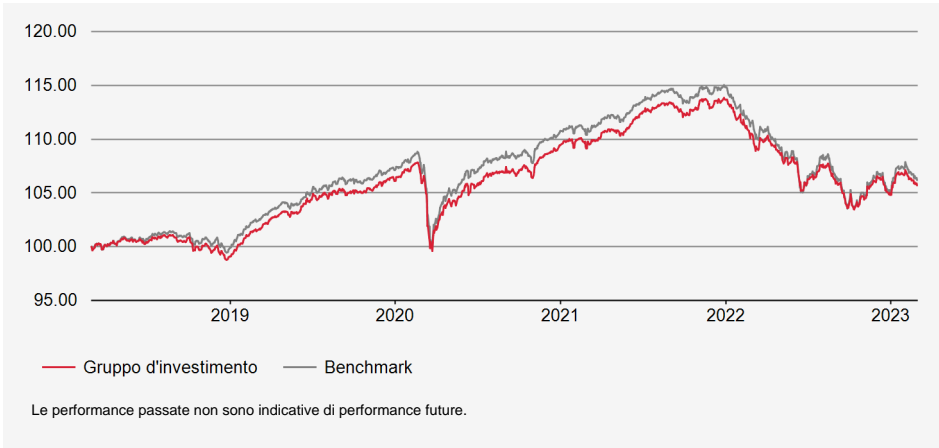


Patrimonio netto (NAV) in mio. CHF: 232.17
Valore d'inventario netto per diritto in CHF: 164.88

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)



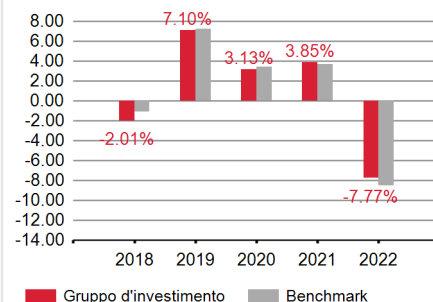
Performance nella valuta di riferimento

	PERFORMANCE CUMULATA				PERFORMANCE ANNUALIZZATA			
	YTD	1 MESE	3 MESI	1 ANNO	3 ANNI	5 ANNI	10 ANNI	INIZIO
GRUPPO D'INVESTIMENTO	0.83%	-0.91%	-0.48%	-4.32%	-0.07%	1.11%	2.13%	2.57%
BENCHMARK	1.06%	-1.01%	-0.34%	-4.77%	-0.20%	1.21%	2.23%	2.87%

Dati statistici (annualizzati)

	1 ANNO	3 ANNI	5 ANNI	10 ANNI	INIZIO
Volatilità Gruppo d'investimento (in %)	4.84	4.48	3.73	3.07	2.87
Volatilità del Benchmark (in %)	5.68	4.89	4.01	3.16	2.90
Tracking Error ex post (in %)	0.96	0.63	0.56	0.52	0.58
Information Ratio	0.47	0.21	-0.17	-0.19	-0.49
Sharpe Ratio	-0.92	0.08	0.45	0.86	0.87
Correlazione	1.00	0.99	0.99	0.99	0.98
Beta	0.85	0.91	0.93	0.96	0.97
Jensen alfa	-0.28	0.15	0.04	0.01	-0.22

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: 0.57%
ex post al: 30/09/2022 0.60%

Struttura del portafoglio per gruppo d'investimento

	Gruppo d'investimento	Benchmark	max. OPP2
Liquidità	4.27%	2.00%	-
Ipotecche Svizzera	11.41%	13.00%	-
Obbligazioni CHF Svizzera	11.27%	13.00%	-
Obbligazioni CHF Estero	5.03%	6.00%	-
Obbligazioni valute estere (CHF hedged)	29.76%	28.00%	-
Azioni Svizzera	7.83%	8.00%	-
Azioni Estero	5.11%	7.00%	-
Azioni Estero (CHF hedged)	1.56%	-	-
Immobili Svizzera	17.67%	15.00%	30.00%
Immobili estero (CHF hedged)	3.78%	3.00%	10.00%
Investimenti alternativi (CHF hedged)	2.32%	5.00%	15.00%
Totale azioni (Svizzera ed Estero)	14.50%	15.00%	50.00%
Totale valute estere	5.11%	7.00%	30.00%

Struttura del portafoglio secondo le valute

CHF	94.89%
USD	3.56%
EUR	0.63%
JPY	0.31%
ALTRI	0.61%

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	4.25
Rating medio	A+