SW
Benchmark: MSCI Emerging Markets, in CHF
Moneta: CHF
Domicilio: Svizzera
Data di creazione: 31/01/2018
Prezzo di prima emissione: 100.00
Chiusura d'esercizio: 30.09
Emissione/Riscatto: giornalmente
Termine d'accettazione: 11.00
Commissione d'emissione/riscatto: nessuna
Prassi di distribuzione: Capitalizzazione
Asset Manager in base al Swiss Life Best Select Invest Plus@: Candriam Investors Group

Consulenza esterna: PPCmetrics fornisce i seguenti servizi: consulenza sulla struttura idonea del mandato, 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
Quote spese operative TER KGAST ex ante: 0.55%
ex post al: 30/09/2022 0.55%

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.
Tracking error ex ante: Il tracking error previsto per i prossimi 12 mesi corrisponde al Tracking error ex post degli ultimi 3 anni.

Struttura del portafoglio per settore

| | Gruppo d'investimento | Benchmark |
|------------------------------|-----------------------|-----------|
| FINANZA | 21.41% | 22.60% |
| BENI VOLUTTUARI | 16.91% | 13.96% |
| TECNOLOGIA DELL'INFORMAZIONE | 15.40% | 18.27% |
| SERVIZI DI TELECOMUNICAZIONE | 10.63% | 9.69% |
| INDUSTRIE | 8.78% | 5.79% |
| SALUTE | 7.14% | 3.89% |
| BENI DI PRIMA NECESSITÀ | 5.36% | 6.60% |
| MATERIALI | 4.49% | 8.74% |
| SERVIZI DI PUBBLICA UTILITÀ | 1.87% | 3.16% |
| IMMOBILI | - | 2.02% |
| ENERGIA | - | 5.29% |
| LIQUIDITÀ | 7.90% | - |

Struttura del portafoglio secondo il paese/regione

| | Gruppo d'investimento | Benchmark |
|--------------------|-----------------------|-----------|
| CINA | 30.87% | 31.35% |
| INDIA | 16.71% | 15.33% |
| TAIWAN | 12.01% | 13.82% |
| BRASILIE | 8.56% | 5.76% |
| COREA | 6.68% | 10.66% |
| AFRICA DEL SUD | 2.61% | 3.46% |
| ALTRI PAESI ASIA | 7.84% | 6.57% |
| ALTRI PAESI EMEA | 1.02% | 9.84% |
| ALTR PAESI AMERICA | 5.70% | 3.22% |
| LIQUIDITÀ | 7.90% | - |

Le principali posizioni

| | Gruppo d'investimento | Benchmark |
|---|-----------------------|-----------|
| TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFACTURING CO LTD | 5.67% | 5.71% |
| ALIBABA GROUP HOLDING LTD | 4.18% | 2.63% |
| TENCENT HOLDINGS LTD | 3.21% | 3.70% |
| HOUSING DEVELOPMENT FINANCE CORP LTD | 2.58% | 0.85% |
| MEITUAN | 2.56% | 1.62% |
| BHARTI AIRTEL LTD | 1.91% | 0.38% |
| SK HYNIX INC | 1.90% | 0.55% |
| ASIAN PAINTS LTD | 1.84% | 0.27% |
| EICHER MOTORS LTD | 1.76% | 0.11% |
| JAFRON BIOMEDICAL CO LTD | 1.76% | 0.01% |

Ulteriori informazioni sulle società

| | |
|----------------------------------|--------|
| Numero di società | 85 |
| Quota di società senza benchmark | 13.95% |

Fondazione d'investimento Swiss Life

Azioni Global Protect Flex PM (CHF hedged)

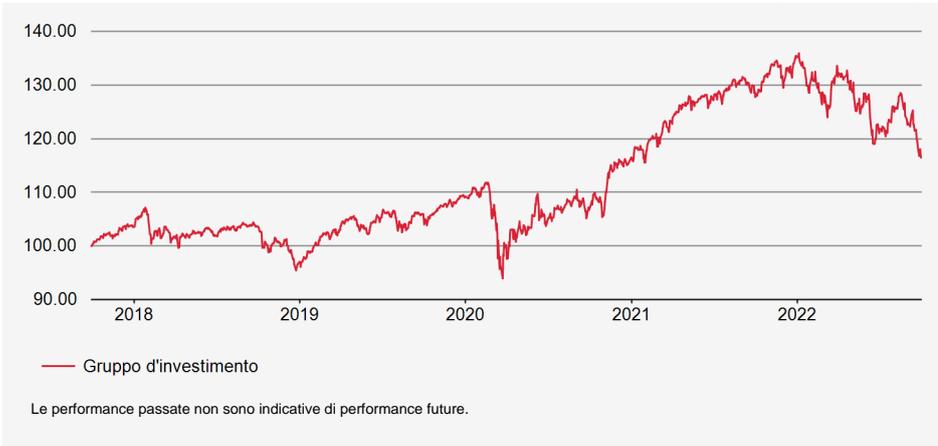


Patrimonio netto (NAV) in mio. CHF: 1,165.01
Valore d'inventario netto per diritto in CHF: 128.50

Strategia d'investimento

Strategia azionaria attiva basata su regole con strategia di copertura complementare. L'universo d'investimento del gruppo d'investimento è composto da società dei maggiori indici borsistici stranieri (in particolare S&P 500, Euro Stoxx 50, FTSE 100 e Nikkei 225) nonché l'SMI; ponderato per la capitalizzazione di mercato o a uno schema di ponderazione alternativo (p.es. processo di riequilibrio o minimo di volatilità). I rischi valutari vengono coperti al 90 % almeno contro il franco. Gli investimenti possono essere effettuati sotto forma di titoli di partecipazione, investimenti collettivi o strumenti derivati. L'impiego complementare di una strategia di copertura composta da opzioni determina, in caso di forte ribasso dei mercati, una riduzione delle perdite sulle quotazioni e, in caso di forte rialzo dei mercati, una limitazione del potenziale di crescita ("put spread collar"). A seconda della valutazione del mercato è possibile rinunciare alla vendita dell'opzione put e/o dell'opzione call. Realizzazione tramite SLF (CH) Equity Global Protect Enhanced (CHF hedged).

Evoluzione del valore nella valuta di riferimento (base 100)



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 | -13.85% | -4.99% | -3.74% | -8.83% | 3.20% | 3.09% | - | 3.98% |

Dati statistici (annualizzati)

| | 1 ANNO | 3 ANNI | 5 ANNI | 10 ANNI | INIZIO |
|---|--------|--------|--------|---------|--------|
| Volatilità Gruppo d'investimento (in %) | 11.83 | 10.40 | 9.17 | - | 8.24 |
| Sharpe Ratio | -0.74 | 0.36 | 0.41 | - | 0.56 |
| Maximum Drawdown (in %) | -14.29 | -15.96 | -15.96 | - | -15.96 |
| Recovery Period (anni) | - | 0.63 | 0.63 | - | 0.63 |

Performance



Informazioni sul prodotto

Numero di valore: 31954200
ISIN: CH0319542004
LEI: 254900LUAQC3MC0MWL48
Codice Bloomberg: SLAGCPM SW
Moneta: CHF
Domicilio: Svizzera
Data di creazione: 29/04/2016
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 Asset Management SA
Pubblicazioni di corsi: Bloomberg: ASSL
www.swisslife.ch/fondazioneinvestimento
Quote spese operative TER KGAST
ex ante: 0.15%
ex post al: 30/09/2022 0.15%

PM tranche: L'acquisto di questa tranche è possibile solo nell'ambito di un accordo speciale con Swiss Life Asset Management SA.

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.

Tracking error ex ante: Il tracking error previsto per i prossimi 12 mesi corrisponde al Tracking error ex post degli ultimi 3 anni.

Fondazione d'investimento Swiss Life

Azioni Global Protect Flex PM (CHF hedged)

Struttura del portafoglio per settore

| | Gruppo d'investimento |
|------------------------------|-----------------------|
| FINANZA | 13.38% |
| TECNOLOGIA DELL'INFORMAZIONE | 11.20% |
| INDUSTRIE | 9.86% |
| SALUTE | 9.70% |
| BENI VOLUTTUARI | 8.41% |
| BENI DI PRIMA NECESSITÀ | 8.13% |
| FUTURE SU INDICE AZIONARIO | 6.30% |
| SERVIZI DI COMUNICAZIONE | 6.19% |
| IMMOBILI | 5.05% |
| SERVIZI DI PUBBLICA UTILITÀ | 4.82% |
| MATERIALI | 4.60% |
| ENERGIA | 3.22% |
| LIQUIDITÀ / PRESTITO | 9.15% |

Le principali posizioni

| | Gruppo d'investimento |
|-----------------------|-----------------------|
| ELI LILLY & CO | 1.53% |
| ALPHABET INC-CL C | 1.19% |
| WASTE CONNECTIONS INC | 0.80% |
| HOME DEPOT INC | 0.79% |
| FAST RETAILING CO LTD | 0.73% |
| CHEVRON CORP | 0.69% |
| MICROSOFT CORP | 0.69% |
| EXXON MOBIL CORP | 0.66% |
| JOHNSON & JOHNSON | 0.65% |
| ON SEMICONDUCTOR | 0.61% |

Struttura del portafoglio secondo il paese/regione

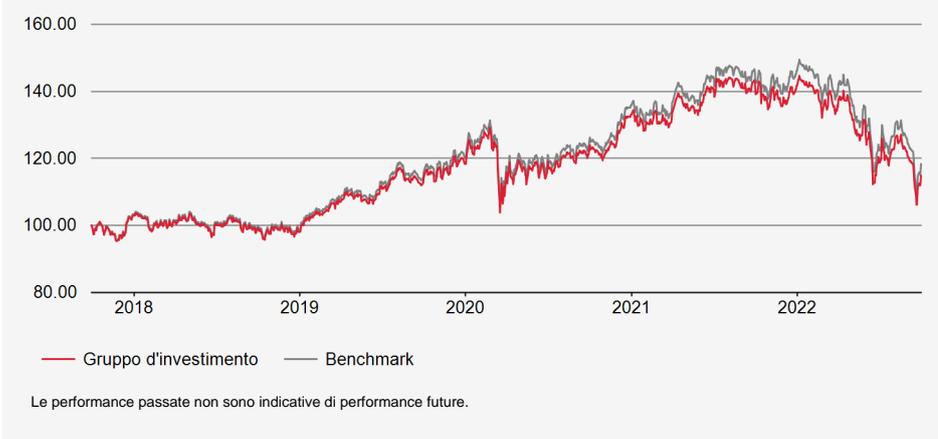
| | Gruppo d'investimento |
|---------------------------------|-----------------------|
| USA E CANADA | 56.36% |
| REGIONE EUROPEA (EUR) | 13.65% |
| REGIONE EUROPEA (EX EUR) | 8.32% |
| FUTURE SU INDICE AZIONARIO | 6.30% |
| REGIONE ASIA E PACIFICO | 5.95% |
| MERCATI EMERGENTI ASIA PACIFICO | 0.28% |
| LIQUIDITÀ / PRESTITO | 9.15% |

Patrimonio netto (NAV) in mio. CHF: 340.04
Valore d'inventario netto per diritto in CHF: 150.87

Strategia d'investimento

Il gruppo d'investimento colloca il proprio patrimonio in fondi d'investimento immobiliari di diritto svizzero, in franchi, ed esclusivamente in immobili svizzeri. Selezione attiva dei fondi d'investimento immobiliari. Realizzazione tramite Swiss Life Funds (CH) Real Estate Switzerland Fund of Funds.

Evoluzione del valore nella valuta di riferimento (base 100)



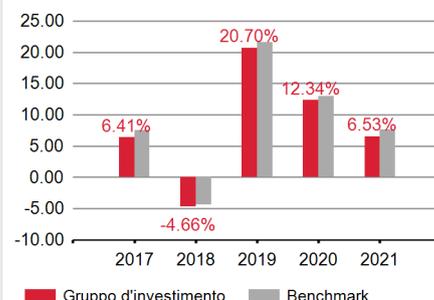
Performance nella valuta di riferimento

| | PERFORMANCE CUMULATA | | | | PERFORMANCE ANNUALIZZATA | | | |
|------------------------------|----------------------|--------|--------|---------|--------------------------|--------|---------|--------|
| | YTD | 1 MESE | 3 MESI | 1 ANNO | 3 ANNI | 5 ANNI | 10 ANNI | INIZIO |
| GRUPPO D'INVESTIMENTO | -18.93% | -5.09% | -3.70% | -18.44% | 0.60% | 2.82% | 3.65% | 3.61% |
| BENCHMARK | -19.02% | -5.21% | -3.74% | -17.83% | 1.16% | 3.43% | 4.32% | 4.28% |

Dati statistici (annualizzati)

| | 1 ANNO | 3 ANNI | 5 ANNI | 10 ANNI | INIZIO |
|---|--------|--------|--------|---------|--------|
| Volatilità Gruppo d'investimento (in %) | 11.17 | 10.85 | 9.70 | 8.72 | 8.27 |
| Volatilità del Benchmark (in %) | 11.72 | 11.13 | 9.94 | 9.01 | 8.53 |
| Tracking Error ex post (in %) | 0.69 | 0.44 | 0.36 | 0.53 | 0.50 |
| Information Ratio | -0.88 | -1.26 | -1.70 | -1.26 | -1.31 |
| Sharpe Ratio | -1.78 | 0.11 | 0.36 | 0.48 | 0.49 |
| Correlazione | 1.00 | 1.00 | 1.00 | 1.00 | 1.00 |
| Beta | 0.95 | 0.97 | 0.98 | 0.97 | 0.97 |
| Jensen alfa | -1.42 | -0.51 | -0.51 | -0.51 | -0.51 |
| Maximum Drawdown (in %) | -26.55 | -26.55 | -26.55 | -26.55 | -26.55 |
| Recovery Period (anni) | - | - | - | - | - |

Performance



Informazioni sul prodotto

Numero di valore: 12468565
ISIN: CH0124685659
LEI: 254900VB5XEQLYLQJ518
Codice Bloomberg: SWLIMP SW
Benchmark: SXI Swiss Real Estate Funds TR Index
Moneta: CHF
Domicilio: Svizzera
Data di creazione: 28/02/2011
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: Swiss Life Asset Management SA
Pubblicazioni di corsi: Bloomberg: ASSL
www.swisslife.ch/fondazionedinvestimento
Quote spese operative TER KGAST
ex ante: 1.00%
ex post al: 30/09/2022 0.99%

PM tranche: L'acquisto di questa tranche è possibile solo nell'ambito di un accordo speciale con Swiss Life Asset Management SA.

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.

Tracking error ex ante: Il tracking error previsto per i prossimi 12 mesi corrisponde al Tracking error ex post degli ultimi 3 anni.

Immobili secondo il tipo di utilizzazione*

| | Gruppo d'investimento | Benchmark |
|-------------------------------|-----------------------|-----------|
| ABITAZIONE | 57.40% | 57.40% |
| UFFICIO | 33.90% | 34.10% |
| MISTI | 8.10% | 8.00% |
| TERRENI EDIFICABILI, PROGETTI | 0.60% | 0.50% |

*in base agli ultimi dati disponibili

Ripartizione geografica degli immobili*

| | Gruppo d'investimento | Benchmark |
|--------------------------|-----------------------|-----------|
| ZURIGO | 34.70% | 35.30% |
| BERNA | 6.80% | 6.70% |
| SVIZZERA CENTRALE | 6.30% | 6.40% |
| SVIZZERA OCCIDENTALE | 4.20% | 4.20% |
| SVIZZERA NORDOCCIDENTALE | 18.00% | 18.10% |
| SVIZZERA ORIENTALE | 5.30% | 5.40% |
| TICINO | 1.80% | 1.90% |
| LAGO DI GINEVRA | 22.90% | 22.00% |

*in base agli ultimi dati disponibili

Le principali posizioni

| | Gruppo d'investimento | Benchmark |
|-----------------------|-----------------------|-----------|
| UBS SWISS SIMA | 29.80% | 30.00% |
| CS REF SIAT | 10.80% | 10.80% |
| CS REF LIVING PLUS | 9.30% | 9.20% |
| UBS SWISS ANFOS | 9.30% | 9.20% |
| CS REF GREEN PROPERTY | 9.20% | 9.10% |

30 settembre 2022

Fondazione d'investimento Swiss Life Infrastruttura globale ESG PM (CHF hedged)



Patrimonio netto (NAV) in mio. CHF: 80.21
Valore d'inventario netto per diritto in CHF: 107.23

Commento di management e prospettive

Il gruppo d'investimento Infrastruttura globale ESG (CHF hedged) ha collocato ulteriori CHF 26,8 mio. nel gruppo d'investimento Infrastruttura globale (EUR). Gruppo d'investimento Infrastruttura globale ESG (EUR): circa EUR 61,5 mio. allocati in ulteriori investimenti. Si tratta di due investimenti diretti (co-investimenti) nei settori trasporto ed energie rinnovabili. A tale scopo è stato sottoscritto per la prima volta il fondo target FONTAVIS SCS SICAV-RAIF- Fontavis ESG Renewable Infrastructure Fund II. Le chiamate di capitale da parte degli investimenti target del gruppo d'investimento Infrastruttura globale ESG (EUR) ammontavano a EUR 78,2 mio. Oltre a un'ampia diversificazione, il portafoglio vanta un'ottima evoluzione nonostante la fase di accumulo ancora in corso. Nel T4 2022 Portfolio Management prevede diverse chiamate di capitale presso gli investitori. Inoltre, nel T4 verranno consultati per la prima volta i sottoscrittori del secondo periodo.

Strategia d'investimento

Acquisizione di diritti del gruppo d'investimento Infrastruttura globale ESG (EUR) e attuazione di coperture valutarie per ridurre i relativi rischi di cambio. Il gruppo d'investimento detiene la liquidità necessaria per la copertura valutaria. Il reddito d'investimento della classe d'investimento EUR viene conseguito mediante collocamenti in investimenti infrastrutturali. L'obiettivo è quello di coprire uno spettro di rischio / rendimento da conservativo a equilibrato (cfr. prospetto del gruppo d'investimento Infrastruttura globale ESG [CHF hedged], punto 2.3).

Performance nella valuta di riferimento

| | PERFORMANCE CUMULATA | | | PERFORMANCE ANNUALIZZATA | | | |
|------------------------------|----------------------|--------------|--------------|--------------------------|--------|---------|--------------|
| | YTD | 3 MESI | 1 ANNO | 3 ANNI | 5 ANNI | 10 ANNI | INIZIO |
| GRUPPO D'INVESTIMENTO | 4.63% | 3.93% | 5.16% | - | - | - | 5.32% |

Principali dati indicativi

| | |
|--|-------|
| Capitale impegnato* | 182.7 |
| Capitale richiamato* | 75.9 |
| Patrimonio netto (NAV)* | 80.2 |
| Impegni di capitale in investimenti del portafoglio* | 159.4 |
| Numero di investimenti del portafoglio (panoramica) | 1 |
| Numero di partecipazioni (panoramica) | 26 |

*in milioni CHF

Informazioni sul prodotto

Numero di valore: 59605226
ISIN: CH0596052263
LEI: 254900U5QZLUQLIN2205
Codice Bloomberg: SWGCHPC SW
Moneta: CHF
Domicilio: Svizzera
Data di creazione: 26/05/2021
Prezzo di prima emissione: 100.00
Chiusura d'esercizio: 30.9
Prassi di distribuzione: Distribuzione
Asset Manager:
Swiss Life Asset Management SA
Amministratore:
Northern Trust Switzerland SA
Ufficio di revisione:
PricewaterhouseCoopers SA
Depotbank:
UBS Switzerland AG
Pubblicazioni di corsi: Bloomberg: ASSL
www.swisslife.ch/fondazioneinvestimento
Quote spese operative TER KGAST
ex ante: 1.97%
ex post al: 30/09/2022 2.19%

Riscatto di diritti: Il riscatto di diritti avviene ogni anno il 30 settembre (termine di riscatto), osservando un termine di disdetta di nove mesi, per la prima volta il 30 settembre 2025, tenendo conto dei limiti di riscatto del gruppo d'investimento Infrastruttura globale (EUR).

Commissione di riscatto sul NAV a favore del gruppo d'investimento: 5.00% Se i diritti possono essere ricollocati con valuta corretta, la commissione di riscatto non viene addebitata.

Fondazione d'investimento Swiss Life

Infrastruttura globale ESG PM (CHF hedged)

Investimenti del portafoglio*

| | Impegni di capitale | Patrimonio netto |
|--|---------------------|------------------|
| Co-Investment Almaviva Santé SAS via SL Vie LUXCO S.À R.L. | 4.37% | 10.09% |
| Co-Investment Altitude Infrastructure THD via Owl BidCo S.À R.L. | 2.70% | 5.57% |
| Co-Investment BCP Battery Holding S.À R.L. | 3.81% | 1.65% |
| Co-Investment JFK via JLC Terminal One Co-Invest L.P. | 4.69% | 0.31% |
| Co-Investment Saffir (offshore Norway) | 5.69% | - |
| Co-Investment TTT via Bazalgette (Investments) Ltd | 5.12% | 10.09% |
| Swiss Life Funds (LUX) ESG GIO III Co-Invest | 15.64% | 17.56% |
| Swiss Life Funds (LUX) ESG Global Infrastructure Opportunities III | 41.22% | 44.49% |
| Co-Investment Energy Assets Group limited via SLAM EAG LUXCO S.À R.L. | 2.56% | 7.37% |
| FONTAVIS SCS SICAV-RAIF- FONTAVIS ESG Renewable Infrastructure Fund Europe («FORTE») | 7.11% | 2.86% |
| FONTAVIS SCS SICAV-RAIF- FONTAVIS ESG Renewable Infrastructure Fund II («FORTE II») | 7.11% | - |

*Senza liquidità

Attività per settore*

| | |
|-------------------------------|--------|
| Comunicazione | 39.10% |
| Servizi di pubblica utilità | 24.00% |
| Trasporto | 22.20% |
| Infrastrutture sociali | 10.10% |
| Energie rinnovabili / Energia | 4.60% |
| Altri | - |

*Senza liquidità

Asset per regione*

| | |
|------------------------------|--------|
| Europa (incl. Gran Bretagna) | 73.34% |
| America del Nord | 26.66% |
| Svizzera | - |
| Altre regioni | - |

*Senza liquidità

Attività per stadio*

| | |
|------------|--------|
| Brownfield | 96.30% |
| Greenfield | 3.70% |

*Senza liquidità

Attività per valuta*

| | |
|-----|--------|
| EUR | 55.50% |
| USD | 26.66% |
| GBP | 17.80% |

*Senza liquidità

30 settembre 2022

Fondazione d'investimento Swiss Life Infrastruttura globale ESG PM (EUR)



Patrimonio netto (NAV) in mio. EUR: 169.95
Valore d'inventario netto per diritto in EUR: 110.87

Commento di management e prospettive

Nel T3 2022 il gruppo d'investimento Infrastruttura globale ESG (EUR) ha allocato circa 61,5 milioni di euro in ulteriori investimenti. Si tratta di due investimenti diretti (co-investimenti) nei settori trasporto ed energie rinnovabili. A tale scopo è stato sottoscritto per la prima volta il fondo target FONTAVIS SCS SICAV-RAIF- Fontavis ESG Renewable Infrastructure Fund II. Le chiamate di capitale da parte di investimenti target ammontavano a 78,2 mio. di euro. Oltre a un'ampia diversificazione, il portafoglio vanta un'ottima evoluzione nonostante la fase di accumulo ancora in corso. Nel T4 2022 Portfolio Management prevede diverse chiamate di capitale presso gli investitori del gruppo d'investimento. Inoltre, nel T4 verranno consultati per la prima volta i sottoscrittori del secondo periodo.

Strategia d'investimento

Partecipazione a diversi fondi infrastrutturali e investimenti diretti diversificati nei Paesi OCSE gestiti da Swiss Life. Concentrazione su strategie Core / Core+ e distribuzioni regolari provenienti dall'attività operativa. Diversificazione per Paesi, regioni, sedi, settori, tecnologie, età degli impianti e profili di cashflow. Il processo d'investimento tiene conto dei fattori di rischio e finanziari e criteri ESG (cfr. prospetto del gruppo d'investimento Infrastruttura globale ESG [EUR], punto 2.3).

Performance nella valuta di riferimento

| | PERFORMANCE CUMULATA | | | PERFORMANCE ANNUALIZZATA | | | |
|-----------------------|----------------------|--------|--------|--------------------------|--------|---------|--------|
| | YTD | 3 MESI | 1 ANNO | 3 ANNI | 5 ANNI | 10 ANNI | INIZIO |
| GRUPPO D'INVESTIMENTO | 6.14% | 4.96% | 8.20% | - | - | - | 7.96% |

Principali dati indicativi

| | |
|--|-------|
| Capitale impegnato* | 353.9 |
| Capitale richiamato* | 158.6 |
| Patrimonio netto (NAV)* | 170.0 |
| Impegni di capitale in investimenti del portafoglio* | 351.8 |
| Numero di investimenti del portafoglio (panoramica) | 9 |
| Numero di partecipazioni (panoramica) | 26 |

*in milioni EUR

Informazioni sul prodotto

Numero di valore: 59600218
ISIN: CH0596002185
LEI: 2549009VUGU2MJGSXI62
Codice Bloomberg: SWIGEP SW
Moneta: EUR
Domicilio: Svizzera
Data di creazione: 26/05/2021
Prezzo di prima emissione: 100.00
Chiusura d'esercizio: 30.9
Prassi di distribuzione: Distribuzione
Asset Manager:
Swiss Life Asset Management SA
Amministratore:
Northern Trust Switzerland SA
Ufficio di revisione:
PricewaterhouseCoopers SA
Depotbank:
UBS Switzerland AG
Pubblicazioni di corsi: Bloomberg: ASSL
www.swisslife.ch/fondazioneinvestimento
Quote spese operative TER KGAST
ex ante: 2.02%
ex post al: 30/09/2022 2.25%

Riscatto di diritti: Il riscatto dei diritti avviene ogni anno al 30 settembre (termine di riscatto), osservando un termine di disdetta di sei mesi, per la prima volta il 30 settembre 2025; i riscatti annuali sono limitati al 20% (o al massimo a 50 milioni di euro) del capitale investito.

Commissione di riscatto sul NAV a favore del gruppo d'investimento: 5.00% Se i diritti possono essere ricollocati con valuta corretta, la commissione di riscatto non viene addebitata.

Investimenti del portafoglio*

| | Impegni di capitale | Patrimonio netto |
|--|---------------------|------------------|
| Co-Investment Almaviva Santé SAS via SL Vie LUXCO S.À R.L. | 4.37% | 10.09% |
| Co-Investment Altitude Infrastructure THD via Owl BidCo S.À R.L. | 2.70% | 5.57% |
| Co-Investment BCP Battery Holding S.À R.L. | 3.81% | 1.65% |
| Co-Investment JFK via JLC Terminal One Co-Invest L.P. | 4.69% | 0.31% |
| Co-Investment Saffir (offshore Norway) | 5.69% | - |
| Co-Investment TTT via Bazalgette (Investments) Ltd | 5.12% | 10.09% |
| Swiss Life Funds (LUX) ESG GIO III Co-Invest | 15.64% | 17.56% |
| Swiss Life Funds (LUX) ESG Global Infrastructure Opportunities III | 41.22% | 44.49% |
| Co-Investment Energy Assets Group limited via SLAM EAG LUXCO S.À R.L. | 2.56% | 7.37% |
| FONTAVIS SCS SICAV-RAIF- FONTAVIS ESG Renewable Infrastructure Fund Europe («FORTE») | 7.11% | 2.86% |
| FONTAVIS SCS SICAV-RAIF- FONTAVIS ESG Renewable Infrastructure Fund II («FORTE II») | 7.11% | - |

*Senza liquidità

Attività per settore*

| | |
|-------------------------------|--------|
| Comunicazione | 39.10% |
| Servizi di pubblica utilità | 24.00% |
| Trasporto | 22.20% |
| Infrastrutture sociali | 10.10% |
| Energie rinnovabili / Energia | 4.60% |
| Altri | - |

*Senza liquidità

Asset per regione*

| | |
|------------------------------|--------|
| Europa (incl. Gran Bretagna) | 73.34% |
| America del Nord | 26.66% |
| Svizzera | - |
| Altre regioni | - |

*Senza liquidità

Attività per stadio*

| | |
|------------|--------|
| Brownfield | 96.30% |
| Greenfield | 3.70% |

*Senza liquidità

Attività per valuta*

| | |
|-----|--------|
| EUR | 55.50% |
| USD | 26.66% |
| GBP | 17.80% |

*Senza liquidità

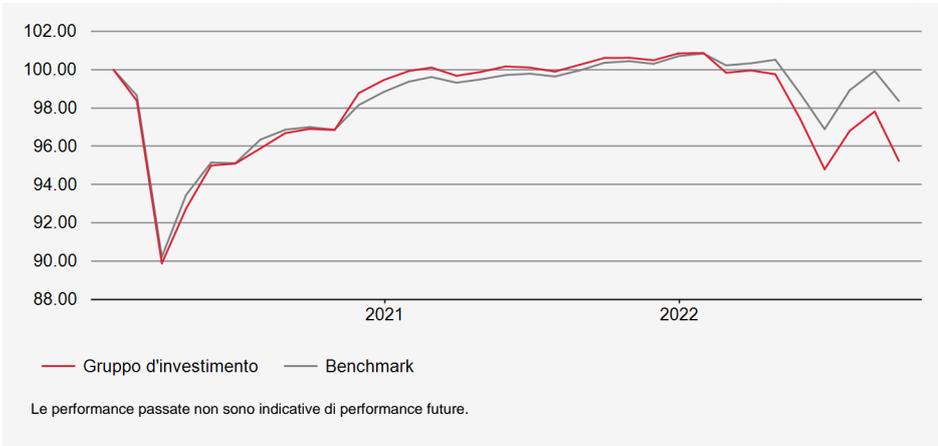
Fondazione d'investimento Swiss Life Senior Secured Loans PM (CHF hedged)

Patrimonio netto (NAV) in mio. CHF: 101.94
Valore d'inventario netto per diritto in CHF: 95.24

Strategia d'investimento

Il gruppo d'investimento mira a rendimenti stabili e elevati con una volatilità dei prezzi minima e una duration dei tassi di interesse bassa. Il gruppo d'investimento investe principalmente in prestiti garantiti Senior Secured Loans da società dei paesi sviluppati. Almeno l'85% sarà investito in Senior Secured Loans garantiti. Limitazioni per debitore per singola impresa: 5%. Al massimo il 25% è investito nello stesso settore industriale. I rischi valutari vengono coperti al 90% almeno contro il franco. Realizzazione tramite du Swiss Life Loan Fund (LUX) S.A., SICAV-SIF Senior Secured Loans V AM-Shares (CHF hedged); fondo d'investimento di diritto lussemburghese.

Evolutione del valore nella valuta di riferimento (base 100)



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 | -5.56% | -2.64% | 0.46% | -5.34% | - | - | - | -1.81% |
| BENCHMARK | -2.33% | -1.56% | 1.52% | -1.99% | - | - | - | -0.62% |

Dati statistici (annualizzati)

| | 1 ANNO | 3 ANNI | 5 ANNI | 10 ANNI | INIZIO |
|---|--------|--------|--------|---------|--------|
| Volatilità Gruppo d'investimento (in %) | 5.16 | - | - | - | 7.05 |
| Volatilità del Benchmark (in %) | 4.02 | - | - | - | 6.63 |
| Tracking Error ex post (in %) | 1.31 | - | - | - | 1.17 |
| Information Ratio | -2.56 | - | - | - | -0.99 |
| Sharpe Ratio | -0.96 | - | - | - | -0.16 |
| Correlazione | 0.99 | - | - | - | 0.99 |
| Beta | 1.27 | - | - | - | 1.05 |
| Jensen alfa | -2.96 | - | - | - | -1.20 |
| Maximum Drawdown (in %) | -6.02 | - | - | - | -10.11 |
| Recovery Period (anni) | - | - | - | - | 0.91 |

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.

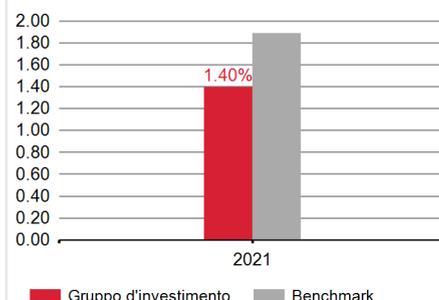
Termine di accettazione: Ultimo = ultimo giorno lavorativo bancario del mese

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.

Tracking error ex ante: Il tracking error previsto per i prossimi 12 mesi corrisponde al Tracking error ex post degli ultimi 3 anni.

Performance



Informazioni sul prodotto

Numero di valore: 51215723

ISIN: CH0512157238

LEI: 254900TFN2RL5B1QJ986

Codice Bloomberg: SWSSLPM SW

Benchmark: 80% JPM US LL UT (CHFh)

20% JPM EU LL UT (CHFh)

Moneta: CHF

Domicilio: Svizzera

Data di creazione: 31/01/2020

Prezzo di prima emissione: 100.00

Chiusura d'esercizio: 30.09

Emissione/Riscatto: mensile

Termine d'accettazione: 14.30

Sottoscrizione: Ultimo -2

Riscatti: Ultimo -5

Commissione d'emissione/riscatto: nessuna

Prassi di distribuzione: Capitalizzazione

**Asset Manager in base al
Swiss Life Best Select Invest Plus®:**
Swiss Life Asset Management SA

Controllo asset manager:

PPCmetrics supporta il controllo costante dell'asset manager e la valutazione dei risultati d'investimento.

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

Quote spese operative TER KGAST

ex ante: 0.51%

ex post al: 30/09/2022 0.51%

Fondazione d'investimento Swiss Life Senior Secured Loans PM (CHF hedged)

Struttura del portafoglio per settore

| | Gruppo d'investimento | Benchmark |
|-------------------------|-----------------------|-----------|
| SERVIZI | 13.79% | 7.16% |
| SALUTE | 10.54% | 12.61% |
| TECNOLOGIA | 9.82% | 8.93% |
| CAVO E SATELLITE | 6.89% | 7.70% |
| CHIMICA | 6.53% | 8.22% |
| ALIMENTAZIONE E BEVANDE | 5.63% | 2.65% |
| EDILIZIA | 4.58% | 3.20% |
| FINANZA | 4.34% | 5.62% |
| GIOCHI/TEMPO LIBERO | 4.09% | 9.32% |
| AUTOMOBILE | 3.88% | 2.17% |
| ALTRI | 25.22% | 32.42% |
| LIQUIDITÀ | 4.70% | - |

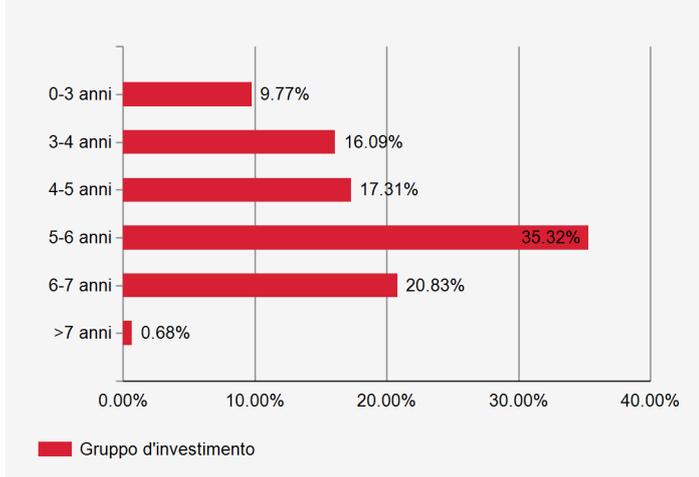
Principali debitori e rating

| | Gruppo d'investimento | Benchmark |
|--------------------|-----------------------|-----------|
| Altice USA | BB- | 1.91% |
| Warner Music Group | BB- | 1.71% |
| CenturyLink | BBB- | 1.70% |
| Belron | BB+ | 1.47% |
| Virgin/O2 | BB- | 1.46% |

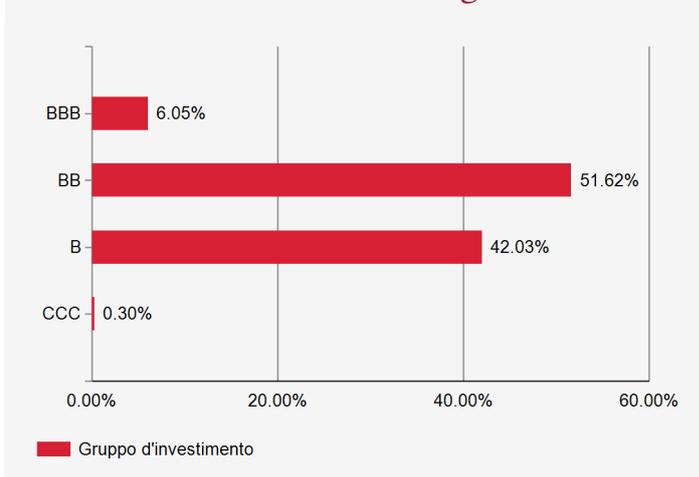
Ulteriori informazioni sui debitori

| | |
|--------------------|-----|
| Numero di debitori | 237 |
|--------------------|-----|

Struttura della scadenza dei titoli



Investimenti secondo il rating



Struttura del portafoglio per valute e rendimento (senza liquidità)

| | Gruppo d'investimento | | Benchmark | |
|-------|-----------------------|------------|-----------|------------|
| | Peso | Rendimento | Peso | Rendimento |
| USD | 61.54% | 8.50% | 80.00% | 7.81% |
| EUR | 38.46% | 8.36% | 20.00% | 7.08% |
| Media | - | 8.45% | - | 7.66% |

Struttura del portafoglio secondo il paese/regione

| | Gruppo d'investimento | Benchmark |
|-------------|-----------------------|-----------|
| STATI UNITI | 56.66% | 80.42% |
| REGNO UNITO | 8.75% | 4.25% |
| PAESI BASSI | 7.19% | 2.40% |
| LUSSEMBURGO | 6.26% | 0.57% |
| GERMANIA | 3.05% | 1.33% |
| BELGIO | 2.91% | 1.62% |
| FRANCIA | 2.46% | 0.33% |
| SPAGNA | 2.17% | 1.14% |
| IRLANDA | 1.85% | 3.88% |
| SVEZIA | 1.29% | - |
| ALTRI | 2.70% | 4.07% |
| LIQUIDITÀ | 4.70% | - |

30 settembre 2022

Fondazione d'investimento Swiss Life Ipoteche Svizzera ESG PM

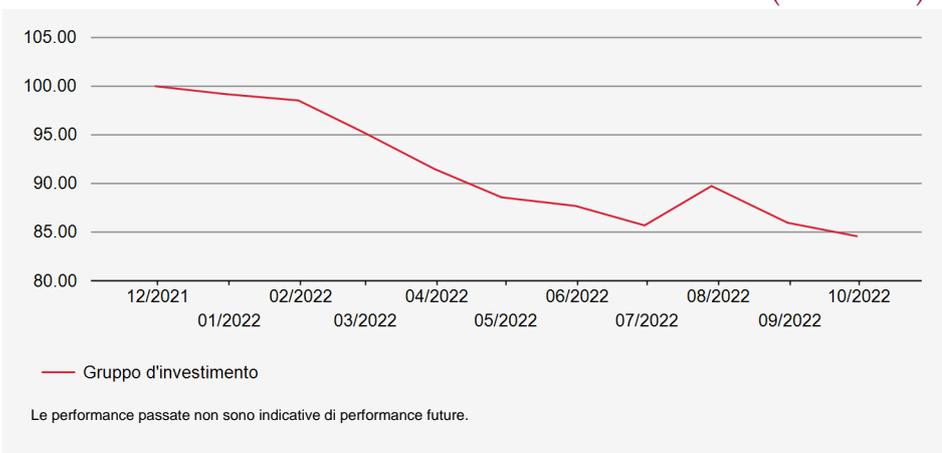


Patrimonio netto (NAV) in mio. CHF: 188.35
Valore d'inventario netto per diritto in CHF: 84.61

Strategia d'investimento

Investimenti in ipoteche svizzere sostenibili: almeno l'85%. Duration target di 8. Attuazione con l'impiego del segmento patrimoniale "Swiss Life ESG Mortgage Fund" del fondo Swiss Life Mortgage Fund, un fondo a ombrello contrattuale di diritto svizzero.

Evoluzione del valore nella valuta di riferimento (base 100)



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 | -14.69% | -1.60% | -1.29% | - | - | - | - | - |

Dati statistici

| | |
|---|-------|
| Durata residua media (anni) | 9.07 |
| Modified Duration (excl. ipoteche a termine)* | 7.25 |
| Modified Duration (incl. ipoteche a termine)* | 7.96 |
| Rendimento lordo alla scadenza | 2.65% |
| Anticipo medio | 58% |
| Numero ipoteche | 311 |
| Differenza di rendimento rispetto ai titoli di Stato svizzeri | 1.54% |

*incl. liquidità

Performance

Storia insufficiente di dati

Informazioni sul prodotto

Numero di valore: 112778775

ISIN: CH1127787757

LEI: 254900V4K2D79T13EF45

Codice Bloomberg: SLHSEPM SW

Moneta: CHF

Domicilio: Svizzera

Data di creazione: 30/11/2021

Prezzo di prima emissione: 100.00

Chiusura d'esercizio: 30.9

Emissione/Riscatto: mensile

Commissione d'emissione/riscatto:
nessuna

Prassi di distribuzione: Capitalizzazione

Asset Manager:

Swiss Life Asset Management SA

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

Quote spese operative TER KGAST

ex ante: 0.35%

ex post al: 30/09/2022 0.35%

PM tranche: L'acquisto di questa tranche è possibile solo nell'ambito di un accordo speciale con Swiss Life Asset Management SA.

Emissione: Mensile, nel rispetto di un periodo di sottoscrizione di un mese.

Riscatto: Mensile, nel rispetto di un termine di disdetta di sei mesi. Il primo riscatto di diritti è possibile al 30 gennaio 2024, osservando il termine di preavviso di sei mesi.

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 patrimoniale (%)

| | |
|--------------|--------|
| IPOTECHE | 78.75% |
| LIQUIDITÀ | 17.66% |
| OBBLIGAZIONI | 3.59% |
| DERIVATI | 0.00% |

Distribuzione in base all'ammontare dell'anticipo (%)

| | |
|----------|--------|
| <40% | 11.18% |
| 40 - 50% | 12.95% |
| 50 - 60% | 10.46% |
| 60 - 70% | 58.16% |
| >70% | 7.24% |

Tipo di oggetti messi in pegno (%)

| | |
|----------------------------|--------|
| CASE UNIFAMILIARE | 26.46% |
| PROPRIETÀ PER PIANI | 50.27% |
| CASE PLURIFAMILIARI | 13.50% |
| IMMOBILI A USO COMMERCIALE | 9.77% |

Quota tipi d'ipoteca (%)

| | |
|----------------------------|--------|
| IPOTECHE A TASSO FISSO | 98.90% |
| IPOTECHE SARON | 1.06% |
| IPOTECHE A TASSO VARIABILE | 0.05% |

Ripartizione geografica degli immobili

| | |
|--------------------------|--------|
| ZURIGO | 21.05% |
| ESPACE MITTELLAND | 11.42% |
| SVIZZERA CENTRALE | 12.59% |
| SVIZZERA NORDOCCIDENTALE | 5.26% |
| SVIZZERA ORIENTALE | 1.95% |
| TICINO | 0.85% |
| REGIONE DEL LEMANO | 46.89% |

Struttura alla scadenza delle ipoteche (%)

| | |
|------------|--------|
| 1-3 ANNI | 9.38% |
| 3-5 ANNI | 10.08% |
| 5-7 ANNI | 19.82% |
| 7-10 ANNI | 25.82% |
| 10-15 ANNI | 19.36% |
| >15 ANNI | 15.54% |

Ipotecche con pagamenti scoperti di ben 90 giorni

| | |
|---|---|
| NUMERO DEBITORI IPOTECARI | - |
| RELATIVO VALORE GLOBALE DELLE IPOTECHE CON PAGAMENTI SCOPERTI | - |
| ANTICIPO MEDIO | - |