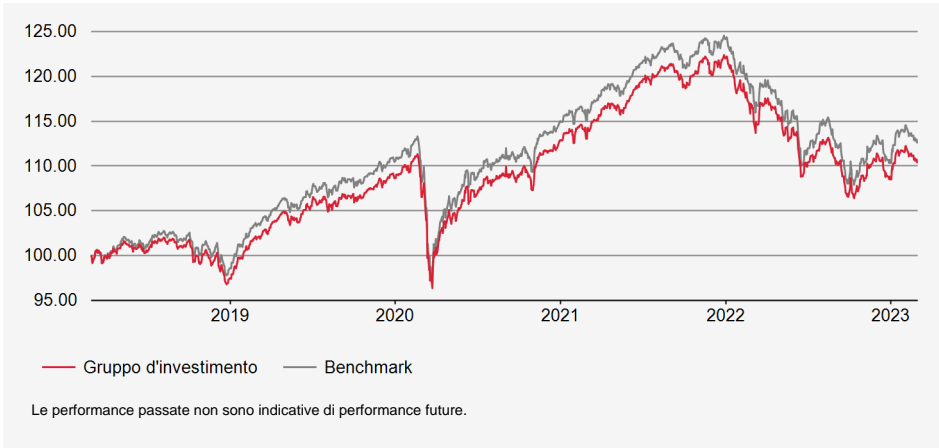


Patrimonio netto (NAV) in mio. CHF: 309.89
Valore d'inventario netto per diritto in CHF: 194.63

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)



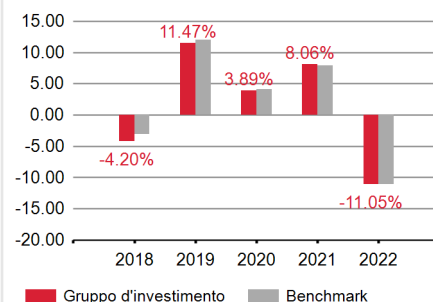
Performance nella valuta di riferimento

| | PERFORMANCE CUMULATA | | | | PERFORMANCE ANNUALIZZATA | | | |
|------------------------------|----------------------|--------|--------|--------|--------------------------|--------|---------|--------|
| | YTD | 1 MESE | 3 MESI | 1 ANNO | 3 ANNI | 5 ANNI | 10 ANNI | INIZIO |
| GRUPPO D'INVESTIMENTO | 1.74% | -1.02% | -0.55% | -5.45% | 1.19% | 2.00% | 3.29% | 3.16% |
| BENCHMARK | 2.06% | -1.05% | -0.31% | -5.30% | 1.32% | 2.40% | 3.63% | 3.70% |

Dati statistici (annualizzati)

| | 1 ANNO | 3 ANNI | 5 ANNI | 10 ANNI | INIZIO |
|-----------------------------------------|--------|--------|--------|---------|--------|
| Volatilità Gruppo d'investimento (in %) | 7.81 | 7.19 | 6.20 | 5.26 | 5.30 |
| Volatilità del Benchmark (in %) | 8.58 | 7.69 | 6.55 | 5.34 | 5.29 |
| Tracking Error ex post (in %) | 0.94 | 0.74 | 0.64 | 0.59 | 0.65 |
| Information Ratio | -0.16 | -0.18 | -0.64 | -0.59 | -0.82 |
| Sharpe Ratio | -0.72 | 0.22 | 0.41 | 0.72 | 0.57 |
| Correlazione | 1.00 | 1.00 | 1.00 | 0.99 | 0.99 |
| Beta | 0.91 | 0.93 | 0.94 | 0.98 | 1.00 |
| Jensen alfa | -0.64 | -0.01 | -0.24 | -0.26 | -0.53 |

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: 0.58%
ex post al: 30/09/2022 0.59%

Struttura del portafoglio per gruppo d'investimento

| | Gruppo d'investimento | Benchmark | max. OPP2 |
|-----------------------------------------|-----------------------|-----------|-----------|
| Liquidità | 4.05% | 2.00% | - |
| Ipotecche Svizzera | 0.73% | - | - |
| Obbligazioni CHF Svizzera | 12.44% | 14.00% | - |
| Obbligazioni CHF Estero | 5.53% | 7.00% | - |
| Obbligazioni valute estere (CHF hedged) | 25.55% | 24.00% | - |
| Azioni Svizzera | 17.91% | 18.00% | - |
| Azioni Estero | 14.57% | 17.00% | - |
| Azioni Estero (CHF hedged) | 2.07% | - | - |
| Immobili Svizzera | 11.77% | 11.00% | 30.00% |
| Immobili estero (CHF hedged) | 3.03% | 2.00% | 10.00% |
| Investimenti alternativi (CHF hedged) | 2.34% | 5.00% | 15.00% |
| Totale azioni (Svizzera ed Estero) | 34.54% | 35.00% | 50.00% |
| Totale valute estere | 14.57% | 17.00% | 30.00% |

Struttura del portafoglio secondo le valute

| | |
|-------|--------|
| CHF | 85.43% |
| USD | 9.96% |
| EUR | 1.88% |
| JPY | 0.91% |
| ALTRI | 1.82% |

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 | 5.35 |
| Rating medio | A |