

30 settembre 2024

Fondazione d'investimento Swiss Life

Obbligazioni CHF Svizzera

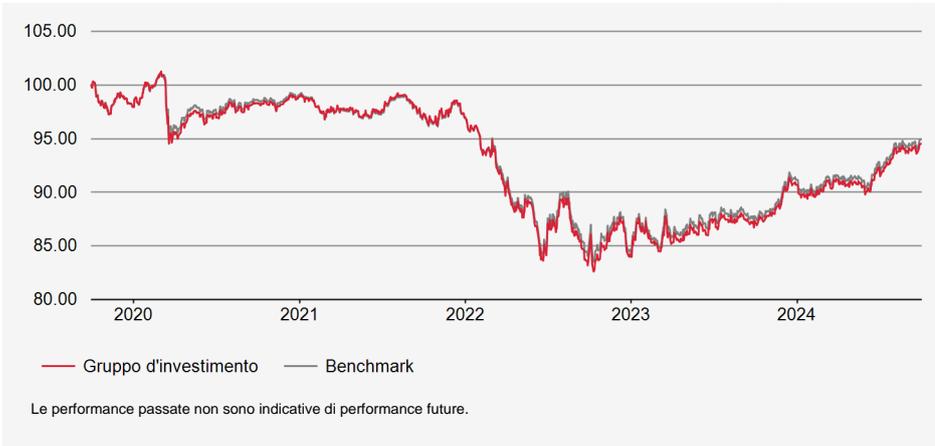


Patrimonio netto (NAV) in mio. CHF: 800.71
Valore d'inventario netto per diritto in CHF: 167.55

Strategia d'investimento

Investimenti in titoli di credito in CHF di debitori prevalentemente domiciliati in Svizzera. Selezione attiva di titoli, gestione della duration e posizionamento della curva dei tassi d'interesse. Limitazione per debitore: 10% (eccezioni: fino al 25% in ogni istituto di credito fondiario, Confederazione Svizzera senza limitazione). Debitori esterni all'indice di riferimento: 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)



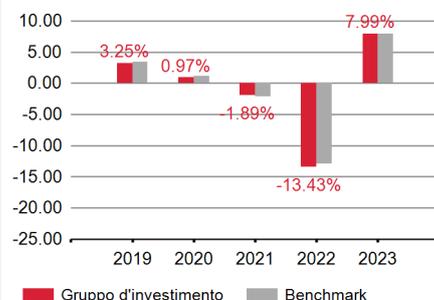
Performance nella valuta di riferimento

	Performance cumulata				Performance annualizzata			
	YTD	1 mese	3 mesi	1 anno	3 anni	5 anni	10 anni	Inizio
Gruppo d'investimento	4.21%	0.72%	2.38%	8.29%	-0.90%	-1.12%	0.56%	2.27%
Benchmark	4.13%	0.69%	2.29%	8.17%	-0.71%	-1.03%	0.66%	2.35%

Dati statistici (annualizzati)

	1 anno	3 anni	5 anni	10 anni	Inizio
Volatilità Gruppo d'investimento (in %)	3.63	6.04	5.75	4.73	3.81
Volatilità del Benchmark (in %)	3.64	5.85	5.49	4.58	3.78
Tracking Error ex post (in %)	0.18	0.43	0.46	0.37	0.44
Information Ratio	0.71	-0.44	-0.19	-0.28	-0.17
Sharpe Ratio	1.78	-0.27	-0.22	0.18	0.53
Correlazione	1.00	1.00	1.00	1.00	0.99
Beta	1.00	1.03	1.04	1.03	1.00
Jensen alfa	0.14	-0.15	-0.04	-0.13	-0.08
Maximum Drawdown (in %)	-2.16	-16.18	-18.41	-19.71	-19.71
Recovery Period (anni)	0.41	-	-	-	-

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: 13.00
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: 30/09/2024 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
Instituti lettere di pegno	30.54%	39.43%
Finanza	27.73%	15.82%
Stati e simili	23.04%	29.83%
Consumo non ciclico	7.93%	7.01%
Servizi di pubblica utilità	5.13%	2.49%
Beni Industriali	2.79%	2.75%
Consumo ciclico	1.38%	0.38%
Comunicazione	0.50%	0.92%
Altri	0.23%	1.38%
Liquidità	0.73%	-

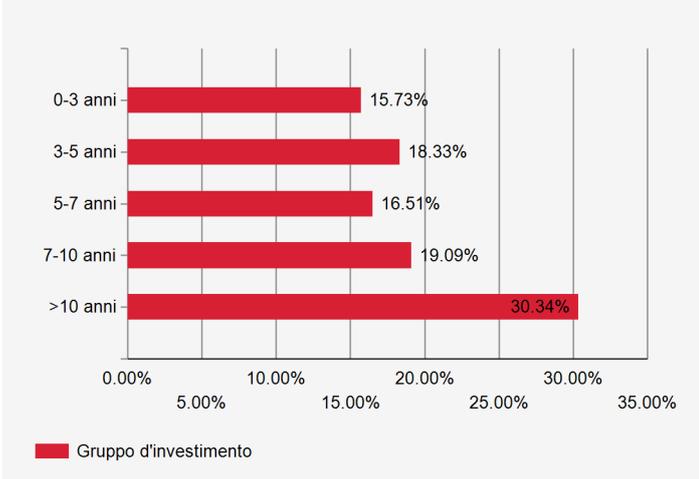
Principali debitori e rating

	Rating	Gruppo d'investimento
Pfandbriefbank	AAA	16.94%
Pfandbriefzentrale	AAA	13.45%
Confederazione	AAA	13.37%
Stadt Zürich	AAA	2.62%
UBS Group AG	AA-	2.54%

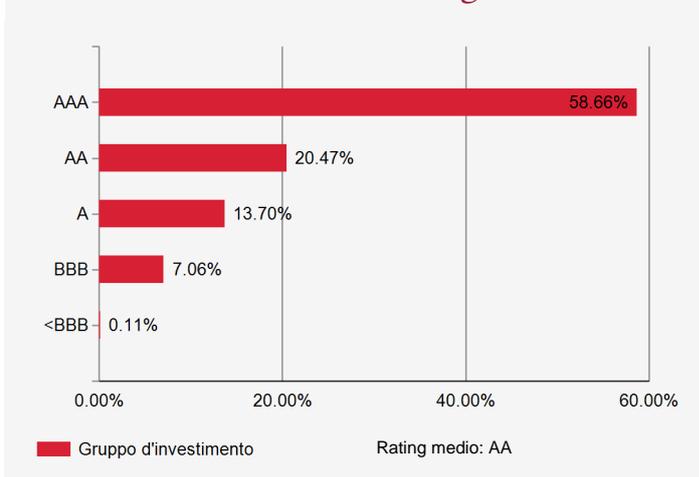
Ulteriori informazioni sui debitori

Numero di debitori	113
Quota di debitori senza benchmark	0.15%

Struttura della scadenza dei titoli



Investimenti secondo il rating



Durata e rendimento alla scadenza

	Gruppo d'investimento	Benchmark
Modified Duration	8.0	8.0
Rendimento alla scadenza teorica*	0.89%	0.79%

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

Fondazione d'investimento Swiss Life

Obbligazioni CHF Estero

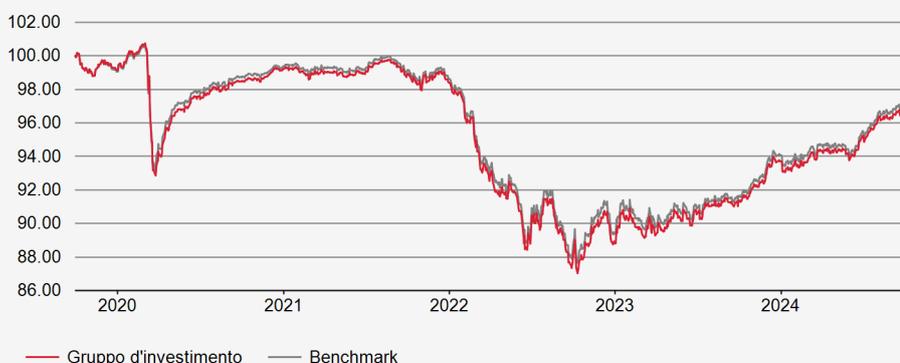


Patrimonio netto (NAV) in mio. CHF: 305.94
Valore d'inventario netto per diritto in CHF: 150.40

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%. Titoli di credito di 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.

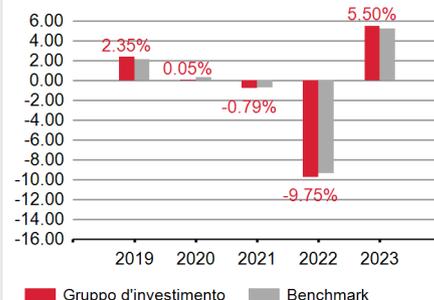
Performance nella valuta di riferimento

	Performance cumulata				Performance annualizzata			
	YTD	1 mese	3 mesi	1 anno	3 anni	5 anni	10 anni	Inizio
Gruppo d'investimento	3.52%	0.70%	1.88%	6.19%	-0.62%	-0.60%	0.31%	1.79%
Benchmark	3.48%	0.68%	1.93%	6.22%	-0.58%	-0.54%	0.37%	1.91%

Dati statistici (annualizzati)

	1 anno	3 anni	5 anni	10 anni	Inizio
Volatilità Gruppo d'investimento (in %)	1.97	3.92	4.47	3.40	3.21
Volatilità del Benchmark (in %)	2.01	3.90	4.26	3.26	3.07
Tracking Error ex post (in %)	0.12	0.25	0.34	0.32	0.85
Information Ratio	-0.22	-0.15	-0.20	-0.20	-0.13
Sharpe Ratio	2.30	-0.34	-0.17	0.18	0.49
Correlazione	1.00	1.00	1.00	1.00	0.96
Beta	0.98	1.00	1.05	1.04	1.01
Jensen alfa	0.09	-0.03	-0.04	-0.09	-0.15
Maximum Drawdown (in %)	-0.98	-12.15	-13.61	-14.23	-14.23
Recovery Period (anni)	0.15	-	-	-	-

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: 13.00
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: 30/09/2024 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	65.90%	48.12%
Stati e simili	7.70%	15.55%
Instituti lettere di pegno	6.20%	16.72%
Consumo ciclico	3.74%	3.49%
Servizi di pubblica utilità	3.73%	2.78%
Beni Industriali	3.01%	5.30%
Consumo non ciclico	2.62%	4.04%
Energia	1.06%	1.23%
Supernazionale	4.73%	-
Altri	1.43%	2.78%
Liquidità	-0.13%	-

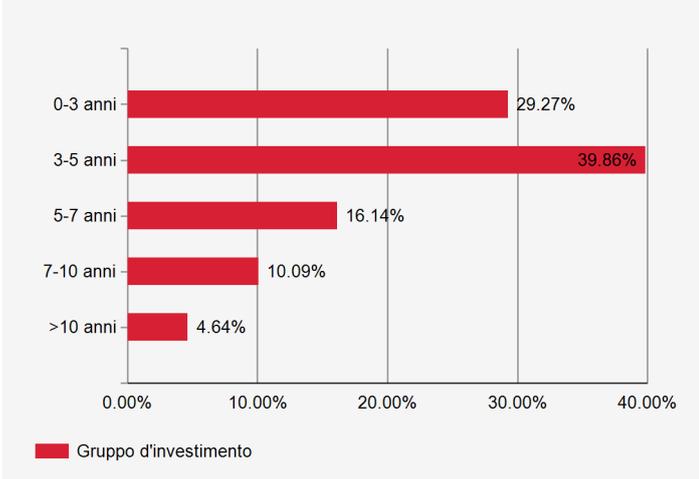
Principali debitori e rating

	Gruppo d'investimento	
Banco Santander SA, Madrid	A+	4.35%
Bank of Nova Scotia/The	AA	3.95%
Groupe BPCE	AA-	3.83%
Müchener Hypothekenbank	AA	3.71%
Credit Agricole Group	AA-	3.28%

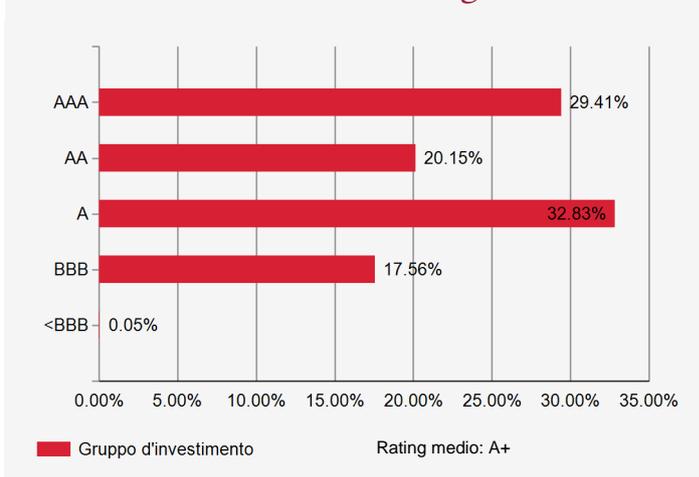
Ulteriori informazioni sui debitori

Numero di debitori	113
Quota di debitori senza benchmark	2.41%

Struttura della scadenza dei titoli



Investimenti secondo il rating



Durata e rendimento alla scadenza

	Gruppo d'investimento	Benchmark
Modified Duration	4.2	4.2
Rendimento alla scadenza teorica*	1.17%	1.05%

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

Struttura del portafoglio secondo il paese/regione

	Gruppo d'investimento	Benchmark
Francia	16.28%	16.23%
Germania	14.97%	13.38%
Canada	12.68%	11.86%
Stati Uniti	9.95%	12.19%
Australia	6.08%	6.67%
Spagna	5.98%	4.65%
Regno Unito	4.71%	4.45%
Regione Europea (Ex EUR)	8.54%	6.59%
Regione Europea (EUR)	5.45%	9.60%
Mercati Emergenti in America	5.39%	4.05%
Altri	10.11%	10.35%
Liquidità, copertura	-0.13%	-

Fondazione d'investimento Swiss Life

Obbligazioni Global (CHF hedged)

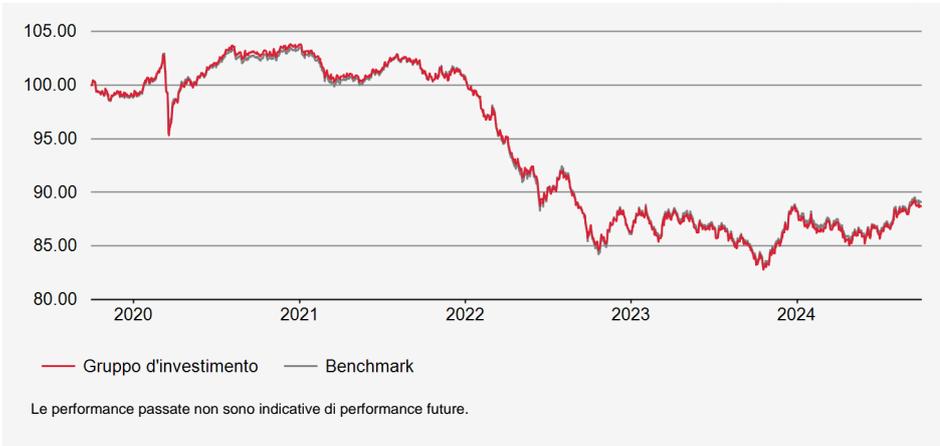


Patrimonio netto (NAV) in mio. CHF: 149.41
Valore d'inventario netto per diritto in CHF: 120.24

Strategia d'investimento

Investimenti in titoli di credito 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). Titoli di credito di 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 Aggregate (CHF hedged); fondi d'investimento di diritto svizzero della categoria "altri fondi per investimenti tradizionali".

Evoluzione del valore nella valuta di riferimento (base 100)



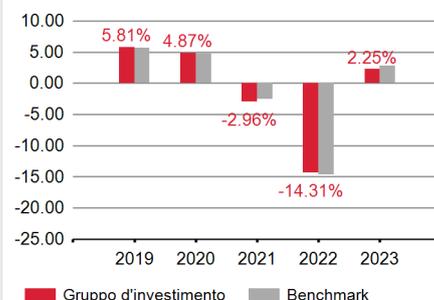
Performance nella valuta di riferimento

	Performance cumulata				Performance annualizzata			
	YTD	1 mese	3 mesi	1 anno	3 anni	5 anni	10 anni	Inizio
Gruppo d'investimento	0.51%	0.81%	3.01%	5.46%	-4.28%	-2.37%	-0.35%	0.80%
Benchmark	0.65%	0.88%	3.15%	5.68%	-4.11%	-2.28%	-0.18%	0.90%

Dati statistici (annualizzati)

	1 anno	3 anni	5 anni	10 anni	Inizio
Volatilità Gruppo d'investimento (in %)	5.47	5.87	5.24	4.26	5.40
Volatilità del Benchmark (in %)	5.37	6.12	5.38	4.35	5.56
Tracking Error ex post (in %)	0.28	0.58	0.51	0.56	1.40
Information Ratio	-0.78	-0.30	-0.18	-0.31	-0.06
Sharpe Ratio	0.70	-0.87	-0.49	-0.01	0.11
Correlazione	1.00	1.00	1.00	0.99	0.97
Beta	1.02	0.95	0.97	0.97	0.94
Jensen alfa	-0.28	-0.40	-0.16	-0.17	-0.05
Maximum Drawdown (in %)	-4.13	-18.55	-20.24	-20.24	-20.24
Recovery Period (anni)	0.37	-	-	-	-

Performance



Informazioni sul prodotto

Numero di valore: 1245479
ISIN: CH0012454796
LEI: 254900F82G5L48XPDV74
Codice Bloomberg: SWAOBFG SW
Benchmark: BLOOMBERG GLO AGG EX SEC EX CNY HEDGED 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: 13.00
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/fondazionedinvestimento
Quote spese operative TER KGAST ex ante: 0.46%
ex post al: 30/09/2024 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	52.04%	72.55%
Finanza	18.94%	11.42%
Consumo non ciclico	6.85%	4.01%
Comunicazione	2.81%	1.95%
Consumo ciclico	2.40%	1.81%
Servizi di pubblica utilità	1.94%	2.71%
Tecnologia	1.48%	1.10%
Energia	1.38%	1.67%
Supernazionale	5.05%	-
Altri	1.94%	2.78%
Liquidità	5.26%	-
Copertura del rischio di cambio	-0.09%	-

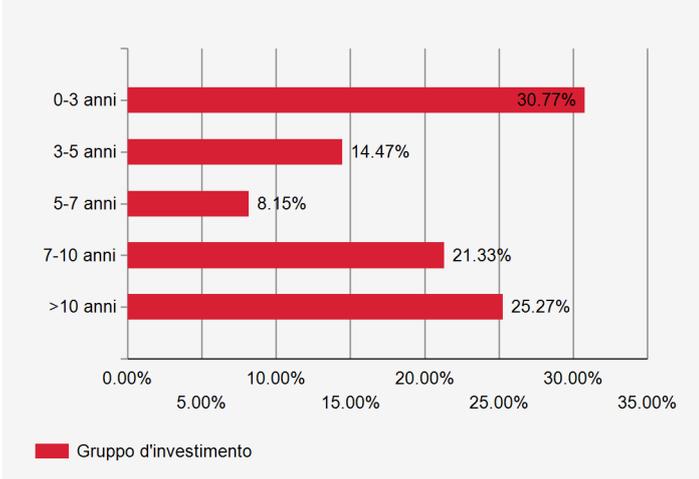
Principali debitori e rating

	Gruppo d'investimento	
Giappone	A+	17.44%
US Treasury N/B	AAA	8.85%
Italia	BBB	5.45%
Regno di Spagna	A	2.56%
BNG Bank NV	AAA	1.97%

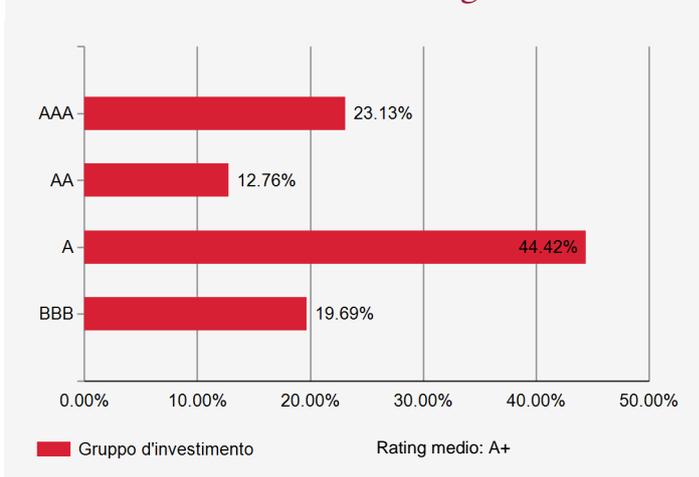
Ulteriori informazioni sui debitori

Numero di debitori	149
Quota di debitori senza benchmark	0.00%

Struttura della scadenza dei titoli



Investimenti secondo il rating



Durata e rendimento alla scadenza

	Gruppo d'investimento	Benchmark
Modified Duration	7.2	6.9
Rendimento alla scadenza teorica*	3.47%	3.42%

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

Struttura del portafoglio secondo il paese/regione

	Gruppo d'investimento	Benchmark
Stati Uniti	25.14%	37.17%
Giappone	20.41%	13.69%
Canada	8.10%	4.37%
Italia	6.81%	4.00%
Germania	5.41%	5.87%
Francia	5.24%	6.18%
Regno Unito	3.78%	5.48%
Regione Europea (EUR)	11.10%	8.90%
Regione Europea (Ex EUR)	3.57%	1.59%
Mercati Emergenti in America	1.66%	0.04%
Altri	3.61%	12.72%
Liquidità, copertura	5.17%	-

Fondazione d'investimento Swiss Life

Obbligazioni Global Stati+ (CHF hedged)

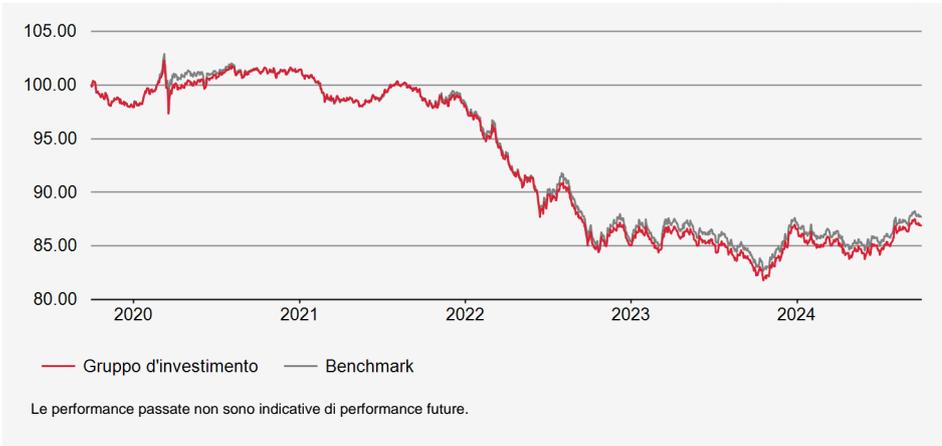


Patrimonio netto (NAV) in mio. CHF: 866.06
Valore d'inventario netto per diritto in CHF: 107.80

Strategia d'investimento

Investimenti in titoli di credito 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). Titoli di credito di 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)



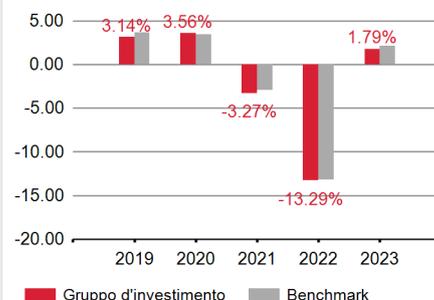
Performance nella valuta di riferimento

	Performance cumulata				Performance annualizzata			
	YTD	1 mese	3 mesi	1 anno	3 anni	5 anni	10 anni	Inizio
Gruppo d'investimento	0.35%	0.62%	2.74%	4.74%	-4.11%	-2.77%	-0.64%	0.55%
Benchmark	0.56%	0.72%	2.78%	4.79%	-3.81%	-2.58%	-0.41%	0.59%

Dati statistici (annualizzati)

	1 anno	3 anni	5 anni	10 anni	Inizio
Volatilità Gruppo d'investimento (in %)	4.88	5.04	4.32	3.71	3.57
Volatilità del Benchmark (in %)	4.60	5.15	4.39	3.80	3.53
Tracking Error ex post (in %)	0.34	0.57	0.60	0.59	0.69
Information Ratio	-0.15	-0.52	-0.31	-0.39	-0.06
Sharpe Ratio	0.64	-0.97	-0.68	-0.09	0.21
Correlazione	1.00	0.99	0.99	0.99	0.98
Beta	1.06	0.97	0.98	0.96	0.99
Jensen alfa	-0.25	-0.43	-0.25	-0.23	-0.03
Maximum Drawdown (in %)	-3.70	-17.43	-20.00	-20.00	-20.00
Recovery Period (anni)	0.27	-	-	-	-

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: 13.00
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: 30/09/2024 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	76.59%	100.00%
Finanza	6.78%	-
Instituti lettere di pegno	3.56%	-
Beni Industriali	0.08%	-
Supernazionale	4.27%	-
Liquidità	8.59%	-
Copertura del rischio di cambio	0.11%	-

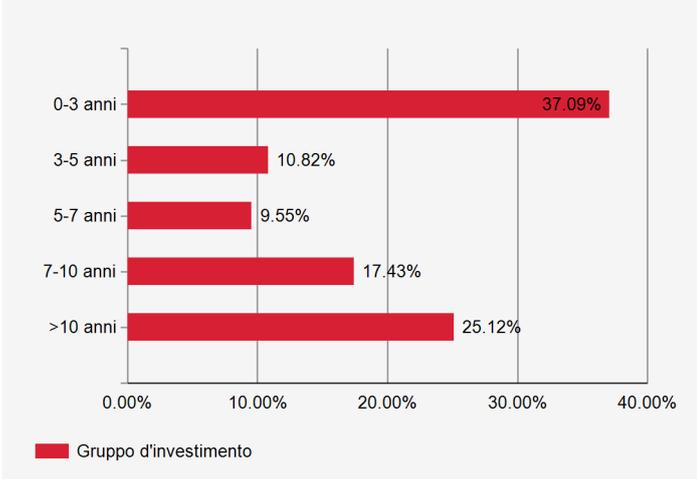
Principali debitori e rating

	Gruppo d'investimento	
Giappone	A+	21.87%
US Treasury N/B	AAA	14.44%
Italia	BBB-	5.73%
People's Republic of China	A+	5.38%
Regno di Spagna	A-	4.64%

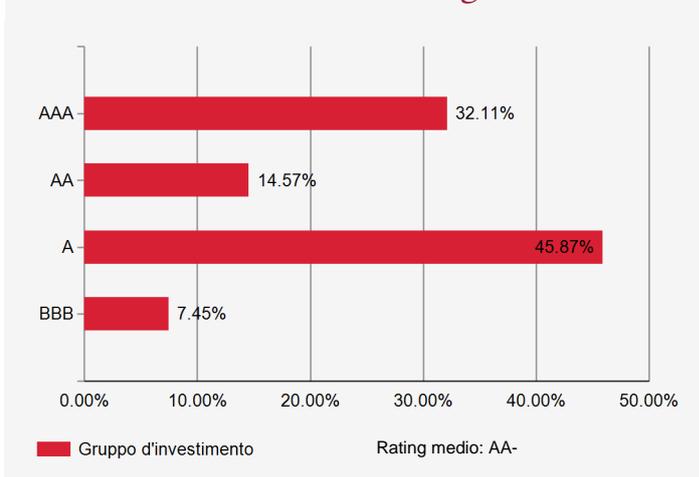
Ulteriori informazioni sui debitori

Numero di debitori	65
Quota di debitori senza benchmark	3.30%

Struttura della scadenza dei titoli



Investimenti secondo il rating



Durata e rendimento alla scadenza

	Gruppo d'investimento	Benchmark
Modified Duration	7.4	7.3
Rendimento alla scadenza teorica*	3.03%	2.92%

* 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
JPY	31.78%	4.73	17.98%	8.92
EUR	21.87%	10.03	23.12%	7.17
USD	18.19%	12.31	33.43%	6.01
GBP	9.08%	8.72	5.54%	8.99
Altri	19.07%	7.28	19.94%	7.11

Struttura del portafoglio secondo il paese/regione

	Gruppo d'investimento	Benchmark
Giappone	24.39%	17.98%
Stati Uniti	15.99%	33.43%
Italia	6.33%	5.02%
Cina	5.95%	9.51%
Spagna	5.28%	3.28%
Regno Unito	4.97%	5.54%
Germania	3.73%	4.37%
Regione Europea (EUR)	10.92%	9.68%
Regione Europea (Ex EUR)	4.94%	0.45%
Regione Asia e Pacifico	1.84%	1.35%
Altri	6.95%	9.40%
Liquidità, copertura	8.71%	-

Fondazione d'investimento Swiss Life

Obbligazioni Global Imprese Short Term (CHF hedged)

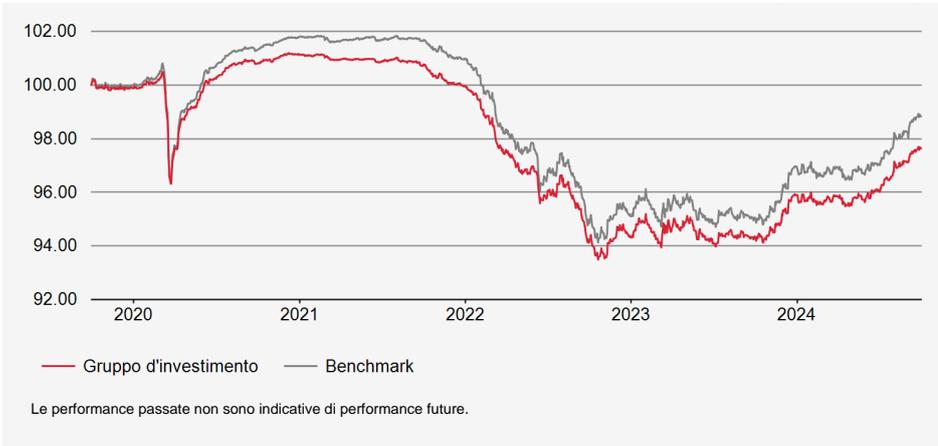


Patrimonio netto (NAV) in mio. CHF: 1,376.35
Valore d'inventario netto per diritto in CHF: 99.05

Strategia d'investimento

Investimenti in titoli di credito di società (agenzie e supranazionali 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%. Titoli di credito di 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)



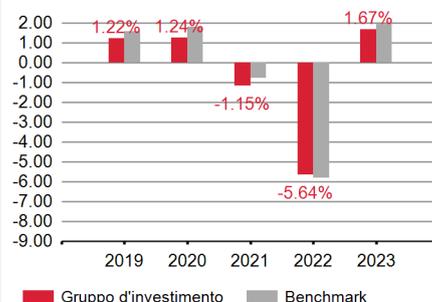
Performance nella valuta di riferimento

	Performance cumulata				Performance annualizzata			
	YTD	1 mese	3 mesi	1 anno	3 anni	5 anni	10 anni	Inizio
Gruppo d'investimento	1.81%	0.53%	1.62%	3.48%	-1.03%	-0.48%	-0.27%	-0.09%
Benchmark	1.92%	0.58%	1.83%	3.97%	-0.93%	-0.23%	-0.09%	0.07%

Dati statistici (annualizzati)

	1 anno	3 anni	5 anni	10 anni	Inizio
Volatilità Gruppo d'investimento (in %)	1.37	2.13	2.22	1.67	1.61
Volatilità del Benchmark (in %)	1.68	2.35	2.39	1.76	1.69
Tracking Error ex post (in %)	0.36	0.31	0.27	0.32	0.32
Information Ratio	-1.34	-0.32	-0.92	-0.55	-0.49
Sharpe Ratio	1.41	-0.81	-0.28	0.02	0.12
Correlazione	0.99	0.99	1.00	0.98	0.98
Beta	0.81	0.90	0.92	0.93	0.94
Jensen alfa	-0.02	-0.27	-0.28	-0.16	-0.13
Maximum Drawdown (in %)	-0.53	-7.22	-7.61	-8.08	-8.08
Recovery Period (anni)	0.16	-	-	-	-

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: 13.00
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: 0.37%
ex post al: 30/09/2024 0.37%

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	53.44%	50.99%
Consumo non ciclico	11.59%	12.11%
Consumo ciclico	8.52%	9.88%
Comunicazione	4.67%	5.39%
Energia	4.08%	4.13%
Tecnologia	3.75%	4.08%
Beni Industriali	3.36%	5.91%
Servizi di pubblica utilità	2.52%	5.24%
Altri	2.88%	2.28%
Liquidità	3.58%	-
Copertura del rischio di cambio	1.60%	-

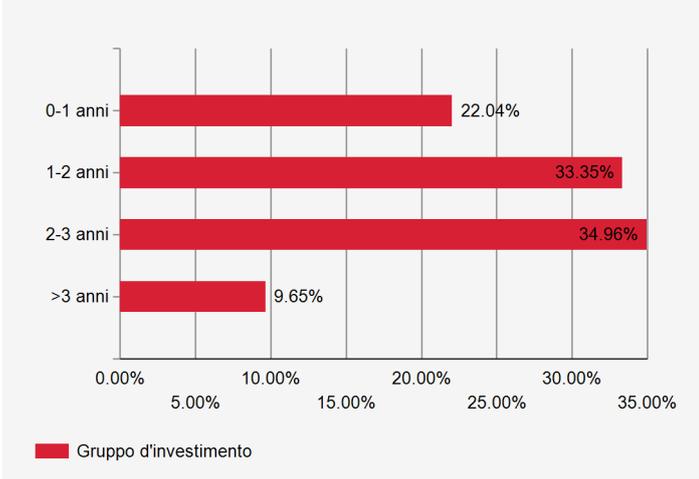
Principali debitori e rating

		Gruppo d'investimento
Banco Santander SA, Madrid	A-	3.06%
Credit Agricole Group	BBB+	2.65%
Citigroup Inc	BBB+	2.33%
Barclays Capital PLC, London	BBB	2.14%
Morgan Stanley NE US	A	2.03%

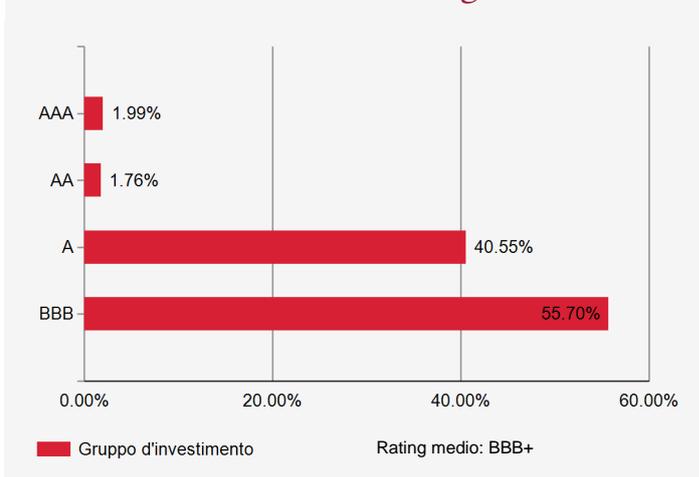
Ulteriori informazioni sui debitori

Numero di debitori	149
Quota di debitori senza benchmark	6.63%

Struttura della scadenza dei titoli



Investimenti secondo il rating



Durata e rendimento alla scadenza

	Gruppo d'investimento	Benchmark
Modified Duration	1.9	1.8
Rendimento alla scadenza teorica*	3.76%	3.89%

* 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	58.79%	1.89	60.04%	1.88
EUR	25.44%	1.97	29.79%	1.96
CHF	11.25%	1.31	0.47%	1.91
GBP	3.47%	1.47	3.86%	1.89
Altri	1.05%	2.00	5.84%	1.97

Struttura del portafoglio secondo il paese/regione

	Gruppo d'investimento	Benchmark
Stati Uniti	34.19%	45.94%
Francia	8.95%	7.59%
Regno Unito	7.84%	6.85%
Canada	7.56%	5.77%
Germania	6.45%	6.20%
Svizzera	6.14%	2.05%
Spagna	5.60%	3.33%
Regione Europea (EUR)	6.14%	6.62%
Mercati Emergenti Asia Pacifico	4.69%	2.36%
Regione Asia e Pacifico	3.55%	4.63%
Altri	3.70%	8.67%
Liquidità, copertura	5.19%	-

Fondazione d'investimento Swiss Life

Obbligazioni Global Imprese (CHF hedged)

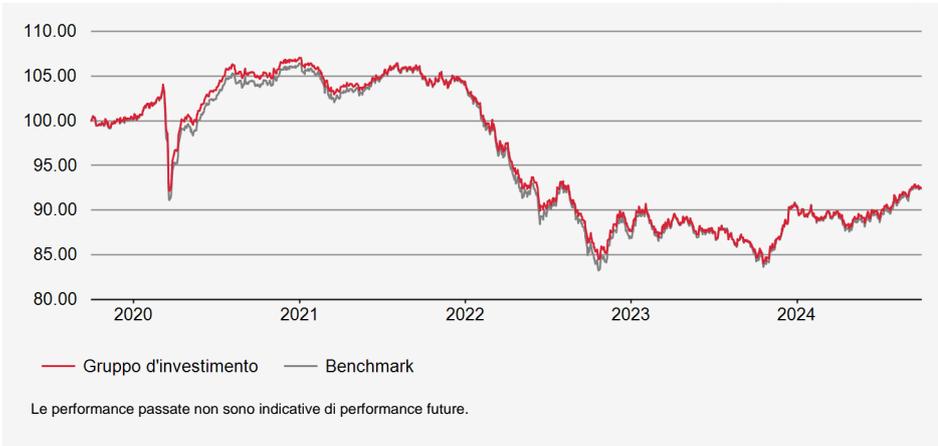


Patrimonio netto (NAV) in mio. CHF: 811.36
Valore d'inventario netto per diritto in CHF: 122.29

Strategia d'investimento

Investimenti in titoli di credito di imprese, incl. agenzie ed enti sovranazionali. Selezione attiva di titoli, gestione della duration e posizionamento della curva dei tassi d'interesse. Titoli di credito di 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)



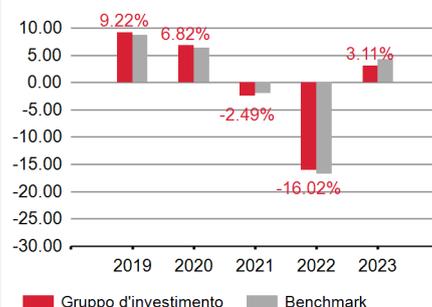
Performance nella valuta di riferimento

	Performance cumulata				Performance annualizzata			
	YTD	1 mese	3 mesi	1 anno	3 anni	5 anni	10 anni	Inizio
Gruppo d'investimento	2.30%	0.98%	3.46%	8.00%	-4.07%	-1.55%	0.16%	1.47%
Benchmark	2.01%	1.22%	3.81%	8.31%	-4.05%	-1.56%	0.30%	1.44%

Dati statistici (annualizzati)

	1 anno	3 anni	5 anni	10 anni	Inizio
Volatilità Gruppo d'investimento (in %)	5.73	7.00	6.81	5.40	5.18
Volatilità del Benchmark (in %)	6.50	7.83	7.56	5.83	5.37
Tracking Error ex post (in %)	0.83	1.00	0.94	0.86	0.96
Information Ratio	-0.38	-0.02	0.01	-0.15	0.02
Sharpe Ratio	1.08	-0.69	-0.25	0.09	0.32
Correlazione	1.00	1.00	1.00	0.99	0.98
Beta	0.88	0.89	0.90	0.92	0.95
Jensen alfa	0.51	-0.54	-0.16	-0.08	0.11
Maximum Drawdown (in %)	-3.05	-20.25	-21.47	-21.47	-21.47
Recovery Period (anni)	0.27	-	-	-	-

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: 13.00
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: 30/09/2024 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	46.83%	38.35%
Consumo non ciclico	13.75%	16.36%
Energia	7.44%	6.00%
Servizi di pubblica utilità	6.41%	8.99%
Beni Industriali	5.32%	7.20%
Consumo ciclico	5.09%	7.61%
Comunicazione	5.08%	7.90%
Tecnologia	4.98%	4.64%
Altri	2.00%	2.95%
Liquidità	2.54%	-
Copertura del rischio di cambio	0.57%	-

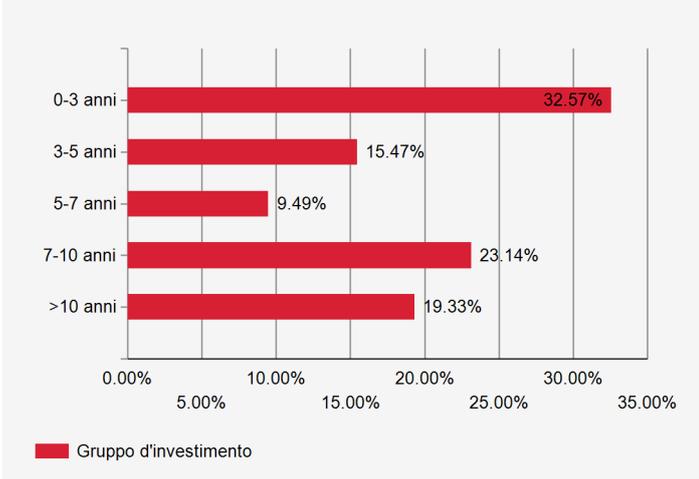
Principali debitori e rating

	Rating	Gruppo d'investimento
Porsche Automobil Holding SE	BBB	2.26%
Banco Santander SA, Madrid	BBB+	2.26%
Groupe BPCE	BBB+	1.74%
Credit Agricole Group	BBB+	1.73%
Société Générale, Paris	BBB	1.66%

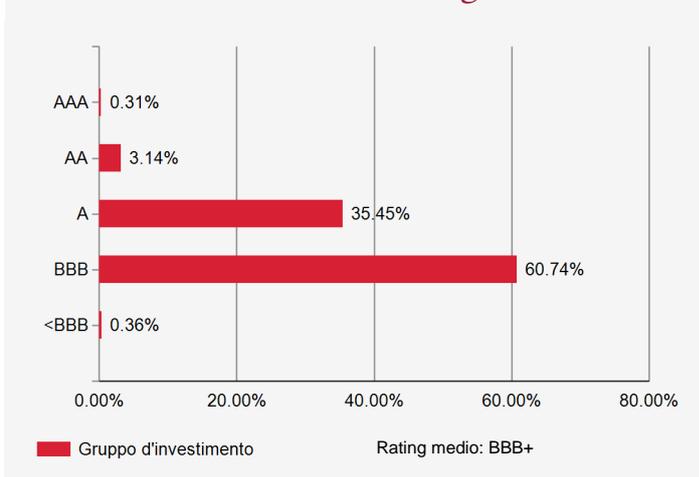
Ulteriori informazioni sui debitori

Numero di debitori	231
Quota di debitori senza benchmark	3.11%

Struttura della scadenza dei titoli



Investimenti secondo il rating



Durata e rendimento alla scadenza

	Gruppo d'investimento	Benchmark
Modified Duration	6.1	6.1
Rendimento alla scadenza teorica*	4.71%	4.65%

* 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	56.90%	7.88	67.08%	6.74
EUR	28.77%	3.60	23.88%	4.44
CHF	5.81%	2.18	0.37%	4.39
JPY	2.48%	2.04	0.70%	4.16
Altri	6.03%	4.29	7.97%	5.64

Struttura del portafoglio secondo il paese/regione

	Gruppo d'investimento	Benchmark
Stati Uniti	37.40%	56.23%
Regno Unito	10.24%	6.85%
Francia	9.17%	6.19%
Germania	5.33%	5.04%
Spagna	4.30%	2.20%
Giappone	4.15%	3.37%
Svizzera	3.99%	1.45%
Regione Europea (EUR)	9.45%	5.87%
Regione Asia e Pacifico	3.23%	2.21%
Regione Europea (Ex EUR)	3.20%	1.61%
Altri	6.43%	8.98%
Liquidità, copertura	3.11%	-

Fondazione d'investimento Swiss Life

Obbligazioni Emerging Markets Short Term (CHF hedged)



SwissLife

Patrimonio netto (NAV) in mio. CHF: 128.57
Valore d'inventario netto per diritto in CHF: 96.78

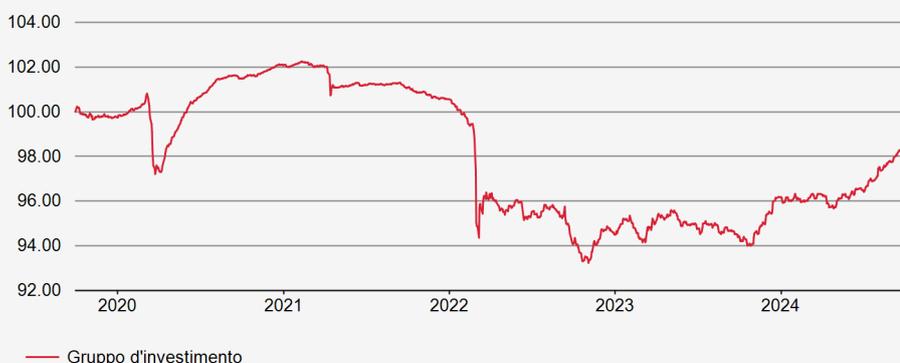
Strategia d'investimento

Investimenti in titoli di credito in dollari statunitensi o altre valute forti di imprese e stati 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)



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	2.28%	0.63%	1.95%	4.15%	-0.90%	-0.33%	-	-0.47%

Dati statistici (annualizzati)

	1 anno	3 anni	5 anni	10 anni	Inizio
Volatilità Gruppo d'investimento (in %)	1.94	2.66	2.65	-	2.29
Sharpe Ratio	1.33	-0.60	-0.18	-	-0.14
Maximum Drawdown (in %)	-0.68	-7.78	-8.82	-	-8.82
Recovery Period (anni)	0.07	-	-	-	-

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: 13.00

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: 0.57%

ex post al: 30/09/2024 0.57%

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 (CHF hedged)

Struttura del portafoglio per settore

	Gruppo d'investimento
Finanza	33.86%
Stati e simili	18.51%
Energia	8.84%
Comunicazione	8.25%
Consumo non ciclico	6.38%
Consumo ciclico	6.29%
Materiali di base	5.79%
Servizi di pubblica utilità	4.23%
Altri	6.03%
Liquidità	1.75%
Copertura del rischio di cambio	0.08%

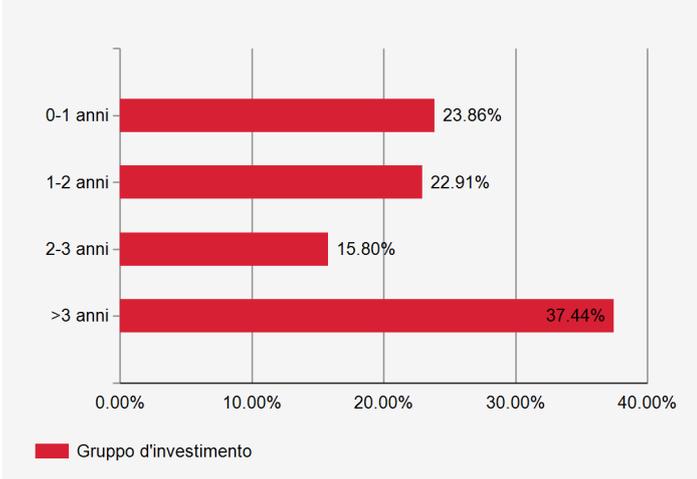
Principali debitori e rating

	Gruppo d'investimento	
HDFC Bank Ltd	BBB-	3.07%
First Abu Dhabi Bank PJSC	AA-	3.05%
United Mexican States	BBB	3.05%
OTP Bank Nyrt	BBB-	2.73%
Reliance Industries Ltd	BBB	2.39%

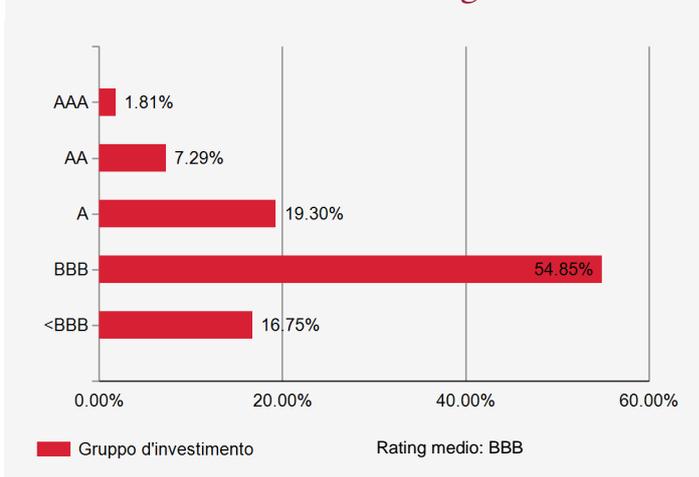
Ulteriori informazioni sui debitori

Numero di debitori	94
--------------------	----

Struttura della scadenza dei titoli



Investimenti secondo il rating



Durata e rendimento alla scadenza

	Gruppo d'investimento
Modified Duration	2.1
Rendimento alla scadenza teorica*	4.97%

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

Struttura del portafoglio per valute e la duration

	Gruppo d'investimento	
	Peso	Duration
CHF	99.70%	0.07
USD	0.30%	673.87
EUR	0.01%	1040.17

Struttura del portafoglio secondo il paese/regione

	Gruppo d'investimento
Cina	10.93%
India	9.69%
Emirati Arabi Uniti	7.75%
Messico	6.17%
Indonesia	6.12%
Ungheria	4.65%
Qatar	3.60%
Mercati Emergenti Asia Pacifico	15.60%
Mercati Emergenti in America	13.57%
Mercati Emergenti in Europa	4.12%
Altri	15.99%
Liquidità, copertura	1.82%

Fondazione d'investimento Swiss Life

Obbligazioni Emerging Markets Imprese (CHF hedged)

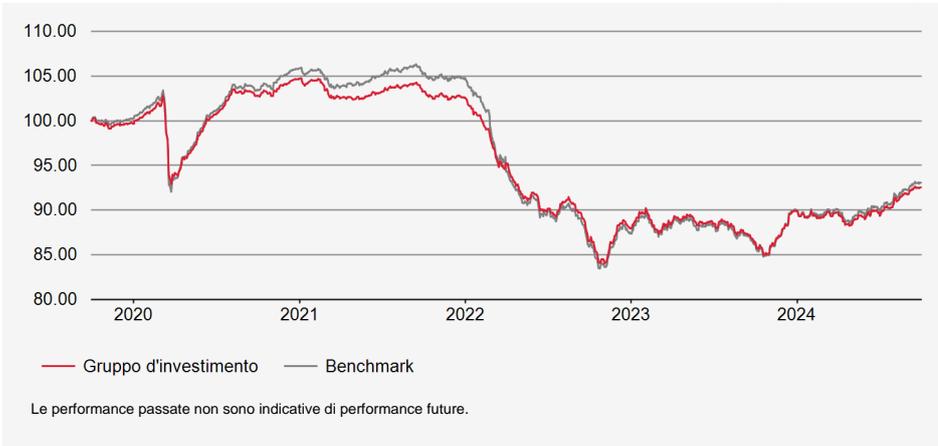


Patrimonio netto (NAV) in mio. CHF: 352.54
Valore d'inventario netto per diritto in CHF: 94.60

Strategia d'investimento

Investimenti in titoli di credito in dollari statunitensi o altre valute forti di imprese e Stati, inclusi organismi sovranazionali e agenzie, di Paesi di recente industrializzazione (Emerging Markets). Selezione attiva dei titoli, gestione della duration e posizionamento lungo la curva dei tassi. Limitazione per debitore: 10%. Titoli di credito di debitori esterni al benchmark: max. 35%. Qualità media di rating: almeno BBB-. I rischi di valuta vengono coperti almeno al 90% rispetto al franco svizzero. Attuazione con l'impiego di Swiss Life Funds (LUX) Bond Emerging Markets Corporates CHF-hedged AM Cap; fondo d'investimento di diritto lussemburghese.

Evoluzione del valore nella valuta di riferimento (base 100)



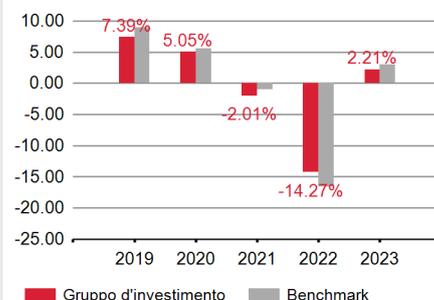
Performance nella valuta di riferimento

	Performance cumulata				Performance annualizzata			
	YTD	1 mese	3 mesi	1 anno	3 anni	5 anni	10 anni	Inizio
Gruppo d'investimento	2.96%	0.84%	3.22%	7.03%	-3.58%	-1.53%	-	-0.79%
Benchmark	3.38%	0.89%	3.30%	7.89%	-4.00%	-1.42%	-	-0.43%

Dati statistici (annualizzati)

	1 anno	3 anni	5 anni	10 anni	Inizio
Volatilità Gruppo d'investimento (in %)	4.86	6.11	6.39	-	5.59
Volatilità del Benchmark (in %)	4.98	6.62	7.06	-	6.14
Tracking Error ex post (in %)	0.43	1.28	1.22	-	1.07
Information Ratio	-2.01	0.33	-0.09	-	-0.34
Sharpe Ratio	1.09	-0.71	-0.27	-	-0.12
Correlazione	1.00	0.98	0.99	-	0.99
Beta	0.97	0.91	0.89	-	0.90
Jensen alfa	-0.69	-0.02	-0.28	-	-0.39
Maximum Drawdown (in %)	-1.86	-18.64	-19.77	-	-19.77
Recovery Period (anni)	0.14	-	-	-	-

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: 13.00
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: 0.82%
ex post al: 30/09/2024 0.82%

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	31.93%	36.41%
Comunicazione	12.02%	9.03%
Servizi di pubblica utilità	10.70%	10.48%
Energia	9.55%	11.44%
Consumo non ciclico	8.86%	4.84%
Beni Industriali	6.65%	4.08%
Tecnologia	5.47%	5.27%
Materiali di base	4.50%	11.22%
Supernazionale	1.66%	-
Altri	8.01%	7.24%
Liquidità	0.57%	-
Copertura del rischio di cambio	0.07%	-

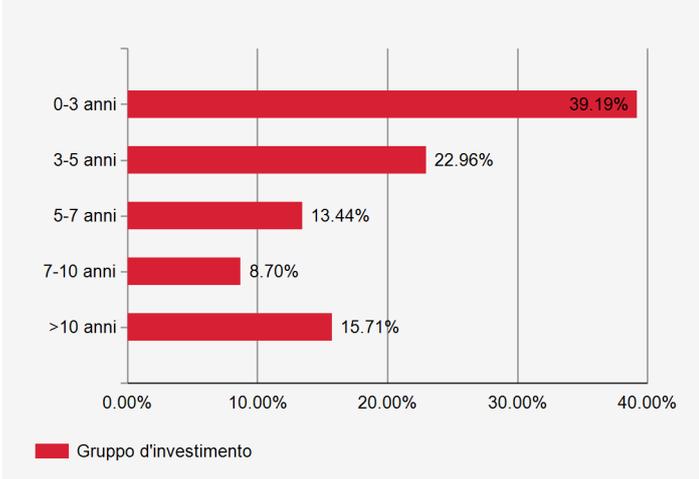
Principali debitori e rating

		Gruppo d'investimento
Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd	AA-	3.53%
US Treasury N/B	AAA	3.31%
Prosus NV	BBB	2.32%
OTP Bank Nyrt	BBB-	1.81%
HDFC Bank Ltd	BBB-	1.77%

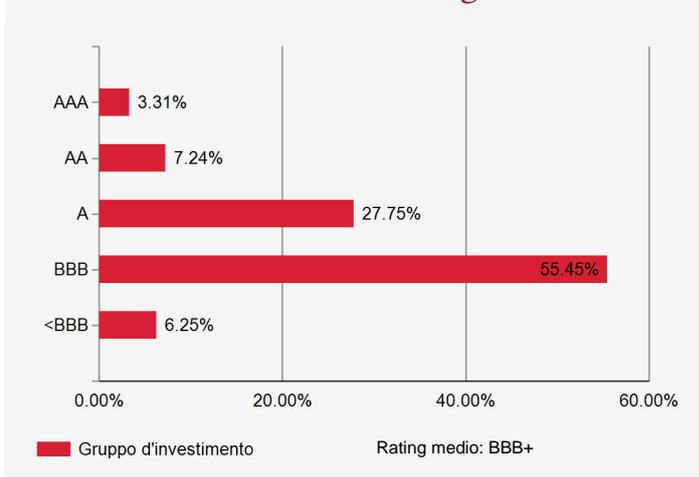
Ulteriori informazioni sui debitori

Numero di debitori	149
Quota di debitori senza benchmark	23.05%

Struttura della scadenza dei titoli



Investimenti secondo il rating



Durata e rendimento alla scadenza

	Gruppo d'investimento	Benchmark
Modified Duration	5.2	4.8
Rendimento alla scadenza teorica*	5.78%	5.19%

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

Struttura del portafoglio secondo il paese/regione

	Gruppo d'investimento	Benchmark
Cina	9.52%	13.52%
Corea del Sud	6.91%	7.63%
Emirati Arabi Uniti	6.66%	5.72%
India	5.92%	4.03%
Messico	5.03%	4.85%
Qatar	4.64%	5.56%
Singapore	4.59%	3.93%
Mercati Emergenti Asia Pacifico	18.84%	19.75%
Mercati Emergenti in America	12.30%	8.20%
Mercati Emergenti Medio Oriente	5.80%	10.07%
Altri	19.14%	16.75%
Liquidità, copertura	0.64%	-

Patrimonio netto (NAV) in mio. CHF: 518.72
Valore d'inventario netto per diritto in CHF: 357.11

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 Index Funds (CH) Equity Switzerland Large Cap e SL iFunds 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)



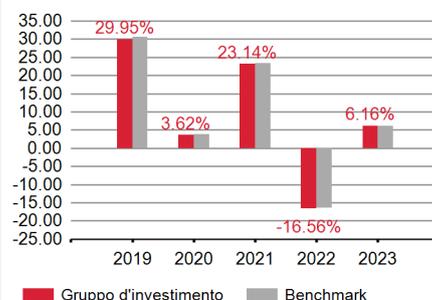
Performance nella valuta di riferimento

	Performance cumulata				Performance annualizzata			
	YTD	1 mese	3 mesi	1 anno	3 anni	5 anni	10 anni	Inizio
Gruppo d'investimento	11.19%	-1.58%	1.91%	12.65%	2.58%	5.66%	6.16%	5.69%
Benchmark	11.47%	-1.59%	2.03%	13.04%	2.58%	5.83%	6.44%	6.18%

Dati statistici (annualizzati)

	1 anno	3 anni	5 anni	10 anni	Inizio
Volatilità Gruppo d'investimento (in %)	10.94	12.45	12.74	12.14	12.84
Volatilità del Benchmark (in %)	11.02	12.50	12.80	12.18	13.17
Tracking Error ex post (in %)	0.27	0.35	0.34	0.31	1.17
Information Ratio	-1.44	-0.02	-0.49	-0.91	-0.49
Sharpe Ratio	0.95	0.15	0.42	0.52	0.41
Correlazione	1.00	1.00	1.00	1.00	1.00
Beta	0.99	1.00	0.99	1.00	0.97
Jensen alfa	-0.30	0.00	-0.14	-0.25	-0.32
Maximum Drawdown (in %)	-6.52	-21.88	-25.88	-25.88	-54.46
Recovery Period (anni)	0.06	-	0.83	0.83	4.97

Performance



Informazioni sul prodotto

Numero di valore: 1245481
ISIN: CH0012454812
LEI: 254900UNZU5YPIKQTQ23
Codice Bloomberg: SWAAKCH SW
Benchmark: SPI® Total Return
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: 13.00
Commissione d'emissione / riscatto: nessuna
Prassi di distribuzione: Capitalizzazione
Asset Manager in base al Swiss Life Best Select Invest Plus® Large Caps (passivo)
 Swiss Life Asset Management AG
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: 0.47%
ex post al: 30/09/2024 0.51%

Struttura del portafoglio per settore

	Gruppo d'investimento	Benchmark
Salute	33.76%	34.11%
Finanza	17.90%	19.68%
Beni di prima necessità	16.48%	16.48%
Industrie	14.17%	13.48%
Materiali	8.22%	8.42%
Beni voluttuari	4.92%	5.14%
Tecnologia dell'informazione	1.67%	1.49%
Servizi di comunicazione	0.87%	0.97%
Servizi di pubblica utilità	0.39%	0.22%
Energia	-	-
Liquidità	1.63%	-

Le principali posizioni

	Gruppo d'investimento	Benchmark
NESTLE SA-REG	13.78%	13.86%
NOVARTIS AG-REG	12.30%	12.37%
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	11.77%	11.84%
UBS GROUP AG-REG	5.21%	5.24%
ABB LTD-REG	4.84%	4.87%
ZURICH INSURANCE GROUP AG	4.62%	4.65%
CIE FINANCIERE RICHEMO-A REG	4.45%	4.48%
SIKA AG-REG	2.78%	2.80%
HOLCIM LTD	2.77%	2.79%
ALCON INC	2.61%	2.62%

Struttura del portafoglio in base al volume dell'impresa

	Gruppo d'investimento		Benchmark	
	Partecip.	Numero	Partecip.	Numero
Grandi imprese	80.14%	20	80.20%	20
Medie imprese	17.50%	47	18.15%	80
Piccole imprese	0.74%	4	1.65%	106
Liquidità	1.63%	-	-	-

Fondazione d'investimento Swiss Life Azioni Svizzera Large Caps Indicizzate



Patrimonio netto (NAV) in mio. CHF: 517.66
Valore d'inventario netto per diritto in CHF: 155.50

Strategia d'investimento

Il gruppo d'investimento viene gestito con un approccio indicizzato e si contraddistingue per l'ampia diversificazione e il tracking error minimo. L'obiettivo d'investimento consiste nel replicare il benchmark SPI® 20 Total Return. Realizzazione tramite Swiss Life Index Funds (CH) Equity Switzerland Large Cap; Fondi d'investimento di diritto svizzero della categoria "altri fondi per investimenti tradizionali".

Evoluzione del valore nella valuta di riferimento (base 100)



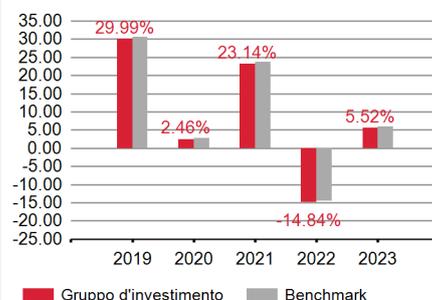
Performance nella valuta di riferimento

	Performance cumulata				Performance annualizzata			
	YTD	1 mese	3 mesi	1 anno	3 anni	5 anni	10 anni	Inizio
Gruppo d'investimento	11.61%	-2.08%	1.36%	12.70%	3.53%	5.68%	-	6.85%
Benchmark	12.02%	-2.12%	1.42%	13.22%	3.95%	6.10%	-	7.27%

Dati statistici (annualizzati)

	1 anno	3 anni	5 anni	10 anni	Inizio
Volatilità Gruppo d'investimento (in %)	11.36	12.34	12.48	-	12.32
Volatilità del Benchmark (in %)	11.47	12.39	12.54	-	12.37
Tracking Error ex post (in %)	0.14	0.09	0.08	-	0.08
Information Ratio	-3.72	-4.62	-5.00	-	-5.21
Sharpe Ratio	0.92	0.22	0.43	-	0.55
Correlazione	1.00	1.00	1.00	-	1.00
Beta	0.99	1.00	1.00	-	1.00
Jensen alfa	-0.41	-0.40	-0.39	-	-0.39
Maximum Drawdown (in %)	-6.92	-19.89	-25.04	-	-25.04
Recovery Period (anni)	0.06	1.69	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: 13.00

Commissione d'emissione / riscatto: nessuna

Prassi di distribuzione: Capitalizzazione

Asset Manager in base al

Swiss Life Best Select Invest Plus®:
Swiss Life 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: 0.17%

ex post al: 30/09/2024 0.26%

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



Struttura del portafoglio per settore

	Gruppo d'investimento	Benchmark
Salute	37.73%	37.74%
Finanza	18.86%	18.87%
Beni di prima necessità	17.34%	17.34%
Materiali	9.86%	9.86%
Industrie	8.52%	8.52%
Beni voluttuari	5.60%	5.60%
Servizi di comunicazione	1.09%	1.09%
Tecnologia dell'informazione	0.97%	0.97%
Liquidità / Prestito	0.04%	-

Le principali posizioni

	Gruppo d'investimento	Benchmark
NESTLE SA-REG	17.34%	17.34%
NOVARTIS AG-REG	15.47%	15.48%
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	14.81%	14.81%
UBS GROUP AG-REG	6.56%	6.56%
ABB LTD-REG	6.09%	6.09%
ZURICH INSURANCE GROUP AG	5.81%	5.81%
CIE FINANCIERE RICHEMO-A REG	5.60%	5.60%
SIKA AG-REG	3.50%	3.50%
HOLCIM LTD	3.48%	3.49%
ALCON INC	3.28%	3.28%

Nota legale: La presente pubblicazione non rappresenta né un invito, né una raccomandazione ad acquistare o vendere strumenti d'investimento, ma funge meramente da veicolo informativo. È possibile richiedere gratuitamente tutti i documenti che costituiscono la base giuridica di un eventuale investimento presso la Fondazione d'investimento Swiss Life, c/o Swiss Life SA, casella postale 8022 Zurigo, telefono 043 547 71 11 e su www.swisslife.ch/aniagesstiftung. La cerchia degli investitori è limitata alle istituzioni del secondo pilastro e del pilastro 3a, non-ché istituzioni esonerate dall'obbligo tributario, con sede in Svizzera e che secondo l'oggetto sociale perseguono la previdenza professionale e persone che gestiscono investimenti collettivi per queste istituzioni, sono sorvegliate dall'Autorità federale di vigilanza sui mercati finanziari FINMA e che investono presso la fondazione esclusivamente capitali per queste istituzioni. La performance precedente non rappresenta un indicatore né per l'evoluzione attuale, né per quella futura. L'utilizzo non implica alcuna affiliazione con o sponsorizzazione da parte di quest'ultimi. **Fonte:** Swiss Life Asset Managers. Tutti i diritti riservati.

Fondazione d'investimento Swiss Life

Azioni Svizzera Small & Mid Caps

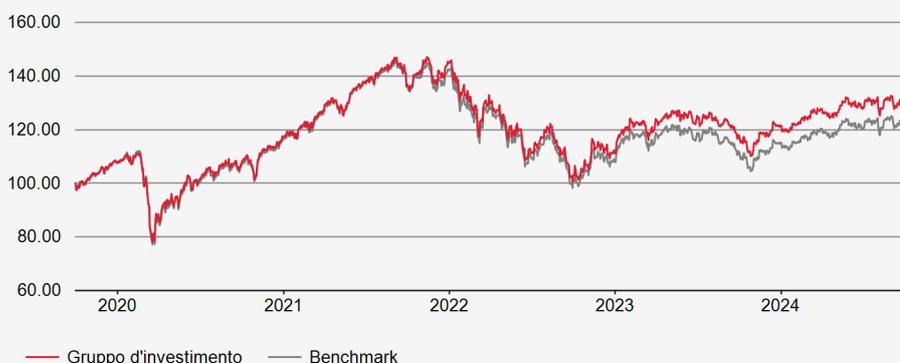


Patrimonio netto (NAV) in mio. CHF: 137.24
Valore d'inventario netto per diritto in CHF: 131.27

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)



Le performance passate non sono indicative di performance future.

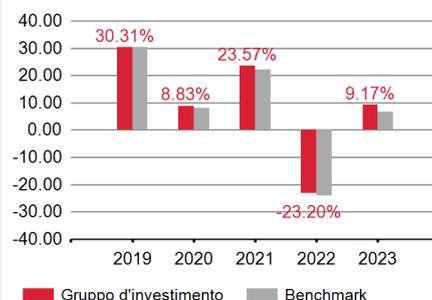
Performance nella valuta di riferimento

	Performance cumulata				Performance annualizzata			
	YTD	1 mese	3 mesi	1 anno	3 anni	5 anni	10 anni	Inizio
Gruppo d'investimento	9.97%	0.71%	4.41%	13.14%	-0.82%	5.95%	-	4.17%
Benchmark	9.26%	0.58%	4.53%	12.27%	-2.75%	4.67%	-	3.20%

Dati statistici (annualizzati)

	1 anno	3 anni	5 anni	10 anni	Inizio
Volatilità Gruppo d'investimento (in %)	10.41	14.78	15.59	-	15.37
Volatilità del Benchmark (in %)	10.33	14.64	15.71	-	15.35
Tracking Error ex post (in %)	1.28	1.70	1.62	-	1.57
Information Ratio	0.69	1.14	0.79	-	0.62
Sharpe Ratio	1.04	-0.10	0.36	-	0.27
Correlazione	0.99	0.99	0.99	-	0.99
Beta	1.00	1.00	0.99	-	1.00
Jensen alfa	0.88	1.94	1.33	-	0.98
Maximum Drawdown (in %)	-6.63	-31.60	-31.60	-	-31.60
Recovery Period (anni)	0.05	-	-	-	-

Performance



Informazioni sul prodotto

Numero di valore: 39561890
ISIN: CH0395618900
LEI: 254900QGENUS1GIJ4549
Codice Bloomberg: SWLASM SW
Benchmark: SPI EXTRA® 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: 13.00
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: 30/09/2024 0.94%

Struttura del portafoglio per settore

	Gruppo d'investimento	Benchmark
Industrie	37.46%	33.25%
Salute	19.12%	19.67%
Finanza	14.73%	22.90%
Beni di prima necessità	13.71%	13.07%
Tecnologia dell'informazione	4.56%	3.58%
Beni voluttuari	2.38%	3.27%
Materiali	1.99%	2.68%
Servizi di pubblica utilità	1.97%	1.09%
Servizi di comunicazione	-	0.50%
Energia	-	-
Liquidità	4.08%	-

Le principali posizioni

	Gruppo d'investimento	Benchmark
LINDT & SPRÜNGLI	6.77%	7.12%
STRAUMANN HOLDING AG	5.43%	5.07%
SGS SA	5.42%	4.49%
SANDOZ GROUP AG	4.91%	4.72%
SCHINDLER HOLDING AG	4.27%	4.66%
VAT GROUP AG	4.17%	3.60%
JULIUS BAER GROUP LTD	3.94%	3.25%
BALOISE HOLDING AG	2.87%	2.33%
BELIMO HOLDING AG	2.76%	1.85%
SIEGFRIED HOLDING AG	2.41%	1.51%

Struttura del portafoglio in base al volume dell'impresa

	Gruppo d'investimento		Benchmark	
	Partecip.	Numero	Partecip.	Numero
Grandi imprese	12.18%	3	9.78%	2
Medie imprese	80.04%	45	82.01%	78
Piccole imprese	3.69%	4	8.21%	106
Liquidità	4.08%	-	-	-

Fondazione d'investimento Swiss Life

Azioni Svizzera Protect Flex



Patrimonio netto (NAV) in mio. CHF: 175.59
Valore d'inventario netto per diritto in CHF: 116.85

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)



— Gruppo d'investimento

Le performance passate non sono indicative di performance future.

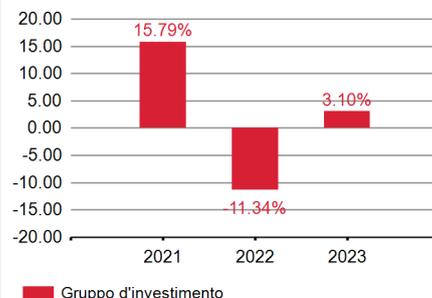
Performance nella valuta di riferimento

	Performance cumulata				Performance annualizzata			
	YTD	1 mese	3 mesi	1 anno	3 anni	5 anni	10 anni	Inizio
Gruppo d'investimento	9.14%	-1.77%	0.85%	10.19%	2.39%	-	-	4.20%

Dati statistici (annualizzati)

	1 anno	3 anni	5 anni	10 anni	Inizio
Volatilità Gruppo d'investimento (in %)	8.57	8.92	-	-	8.97
Sharpe Ratio	0.96	0.19	-	-	0.40
Maximum Drawdown (in %)	-4.84	-15.35	-	-	-15.35
Recovery Period (anni)	0.06	1.79	-	-	1.79

Performance



Informazioni sul prodotto

Numero di valore: 58002332

ISIN: CH0580023320

LEI: 254900ZUTROYHLYQ4E86

Codice Bloomberg: SLASPFC 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: 13.00

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: 0.45%

ex post al: 30/09/2024 0.45%

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	35.66%
Finanza	17.78%
Beni di prima necessità	14.38%
Materiali	9.28%
Industrie	8.10%
Beni voluttuari	5.27%
Servizi di comunicazione	1.03%
Tecnologia dell'informazione	0.91%
Future su indice azionario	0.07%
Liquidità / Prestito	7.51%

Posizioni principali

	Gruppo d'investimento
NOVARTIS AG-REG	14.61%
NESTLE SA-REG	14.38%
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	13.94%
UBS GROUP AG-REG	6.18%
ABB LTD-REG	5.81%
ZURICH INSURANCE GROUP AG	5.47%
CIE FINANCIERE RICHEMO-A REG	5.27%
SIKA AG-REG	3.29%
HOLCIM LTD	3.28%
ALCON INC	3.09%

Fondazione d'investimento Swiss Life

Azioni Estero ESG

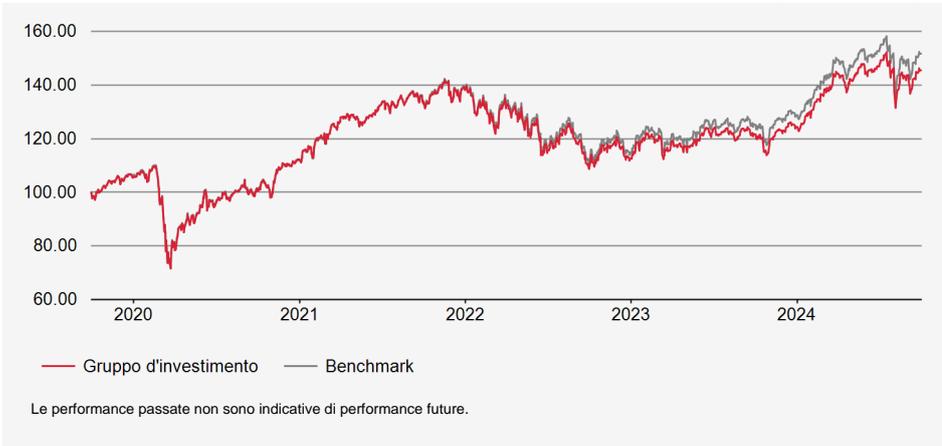


Patrimonio netto (NAV) in mio. CHF: 473.76
Valore d'inventario netto per diritto in CHF: 234.36

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, Amundi Emerging Markets Equity Focus Fund e fondo Robeco Emerging Markets Equities.

Evoluzione del valore nella valuta di riferimento (base 100)



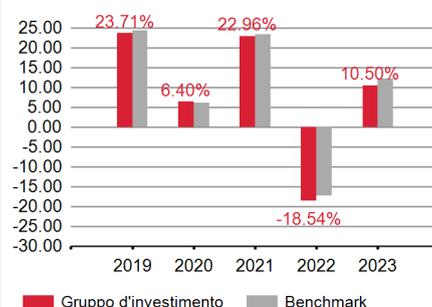
Performance nella valuta di riferimento

	Performance cumulata				Performance annualizzata			
	YTD	1 mese	3 mesi	1 anno	3 anni	5 anni	10 anni	Inizio
Gruppo d'investimento	17.03%	1.30%	-0.99%	19.61%	3.00%	7.78%	7.35%	3.77%
Benchmark	17.89%	1.61%	-0.62%	21.15%	4.35%	8.68%	8.26%	4.97%

Dati statistici (annualizzati)

	1 anno	3 anni	5 anni	10 anni	Inizio
Volatilità Gruppo d'investimento (in %)	11.34	14.16	16.33	14.81	15.45
Volatilità del Benchmark (in %)	11.17	14.17	16.30	14.77	15.70
Tracking Error ex post (in %)	0.48	0.41	0.46	0.61	1.38
Information Ratio	-3.22	-3.30	-1.94	-1.50	-0.87
Sharpe Ratio	1.45	0.16	0.45	0.50	0.22
Correlazione	1.00	1.00	1.00	1.00	1.00
Beta	1.01	1.00	1.00	1.00	0.98
Jensen alfa	-1.81	-1.34	-0.91	-0.93	-1.12
Maximum Drawdown (in %)	-13.61	-23.39	-34.66	-34.66	-60.40
Recovery Period (anni)	-	1.47	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: 13.00
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)
 50% Amundi / 50% Robeco
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: 30/09/2024 0.74%

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	23.59%	25.11%
Finanza	15.70%	15.28%
Industrie	13.28%	11.86%
Beni voluttuari	11.46%	11.25%
Salute	10.45%	10.64%
Servizi di comunicazione	6.79%	7.38%
Beni di prima necessità	5.68%	5.99%
Materiali	4.53%	4.50%
Immobili	3.44%	3.22%
Energia	2.82%	2.80%
Servizi di pubblica utilità	1.82%	1.97%
Liquidità	0.40%	-

Struttura del portafoglio secondo il paese/regione

	Gruppo d'investimento	Benchmark
USA	66.65%	67.84%
Giappone	6.30%	6.73%
Gran Bretagna	4.19%	3.67%
Canada	2.79%	3.11%
Francia	2.55%	2.55%
Germania	1.16%	1.00%
Resto dell'Europa	6.95%	6.23%
Altri paesi Asia	6.16%	6.29%
Altri	2.84%	2.56%
Liquidità	0.40%	-

Ulteriori informazioni sulle società

Numero di società	7,778
Quota di società senza benchmark	6.07%

Le principali posizioni

	Gruppo d'investimento	Benchmark
MICROSOFT CORP	5.88%	6.78%
NVIDIA CORP	5.78%	6.67%
ALPHABET INC	3.52%	4.06%
TESLA INC	1.45%	1.68%
ELI LILLY & CO	1.38%	1.60%
VISA INC	0.84%	0.97%
MASTERCARD INC	0.80%	0.91%
PROCTER & GAMBLE CO/THE	0.79%	0.91%
HOME DEPOT INC/THE	0.78%	0.90%
JOHNSON & JOHNSON	0.75%	0.87%

Struttura del portafoglio secondo le valute

	Gruppo d'investimento	Benchmark
USD	67.87%	68.03%
EUR	7.41%	6.90%
JPY	6.32%	6.73%
GBP	4.29%	3.68%
CHF	0.47%	0.21%
Altri	13.63%	14.43%

30 settembre 2024

Fondazione d'investimento Swiss Life

Azioni Estero ESG Indicizzate

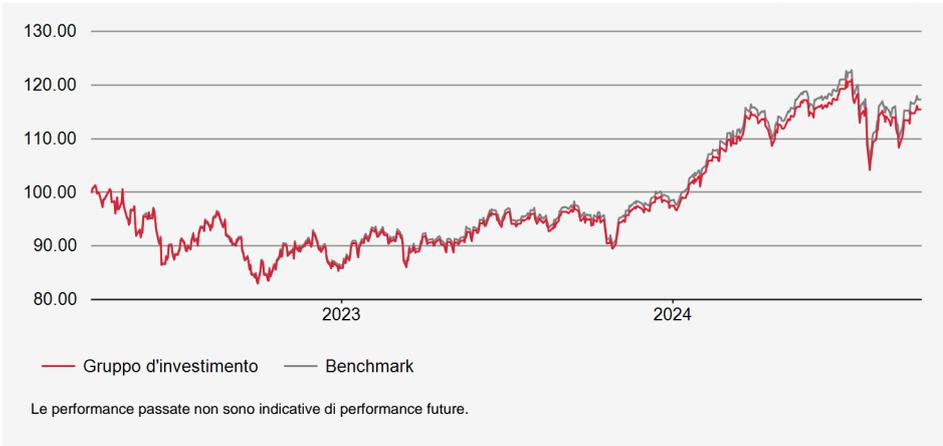


Patrimonio netto (NAV) in mio. CHF: 610.15
Valore d'inventario netto per diritto in CHF: 115.44

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)



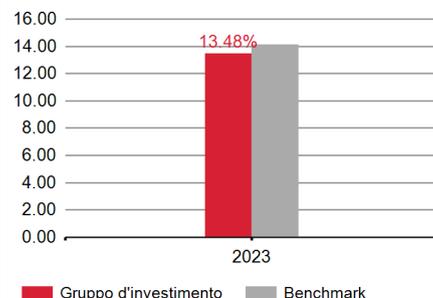
Performance nella valuta di riferimento

	Performance cumulata				Performance annualizzata			
	YTD	1 mese	3 mesi	1 anno	3 anni	5 anni	10 anni	Inizio
Gruppo d'investimento	18.40%	1.29%	-1.51%	21.64%	-	-	-	5.90%
Benchmark	19.08%	1.34%	-1.32%	22.55%	-	-	-	6.58%

Dati statistici (annualizzati)

	1 anno	3 anni	5 anni	10 anni	Inizio
Volatilità Gruppo d'investimento (in %)	11.39	-	-	-	14.83
Volatilità del Benchmark (in %)	11.42	-	-	-	14.85
Tracking Error ex post (in %)	0.07	-	-	-	0.14
Information Ratio	-13.29	-	-	-	-4.70
Sharpe Ratio	1.59	-	-	-	0.31
Correlazione	1.00	-	-	-	1.00
Beta	1.00	-	-	-	1.00
Jensen alfa	-0.86	-	-	-	-0.67
Maximum Drawdown (in %)	-13.92	-	-	-	-18.04
Recovery Period (anni)	-	-	-	-	1.30

Performance



Informazioni sul prodotto

Numero di valore: 117189932
ISIN: CH1171899326
LEI: 254900Q154AKVWL8UQ41
Codice Bloomberg: SWAEICI SW
Benchmark: MSCI World ex Switzerland ESG Leaders Net Return
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: 13.00
Commissione d'emissione / riscatto: nessuna
Prassi di distribuzione: Capitalizzazione
Asset Manager in base al Swiss Life Best Select Invest Plus@: UBS 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: 0.52%
ex post al: 30/09/2024 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 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 Estero ESG Indicizzate

Struttura del portafoglio per settore

	Gruppo d'investimento	Benchmark
Tecnologia dell'informazione	27.69%	27.88%
Finanza	14.82%	14.89%
Salute	11.22%	11.27%
Industrie	10.64%	10.70%
Beni voluttuari	10.61%	10.68%
Servizi di comunicazione	8.01%	8.05%
Beni di prima necessità	6.19%	6.24%
Materiali	3.73%	3.73%
Energia	2.45%	2.46%
Immobili	2.29%	2.32%
Servizi di pubblica utilità	1.74%	1.78%
Liquidità	0.60%	-

Le principali posizioni

	Gruppo d'investimento	Benchmark
MICROSOFT CORP	8.42%	8.48%
NVIDIA CORP	8.28%	8.34%
ALPHABET INC	5.04%	5.08%
TESLA INC	2.08%	2.10%
ELI LILLY & CO	1.98%	2.00%
VISA INC	1.20%	1.21%
MASTERCARD INC	1.14%	1.14%
PROCTER & GAMBLE CO/THE	1.13%	1.14%
HOME DEPOT INC/THE	1.11%	1.12%
JOHNSON & JOHNSON	1.08%	1.09%

Struttura del portafoglio secondo il paese/regione

	Gruppo d'investimento	Benchmark
USA	73.77%	74.18%
Giappone	6.24%	6.24%
Gran Bretagna	3.61%	3.66%
Canada	3.19%	3.22%
Francia	2.92%	2.98%
Germania	1.04%	1.02%
Resto dell'Europa	6.20%	6.25%
Altri paesi Asia	2.42%	2.44%
Altri	-	-
Liquidità	0.60%	-

Struttura del portafoglio secondo le valute

	Gruppo d'investimento	Benchmark
USD	74.20%	74.18%
EUR	7.42%	7.51%
JPY	6.26%	6.24%
GBP	3.74%	3.67%
Altri	8.38%	8.39%

Fondazione d'investimento Swiss Life

Azioni Global Small Caps

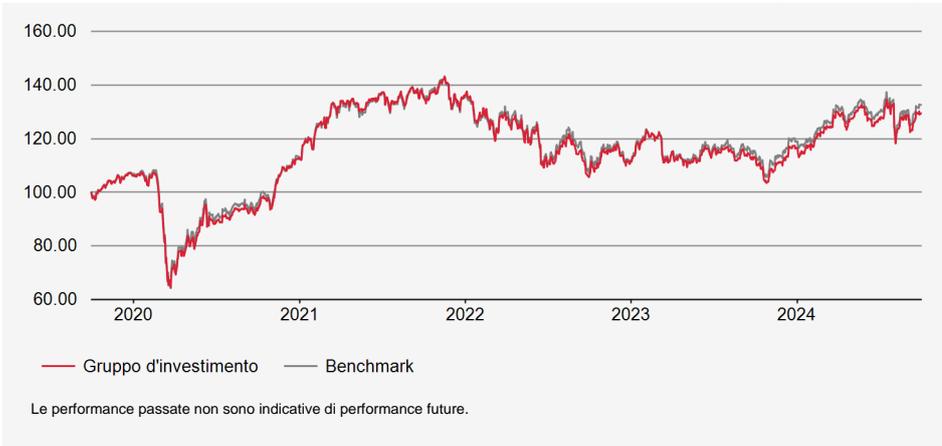


Patrimonio netto (NAV) in mio. CHF: 468.19
Valore d'inventario netto per diritto in CHF: 122.80

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)



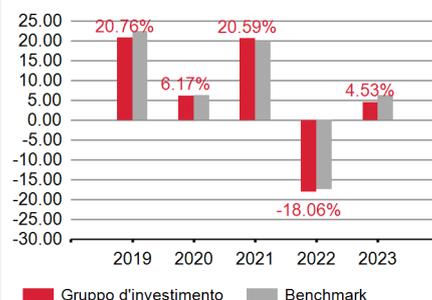
Performance nella valuta di riferimento

	Performance cumulata				Performance annualizzata			
	YTD	1 mese	3 mesi	1 anno	3 anni	5 anni	10 anni	Inizio
Gruppo d'investimento	11.09%	0.60%	1.79%	14.32%	-1.51%	5.29%	-	3.16%
Benchmark	11.54%	1.54%	2.13%	14.91%	-0.79%	5.80%	-	4.84%

Dati statistici (annualizzati)

	1 anno	3 anni	5 anni	10 anni	Inizio
Volatilità Gruppo d'investimento (in %)	14.43	15.99	20.19	-	19.31
Volatilità del Benchmark (in %)	13.85	15.96	19.77	-	18.98
Tracking Error ex post (in %)	1.78	1.80	1.90	-	2.35
Information Ratio	-0.33	-0.40	-0.27	-	-0.71
Sharpe Ratio	0.82	-0.14	0.25	-	0.17
Correlazione	0.99	0.99	1.00	-	0.99
Beta	1.03	1.00	1.02	-	1.01
Jensen alfa	-1.05	-0.73	-0.60	-	-1.72
Maximum Drawdown (in %)	-12.07	-27.71	-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: 13.00
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: 0.84%
ex post al: 30/09/2024 0.84%

Struttura del portafoglio per settore

	Gruppo d'investimento	Benchmark
Industrie	22.01%	19.72%
Finanza	16.42%	14.82%
Beni voluttuari	12.64%	13.48%
Tecnologia dell'informazione	12.11%	11.22%
Salute	10.03%	9.64%
Materiali	6.80%	7.91%
Immobili	6.29%	8.59%
Beni di prima necessità	4.46%	4.89%
Energia	3.87%	3.96%
Servizi di comunicazione	3.22%	3.13%
Servizi di pubblica utilità	1.78%	2.64%
Liquidità	0.37%	-

Le principali posizioni

	Gruppo d'investimento	Benchmark
TAYLOR MORRISON	0.66%	0.04%
CACTUS	0.63%	0.02%
PLANISWARE	0.59%	0.00%
WEATHERFORD INTERNAT	0.56%	0.03%
SPROUTS FARMERS MARKET	0.54%	0.06%
PIPER SANDLER	0.49%	0.03%
SIGMAROC	0.46%	-
TMX	0.44%	-
PINNACLE FINANCIAL PARTNERS	0.44%	0.04%
HELIOS TOWERS	0.41%	0.01%

Struttura del portafoglio secondo il paese/regione

	Gruppo d'investimento	Benchmark
USA	60.31%	56.65%
Giappone	7.69%	11.61%
Gran Bretagna	6.55%	4.95%
Canada	2.26%	3.57%
Francia	2.00%	1.10%
Germania	1.72%	1.24%
Resto dell'Europa	10.36%	8.20%
Altri paesi Asia	5.56%	8.66%
Altri	3.17%	4.03%
Liquidità	0.37%	-

Struttura del portafoglio secondo le valute

	Gruppo d'investimento	Benchmark
USD	62.28%	56.90%
EUR	8.52%	5.80%
JPY	7.73%	11.60%
GBP	6.62%	4.97%
CHF	1.86%	1.42%
Altri	12.99%	19.31%

Ulteriori informazioni sulle società

Numero di società	6,835
Quota di società senza benchmark	23.05%

Fondazione d'investimento Swiss Life

Azioni Emerging Markets ESG

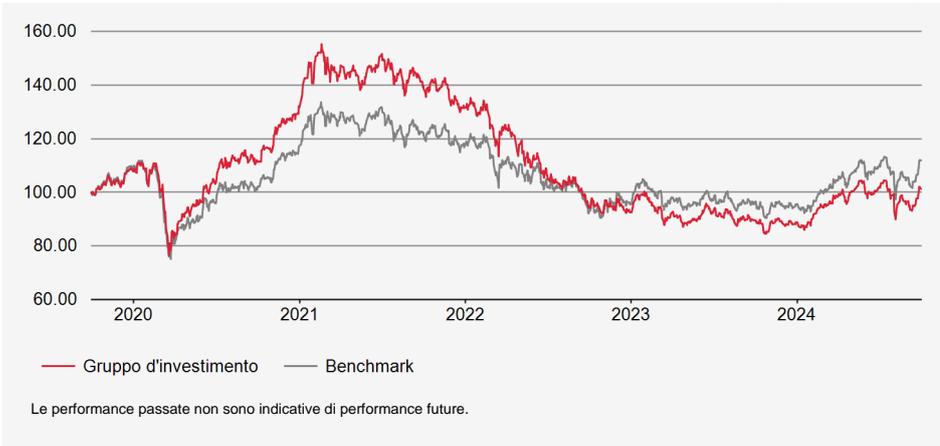


Patrimonio netto (NAV) in mio. CHF: 261.74
Valore d'inventario netto per diritto in CHF: 86.75

Strategia d'investimento

Investimenti in titoli di partecipazione di società domiciliate in Paesi emergenti. Selezione attiva di Paesi, settori e titoli. Realizzazione tramite Amundi Emerging Markets Equity Focus e Robeco Emerging Markets Equities Fund; SICAV di diritto lussemburghese secondo l'OICVM.

Evoluzione del valore nella valuta di riferimento (base 100)



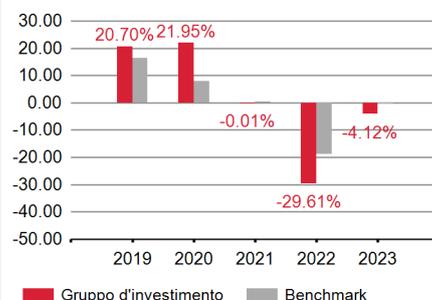
Performance nella valuta di riferimento

	Performance cumulata				Performance annualizzata			
	YTD	1 mese	3 mesi	1 anno	3 anni	5 anni	10 anni	Inizio
Gruppo d'investimento	14.08%	4.90%	-0.39%	13.01%	-10.16%	0.26%	-	-2.11%
Benchmark	17.13%	6.06%	2.06%	16.23%	-2.91%	2.27%	-	0.12%

Dati statistici (annualizzati)

	1 anno	3 anni	5 anni	10 anni	Inizio
Volatilità Gruppo d'investimento (in %)	12.18	13.88	16.60	-	16.59
Volatilità del Benchmark (in %)	12.95	14.52	16.38	-	15.99
Tracking Error ex post (in %)	2.51	4.73	5.15	-	5.16
Information Ratio	-1.29	-1.54	-0.39	-	-0.43
Sharpe Ratio	0.88	-0.82	0.01	-	-0.12
Correlazione	0.98	0.94	0.95	-	0.95
Beta	0.92	0.90	0.96	-	0.99
Jensen alfa	-2.09	-7.62	-1.94	-	-2.23
Maximum Drawdown (in %)	-13.87	-40.72	-45.54	-	-45.54
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: 13.00
Commissione d'emissione / riscatto: nessuna
Prassi di distribuzione: Capitalizzazione
Asset Manager in base al Swiss Life Best Select Invest Plus@: 50% Amundi / 50% Robeco
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: 0.86%
ex post al: 30/09/2024 0.86%

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	18.23%	22.92%
Tecnologia dell'informazione	18.00%	22.50%
Beni voluttuari	13.17%	13.79%
Servizi di comunicazione	5.90%	9.36%
Industrie	4.51%	6.76%
Immobili	4.13%	1.58%
Beni di prima necessità	3.66%	5.20%
Materiali	3.28%	6.63%
Servizi di pubblica utilità	2.54%	2.92%
Energia	2.17%	4.77%
Salute	1.36%	3.57%
Liquidità	22.99%	-

Le principali posizioni

	Gruppo d'investimento	Benchmark
TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFACTURING CO LT	7.29%	9.18%
SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	3.11%	2.96%
ALIBABA GROUP HOLDING LTD	2.44%	2.51%
TENCENT HOLDINGS LTD	2.08%	2.22%
HDFC BANK LTD	2.05%	1.07%
NASPERS LTD	1.55%	0.26%
INFOSYS LTD	1.48%	0.46%
ICICI BANK LTD ADR	1.32%	-
HON HAI PRECISION INDUSTRY CO LTD	0.97%	0.45%
SK HYNIX INC	0.88%	0.44%

Struttura del portafoglio secondo il paese/regione

	Gruppo d'investimento	Benchmark
Cina	18.60%	27.24%
India	14.90%	19.63%
Taiwan	11.59%	17.79%
Corea	10.07%	10.53%
Brasile	4.51%	4.85%
Africa del sud	2.84%	3.03%
Altri paesi Asia	5.85%	5.26%
Altri paesi EMEA	6.45%	8.97%
Altr paesi America	2.22%	2.71%
Liquidità	22.99%	-

Struttura del portafoglio secondo le valute

	Gruppo d'investimento	Benchmark
HKD	13.74%	21.19%
TWD	12.26%	17.82%
INR	12.20%	19.63%
KRW	10.11%	10.53%
USD	6.25%	3.00%
EUR	1.19%	0.46%
CHF	0.00%	-
Altri	44.29%	27.32%

Ulteriori informazioni sulle società

Numero di società	265
Quota di società senza benchmark	3.39%

30 settembre 2024

Fondazione d'investimento Swiss Life

Azioni Global Protect Flex (CHF hedged)

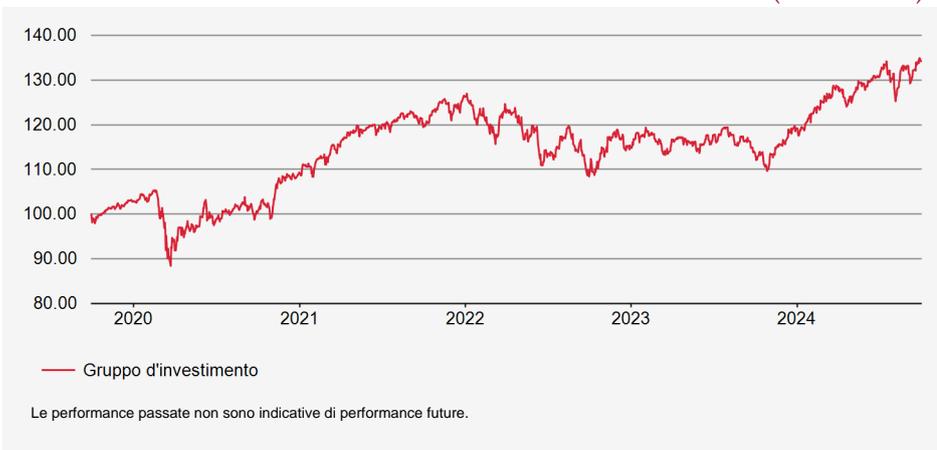


Patrimonio netto (NAV) in mio. CHF: 787.44
Valore d'inventario netto per diritto in CHF: 154.47

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. 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 (CHF hedged).

Evoluzione del valore nella valuta di riferimento (base 100)



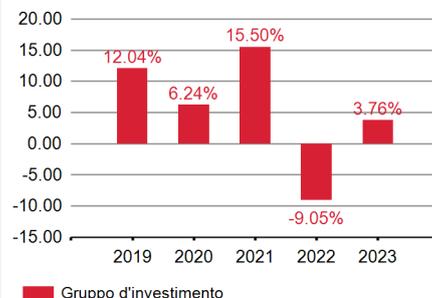
Performance nella valuta di riferimento

	Performance cumulata				Performance annualizzata			
	YTD	1 mese	3 mesi	1 anno	3 anni	5 anni	10 anni	Inizio
Gruppo d'investimento	12.60%	0.78%	2.71%	17.94%	3.94%	6.05%	-	5.30%

Dati statistici (annualizzati)

	1 anno	3 anni	5 anni	10 anni	Inizio
Volatilità Gruppo d'investimento (in %)	7.68	10.30	9.88	-	8.45
Sharpe Ratio	1.95	0.31	0.58	-	0.64
Maximum Drawdown (in %)	-6.62	-14.58	-15.99	-	-15.99
Recovery Period (anni)	0.14	1.43	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: 13.00
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: 0.60%
ex post al: 30/09/2024 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
Tecnologia dell'informazione	16.09%
Finanza	15.02%
Salute	12.68%
Industrie	12.46%
Beni di prima necessità	7.75%
Beni voluttuari	7.44%
Servizi di pubblica utilità	5.41%
Servizi di comunicazione	5.05%
Materiali	3.95%
Energia	2.95%
Immobili	2.84%
Future su indice azionario	0.78%
Liquidità / Prestito	7.57%

Posizioni principali

	Gruppo d'investimento
INTL BUSINESS MACHINES CORP	0.79%
T-MOBILE US INC	0.77%
WALMART INC	0.74%
CHUBB LTD	0.69%
CISCO SYSTEMS INC	0.68%
JOHNSON & JOHNSON	0.68%
PEPSICO INC	0.66%
MOTOROLA SOLUTIONS INC	0.61%
ACCENTURE PLC-CL A	0.61%
ELI LILLY & CO	0.61%

Struttura del portafoglio secondo il paese/regione

	Gruppo d'investimento
USA e Canada	67.57%
Regione Europea (EUR)	10.15%
Regione Asia e Pacifico	7.88%
Regione Europea (Ex EUR)	5.67%
Future su indice azionario	0.78%
Mercati Emergenti in America	0.35%
Mercati Emergenti in Europa	0.03%
Liquidità / Prestito	7.57%

Nota legale: La presente pubblicazione non rappresenta né un invito, né una raccomandazione ad acquistare o vendere strumenti d'investimento, ma funge meramente da veicolo informativo. È possibile richiedere gratuitamente tutti i documenti che costituiscono la base giuridica di un eventuale investimento presso la Fondazione d'investimento Swiss Life, c/o Swiss Life SA, casella postale 8022 Zurigo, telefono 043 547 71 11 e su www.swisslife.ch/anlagestiftung. La cerchia degli investitori è limitata alle istituzioni del secondo pilastro e del pilastro 3a, non-ché istituzioni esonerate dall'obbligo tributario, con sede in Svizzera e che secondo l'oggetto sociale perseguono la previdenza professionale e persone che gestiscono investimenti collettivi per queste istituzioni, sono sorvegliate dall'Autorità federale di vigilanza sui mercati finanziari FINMA e che investono presso la fondazione esclusivamente capitali per queste istituzioni. La performance precedente non rappresenta un indicatore né per l'evoluzione attuale, né per quella futura. L'utilizzo non implica alcuna affiliazione con o sponsorizzazione da parte di quest'ultimi. **Fonte:** Swiss Life Asset Managers. Tutti i diritti riservati.

Patrimonio netto (NAV) in mio. CHF: 3,906.41
Valore d'inventario netto per diritto in CHF: 208.02



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	3.18%	0.59%	1.10%	4.00%	3.58%	4.29%	5.15%	5.25%
Benchmark	2.51%	0.41%	1.04%	2.89%	3.74%	4.36%	4.86%	5.18%

Dati statistici (annualizzati)

	1 anno	3 anni	5 anni	10 anni	Inizio
Volatilità Gruppo d'investimento (in %)	0.66	1.35	1.42	1.68	1.57
Volatilità del Benchmark (in %)	0.36	0.60	0.61	0.59	0.60
Tracking Error ex post (in %)	0.66	1.30	1.34	1.57	1.51
Information Ratio	1.67	-0.12	-0.05	0.19	0.05
Sharpe Ratio	3.70	2.10	2.87	3.17	3.39
Correlazione	0.31	0.43	0.46	0.44	0.36
Beta	0.51	0.76	0.85	1.02	0.83
Jensen alfa	1.80	0.58	0.58	0.19	0.98
Maximum Drawdown (in %)	0.00	-0.85	-0.85	-0.85	-0.85
Recovery Period (anni)	-	0.30	0.30	0.30	0.30

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).

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.

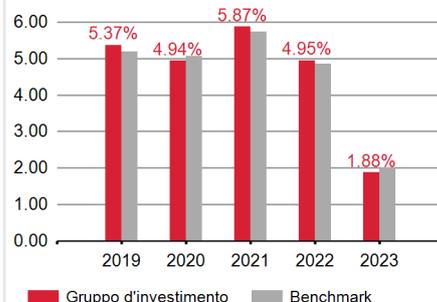
Quote spese operative TER ISA: La quota spese operative TER ISA copre tutti i costi, eccezione fatta per i costi di transazione e i tributi fiscali legati alla transazione.

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: 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: Secondo prospetto

Commissione di riscatto: 3.00%

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: 30/09/2024 0.71%

Base CIN al: 30/09/2024 0.89%

Ricavi da immobili secondo l'utilizzo

Abitazione	70.93%
Ufficio	6.56%
Vendita	14.26%
Parcheggio	6.22%
Utilizzazione accessoria	2.03%
Di cui sviluppo di progetti*	2.78%

*in % del valore di mercato

Ripartizione geografica degli immobili*

Zurigo	39.60%
Berna	5.53%
Svizzera centrale	4.12%
Svizzera occidentale	5.03%
Svizzera nordoccidentale	17.12%
Svizzera orientale	6.32%
Ticino	4.11%
Lago di Ginevra	18.17%

*secondo il monitoring delle regioni di Wüest Partner AG

Cifre chiave relative agli immobili

Valore venale*	4'872.72
Numero degli immobili	293
Quota di locazione	98.38%

*in milioni CHF

Ulteriori cifre salienti

Finanziamento esterno*	846.0
Grado di finanziamento esterno	17.36%
Liquidità*	8.6

*in milioni CHF

Classificazione degli immobili in base all'età

2020-2024	6.32%
2010-2019	11.11%
2000-2009	9.36%
1990-1999	8.20%
1980-1989	9.59%
1970-1979	21.42%
1960-1969	11.64%
prima del 1960	22.36%

Patrimonio netto (NAV) in mio. CHF: 544.29
Valore d'inventario netto per diritto in CHF: 137.25



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: 20-90%, 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%, sviluppo progetti: 0-30%.
 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	3.24%	1.04%	1.51%	4.03%	3.60%	4.48%	-	4.74%
Benchmark	2.51%	0.41%	1.04%	2.89%	3.74%	4.36%	-	4.54%

Dati statistici (annualizzati)

	1 anno	3 anni	5 anni	10 anni	Inizio
Volatilità Gruppo d'investimento (in %)	0.86	1.11	1.63	-	1.70
Volatilità del Benchmark (in %)	0.36	0.60	0.61	-	0.59
Tracking Error ex post (in %)	0.76	1.06	1.54	-	1.63
Information Ratio	1.50	-0.13	0.08	-	0.12
Sharpe Ratio	2.88	2.57	2.61	-	2.80
Correlazione	0.51	0.50	0.43	-	0.39
Beta	1.10	0.74	0.91	-	0.90
Jensen alfa	1.00	0.65	0.53	-	0.67
Maximum Drawdown (in %)	0.00	-0.60	-0.60	-	-0.60
Recovery Period (anni)	-	0.22	0.22	-	0.22

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).

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.

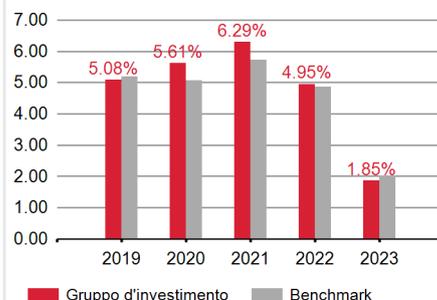
Quote spese operative TER ISA: La quota spese operative TER ISA copre tutti i costi, eccezione fatta per i costi di transazione e i tributi fiscali legati alla transazione.

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: Secondo prospetto

Commissione di riscatto: 3.00%

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: 30/09/2024 0.74%

Base CIN al: 30/09/2024 0.85%

Ricavi da immobili secondo l'utilizzo

Abitazioni senza offerta di assistenza stazionaria	76.32%
Strutture di cura e case per anziani	12.95%
Immobili sanitari	-
Servizio e vendita	5.40%
Utilizzazione accessoria e parcheggio	5.34%
Di cui sviluppo di progetti*	1.86%

*in % del valore di mercato

Ripartizione geografica degli immobili*

Zurigo	62.88%
Berna	11.01%
Svizzera centrale	-
Svizzera occidentale	-
Svizzera nordoccidentale	16.89%
Svizzera orientale	2.30%
Ticino	6.92%
Lago di Ginevra	-

*secondo il monitoring delle regioni di Wüest Partner AG

Cifre chiave relative agli immobili

Valore venale*	622.33
Numero degli immobili	16
Quota di locazione	98.51%

*in milioni CHF

Ulteriori cifre salienti

Finanziamento esterno*	63.3
Grado di finanziamento esterno	10.17%
Liquidità*	0.1

*in milioni CHF

Classificazione degli immobili in base all'età

2020-2024	59.06%
2010-2019	19.49%
2000-2009	17.20%
1990-1999	1.46%
1980-1989	-
1970-1979	-
1960-1969	-
prima del 1960	2.80%

Patrimonio netto (NAV) in mio. CHF: 1,889.05
Valore d'inventario netto per diritto in CHF: 182.64



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	3.03%	1.45%	2.14%	3.73%	3.36%	4.06%	4.65%	4.77%
Benchmark	2.51%	0.41%	1.04%	2.89%	3.74%	4.36%	4.86%	5.13%

Dati statistici (annualizzati)

	1 anno	3 anni	5 anni	10 anni	Inizio
Volatilità Gruppo d'investimento (in %)	1.44	1.53	1.78	1.65	1.56
Volatilità del Benchmark (in %)	0.36	0.60	0.61	0.59	0.63
Tracking Error ex post (in %)	1.32	1.56	1.74	1.58	1.53
Information Ratio	0.63	-0.25	-0.17	-0.13	-0.24
Sharpe Ratio	1.50	1.70	2.16	2.95	3.14
Correlazione	0.52	0.30	0.35	0.37	0.33
Beta	1.91	0.59	0.79	0.84	0.72
Jensen alfa	-0.45	0.86	0.61	0.61	1.14
Maximum Drawdown (in %)	-0.67	-1.78	-1.78	-1.78	-1.78
Recovery Period (anni)	0.21	0.50	0.50	0.50	0.50

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).

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.

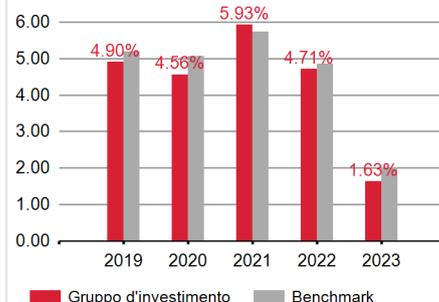
Quote spese operative TER ISA: La quota spese operative TER ISA copre tutti i costi, eccezione fatta per i costi di transazione e i tributi fiscali legati alla transazione.

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: 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: Secondo prospetto

Commissione di riscatto: 3.00%

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: 30/09/2024 0.70%

Base CIN al: 30/09/2024 0.95%

Ricavi da immobili secondo l'utilizzo

Abitazione	13.10%
Ufficio	40.74%
Vendita	36.45%
Parcheggio	4.52%
Utilizzazione accessoria	5.20%

Di cui sviluppo di progetti* -

*in % del valore di mercato

Ripartizione geografica degli immobili*

Zurigo	42.38%
Berna	5.37%
Svizzera centrale	11.24%
Svizzera occidentale	2.81%
Svizzera nordoccidentale	8.02%
Svizzera orientale	6.41%
Ticino	1.64%
Lago di Ginevra	22.13%

*secondo il monitoring delle regioni di Wüest Partner AG

Cifre chiave relative agli immobili

Valore venale*	2'524.29
Numero degli immobili	108
Quota di locazione	96.22%

*in milioni CHF

Ulteriori cifre salienti

Finanziamento esterno*	598.2
Grado di finanziamento esterno	23.70%
Liquidità*	12.6

*in milioni CHF

Classificazione degli immobili in base all'età

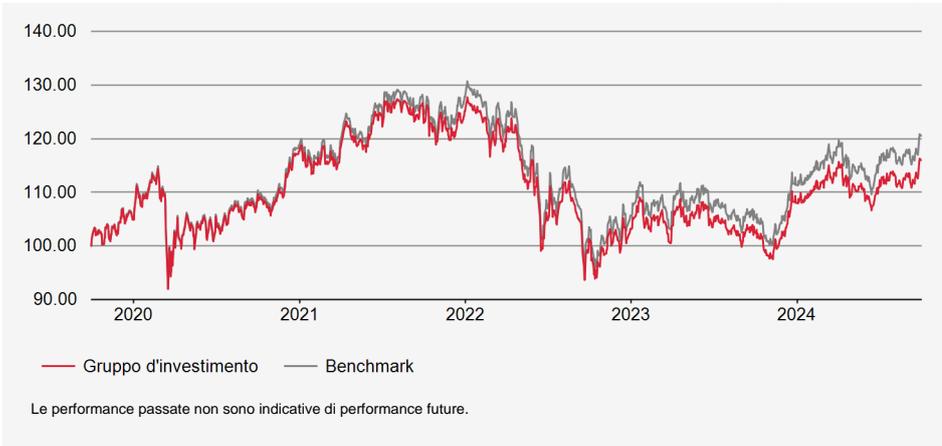
2020-2024	4.03%
2010-2019	2.73%
2000-2009	1.43%
1990-1999	14.07%
1980-1989	16.62%
1970-1979	25.28%
1960-1969	9.58%
prima del 1960	26.26%

Patrimonio netto (NAV) in mio. CHF: 416.61
Valore d'inventario netto per diritto in CHF: 169.45

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. Il gruppo d'investimento viene gestito con un approccio indicizzato. L'obiettivo d'investimento consiste nel replicare al meglio il benchmark SXI Real Estate® Funds Broad Total Return. Realizzazione tramite Swiss Life Index Funds III (CH) Real Estate Switzerland.

Evoluzione del valore nella valuta di riferimento (base 100)



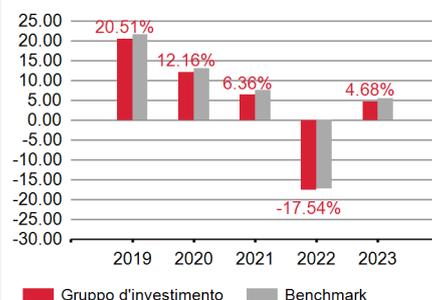
Performance nella valuta di riferimento

	Performance cumulata				Performance annualizzata			
	YTD	1 mese	3 mesi	1 anno	3 anni	5 anni	10 anni	Inizio
Gruppo d'investimento	7.36%	2.59%	4.59%	13.07%	-2.32%	3.00%	4.33%	3.95%
Benchmark	8.24%	2.62%	4.67%	14.33%	-1.46%	3.80%	5.25%	4.80%

Dati statistici (annualizzati)

	1 anno	3 anni	5 anni	10 anni	Inizio
Volatilità Gruppo d'investimento (in %)	10.53	10.06	9.95	9.00	8.31
Volatilità del Benchmark (in %)	10.95	10.42	10.24	9.28	8.58
Tracking Error ex post (in %)	0.60	0.53	0.44	0.48	0.49
Information Ratio	-2.09	-1.62	-1.81	-1.94	-1.71
Sharpe Ratio	1.03	-0.30	0.28	0.50	0.49
Correlazione	1.00	1.00	1.00	1.00	1.00
Beta	0.96	0.96	0.97	0.97	0.97
Jensen alfa	-0.77	-0.94	-0.69	-0.75	-0.68
Maximum Drawdown (in %)	-7.79	-26.64	-26.64	-26.64	-26.64
Recovery Period (anni)	0.29	-	-	-	-

Performance



Informazioni sul prodotto

Numero di valore: 12468379
ISIN: CH0124683795
LEI: 254900VB5XEQLYLQJ518
Codice Bloomberg: SWLIMSC SW
Benchmark: SXI Real Estate® Funds Broad Total Return
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: 13.00
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: 1.00%
ex post al: 30/09/2024 1.12%

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

Fondi immobiliari Svizzera Indicizzati



Le principali posizioni

UBS PRPRTY FD SW MIXD SIMA	16.48%
CREDIT SUISSE REAL EST SIAT	6.00%
UBS PRPRTY FD SW RESIDTL ANF	4.98%
CS REAL ESTATE LIVINGPLUS	4.86%
SWISS L REF CH ESG SWISS PRO	3.93%
ED DE ROTHSCHILD REAL ESTATE	3.80%
CS REAL ESTATE FD GREEN PROP	3.68%
LA FONCIERE	3.19%
IMMOFONDS	3.18%
UBS PRPRTY FD LEMAN RESD FON	3.00%

Fondazione d'investimento Swiss Life

Immobili Europa Industria e Logistica ESG (CHF)

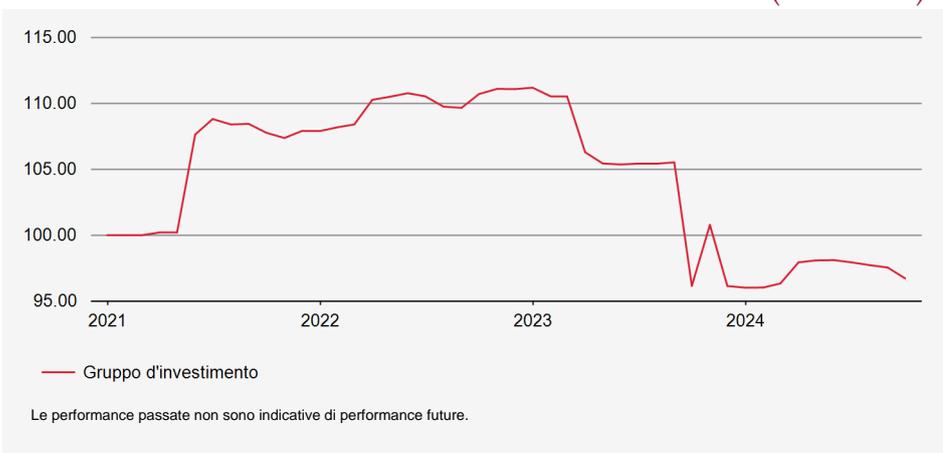


Patrimonio netto (NAV) in mio. CHF: 16.44
Valore d'inventario netto per diritto in CHF: 96.77

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)



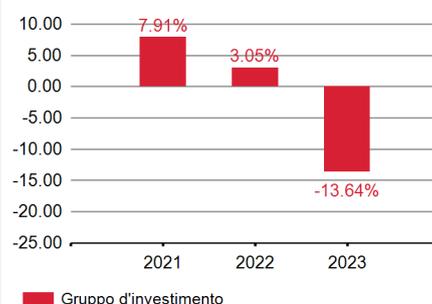
Performance nella valuta di riferimento

	Performance cumulata				Performance annualizzata			
	YTD	1 mese	3 mesi	1 anno	3 anni	5 anni	10 anni	Inizio
Gruppo d'investimento	0.73%	-0.85%	-1.25%	0.59%	-3.54%	-	-	-0.86%

Dati statistici (annualizzati)

	1 anno	3 anni	5 anni	10 anni	Inizio
Volatilità Gruppo d'investimento (in %)	7.25	7.24	-	-	7.46
Sharpe Ratio	-0.12	-0.59	-	-	-0.17
Maximum Drawdown (in %)	-4.73	-13.64	-	-	-13.64
Recovery Period (anni)	-	-	-	-	-

Performance



Informazioni sul prodotto

Numero di valore: 56847985

ISIN: CH0568479858

LEI: 254900A0BOVBYIND4J79

Codice Bloomberg: SLIEILC SW

Valuta: CHF

Domicilio: Svizzera

Data di lancio: 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

Politica 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: 1.54%

ex post al: 30/09/2024 1.54%

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

Logistica	52.32%
Industria	47.68%

Ripartizione geografica degli immobili

Germania	66.01%
Austria	18.74%
Paesi Bassi	8.08%
Francia	7.17%
Regno Unito	-

Cifre chiave relative agli immobili

Valore venale*	591.57
Numero degli immobili	21
Quota di locazione	99.20%

*in milioni EUR

Ulteriori cifre salienti

Grado di finanziamento esterno	31.20%
--------------------------------	--------

I dati su questa pagina si riferiscono al fondo target al 30/09/2024. A livello di gruppo d'investimento possono variare leggermente a causa della possibile detenzione di liquidità.

Fondazione d'investimento Swiss Life

Immobili Europa Industria e Logistica ESG (EUR)

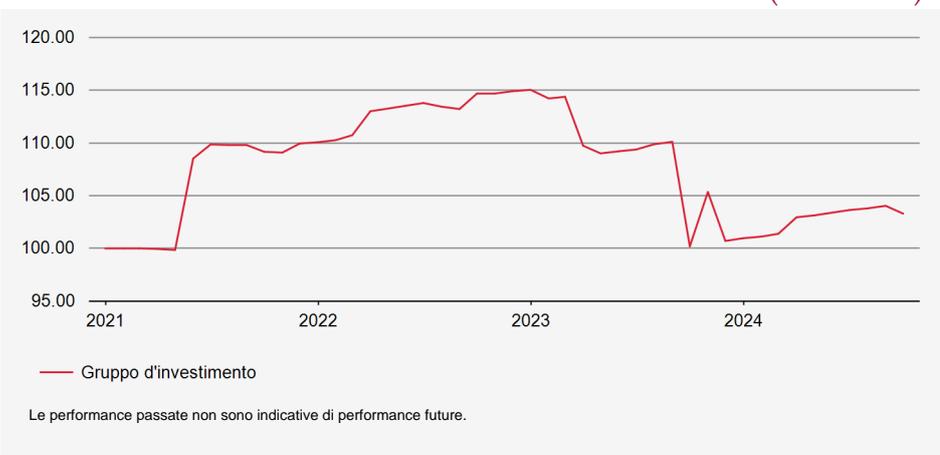


Patrimonio netto (NAV) in mio. EUR: 166.25
Valore d'inventario netto per diritto in EUR: 98.66

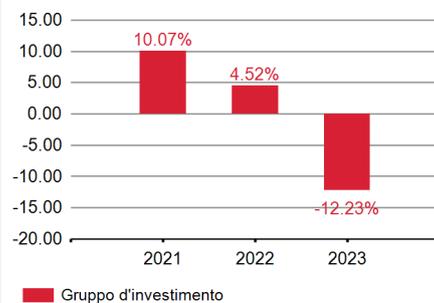
Strategia d'investimento

Investimenti in immobili industriali e logistici. Allocations 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



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	2.30%	-0.71%	-0.33%	3.10%	-1.82%	-	-	0.86%

Dati statistici (annualizzati)

	1 anno	3 anni	5 anni	10 anni	Inizio
Volatilità Gruppo d'investimento (in %)	7.23	7.46	-	-	7.99
Sharpe Ratio	-0.10	-0.50	-	-	-0.07
Maximum Drawdown (in %)	-4.40	-12.91	-	-	-12.91
Recovery Period (anni)	-	-	-	-	-

Informazioni sul prodotto

Numero di valore: 56848140

ISIN: CH0568481409

LEI: 254900I0ML8QYK4H7G51

Codice Bloomberg: SLIEILE SW

Valuta: EUR

Domicilio: Svizzera

Data di lancio: 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

Politica di distribuzione: Distribuzione

Ultima distribuzione al:

21/02/2024 EUR 4.55

Asset Manager

Swiss Life Asset Management SA

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

Quote spese operative TER KGAST

ex ante: 1.60%

ex post al: 30/09/2024 1.60%

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 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

Immobili Europa Industria e Logistica ESG (EUR)



Ricavi da immobili secondo l'utilizzo

Logistica	52.32%
Industria	47.68%

Ripartizione geografica degli immobili

Germania	66.01%
Austria	18.74%
Paesi Bassi	8.08%
Francia	7.17%
Regno Unito	-

Cifre chiave relative agli immobili

Valore venale*	591.57
Numero degli immobili	21
Quota di locazione	99.20%

*in milioni EUR

Ulteriori cifre salienti

Grado di finanziamento esterno	31.20%
--------------------------------	--------

I dati su questa pagina si riferiscono al fondo target al 30/09/2024. A livello di gruppo d'investimento possono variare leggermente a causa della possibile detenzione di liquidità.

30 settembre 2024

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



Patrimonio netto (NAV) in mio. CHF: 201.23
Valore d'inventario netto per diritto in CHF: 111.59

Commento di management e prospettive

Nel periodo in rassegna (T3 2024) non vi sono state ulteriori chiamate di capitale per gli investitori. Il gruppo d'investimento Infrastruttura globale ESG (EUR) ha tuttavia continuato a investire in investimenti target. Si trattava di collocamenti in fondi target e di chiamate di capitale da due investimenti diretti. Il patrimonio del gruppo d'investimento ha registrato un'evoluzione positiva nel terzo trimestre 2024. Le valute estere nel patrimonio dei gruppi d'investimento hanno avuto un effetto leggermente negativo sulla valutazione complessiva. Nel quarto trimestre 2024 è prevista un'ulteriore chiamata di capitale per gli investitori.

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	-0.37%	0.01%	0.11%	3.08%	-	-	3.33%

Principali dati indicativi

Capitale impegnato*	259.1
Capitale richiamato*	191.3
Patrimonio netto (NAV)*	201.2
Impegni di capitale in investimenti del portafoglio*	234.8
Numero di investimenti del portafoglio (panoramica)	15
Numero di partecipazioni (panoramica)	30

*in milioni CHF

Informazioni sul prodotto

Numero di valore: 56897992

ISIN: CH0568979923

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 Global Services SE
Leudelange Lussemburgo
succursale Basilea

Ufficio di revisione:

PricewaterhouseCoopers SA

Depotbank:

UBS Switzerland AG

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

Quote spese operative TER KGAST

ex ante: 1.46%

ex post al: 30/09/2024 1.46%

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).

Investimenti del portafoglio*

	Impegni di capitale	Patrimonio netto
Swiss Life Funds (LUX) ESG Global Infrastructure Opportunities III	30.86%	34.36%
Swiss Life Funds (LUX) ESG GIO III Co-Invest	11.70%	12.57%
FONTAVIS ESG Renewable Infrastructure Fund II («FORTE II»)	9.58%	7.58%
Swiss Life Funds (LUX) ESG Global Infrastructure Opportunities Growth II	8.51%	3.39%
FONTAVIS ESG Renewable Infrastructure Fund Europe («FORTE»)	5.32%	7.21%
Co-Investment Transition Network Operator Amprion	5.32%	3.46%
Co-Investment District Heating UK	4.99%	5.43%
Co-Investment Saffir (offshore Norway)	4.69%	5.03%
Co-Investment TTT via Bazalgette (Investments) Ltd	3.72%	4.54%
Co-Investment JFK via JLC Terminal One Co-Invest L.P.	3.40%	2.21%
Altri	11.91%	14.22%

*Senza liquidità

Attività per settore*

Energie rinnovabili / Energia	32.49%
Comunicazione	31.10%
Trasporto	12.82%
Infrastrutture sociali	12.42%
Servizi di pubblica utilità	11.17%
Altri	-

*Senza liquidità

Asset per regione*

Europa (incl. Gran Bretagna)	79.96%
America del Nord	18.49%
Svizzera	1.55%
Altre regioni	-

*Senza liquidità

Attività per stadio*

Brownfield	91.33%
Greenfield	8.67%

*Senza liquidità

Attività per valuta*

EUR	60.76%
USD	19.53%
GBP	18.16%
CHF	1.55%

*Senza liquidità

30 settembre 2024

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



Patrimonio netto (NAV) in mio. EUR: 430.97
Valore d'inventario netto per diritto in EUR: 118.40

Commento di management e prospettive

Nel periodo in rassegna (T3 2024) il gruppo d'investimento Infrastruttura globale ESG (EUR) ha investito circa 10 milioni di euro nei suoi investimenti target. Si trattava di chiamate di capitale dei fondi target (circa 7 milioni di euro) e di due investimenti diretti (circa 3 milioni di euro). Il patrimonio dei gruppi d'investimento ha continuato a registrare un andamento stabile e positivo nel periodo in rassegna. Nel quarto trimestre 2024 è prevista un'ulteriore chiamata di capitale per gli investitori. Il Portfolio Management verifica nuove allocazioni di capitale nel settore dei fondi e degli investimenti diretti.

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	1.71%	0.76%	2.86%	5.14%	-	-	5.33%

Principali dati indicativi

Capitale impegnato*	502.3
Capitale richiamato*	395.8
Patrimonio netto (NAV)*	431.0
Impegni di capitale in investimenti del portafoglio*	470.0
Numero di investimenti del portafoglio (panoramica)	15
Numero di partecipazioni (panoramica)	30

*in milioni EUR

Informazioni sul prodotto

Numero di valore: 56897994

ISIN: CH0568979949

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

Ultima distribuzione al:

21/02/2024 EUR 0.60

Asset Manager:

Swiss Life Asset Management SA

Amministratore:

Northern Trust Global Services SE
Leudelange Lussemburgo
succursale Basilea

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: 1.56%

ex post al: 30/09/2024 1.56%

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.

Investimenti del portafoglio*

	Impegni di capitale	Patrimonio netto
Swiss Life Funds (LUX) ESG Global Infrastructure Opportunities III	30.86%	34.36%
Swiss Life Funds (LUX) ESG GIO III Co-Invest	11.70%	12.57%
FONTAVIS ESG Renewable Infrastructure Fund II («FORTE II»)	9.58%	7.58%
Swiss Life Funds (LUX) ESG Global Infrastructure Opportunities Growth II	8.51%	3.39%
FONTAVIS ESG Renewable Infrastructure Fund Europe («FORTE»)	5.32%	7.21%
Co-Investment Transition Network Operator Amprion	5.32%	3.46%
Co-Investment District Heating UK	4.99%	5.43%
Co-Investment Saffir (offshore Norway)	4.69%	5.03%
Co-Investment TTT via Bazalgette (Investments) Ltd	3.72%	4.54%
Co-Investment JFK via JLC Terminal One Co-Invest L.P.	3.40%	2.21%
Altri	11.91%	14.22%

*Senza liquidità

Attività per settore*

Energie rinnovabili / Energia	32.49%
Comunicazione	31.10%
Trasporto	12.82%
Infrastrutture sociali	12.42%
Servizi di pubblica utilità	11.17%
Altri	-

*Senza liquidità

Asset per regione*

Europa (incl. Gran Bretagna)	79.96%
America del Nord	18.49%
Svizzera	1.55%
Altre regioni	-

*Senza liquidità

Attività per stadio*

Brownfield	91.33%
Greenfield	8.67%

*Senza liquidità

Attività per valuta*

EUR	60.76%
USD	19.53%
GBP	18.16%
CHF	1.55%

*Senza liquidità

30 settembre 2024

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

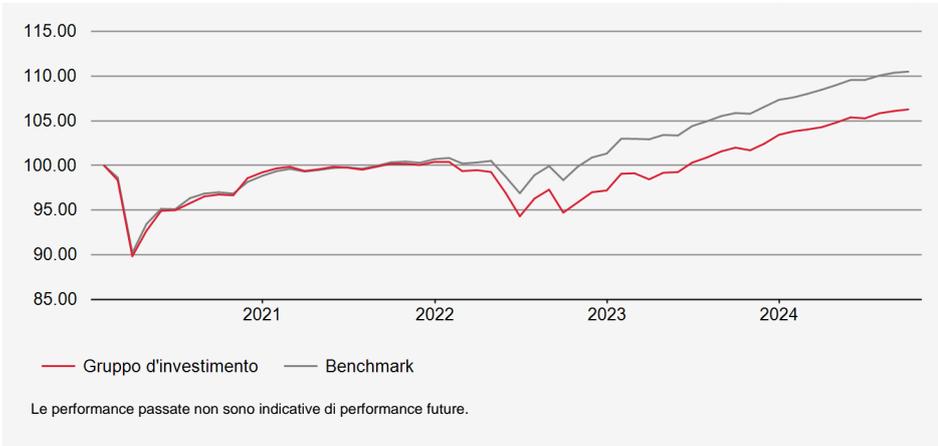


Patrimonio netto (NAV) in mio. CHF: 143.61
Valore d'inventario netto per diritto in CHF: 106.27

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)



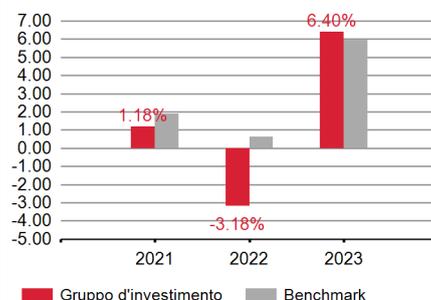
Performance nella valuta di riferimento

	Performance cumulata				Performance annualizzata			
	YTD	1 mese	3 mesi	1 anno	3 anni	5 anni	10 anni	Inizio
Gruppo d'investimento	2.75%	0.17%	0.95%	4.19%	1.98%	-	-	1.31%
Benchmark	2.94%	0.11%	0.85%	4.37%	3.26%	-	-	2.16%

Dati statistici (annualizzati)

	1 anno	3 anni	5 anni	10 anni	Inizio
Volatilità Gruppo d'investimento (in %)	1.20	3.62	-	-	5.63
Volatilità del Benchmark (in %)	0.89	2.81	-	-	5.24
Tracking Error ex post (in %)	0.47	1.05	-	-	1.02
Information Ratio	-0.40	-1.21	-	-	-0.84
Sharpe Ratio	2.18	0.35	-	-	0.19
Correlazione	0.94	0.98	-	-	0.98
Beta	1.28	1.26	-	-	1.06
Jensen alfa	-0.99	-1.94	-	-	-0.96
Maximum Drawdown (in %)	-0.29	-6.07	-	-	-10.15
Recovery Period (anni)	0.08	1.08	-	-	1.50

Performance



Informazioni sul prodotto

Numero di valore: 51215713
ISIN: CH0512157139
LEI: 254900TFN2RL5B1QJ986
Codice Bloomberg: SWSSLCH SW
Benchmark: JPM Lev Loans Upper Tier (80% US + 20% EU) 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: 0.61%

ex post al: 30/09/2024 0.61%

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	16.71%	9.93%
Tecnologia	9.32%	7.68%
Salute	8.16%	8.58%
Finanza	7.67%	5.41%
Giochi/Tempo libero	7.31%	10.54%
Chimica	6.94%	6.06%
Edilizia	5.48%	4.05%
Cavo e Satellite	5.04%	4.18%
Automobile	3.96%	4.02%
Alimentazione e Bevande	3.73%	4.87%
Altri	21.99%	34.70%
Liquidità	3.68%	-

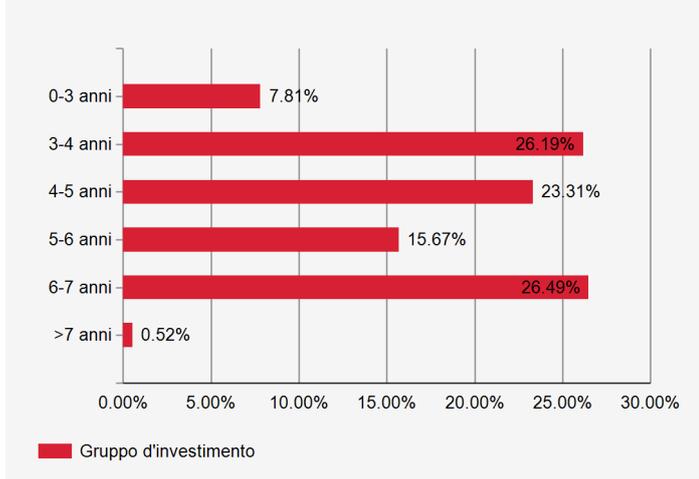
Principali debitori e rating

	Gruppo d'investimento	Benchmark
Action Nederland	BB	1.50%
INEOS Quattro	BB	1.47%
Entain	BB-	1.42%
Belron	BB-	1.41%
Asurion	B+	1.39%

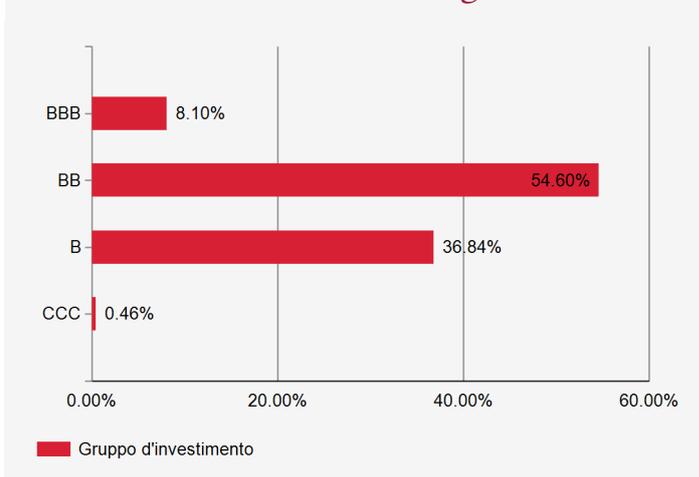
Ulteriori informazioni sui debitori

Numero di debitori	223
--------------------	-----

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	69.03%	7.85%	80.00%	7.19%
EUR	30.97%	7.02%	20.00%	6.52%
Media	-	7.59%	-	7.06%

Struttura del portafoglio secondo il paese/regione

	Gruppo d'investimento	Benchmark
Stati Uniti	57.71%	83.34%
Regno Unito	8.92%	5.66%
Paesi Bassi	6.14%	2.11%
Germania	3.90%	0.40%
Lussemburgo	3.89%	0.29%
Belgio	2.76%	1.09%
Francia	1.84%	-
Svizzera	1.82%	0.17%
Spagna	1.62%	0.81%
Canada	1.41%	2.39%
Altri	6.32%	3.75%
Liquidità	3.68%	-

30 settembre 2024

Fondazione d'investimento Swiss Life Ipotecche Svizzera ESG

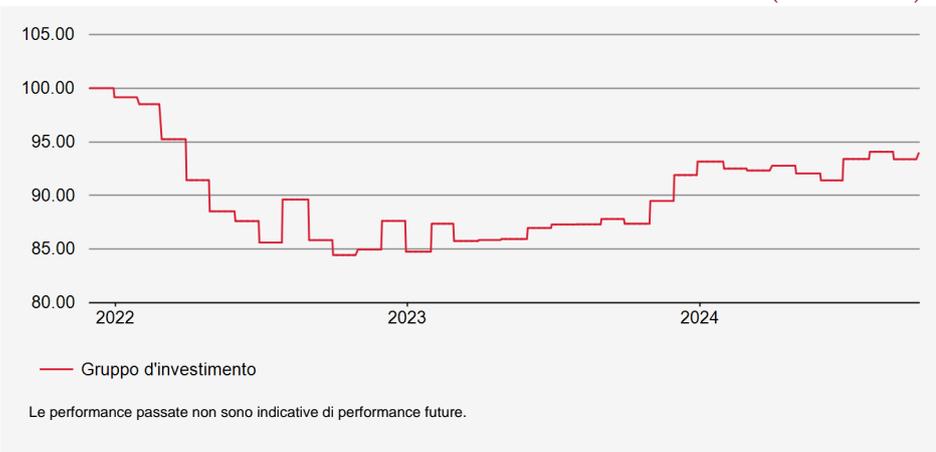


Patrimonio netto (NAV) in mio. CHF: 219.34
Valore d'inventario netto per diritto in CHF: 93.95

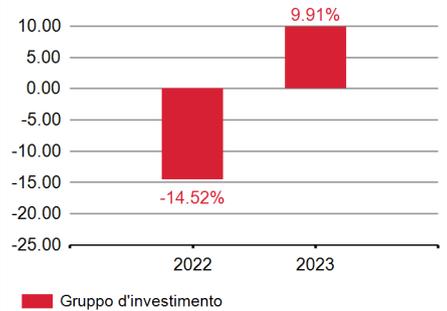
Strategia d'investimento

Investimenti in ipoteche svizzere sostenibili: almeno l'85% previa deduzione di eventuali attività liquide. 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



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: 30/09/2023 0.57%

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	0.85%	0.61%	0.59%	7.53%	-	-	-	-2.18%

Dati statistici

Durata residua media (anni)	8.41
Modified Duration (excl. ipoteche a termine)*	7.13
Modified Duration (incl. ipoteche a termine)*	7.61
Rendimento lordo alla scadenza	1.60%
Anticipo medio	59%
Numero ipoteche	699
Differenza di rendimento rispetto ai titoli di Stato svizzeri	1.20%

*incl. liquidità

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

Ipotecche	94.00%
Fondi Comuni Monetari	3.14%
Liquidità	2.86%
Derivati	0.00%

Distribuzione in base all'ammontare dell'anticipo

<40%	8.89%
40 - 50%	14.10%
50 - 60%	13.86%
60 - 70%	51.47%
>70%	11.68%

Tipo di oggetti messi in pegno

CASE UNIFAMILIARE	35.00%
PROPRIETÀ PER PIANI	52.94%
CASE PLURIFAMILIARI	7.43%
IMMOBILI A USO COMMERCIALE	4.62%

Tipi d'ipoteca

Ipotecche a tasso fisso	98.39%
Ipotecche Saron	1.38%
Ipotecche a tasso variabile	0.23%

Ipotecche con pagamenti scoperti di ben 90 giorni

Anticipo medio	-
Numero debitori ipotecari	-
Relativo Valore globale delle ipotecche con pagamenti scoperti	-

Ripartizione geografica degli immobili

Zurigo	27.18%
Espace Mittelland	15.86%
Svizzera centrale	8.00%
Svizzera nordoccidentale	6.89%
Svizzera orientale	1.92%
Ticino	1.08%
Regione del Lemano	39.07%

Struttura alla scadenza delle ipotecche

1-3 ANNI	7.80%
3-5 ANNI	17.88%
5-7 ANNI	5.09%
7-10 ANNI	49.62%
10-15 ANNI	12.46%
>15 ANNI	7.16%

Distribuzione ESG

Minergie	51.89%
CECE	45.41%
THPE	2.61%
Nessuna etichetta/certificato	0.09%

Fondazione d'investimento Swiss Life

LPP-Mix 15

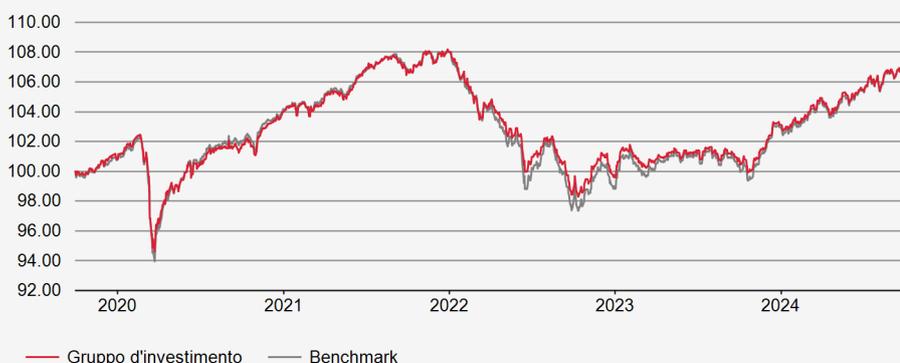


Patrimonio netto (NAV) in mio. CHF: 229.47
Valore d'inventario netto per diritto in CHF: 176.11

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)



Le performance passate non sono indicative di performance future.

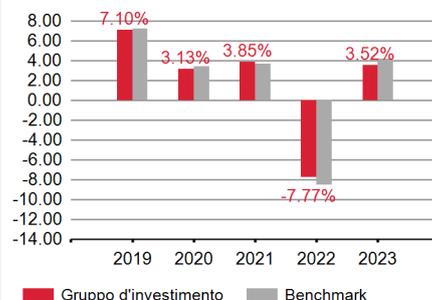
Performance nella valuta di riferimento

	Performance cumulata				Performance annualizzata			
	YTD	1 mese	3 mesi	1 anno	3 anni	5 anni	10 anni	Inizio
Gruppo d'investimento	4.03%	0.40%	1.70%	6.35%	0.16%	1.41%	2.07%	2.70%
Benchmark	4.15%	0.51%	1.72%	6.74%	0.13%	1.41%	2.24%	3.00%

Dati statistici (annualizzati)

	1 anno	3 anni	5 anni	10 anni	Inizio
Volatilità Gruppo d'investimento (in %)	2.43	3.57	3.75	3.07	2.82
Volatilità del Benchmark (in %)	2.78	4.08	4.10	3.21	2.87
Tracking Error ex post (in %)	0.46	0.65	0.56	0.52	0.57
Information Ratio	-0.85	0.04	0.01	-0.33	-0.51
Sharpe Ratio	1.92	-0.15	0.33	0.76	0.89
Correlazione	0.99	0.99	0.99	0.99	0.98
Beta	0.87	0.87	0.91	0.94	0.97
Jensen alfa	0.31	-0.05	0.12	-0.03	-0.20
Maximum Drawdown (in %)	-1.09	-9.12	-9.12	-9.12	-9.12
Recovery Period (anni)	0.07	-	-	-	-

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: 12.00

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: 30/09/2024 0.60%

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.

Commissione: Rimangono riservate le disposizioni divergenti nei regolamenti sulle commissioni di fondazioni di libero passaggio e fondazioni di previdenza 3a.

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 gruppo d'investimento

	Gruppo d'investimento	Benchmark	max. OPP2
Liquidità	2.03%	2.00%	-
Ipoteche Svizzera	12.15%	13.00%	-
Obbligazioni CHF Svizzera	11.08%	13.00%	-
Obbligazioni CHF Estero	5.70%	6.00%	-
Obbligazioni valute estere (CHF hedged)	30.20%	28.00%	-
Azioni Svizzera	8.08%	8.00%	-
Azioni Estero	6.97%	7.00%	-
Azioni Estero (CHF hedged)	-	-	-
Immobili Svizzera	18.08%	15.00%	30.00%
Immobili estero (CHF hedged)	3.39%	3.00%	10.00%
Investimenti alternativi (CHF hedged)	2.33%	5.00%	15.00%
Totale azioni (Svizzera ed Estero)	15.04%	15.00%	50.00%
Totale valute estere	6.97%	7.00%	30.00%

Maggiori posizioni azionarie

NESTLE SA-REG	1.11%
NOVARTIS AG-REG	0.99%
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	0.95%
UBS GROUP AG-REG	0.42%
MICROSOFT CORP	0.41%
NVIDIA CORP	0.40%
ABB LTD-REG	0.39%
ZURICH INSURANCE GROUP AG	0.37%
CIE FINANCIERE RICHEMO-A REG	0.36%
ALPHABET INC	0.25%

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%

Struttura del portafoglio secondo le valute

CHF	93.04%
USD	4.73%
EUR	0.52%
JPY	0.44%
Altri	1.28%

Qualità degli investimenti a reddito fisso

Modified Duration	4.72
Rating medio	A+

Fondazione d'investimento Swiss Life

LPP-Mix 25

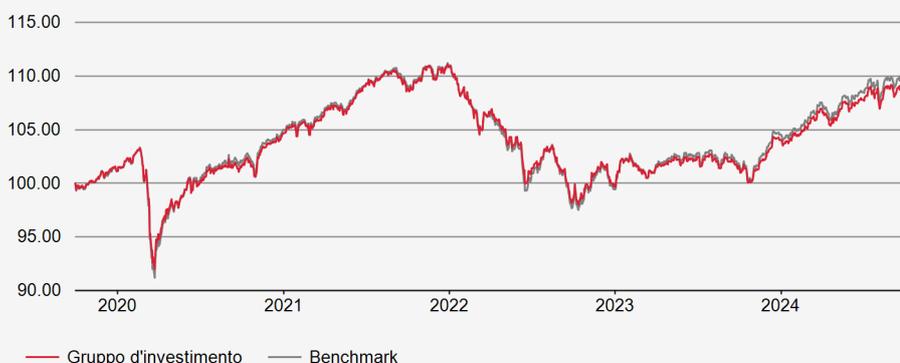


Patrimonio netto (NAV) in mio. CHF: 703.90
Valore d'inventario netto per diritto in CHF: 200.31

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)



Le performance passate non sono indicative di performance future.

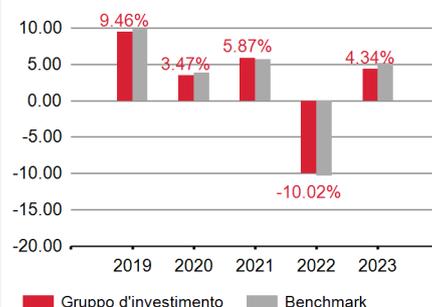
Performance nella valuta di riferimento

	Performance cumulata				Performance annualizzata			
	YTD	1 mese	3 mesi	1 anno	3 anni	5 anni	10 anni	Inizio
Gruppo d'investimento	5.29%	0.35%	1.63%	7.84%	0.22%	1.84%	2.55%	3.06%
Benchmark	5.58%	0.49%	1.73%	8.39%	0.40%	1.99%	2.89%	3.55%

Dati statistici (annualizzati)

	1 anno	3 anni	5 anni	10 anni	Inizio
Volatilità Gruppo d'investimento (in %)	3.31	4.81	5.10	4.29	4.09
Volatilità del Benchmark (in %)	3.60	5.24	5.46	4.42	4.09
Tracking Error ex post (in %)	0.41	0.59	0.55	0.52	0.58
Information Ratio	-1.33	-0.31	-0.28	-0.67	-0.83
Sharpe Ratio	1.83	-0.10	0.33	0.66	0.69
Correlazione	1.00	1.00	1.00	0.99	0.99
Beta	0.92	0.91	0.93	0.96	0.99
Jensen alfa	0.04	-0.21	-0.03	-0.23	-0.46
Maximum Drawdown (in %)	-1.88	-11.75	-11.75	-11.75	-14.16
Recovery Period (anni)	0.04	-	-	-	0.98

Performance



Informazioni sul prodotto

Numero di valore: 1245601

ISIN: CH0012456015

LEI: 5493000KUC3Z24U77V93

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: 12.00

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: 30/09/2024 0.59%

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.

Commissione: Rimangono riservate le disposizioni divergenti nei regolamenti sulle commissioni di fondazioni di libero passaggio e fondazioni di previdenza 3a.

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 gruppo d'investimento

	Gruppo d'investimento	Benchmark	max. OPP2
Liquidità	1.96%	2.00%	-
Ipotecche Svizzera	0.89%	-	-
Obbligazioni CHF Svizzera	15.00%	16.00%	-
Obbligazioni CHF Estero	9.07%	9.00%	-
Obbligazioni valute estere (CHF hedged)	26.85%	28.00%	-
Azioni Svizzera	13.23%	13.00%	-
Azioni Estero	12.02%	12.00%	-
Azioni Estero (CHF hedged)	-	-	-
Immobili Svizzera	15.28%	13.00%	30.00%
Immobili estero (CHF hedged)	3.22%	2.00%	10.00%
Investimenti alternativi (CHF hedged)	2.47%	5.00%	15.00%
Totale azioni (Svizzera ed Estero)	25.25%	25.00%	50.00%
Totale valute estere	12.02%	12.00%	30.00%

Maggiori posizioni azionarie

NESTLE SA-REG	1.82%
NOVARTIS AG-REG	1.63%
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	1.56%
MICROSOFT CORP	0.71%
NVIDIA CORP	0.70%
UBS GROUP AG-REG	0.69%
ABB LTD-REG	0.64%
ZURICH INSURANCE GROUP AG	0.61%
CIE FINANCIERE RICHEMO-A REG	0.59%
ALPHABET INC	0.42%

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%

Struttura del portafoglio secondo le valute

CHF	87.98%
USD	8.16%
EUR	0.89%
JPY	0.76%
Altri	2.21%

Qualità degli investimenti a reddito fisso

Modified Duration	5.82
Rating medio	A

Fondazione d'investimento Swiss Life

LPP-Mix 35

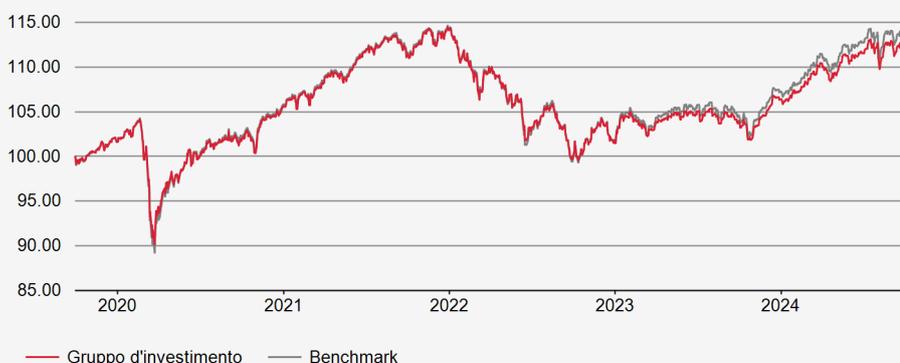


Patrimonio netto (NAV) in mio. CHF: 403.62
Valore d'inventario netto per diritto in CHF: 213.34

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)



Le performance passate non sono indicative di performance future.

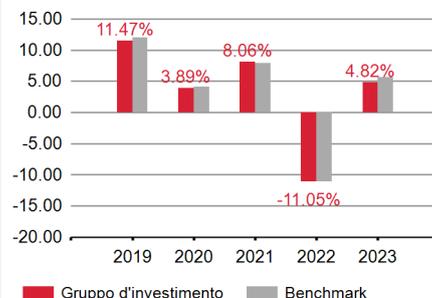
Performance nella valuta di riferimento

	Performance cumulata				Performance annualizzata			
	YTD	1 mese	3 mesi	1 anno	3 anni	5 anni	10 anni	Inizio
Gruppo d'investimento	6.38%	0.25%	1.48%	8.88%	0.54%	2.51%	3.12%	3.35%
Benchmark	6.76%	0.42%	1.58%	9.49%	0.86%	2.75%	3.53%	3.89%

Dati statistici (annualizzati)

	1 anno	3 anni	5 anni	10 anni	Inizio
Volatilità Gruppo d'investimento (in %)	4.11	5.72	6.06	5.27	5.20
Volatilità del Benchmark (in %)	4.35	6.11	6.46	5.40	5.19
Tracking Error ex post (in %)	0.38	0.59	0.61	0.58	0.63
Information Ratio	-1.64	-0.55	-0.40	-0.71	-0.84
Sharpe Ratio	1.71	-0.03	0.38	0.64	0.59
Correlazione	1.00	1.00	1.00	0.99	0.99
Beta	0.94	0.93	0.94	0.97	0.99
Jensen alfa	-0.15	-0.31	-0.07	-0.30	-0.52
Maximum Drawdown (in %)	-2.93	-13.03	-13.41	-13.41	-21.36
Recovery Period (anni)	0.14	-	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: 12.00

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: 30/09/2024 0.57%

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.

Commissione: Rimangono riservate le disposizioni divergenti nei regolamenti sulle commissioni di fondazioni di libero passaggio e fondazioni di previdenza 3a.

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 gruppo d'investimento

	Gruppo d'investimento	Benchmark	max. OPP2
Liquidità	3.26%	2.00%	-
Ipotecche Svizzera	0.60%	-	-
Obbligazioni CHF Svizzera	13.10%	14.00%	-
Obbligazioni CHF Estero	7.13%	7.00%	-
Obbligazioni valute estere (CHF hedged)	24.95%	24.00%	-
Azioni Svizzera	17.88%	18.00%	-
Azioni Estero	16.98%	17.00%	-
Azioni Estero (CHF hedged)	-	-	-
Immobili Svizzera	11.74%	11.00%	30.00%
Immobili estero (CHF hedged)	2.06%	2.00%	10.00%
Investimenti alternativi (CHF hedged)	2.29%	5.00%	15.00%
Totale azioni (Svizzera ed Estero)	34.87%	35.00%	50.00%
Totale valute estere	16.98%	17.00%	30.00%

Maggiori posizioni azionarie

NESTLE SA-REG	2.46%
NOVARTIS AG-REG	2.20%
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	2.10%
MICROSOFT CORP	1.00%
NVIDIA CORP	0.98%
UBS GROUP AG-REG	0.93%
ABB LTD-REG	0.87%
ZURICH INSURANCE GROUP AG	0.83%
CIE FINANCIERE RICHEMO-A REG	0.80%
ALPHABET INC	0.60%

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%

Struttura del portafoglio secondo le valute

CHF	83.02%
USD	11.53%
EUR	1.26%
JPY	1.07%
Altri	3.12%

Qualità degli investimenti a reddito fisso

Modified Duration	5.68
Rating medio	A

Fondazione d'investimento Swiss Life

LPP-Mix 45

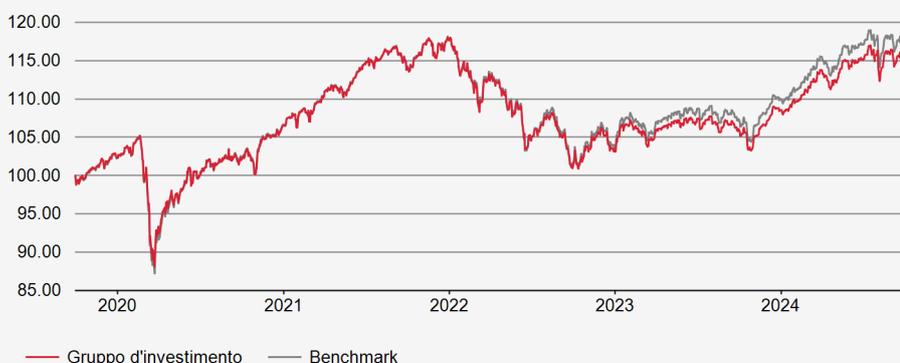


Patrimonio netto (NAV) in mio. CHF: 677.25
Valore d'inventario netto per diritto in CHF: 223.29

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)



Le performance passate non sono indicative di performance future.

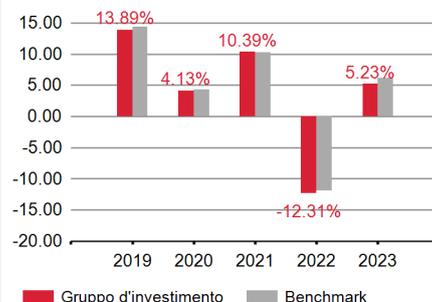
Performance nella valuta di riferimento

	Performance cumulata				Performance annualizzata			
	YTD	1 mese	3 mesi	1 anno	3 anni	5 anni	10 anni	Inizio
Gruppo d'investimento	7.50%	0.21%	1.35%	10.00%	0.75%	3.13%	3.62%	3.55%
Benchmark	7.95%	0.35%	1.44%	10.62%	1.31%	3.50%	4.16%	4.21%

Dati statistici (annualizzati)

	1 anno	3 anni	5 anni	10 anni	Inizio
Volatilità Gruppo d'investimento (in %)	5.00	6.71	7.20	6.41	6.44
Volatilità del Benchmark (in %)	5.17	7.05	7.52	6.47	6.42
Tracking Error ex post (in %)	0.32	0.56	0.56	0.58	0.67
Information Ratio	-1.92	-1.00	-0.65	-0.94	-0.97
Sharpe Ratio	1.61	0.01	0.41	0.60	0.51
Correlazione	1.00	1.00	1.00	1.00	0.99
Beta	0.97	0.95	0.96	0.99	1.00
Jensen alfa	-0.31	-0.52	-0.21	-0.48	-0.64
Maximum Drawdown (in %)	-3.98	-14.55	-16.22	-16.22	-28.27
Recovery Period (anni)	-	-	0.67	0.67	3.76

Performance



Informazioni sul prodotto

Numero di valore: 1245607

ISIN: CH0012456072

LEI: 2549001XL79VZWJO5Q69

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: 12.00

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: 30/09/2024 0.59%

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.

Commissione: Rimangono riservate le disposizioni divergenti nei regolamenti sulle commissioni di fondazioni di libero passaggio e fondazioni di previdenza 3a.

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 gruppo d'investimento

	Gruppo d'investimento	Benchmark	max. OPP2
Liquidità	2.34%	2.00%	-
Ipoteche Svizzera	0.59%	-	-
Obbligazioni CHF Svizzera	10.84%	12.00%	-
Obbligazioni CHF Estero	4.96%	5.00%	-
Obbligazioni valute estere (CHF hedged)	21.35%	20.00%	-
Azioni Svizzera	23.11%	23.00%	-
Azioni Estero	21.99%	22.00%	-
Azioni Estero (CHF hedged)	-	-	-
Immobili Svizzera	10.45%	9.00%	30.00%
Immobili estero (CHF hedged)	1.80%	2.00%	10.00%
Investimenti alternativi (CHF hedged)	2.58%	5.00%	15.00%
Totale azioni (Svizzera ed Estero)	45.10%	45.00%	50.00%
Totale valute estere	21.99%	22.00%	30.00%

Maggiori posizioni azionarie

NESTLE SA-REG	3.18%
NOVARTIS AG-REG	2.84%
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	2.72%
MICROSOFT CORP	1.29%
NVIDIA CORP	1.27%
UBS GROUP AG-REG	1.20%
ABB LTD-REG	1.12%
ZURICH INSURANCE GROUP AG	1.07%
CIE FINANCIERE RICHEMO-A REG	1.03%
ALPHABET INC	0.77%

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%

Struttura del portafoglio secondo le valute

CHF	78.01%
USD	14.92%
EUR	1.63%
JPY	1.39%
Altri	4.05%

Qualità degli investimenti a reddito fisso

Modified Duration	5.74
Rating medio	A

30 settembre 2024

Fondazione d'investimento Swiss Life LPP-Mix 75



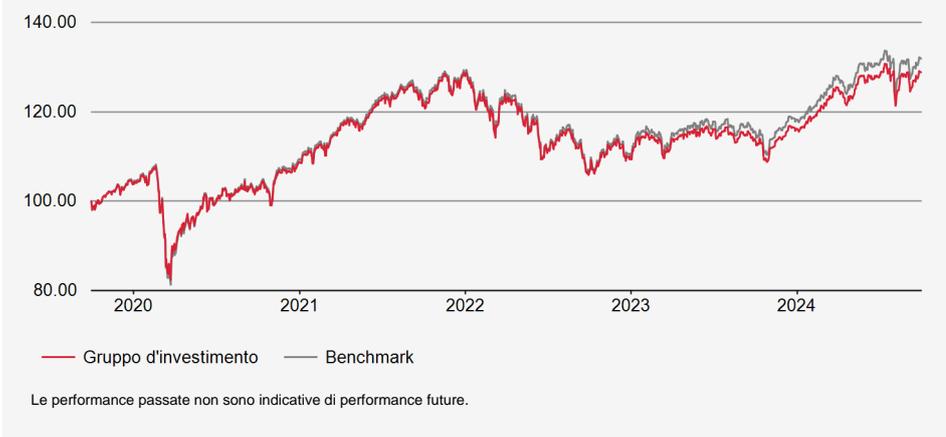
(superamento quota azionaria e in valuta estera secondo OPP 2)

Patrimonio netto (NAV) in mio. CHF: 286.50
Valore d'inventario netto per diritto in CHF: 140.48

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)



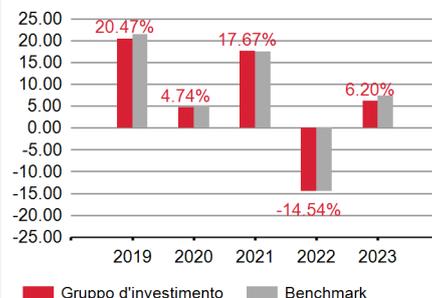
Performance nella valuta di riferimento

	Performance cumulata				Performance annualizzata			
	YTD	1 mese	3 mesi	1 anno	3 anni	5 anni	10 anni	Inizio
Gruppo d'investimento	10.90%	0.01%	0.88%	13.09%	1.91%	5.19%	-	5.91%
Benchmark	11.54%	0.16%	1.07%	14.00%	2.47%	5.68%	-	6.47%

Dati statistici (annualizzati)

	1 anno	3 anni	5 anni	10 anni	Inizio
Volatilità Gruppo d'investimento (in %)	7.75	9.59	10.40	-	10.44
Volatilità del Benchmark (in %)	7.92	10.05	10.92	-	10.89
Tracking Error ex post (in %)	0.29	0.70	0.86	-	0.80
Information Ratio	-3.17	-0.81	-0.57	-	-0.69
Sharpe Ratio	1.40	0.12	0.47	-	0.55
Correlazione	1.00	1.00	1.00	-	1.00
Beta	0.98	0.95	0.95	-	0.96
Jensen alfa	-0.63	-0.48	-0.22	-	-0.28
Maximum Drawdown (in %)	-7.18	-17.76	-23.54	-	-23.54
Recovery Period (anni)	-	1.76	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: 12.00
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: 0.62%
ex post al: 30/09/2024 0.61%

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.
Commissione: Rimangono riservate le disposizioni divergenti nei regolamenti sulle commissioni di fondazioni di libero passaggio e fondazioni di previdenza 3a.
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

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	3.80%	2.00%	-
Ipoteche Svizzera	0.24%	-	-
Obbligazioni valute estere (CHF hedged)	15.11%	13.00%	-
Azioni Svizzera	36.89%	38.00%	-
Azioni Estero	36.95%	37.00%	-
Azioni Estero (CHF hedged)	-	-	-
Immobili Svizzera	4.74%	5.00%	30.00%
Immobili estero (CHF hedged)	0.25%	-	10.00%
Investimenti alternativi (CHF hedged)	2.01%	5.00%	15.00%
Totale azioni (Svizzera ed Estero)	73.84%	75.00%	50.00%
Totale valute estere	36.95%	37.00%	30.00%

Maggiori posizioni azionarie

NESTLE SA-REG	5.08%
NOVARTIS AG-REG	4.54%
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	4.34%
MICROSOFT CORP	2.17%
NVIDIA CORP	2.14%
UBS GROUP AG-REG	1.92%
ABB LTD-REG	1.79%
ZURICH INSURANCE GROUP AG	1.70%
CIE FINANCIERE RICHEMO-A REG	1.64%
ALPHABET INC	1.30%

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%

Struttura del portafoglio secondo le valute

CHF	63.05%
USD	25.08%
EUR	2.74%
JPY	2.34%
Altri	6.80%

Qualità degli investimenti a reddito fisso

Modified Duration	4.57
Rating medio	A-

Fondazione d'investimento Swiss Life

LPP-Mix 25 P



Patrimonio netto (NAV) in mio. CHF: 703.90
Valore d'inventario netto per diritto in CHF: 169.99

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)



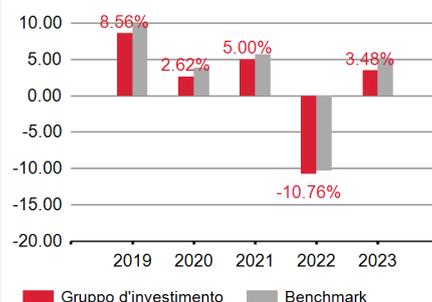
Performance nella valuta di riferimento

	Performance cumulata				Performance annualizzata			
	YTD	1 mese	3 mesi	1 anno	3 anni	5 anni	10 anni	Inizio
Gruppo d'investimento	4.63%	0.28%	1.42%	6.95%	-0.61%	1.00%	1.70%	2.44%
Benchmark	5.58%	0.49%	1.73%	8.39%	0.40%	1.99%	2.89%	3.76%

Dati statistici (annualizzati)

	1 anno	3 anni	5 anni	10 anni	Inizio
Volatilità Gruppo d'investimento (in %)	3.31	4.81	5.10	4.28	4.09
Volatilità del Benchmark (in %)	3.60	5.24	5.46	4.42	4.10
Tracking Error ex post (in %)	0.42	0.59	0.55	0.52	0.59
Information Ratio	-3.45	-1.72	-1.80	-2.29	-2.26
Sharpe Ratio	1.58	-0.27	0.17	0.46	0.55
Correlazione	1.00	1.00	1.00	0.99	0.99
Beta	0.92	0.91	0.93	0.96	0.99
Jensen alfa	-0.86	-1.03	-0.87	-1.07	-1.28
Maximum Drawdown (in %)	-1.93	-12.33	-12.33	-12.33	-15.36
Recovery Period (anni)	0.07	-	-	-	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: 12.00
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: 1.39%
ex post al: 30/09/2024 1.42%

Struttura del portafoglio per gruppo d'investimento

	Gruppo d'investimento	Benchmark	max. OPP2
Liquidità	1.96%	2.00%	-
Ipotecche Svizzera	0.89%	-	-
Obbligazioni CHF Svizzera	15.00%	16.00%	-
Obbligazioni CHF Estero	9.07%	9.00%	-
Obbligazioni valute estere (CHF hedged)	26.85%	28.00%	-
Azioni Svizzera	13.23%	13.00%	-
Azioni Estero	12.02%	12.00%	-
Azioni Estero (CHF hedged)	-	-	-
Immobili Svizzera	15.28%	13.00%	30.00%
Immobili estero (CHF hedged)	3.22%	2.00%	10.00%
Investimenti alternativi (CHF hedged)	2.47%	5.00%	15.00%
Totale azioni (Svizzera ed Estero)	25.25%	25.00%	50.00%
Totale valute estere	12.02%	12.00%	30.00%

Maggiori posizioni azionarie

NESTLE SA-REG	1.82%
NOVARTIS AG-REG	1.63%
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	1.56%
MICROSOFT CORP	0.71%
NVIDIA CORP	0.70%
UBS GROUP AG-REG	0.69%
ABB LTD-REG	0.64%
ZURICH INSURANCE GROUP AG	0.61%
CIE FINANCIERE RICHEMO-A REG	0.59%
ALPHABET INC	0.42%

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%

Struttura del portafoglio secondo le valute

CHF	87.98%
USD	8.16%
EUR	0.89%
JPY	0.76%
Altri	2.21%

Qualità degli investimenti a reddito fisso

Modified Duration	5.82
Rating medio	A

Fondazione d'investimento Swiss Life

LPP-Mix 35 P

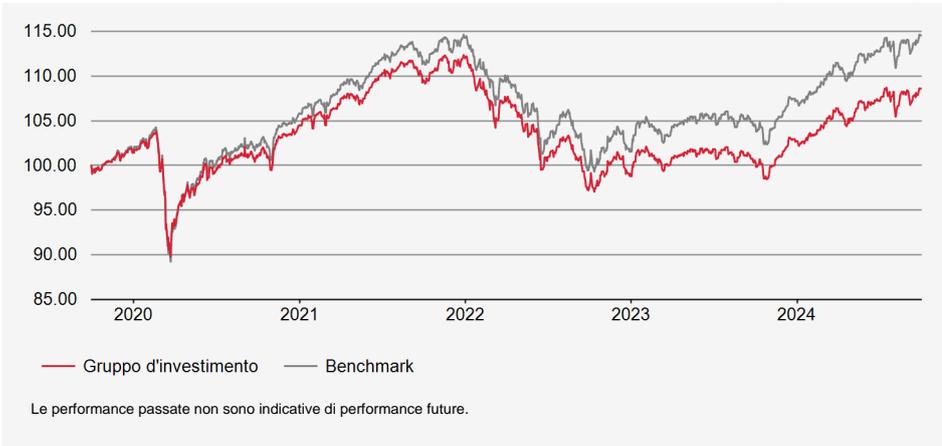


Patrimonio netto (NAV) in mio. CHF: 403.62
Valore d'inventario netto per diritto in CHF: 185.60

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)



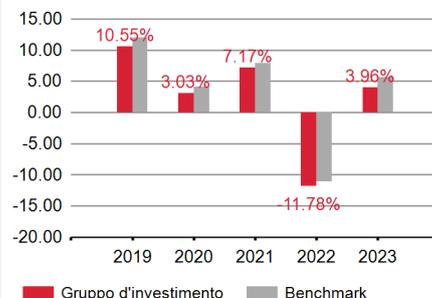
Performance nella valuta di riferimento

	Performance cumulata				Performance annualizzata			
	YTD	1 mese	3 mesi	1 anno	3 anni	5 anni	10 anni	Inizio
Gruppo d'investimento	5.71%	0.18%	1.26%	7.98%	-0.29%	1.66%	2.26%	2.85%
Benchmark	6.76%	0.42%	1.58%	9.49%	0.86%	2.75%	3.53%	4.26%

Dati statistici (annualizzati)

	1 anno	3 anni	5 anni	10 anni	Inizio
Volatilità Gruppo d'investimento (in %)	4.11	5.72	6.06	5.27	5.16
Volatilità del Benchmark (in %)	4.35	6.11	6.46	5.40	5.16
Tracking Error ex post (in %)	0.37	0.58	0.60	0.58	0.66
Information Ratio	-4.05	-1.98	-1.80	-2.19	-2.16
Sharpe Ratio	1.50	-0.17	0.25	0.48	0.51
Correlazione	1.00	1.00	1.00	0.99	0.99
Beta	0.94	0.93	0.94	0.97	0.99
Jensen alfa	-1.06	-1.14	-0.92	-1.15	-1.38
Maximum Drawdown (in %)	-2.97	-13.60	-13.60	-13.60	-22.51
Recovery Period (anni)	-	-	-	-	3.44

Performance



Informazioni sul prodotto

Numero di valore: 1436916
ISIN: CH0014369166
LEI: 254900SR5GM6HP44F130
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: 12.00
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: 30/09/2024 1.40%

Struttura del portafoglio per gruppo d'investimento

	Gruppo d'investimento	Benchmark	max. OPP2
Liquidità	3.26%	2.00%	-
Ipoteche Svizzera	0.60%	-	-
Obbligazioni CHF Svizzera	13.10%	14.00%	-
Obbligazioni CHF Estero	7.13%	7.00%	-
Obbligazioni valute estere (CHF hedged)	24.95%	24.00%	-
Azioni Svizzera	17.88%	18.00%	-
Azioni Estero	16.98%	17.00%	-
Azioni Estero (CHF hedged)	-	-	-
Immobili Svizzera	11.74%	11.00%	30.00%
Immobili estero (CHF hedged)	2.06%	2.00%	10.00%
Investimenti alternativi (CHF hedged)	2.29%	5.00%	15.00%
Totale azioni (Svizzera ed Estero)	34.87%	35.00%	50.00%
Totale valute estere	16.98%	17.00%	30.00%

Maggiori posizioni azionarie

NESTLE SA-REG	2.46%
NOVARTIS AG-REG	2.20%
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	2.10%
MICROSOFT CORP	1.00%
NVIDIA CORP	0.98%
UBS GROUP AG-REG	0.93%
ABB LTD-REG	0.87%
ZURICH INSURANCE GROUP AG	0.83%
CIE FINANCIERE RICHEMO-A REG	0.80%
ALPHABET INC	0.60%

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%

Struttura del portafoglio secondo le valute

CHF	83.02%
USD	11.53%
EUR	1.26%
JPY	1.07%
Altri	3.12%

Qualità degli investimenti a reddito fisso

Modified Duration	5.68
Rating medio	A

Fondazione d'investimento Swiss Life

LPP-Mix 45 P



Patrimonio netto (NAV) in mio. CHF: 677.25
Valore d'inventario netto per diritto in CHF: 200.74

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)



Le performance passate non sono indicative di performance future.

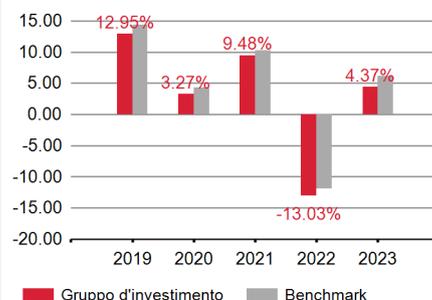
Performance nella valuta di riferimento

	Performance cumulata				Performance annualizzata			
	YTD	1 mese	3 mesi	1 anno	3 anni	5 anni	10 anni	Inizio
Gruppo d'investimento	6.82%	0.14%	1.13%	9.09%	-0.08%	2.28%	2.76%	3.22%
Benchmark	7.95%	0.35%	1.44%	10.62%	1.31%	3.50%	4.16%	4.74%

Dati statistici (annualizzati)

	1 anno	3 anni	5 anni	10 anni	Inizio
Volatilità Gruppo d'investimento (in %)	5.01	6.71	7.20	6.41	6.34
Volatilità del Benchmark (in %)	5.17	7.05	7.52	6.47	6.33
Tracking Error ex post (in %)	0.32	0.55	0.56	0.58	0.68
Information Ratio	-4.82	-2.51	-2.16	-2.42	-2.26
Sharpe Ratio	1.44	-0.12	0.29	0.47	0.47
Correlazione	1.00	1.00	1.00	1.00	0.99
Beta	0.97	0.95	0.96	0.99	1.00
Jensen alfa	-1.24	-1.36	-1.07	-1.34	-1.51
Maximum Drawdown (in %)	-4.02	-15.10	-16.28	-16.28	-29.17
Recovery Period (anni)	-	-	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: 12.00

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: 30/09/2024 1.42%

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 gruppo d'investimento

	Gruppo d'investimento	Benchmark	max. OPP2
Liquidità	2.34%	2.00%	-
Ipotecche Svizzera	0.59%	-	-
Obbligazioni CHF Svizzera	10.84%	12.00%	-
Obbligazioni CHF Estero	4.96%	5.00%	-
Obbligazioni valute estere (CHF hedged)	21.35%	20.00%	-
Azioni Svizzera	23.11%	23.00%	-
Azioni Estero	21.99%	22.00%	-
Azioni Estero (CHF hedged)	-	-	-
Immobili Svizzera	10.45%	9.00%	30.00%
Immobili estero (CHF hedged)	1.80%	2.00%	10.00%
Investimenti alternativi (CHF hedged)	2.58%	5.00%	15.00%
Totale azioni (Svizzera ed Estero)	45.10%	45.00%	50.00%
Totale valute estere	21.99%	22.00%	30.00%

Maggiori posizioni azionarie

NESTLE SA-REG	3.18%
NOVARTIS AG-REG	2.84%
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	2.72%
MICROSOFT CORP	1.29%
NVIDIA CORP	1.27%
UBS GROUP AG-REG	1.20%
ABB LTD-REG	1.12%
ZURICH INSURANCE GROUP AG	1.07%
CIE FINANCIERE RICHEMO-A REG	1.03%
ALPHABET INC	0.77%

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%

Struttura del portafoglio secondo le valute

CHF	78.01%
USD	14.92%
EUR	1.63%
JPY	1.39%
Altri	4.05%

Qualità degli investimenti a reddito fisso

Modified Duration	5.74
Rating medio	A

30 settembre 2024

Fondazione d'investimento Swiss Life

Obbligazioni CHF Svizzera PM

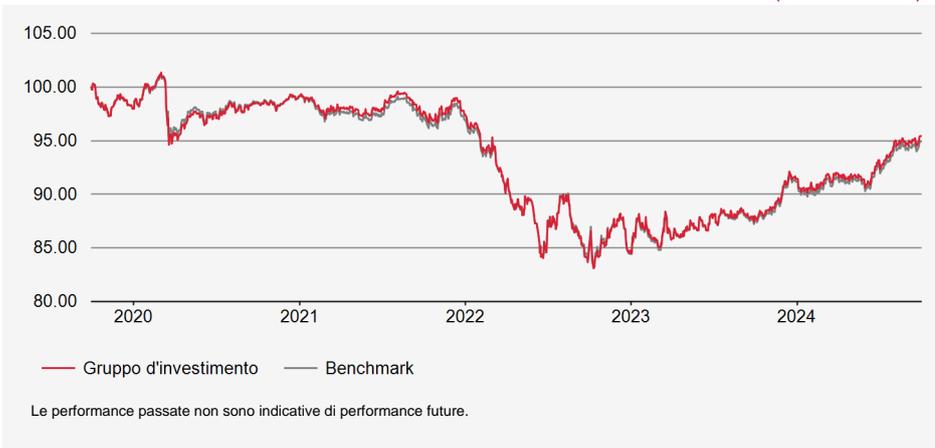


Patrimonio netto (NAV) in mio. CHF: 800.71
Valore d'inventario netto per diritto in CHF: 147.54

Strategia d'investimento

Investimenti in titoli di credito in CHF di debitori prevalentemente domiciliati in Svizzera. Selezione attiva di titoli, gestione della duration e posizionamento della curva dei tassi d'interesse. Limitazione per debitore: 10% (eccezioni: fino al 25% in ogni istituto di credito fondiario, Confederazione Svizzera senza limitazione). Debitori esterni all'indice di riferimento: 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)



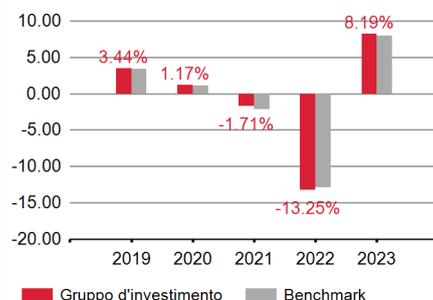
Performance nella valuta di riferimento

	Performance cumulata				Performance annualizzata			
	YTD	1 mese	3 mesi	1 anno	3 anni	5 anni	10 anni	Inizio
Gruppo d'investimento	4.36%	0.74%	2.43%	8.50%	-0.71%	-0.93%	0.76%	2.27%
Benchmark	4.13%	0.69%	2.29%	8.17%	-0.71%	-1.03%	0.66%	2.10%

Dati statistici (annualizzati)

	1 anno	3 anni	5 anni	10 anni	Inizio
Volatilità Gruppo d'investimento (in %)	3.64	6.04	5.75	4.74	4.06
Volatilità del Benchmark (in %)	3.64	5.85	5.49	4.58	4.01
Tracking Error ex post (in %)	0.18	0.43	0.46	0.37	0.43
Information Ratio	1.83	0.01	0.23	0.25	0.39
Sharpe Ratio	1.83	-0.23	-0.19	0.22	0.55
Correlazione	1.00	1.00	1.00	1.00	0.99
Beta	1.00	1.03	1.04	1.03	1.01
Jensen alfa	0.34	0.05	0.16	0.06	0.15
Maximum Drawdown (in %)	-2.14	-16.04	-17.99	-19.21	-19.21
Recovery Period (anni)	0.41	-	-	-	-

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: 13.00
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: 30/09/2024 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	30.54%	39.43%
Finanza	27.73%	15.82%
Stati e simili	23.04%	29.83%
Consumo non ciclico	7.93%	7.01%
Servizi di pubblica utilità	5.13%	2.49%
Beni Industriali	2.79%	2.75%
Consumo ciclico	1.38%	0.38%
Comunicazione	0.50%	0.92%
Altri	0.23%	1.38%
Liquidità	0.73%	-

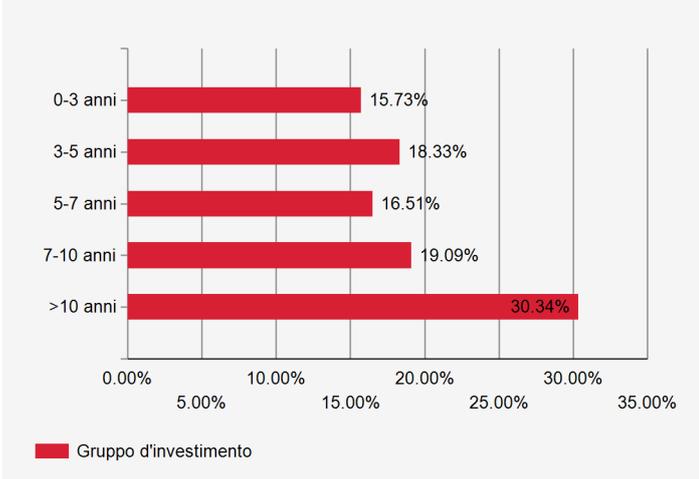
Principali debitori e rating

	Rating	Gruppo d'investimento
Pfandbriefbank	AAA	16.94%
Pfandbriefzentrale	AAA	13.45%
Confederazione	AAA	13.37%
Stadt Zürich	AAA	2.62%
UBS Group AG	AA-	2.54%

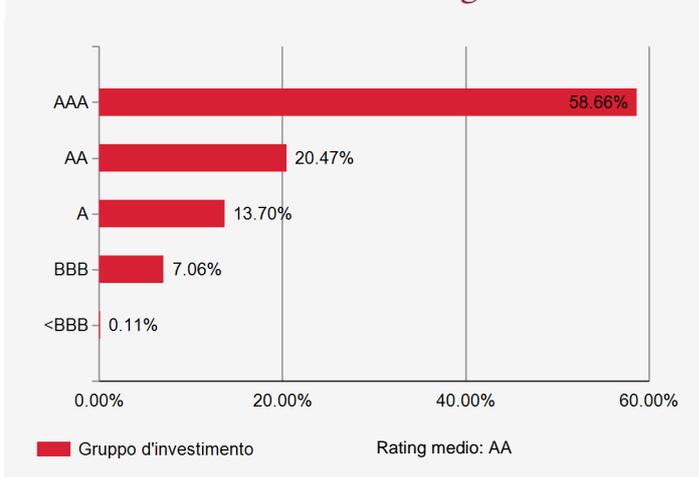
Ulteriori informazioni sui debitori

Numero di debitori	113
Quota di debitori senza benchmark	0.15%

Struttura della scadenza dei titoli



Investimenti secondo il rating



Durata e rendimento alla scadenza

	Gruppo d'investimento	Benchmark
Modified Duration	8.0	8.0
Rendimento alla scadenza teorica*	0.89%	0.79%

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

Fondazione d'investimento Swiss Life

Obbligazioni CHF Estero PM

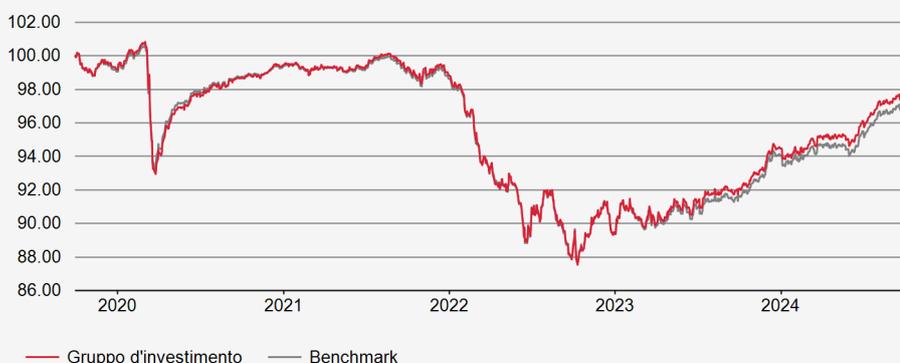


Patrimonio netto (NAV) in mio. CHF: 305.94
Valore d'inventario netto per diritto in CHF: 136.40

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%. Titoli di credito di 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.

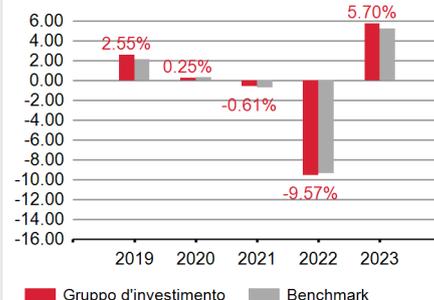
Performance nella valuta di riferimento

	Performance cumulata				Performance annualizzata			
	YTD	1 mese	3 mesi	1 anno	3 anni	5 anni	10 anni	Inizio
Gruppo d'investimento	3.68%	0.72%	1.93%	6.40%	-0.43%	-0.41%	0.50%	1.81%
Benchmark	3.48%	0.68%	1.93%	6.22%	-0.58%	-0.54%	0.37%	1.68%

Dati statistici (annualizzati)

	1 anno	3 anni	5 anni	10 anni	Inizio
Volatilità Gruppo d'investimento (in %)	1.97	3.92	4.47	3.40	3.47
Volatilità del Benchmark (in %)	2.01	3.90	4.26	3.26	3.25
Tracking Error ex post (in %)	0.12	0.25	0.35	0.32	0.96
Information Ratio	1.58	0.63	0.36	0.41	0.13
Sharpe Ratio	2.39	-0.29	-0.13	0.24	0.51
Correlazione	1.00	1.00	1.00	1.00	0.96
Beta	0.98	1.00	1.05	1.04	1.03
Jensen alfa	0.29	0.16	0.16	0.10	0.07
Maximum Drawdown (in %)	-0.97	-12.02	-13.18	-13.71	-13.71
Recovery Period (anni)	0.15	-	-	-	-

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: 13.00
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: 30/09/2024 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	65.90%	48.12%
Stati e simili	7.70%	15.55%
Instituti lettere di pegno	6.20%	16.72%
Consumo ciclico	3.74%	3.49%
Servizi di pubblica utilità	3.73%	2.78%
Beni Industriali	3.01%	5.30%
Consumo non ciclico	2.62%	4.04%
Energia	1.06%	1.23%
Supernazionale	4.73%	-
Altri	1.43%	2.78%
Liquidità	-0.13%	-

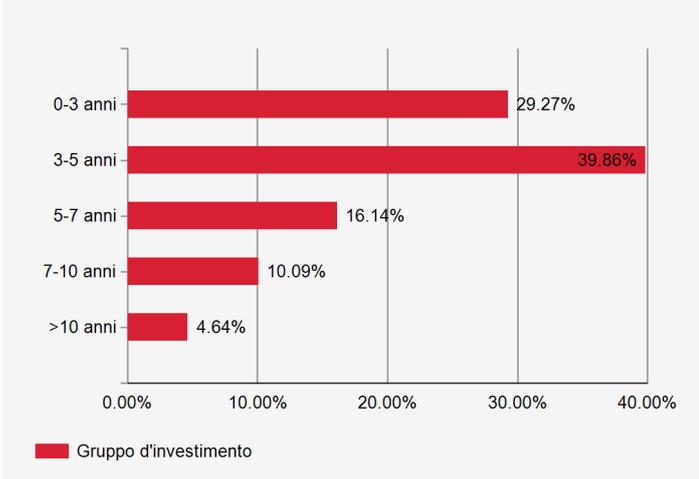
Principali debitori e rating

	Gruppo d'investimento	
Banco Santander SA, Madrid	A+	4.35%
Bank of Nova Scotia/The	AA	3.95%
Groupe BPCE	AA-	3.83%
Müchener Hypothekenbank	AA	3.71%
Credit Agricole Group	AA-	3.28%

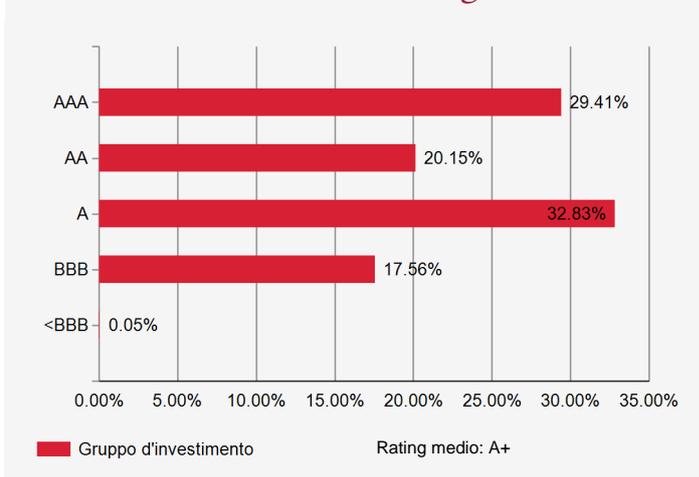
Ulteriori informazioni sui debitori

Numero di debitori	113
Quota di debitori senza benchmark	2.41%

Struttura della scadenza dei titoli



Investimenti secondo il rating



Durata e rendimento alla scadenza

	Gruppo d'investimento	Benchmark
Modified Duration	4.2	4.2
Rendimento alla scadenza teorica*	1.17%	1.05%

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

Struttura del portafoglio secondo il paese/regione

	Gruppo d'investimento	Benchmark
Francia	16.28%	16.23%
Germania	14.97%	13.38%
Canada	12.68%	11.86%
Stati Uniti	9.95%	12.19%
Australia	6.08%	6.67%
Spagna	5.98%	4.65%
Regno Unito	4.71%	4.45%
Regione Europea (Ex EUR)	8.54%	6.59%
Regione Europea (EUR)	5.45%	9.60%
Mercati Emergenti in America	5.39%	4.05%
Altri	10.11%	10.35%
Liquidità, copertura	-0.13%	-

Fondazione d'investimento Swiss Life

Obbligazioni Global PM (CHF hedged)



Patrimonio netto (NAV) in mio. CHF: 149.41
Valore d'inventario netto per diritto in CHF: 121.00

Strategia d'investimento

Investimenti in titoli di credito 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). Titoli di credito di 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 Aggregate (CHF hedged); fondi d'investimento di diritto svizzero della categoria "altri fondi per investimenti tradizionali".

Evoluzione del valore nella valuta di riferimento (base 100)



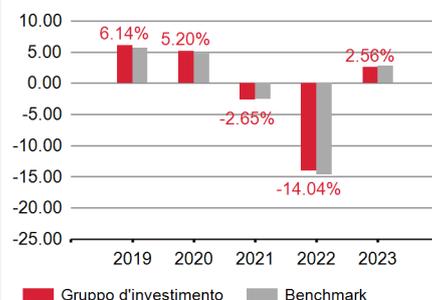
Performance nella valuta di riferimento

	Performance cumulata				Performance annualizzata			
	YTD	1 mese	3 mesi	1 anno	3 anni	5 anni	10 anni	Inizio
Gruppo d'investimento	0.75%	0.83%	3.08%	5.80%	-3.98%	-2.06%	-0.04%	1.10%
Benchmark	0.65%	0.88%	3.15%	5.68%	-4.11%	-2.28%	-0.18%	0.84%

Dati statistici (annualizzati)

	1 anno	3 anni	5 anni	10 anni	Inizio
Volatilità Gruppo d'investimento (in %)	5.46	5.87	5.24	4.26	5.61
Volatilità del Benchmark (in %)	5.37	6.12	5.38	4.35	5.62
Tracking Error ex post (in %)	0.28	0.58	0.51	0.56	1.37
Information Ratio	0.41	0.22	0.42	0.25	0.19
Sharpe Ratio	0.76	-0.81	-0.43	0.06	0.19
Correlazione	1.00	1.00	1.00	0.99	0.97
Beta	1.02	0.95	0.97	0.97	0.97
Jensen alfa	0.05	-0.10	0.14	0.14	0.29
Maximum Drawdown (in %)	-4.04	-18.05	-19.52	-19.52	-19.52
Recovery Period (anni)	0.36	-	-	-	-

Performance



Informazioni sul prodotto

Numero di valore: 3026055
ISIN: CH0030260555
LEI: 254900F82G5L48XPDV74
Codice Bloomberg: SLOFGPM SW
Benchmark: BLOOMBERG GLO AGG EX SEC EX CNY HEDGED 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: 13.00
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: 30/09/2024 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 PM (CHF hedged)

Struttura del portafoglio per settore

	Gruppo d'investimento	Benchmark
Stati e simili	52.04%	72.55%
Finanza	18.94%	11.42%
Consumo non ciclico	6.85%	4.01%
Comunicazione	2.81%	1.95%
Consumo ciclico	2.40%	1.81%
Servizi di pubblica utilità	1.94%	2.71%
Tecnologia	1.48%	1.10%
Energia	1.38%	1.67%
Supernazionale	5.05%	-
Altri	1.94%	2.78%
Liquidità	5.26%	-
Copertura del rischio di cambio	-0.09%	-

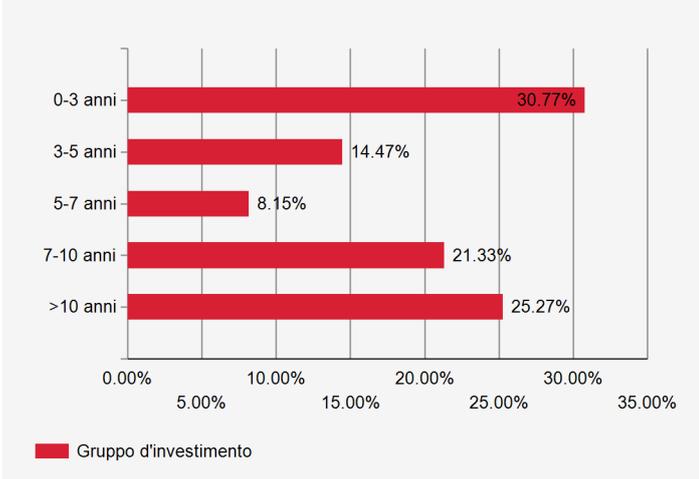
Principali debitori e rating

	Gruppo d'investimento	
Giappone	A+	17.44%
US Treasury N/B	AAA	8.85%
Italia	BBB	5.45%
Regno di Spagna	A	2.56%
BNG Bank NV	AAA	1.97%

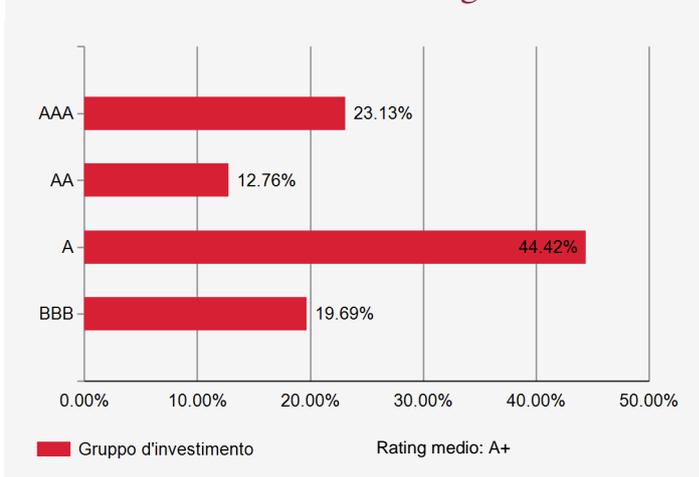
Ulteriori informazioni sui debitori

Numero di debitori	149
Quota di debitori senza benchmark	0.00%

Struttura della scadenza dei titoli



Investimenti secondo il rating



Durata e rendimento alla scadenza

	Gruppo d'investimento	Benchmark
Modified Duration	7.2	6.9
Rendimento alla scadenza teorica*	3.47%	3.42%

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

Struttura del portafoglio secondo il paese/regione

	Gruppo d'investimento	Benchmark
Stati Uniti	25.14%	37.17%
Giappone	20.41%	13.69%
Canada	8.10%	4.37%
Italia	6.81%	4.00%
Germania	5.41%	5.87%
Francia	5.24%	6.18%
Regno Unito	3.78%	5.48%
Regione Europea (EUR)	11.10%	8.90%
Regione Europea (Ex EUR)	3.57%	1.59%
Mercati Emergenti in America	1.66%	0.04%
Altri	3.61%	12.72%
Liquidità, copertura	5.17%	-

Fondazione d'investimento Swiss Life

Obbligazioni Global Stati+ PM (CHF hedged)

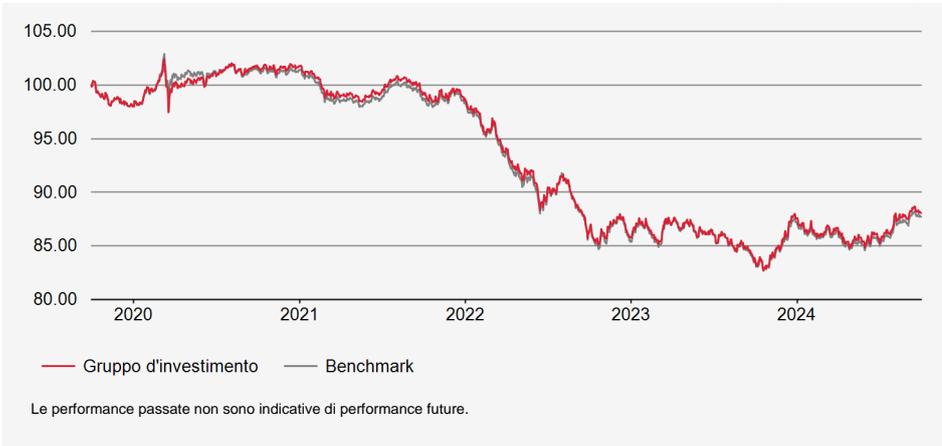


Patrimonio netto (NAV) in mio. CHF: 866.06
Valore d'inventario netto per diritto in CHF: 112.07

Strategia d'investimento

Investimenti in titoli di credito 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). Titoli di credito di 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)



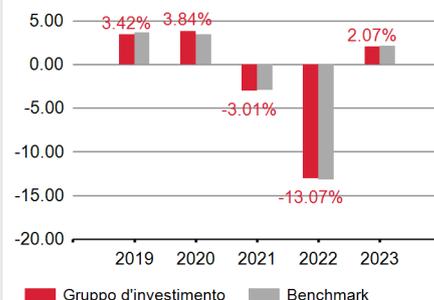
Performance nella valuta di riferimento

	Performance cumulata				Performance annualizzata			
	YTD	1 mese	3 mesi	1 anno	3 anni	5 anni	10 anni	Inizio
Gruppo d'investimento	0.56%	0.64%	2.82%	5.02%	-3.85%	-2.51%	-0.37%	0.83%
Benchmark	0.56%	0.72%	2.78%	4.79%	-3.81%	-2.58%	-0.41%	0.59%

Dati statistici (annualizzati)

	1 anno	3 anni	5 anni	10 anni	Inizio
Volatilità Gruppo d'investimento (in %)	4.88	5.04	4.33	3.71	3.57
Volatilità del Benchmark (in %)	4.60	5.15	4.39	3.80	3.53
Tracking Error ex post (in %)	0.34	0.57	0.60	0.59	0.69
Information Ratio	0.68	-0.07	0.13	0.07	0.35
Sharpe Ratio	0.70	-0.92	-0.62	-0.02	0.29
Correlazione	1.00	0.99	0.99	0.99	0.98
Beta	1.06	0.97	0.98	0.96	0.99
Jensen alfa	0.04	-0.17	0.01	0.04	0.25
Maximum Drawdown (in %)	-3.60	-17.01	-19.23	-19.23	-19.23
Recovery Period (anni)	0.28	-	-	-	-

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: 13.00
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: 30/09/2024 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	76.59%	100.00%
Finanza	6.78%	-
Instituti lettere di pegno	3.56%	-
Beni Industriali	0.08%	-
Supernazionale	4.27%	-
Liquidità	8.59%	-
Copertura del rischio di cambio	0.11%	-

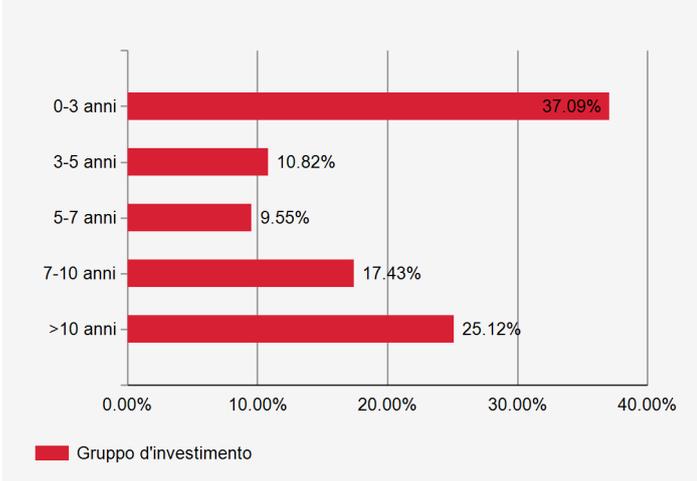
Principali debitori e rating

	Gruppo d'investimento	Benchmark
Giappone	A+	21.87%
US Treasury N/B	AAA	14.44%
Italia	BBB-	5.73%
People's Republic of China	A+	5.38%
Regno di Spagna	A-	4.64%

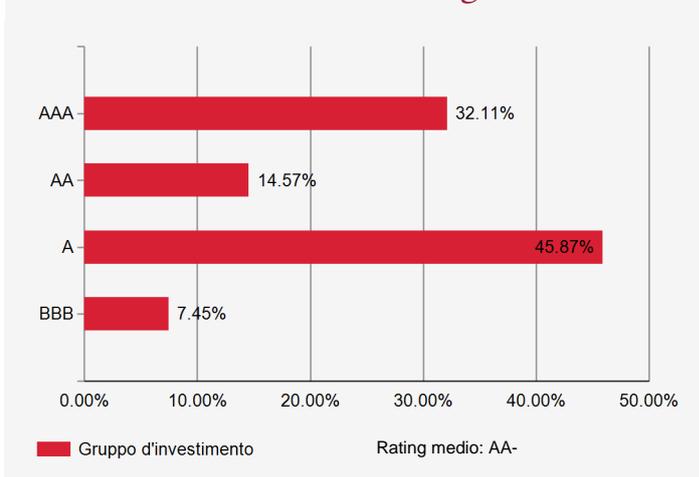
Ulteriori informazioni sui debitori

Numero di debitori	65
Quota di debitori senza benchmark	3.30%

Struttura della scadenza dei titoli



Investimenti secondo il rating



Durata e rendimento alla scadenza

	Gruppo d'investimento	Benchmark
Modified Duration	7.4	7.3
Rendimento alla scadenza teorica*	3.03%	2.92%

* 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
JPY	31.78%	4.73	17.98%	8.92
EUR	21.87%	10.03	23.12%	7.17
USD	18.19%	12.31	33.43%	6.01
GBP	9.08%	8.72	5.54%	8.99
Altri	19.07%	7.28	19.94%	7.11

Struttura del portafoglio secondo il paese/regione

	Gruppo d'investimento	Benchmark
Giappone	24.39%	17.98%
Stati Uniti	15.99%	33.43%
Italia	6.33%	5.02%
Cina	5.95%	9.51%
Spagna	5.28%	3.28%
Regno Unito	4.97%	5.54%
Germania	3.73%	4.37%
Regione Europea (EUR)	10.92%	9.68%
Regione Europea (Ex EUR)	4.94%	0.45%
Regione Asia e Pacifico	1.84%	1.35%
Altri	6.95%	9.40%
Liquidità, copertura	8.71%	-



Fondazione d'investimento Swiss Life

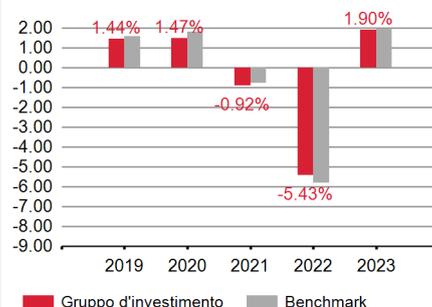
Obbligazioni Global Imprese Short Term PM (CHF hedged) SwissLife

Patrimonio netto (NAV) in mio. CHF: 1,376.35
Valore d'inventario netto per diritto in CHF: 101.54

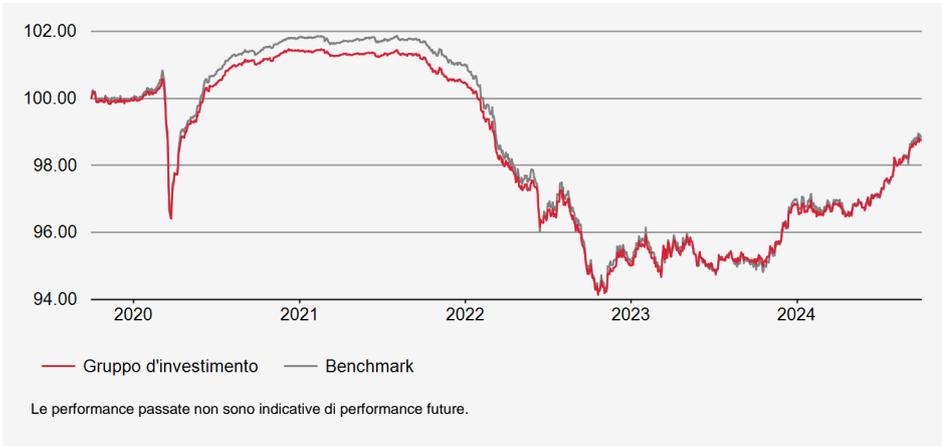
Strategia d'investimento

Investimenti in titoli di credito di società (agenzie e supranazionali 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%. Titoli di credito di 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".

Performance



Evoluzione del valore nella valuta di riferimento (base 100)



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: 13.00
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: 30/09/2024 0.15%

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	1.99%	0.54%	1.68%	3.73%	-0.80%	-0.25%	-0.04%	0.14%
Benchmark	1.92%	0.58%	1.83%	3.97%	-0.93%	-0.23%	-0.09%	0.07%

Dati statistici (annualizzati)

	1 anno	3 anni	5 anni	10 anni	Inizio
Volatilità Gruppo d'investimento (in %)	1.36	2.14	2.22	1.67	1.61
Volatilità del Benchmark (in %)	1.68	2.35	2.39	1.76	1.69
Tracking Error ex post (in %)	0.37	0.31	0.27	0.32	0.32
Information Ratio	-0.65	0.41	-0.07	0.16	0.23
Sharpe Ratio	1.59	-0.70	-0.18	0.15	0.26
Correlazione	0.99	0.99	1.00	0.98	0.98
Beta	0.81	0.90	0.92	0.93	0.94
Jensen alfa	0.23	-0.04	-0.05	0.06	0.09
Maximum Drawdown (in %)	-0.49	-6.99	-7.22	-7.22	-7.22
Recovery Period (anni)	0.25	-	-	-	-

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 Short Term PM (CHF hedged)

Struttura del portafoglio per settore

	Gruppo d'investimento	Benchmark
Finanza	53.44%	50.99%
Consumo non ciclico	11.59%	12.11%
Consumo ciclico	8.52%	9.88%
Comunicazione	4.67%	5.39%
Energia	4.08%	4.13%
Tecnologia	3.75%	4.08%
Beni Industriali	3.36%	5.91%
Servizi di pubblica utilità	2.52%	5.24%
Altri	2.88%	2.28%
Liquidità	3.58%	-
Copertura del rischio di cambio	1.60%	-

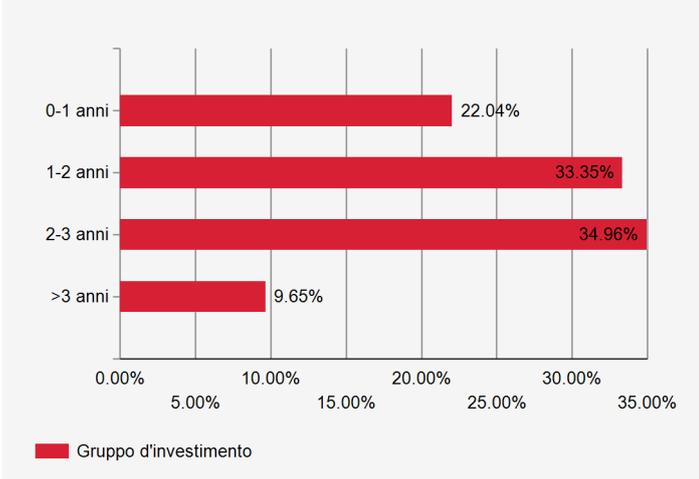
Principali debitori e rating

		Gruppo d'investimento
Banco Santander SA, Madrid	A-	3.06%
Credit Agricole Group	BBB+	2.65%
Citigroup Inc	BBB+	2.33%
Barclays Capital PLC, London	BBB	2.14%
Morgan Stanley NE US	A	2.03%

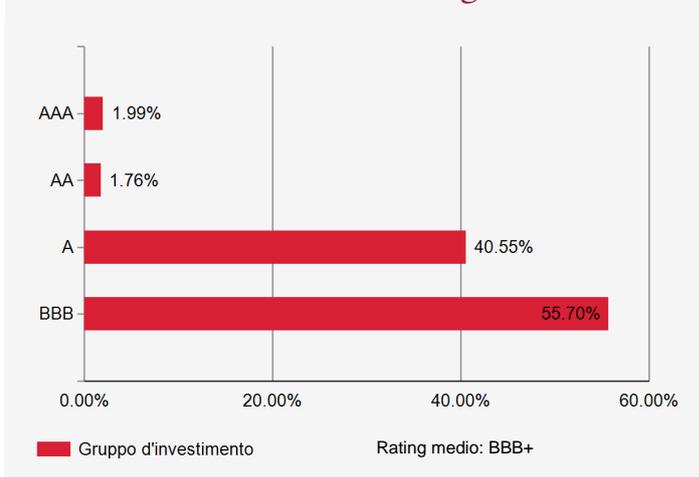
Ulteriori informazioni sui debitori

Numero di debitori	149
Quota di debitori senza benchmark	6.63%

Struttura della scadenza dei titoli



Investimenti secondo il rating



Durata e rendimento alla scadenza

	Gruppo d'investimento	Benchmark
Modified Duration	1.9	1.8
Rendimento alla scadenza teorica*	3.76%	3.89%

* 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	58.79%	1.89	60.04%	1.88
EUR	25.44%	1.97	29.79%	1.96
CHF	11.25%	1.31	0.47%	1.91
GBP	3.47%	1.47	3.86%	1.89
Altri	1.05%	2.00	5.84%	1.97

Struttura del portafoglio secondo il paese/regione

	Gruppo d'investimento	Benchmark
Stati Uniti	34.19%	45.94%
Francia	8.95%	7.59%
Regno Unito	7.84%	6.85%
Canada	7.56%	5.77%
Germania	6.45%	6.20%
Svizzera	6.14%	2.05%
Spagna	5.60%	3.33%
Regione Europea (EUR)	6.14%	6.62%
Mercati Emergenti Asia Pacifico	4.69%	2.36%
Regione Asia e Pacifico	3.55%	4.63%
Altri	3.70%	8.67%
Liquidità, copertura	5.19%	-

30 settembre 2024

Fondazione d'investimento Swiss Life

Obbligazioni Global Imprese PM (CHF hedged)

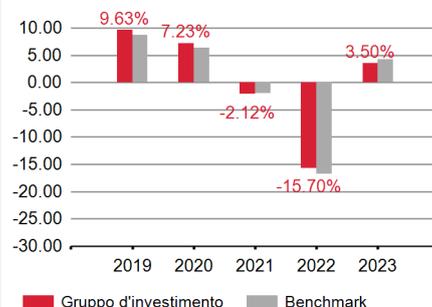


Patrimonio netto (NAV) in mio. CHF: 811.36
Valore d'inventario netto per diritto in CHF: 129.03

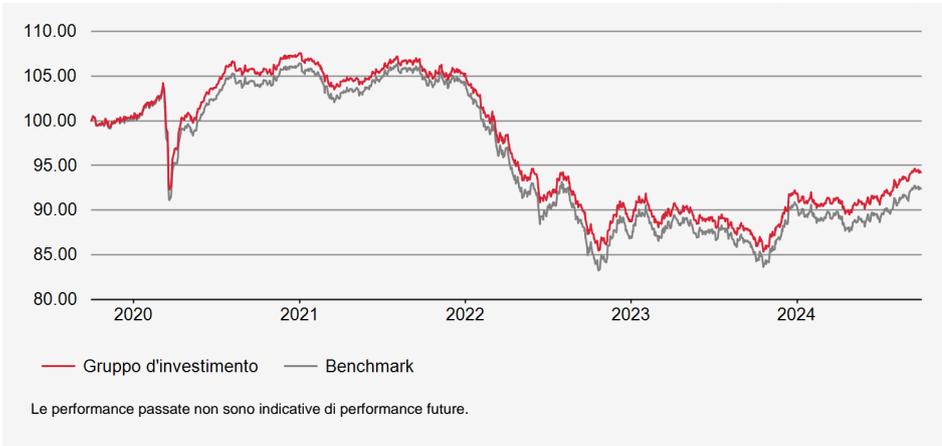
Strategia d'investimento

Investimenti in titoli di credito di imprese, incl. agenzie ed enti sovranazionali. Selezione attiva di titoli, gestione della duration e posizionamento della curva dei tassi d'interesse. Titoli di credito di 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".

Performance



Evoluzione del valore nella valuta di riferimento (base 100)



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: 13.00
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

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	2.58%	1.02%	3.56%	8.41%	-3.71%	-1.18%	0.55%	1.86%
Benchmark	2.01%	1.22%	3.81%	8.31%	-4.05%	-1.56%	0.30%	1.44%

Dati statistici (annualizzati)

	1 anno	3 anni	5 anni	10 anni	Inizio
Volatilità Gruppo d'investimento (in %)	5.72	6.99	6.81	5.40	5.18
Volatilità del Benchmark (in %)	6.50	7.83	7.56	5.83	5.37
Tracking Error ex post (in %)	0.84	1.00	0.95	0.86	0.96
Information Ratio	0.11	0.34	0.41	0.29	0.43
Sharpe Ratio	1.15	-0.64	-0.20	0.16	0.40
Correlazione	1.00	1.00	1.00	0.99	0.98
Beta	0.88	0.89	0.90	0.92	0.95
Jensen alfa	0.92	-0.19	0.21	0.30	0.50
Maximum Drawdown (in %)	-2.93	-19.66	-20.63	-20.63	-20.63
Recovery Period (anni)	0.22	-	-	-	-

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: 30/09/2024 0.15%

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 Global Imprese PM (CHF hedged)

Struttura del portafoglio per settore

	Gruppo d'investimento	Benchmark
Finanza	46.83%	38.35%
Consumo non ciclico	13.75%	16.36%
Energia	7.44%	6.00%
Servizi di pubblica utilità	6.41%	8.99%
Beni Industriali	5.32%	7.20%
Consumo ciclico	5.09%	7.61%
Comunicazione	5.08%	7.90%
Tecnologia	4.98%	4.64%
Altri	2.00%	2.95%
Liquidità	2.54%	-
Copertura del rischio di cambio	0.57%	-

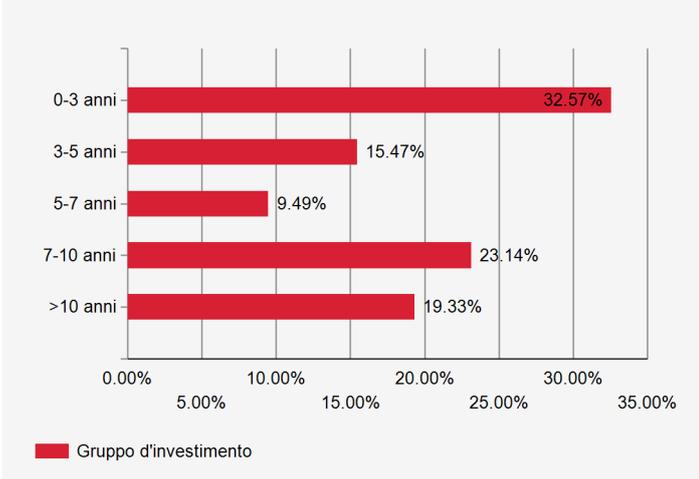
Principali debitori e rating

		Gruppo d'investimento
Porsche Automobil Holding SE	BBB	2.26%
Banco Santander SA, Madrid	BBB+	2.26%
Groupe BPCE	BBB+	1.74%
Credit Agricole Group	BBB+	1.73%
Société Générale, Paris	BBB	1.66%

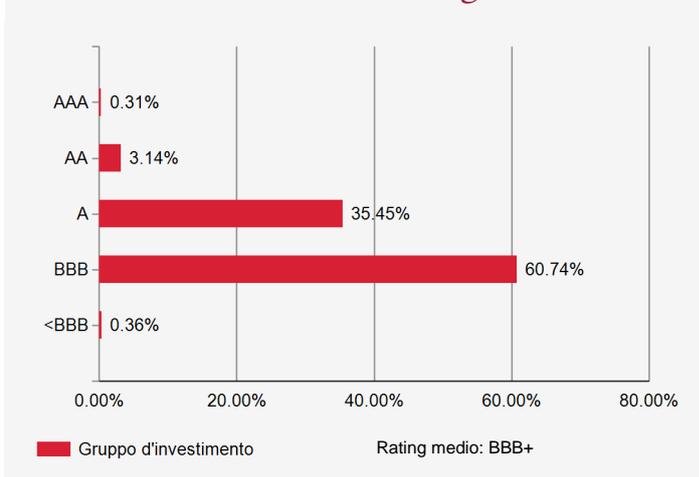
Ulteriori informazioni sui debitori

Numero di debitori	231
Quota di debitori senza benchmark	3.11%

Struttura della scadenza dei titoli



Investimenti secondo il rating



Durata e rendimento alla scadenza

	Gruppo d'investimento	Benchmark
Modified Duration	6.1	6.1
Rendimento alla scadenza teorica*	4.71%	4.65%

* 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	56.90%	7.88	67.08%	6.74
EUR	28.77%	3.60	23.88%	4.44
CHF	5.81%	2.18	0.37%	4.39
JPY	2.48%	2.04	0.70%	4.16
Altri	6.03%	4.29	7.97%	5.64

Struttura del portafoglio secondo il paese/regione

	Gruppo d'investimento	Benchmark
Stati Uniti	37.40%	56.23%
Regno Unito	10.24%	6.85%
Francia	9.17%	6.19%
Germania	5.33%	5.04%
Spagna	4.30%	2.20%
Giappone	4.15%	3.37%
Svizzera	3.99%	1.45%
Regione Europea (EUR)	9.45%	5.87%
Regione Asia e Pacifico	3.23%	2.21%
Regione Europea (Ex EUR)	3.20%	1.61%
Altri	6.43%	8.98%
Liquidità, copertura	3.11%	-

Fondazione d'investimento Swiss Life

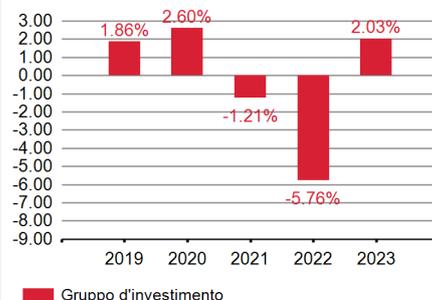
Obbligazioni Emerging Markets Short Term PM (CHF hedged)

Patrimonio netto (NAV) in mio. CHF: 128.57
Valore d'inventario netto per diritto in CHF: 98.62

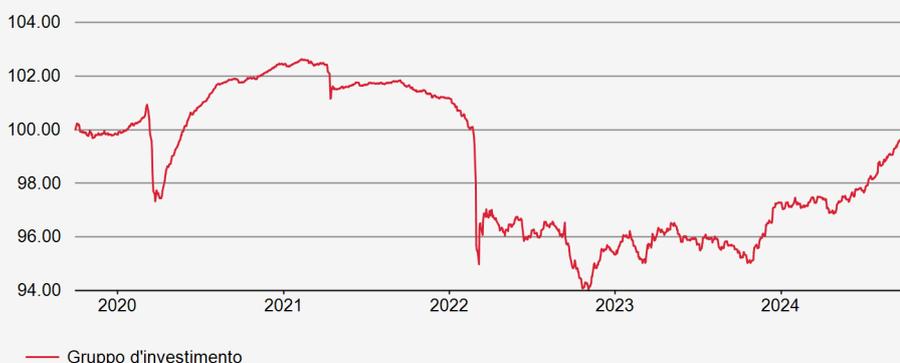
Strategia d'investimento

Investimenti in titoli di credito in dollari statunitensi o altre valute forti di imprese e stati 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)



Le performance passate non sono indicative di performance future.

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: 13.00
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: 0.30%
ex post al: 30/09/2024 0.30%

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	2.49%	0.65%	2.03%	4.44%	-0.63%	-0.06%	-	-0.20%

Dati statistici (annualizzati)

	1 anno	3 anni	5 anni	10 anni	Inizio
Volatilità Gruppo d'investimento (in %)	1.93	2.66	2.65	-	2.30
Sharpe Ratio	1.48	-0.50	-0.08	-	-0.03
Maximum Drawdown (in %)	-0.65	-7.52	-8.39	-	-8.39
Recovery Period (anni)	0.05	-	-	-	-

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
Finanza	33.86%
Stati e simili	18.51%
Energia	8.84%
Comunicazione	8.25%
Consumo non ciclico	6.38%
Consumo ciclico	6.29%
Materiali di base	5.79%
Servizi di pubblica utilità	4.23%
Altri	6.03%
Liquidità	1.75%
Copertura del rischio di cambio	0.08%

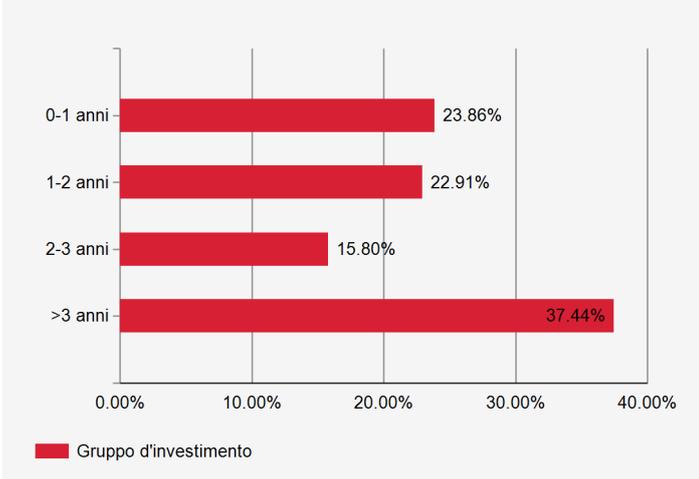
Principali debitori e rating

		Gruppo d'investimento
HDFC Bank Ltd	BBB-	3.07%
First Abu Dhabi Bank PJSC	AA-	3.05%
United Mexican States	BBB	3.05%
OTP Bank Nyrt	BBB-	2.73%
Reliance Industries Ltd	BBB	2.39%

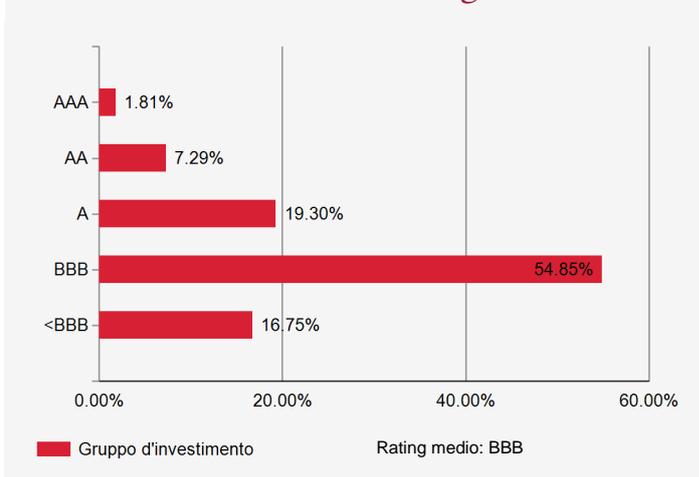
Ulteriori informazioni sui debitori

Numero di debitori	94
--------------------	----

Struttura della scadenza dei titoli



Investimenti secondo il rating



Durata e rendimento alla scadenza

	Gruppo d'investimento
Modified Duration	2.1
Rendimento alla scadenza teorica*	4.97%

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

Struttura del portafoglio per valute e la duration

	Gruppo d'investimento	
	Peso	Duration
CHF	99.70%	0.07
USD	0.30%	673.87
EUR	0.01%	1040.17

Struttura del portafoglio secondo il paese/regione

	Gruppo d'investimento
Cina	10.93%
India	9.69%
Emirati Arabi Uniti	7.75%
Messico	6.17%
Indonesia	6.12%
Ungheria	4.65%
Qatar	3.60%
Mercati Emergenti Asia Pacifico	15.60%
Mercati Emergenti in America	13.57%
Mercati Emergenti in Europa	4.12%
Altri	15.99%
Liquidità, copertura	1.82%



Fondazione d'investimento Swiss Life

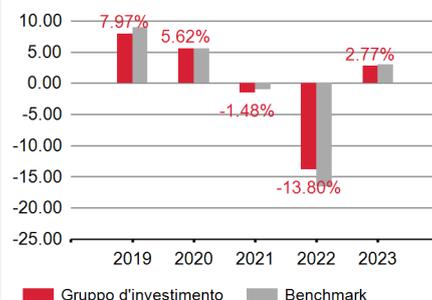
Obbligazioni Emerging Markets Imprese PM (CHF hedged) SwissLife

Patrimonio netto (NAV) in mio. CHF: 352.54
Valore d'inventario netto per diritto in CHF: 98.23

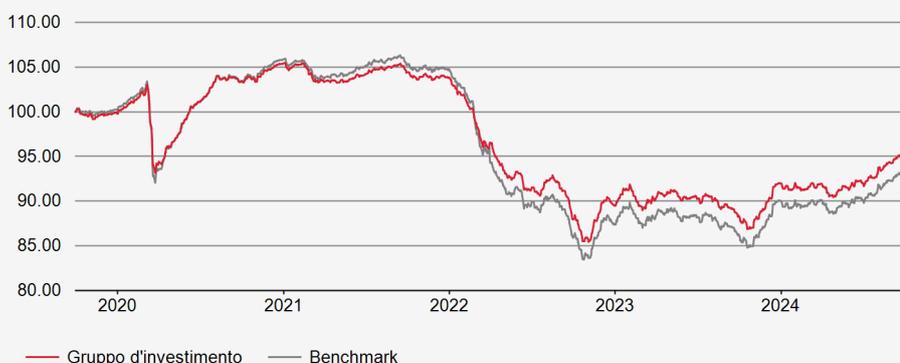
Strategia d'investimento

Investimenti in titoli di credito in dollari statunitensi o altre valute forti di imprese e Stati, inclusi organismi sovranazionali e agenzie, di Paesi di recente industrializzazione (Emerging Markets). Selezione attiva dei titoli, gestione della duration e posizionamento lungo la curva dei tassi. Limitazione per debitore: 10%. Titoli di credito di debitori esterni al benchmark: max. 35%. Qualità media di rating: almeno BBB-. I rischi di valuta vengono coperti almeno al 90% rispetto al franco svizzero. Attuazione con l'impiego di Swiss Life Funds (LUX) Bond Emerging Markets Corporates CHF-hedged AM Cap; fondo d'investimento di diritto lussemburghese.

Performance



Evoluzione del valore nella valuta di riferimento (base 100)



Le performance passate non sono indicative di performance future.

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: 13.00
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: 0.28%
ex post al: 30/09/2024 0.28%

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	3.37%	0.88%	3.36%	7.59%	-3.06%	-1.00%	-	-0.25%
Benchmark	3.38%	0.89%	3.30%	7.89%	-4.00%	-1.42%	-	-0.43%

Dati statistici (annualizzati)

	1 anno	3 anni	5 anni	10 anni	Inizio
Volatilità Gruppo d'investimento (in %)	4.85	6.12	6.39	-	5.59
Volatilità del Benchmark (in %)	4.98	6.62	7.06	-	6.14
Tracking Error ex post (in %)	0.42	1.28	1.22	-	1.07
Information Ratio	-0.70	0.73	0.34	-	0.16
Sharpe Ratio	1.20	-0.62	-0.18	-	-0.02
Correlazione	1.00	0.98	0.99	-	0.99
Beta	0.97	0.91	0.89	-	0.90
Jensen alfa	-0.12	0.50	0.25	-	0.14
Maximum Drawdown (in %)	-1.70	-18.17	-18.98	-	-18.98
Recovery Period (anni)	0.11	-	-	-	-

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 Imprese PM (CHF hedged)

Struttura del portafoglio per settore

	Gruppo d'investimento	Benchmark
Finanza	31.93%	36.41%
Comunicazione	12.02%	9.03%
Servizi di pubblica utilità	10.70%	10.48%
Energia	9.55%	11.44%
Consumo non ciclico	8.86%	4.84%
Beni Industriali	6.65%	4.08%
Tecnologia	5.47%	5.27%
Materiali di base	4.50%	11.22%
Supernazionale	1.66%	-
Altri	8.01%	7.24%
Liquidità	0.57%	-
Copertura del rischio di cambio	0.07%	-

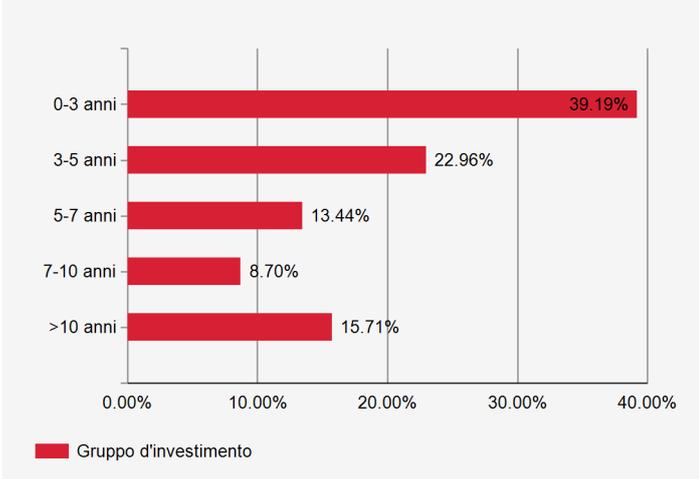
Principali debitori e rating

		Gruppo d'investimento
Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd	AA-	3.53%
US Treasury N/B	AAA	3.31%
Prosus NV	BBB	2.32%
OTP Bank Nyrt	BBB-	1.81%
HDFC Bank Ltd	BBB-	1.77%

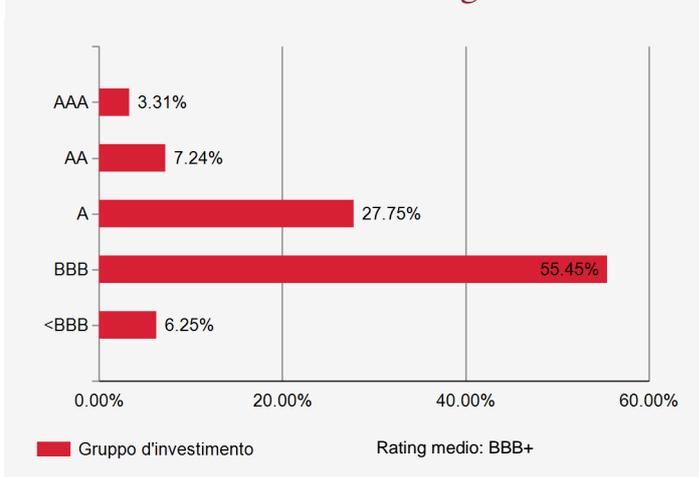
Ulteriori informazioni sui debitori

Numero di debitori	149
Quota di debitori senza benchmark	23.05%

Struttura della scadenza dei titoli



Investimenti secondo il rating



Durata e rendimento alla scadenza

	Gruppo d'investimento	Benchmark
Modified Duration	5.2	4.8
Rendimento alla scadenza teorica*	5.78%	5.19%

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

Struttura del portafoglio secondo il paese/regione

	Gruppo d'investimento	Benchmark
Cina	9.52%	13.52%
Corea del Sud	6.91%	7.63%
Emirati Arabi Uniti	6.66%	5.72%
India	5.92%	4.03%
Messico	5.03%	4.85%
Qatar	4.64%	5.56%
Singapore	4.59%	3.93%
Mercati Emergenti Asia Pacifico	18.84%	19.75%
Mercati Emergenti in America	12.30%	8.20%
Mercati Emergenti Medio Oriente	5.80%	10.07%
Altri	19.14%	16.75%
Liquidità, copertura	0.64%	-

Fondazione d'investimento Swiss Life

Azioni Svizzera PM

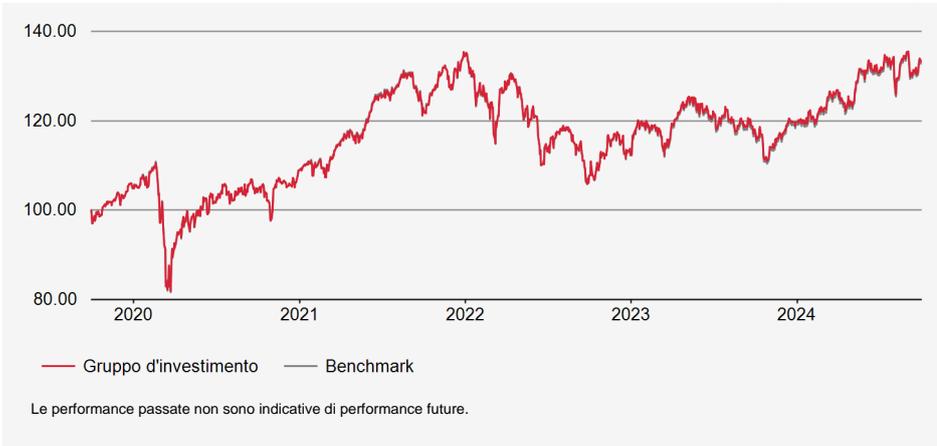


Patrimonio netto (NAV) in mio. CHF: 518.72
Valore d'inventario netto per diritto in CHF: 203.58

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 Index Funds (CH) Equity Switzerland Large Cap e SL iFunds 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)



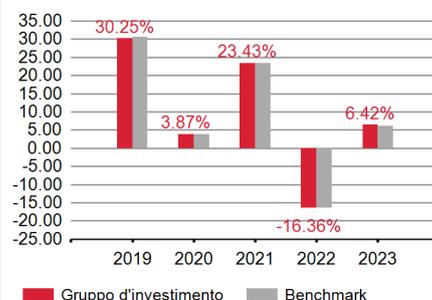
Performance nella valuta di riferimento

	Performance cumulata				Performance annualizzata			
	YTD	1 mese	3 mesi	1 anno	3 anni	5 anni	10 anni	Inizio
Gruppo d'investimento	11.37%	-1.57%	1.96%	12.91%	2.82%	5.91%	6.41%	4.18%
Benchmark	11.47%	-1.59%	2.03%	13.04%	2.58%	5.83%	6.44%	4.41%

Dati statistici (annualizzati)

	1 anno	3 anni	5 anni	10 anni	Inizio
Volatilità Gruppo d'investimento (in %)	10.95	12.46	12.74	12.14	12.81
Volatilità del Benchmark (in %)	11.02	12.50	12.80	12.18	12.81
Tracking Error ex post (in %)	0.27	0.35	0.34	0.31	0.67
Information Ratio	-0.49	0.67	0.25	-0.10	-0.34
Sharpe Ratio	0.97	0.17	0.44	0.54	0.32
Correlazione	1.00	1.00	1.00	1.00	1.00
Beta	0.99	1.00	0.99	1.00	1.00
Jensen alfa	-0.05	0.24	0.11	0.00	-0.22
Maximum Drawdown (in %)	-6.50	-21.74	-25.86	-25.86	-54.13
Recovery Period (anni)	0.06	1.93	0.83	0.83	4.84

Performance



Informazioni sul prodotto

Numero di valore: 3026057
ISIN: CH0030260571
LEI: 254900UNZU5YPIKQTQ23
Codice Bloomberg: SLACHPM SW
Benchmark: SPI® Total Return
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: 13.00
Commissione d'emissione / riscatto: nessuna
Prassi di distribuzione: Capitalizzazione
Asset Manager in base al Swiss Life Best Select Invest Plus® Large Caps (passivo)
 Swiss Life Asset Management AG
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: 0.26%
ex post al: 30/09/2024 0.28%

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	33.76%	34.11%
Finanza	17.90%	19.68%
Beni di prima necessità	16.48%	16.48%
Industrie	14.17%	13.48%
Materiali	8.22%	8.42%
Beni voluttuari	4.92%	5.14%
Tecnologia dell'informazione	1.67%	1.49%
Servizi di comunicazione	0.87%	0.97%
Servizi di pubblica utilità	0.39%	0.22%
Energia	-	-
Liquidità	1.63%	-

Le principali posizioni

	Gruppo d'investimento	Benchmark
NESTLE SA-REG	13.78%	13.86%
NOVARTIS AG-REG	12.30%	12.37%
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	11.77%	11.84%
UBS GROUP AG-REG	5.21%	5.24%
ABB LTD-REG	4.84%	4.87%
ZURICH INSURANCE GROUP AG	4.62%	4.65%
CIE FINANCIERE RICHEMO-A REG	4.45%	4.48%
SIKA AG-REG	2.78%	2.80%
HOLCIM LTD	2.77%	2.79%
ALCON INC	2.61%	2.62%

Struttura del portafoglio in base al volume dell'impresa

	Gruppo d'investimento		Benchmark	
	Partecip.	Numero	Partecip.	Numero
Grandi imprese	80.14%	20	80.20%	20
Medie imprese	17.50%	47	18.15%	80
Piccole imprese	0.74%	4	1.65%	106
Liquidità	1.63%	-	-	-

Fondazione d'investimento Swiss Life

Azioni Svizzera Large Caps Indicizzate PM

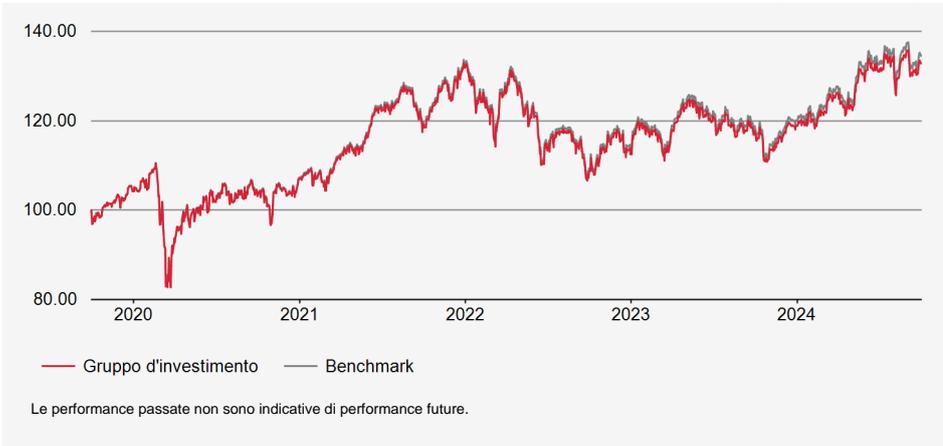


Patrimonio netto (NAV) in mio. CHF: 517.66
Valore d'inventario netto per diritto in CHF: 156.32

Strategia d'investimento

Il gruppo d'investimento viene gestito con un approccio indicizzato e si contraddistingue per l'ampia diversificazione e il tracking error minimo. L'obiettivo d'investimento consiste nel replicare il benchmark SPI® 20 Total Return. Realizzazione tramite Swiss Life Index Funds (CH) Equity Switzerland Large Cap; Fondi d'investimento di diritto svizzero della categoria "altri fondi per investimenti tradizionali".

Evoluzione del valore nella valuta di riferimento (base 100)



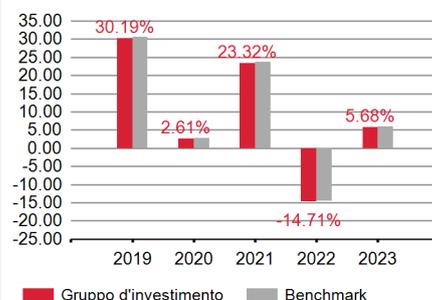
Performance nella valuta di riferimento

	Performance cumulata				Performance annualizzata			
	YTD	1 mese	3 mesi	1 anno	3 anni	5 anni	10 anni	Inizio
Gruppo d'investimento	11.71%	-2.10%	1.37%	12.83%	3.67%	5.83%	-	6.93%
Benchmark	12.02%	-2.12%	1.42%	13.22%	3.95%	6.10%	-	7.20%

Dati statistici (annualizzati)

	1 anno	3 anni	5 anni	10 anni	Inizio
Volatilità Gruppo d'investimento (in %)	11.37	12.33	12.48	-	12.35
Volatilità del Benchmark (in %)	11.47	12.39	12.54	-	12.40
Tracking Error ex post (in %)	0.12	0.08	0.08	-	0.08
Information Ratio	-3.09	-3.28	-3.39	-	-3.46
Sharpe Ratio	0.93	0.24	0.44	-	0.55
Correlazione	1.00	1.00	1.00	-	1.00
Beta	0.99	1.00	1.00	-	1.00
Jensen alfa	-0.28	-0.26	-0.24	-	-0.24
Maximum Drawdown (in %)	-6.91	-19.80	-25.03	-	-25.03
Recovery Period (anni)	0.06	1.69	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: 13.00

Commissione d'emissione / riscatto: nessuna

Prassi di distribuzione: Capitalizzazione

Asset Manager in base al

Swiss Life Best Select Invest Plus®:
Swiss Life 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: 0.15%

ex post al: 30/09/2024 0.14%

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	37.73%	37.74%
Finanza	18.86%	18.87%
Beni di prima necessità	17.34%	17.34%
Materiali	9.86%	9.86%
Industrie	8.52%	8.52%
Beni voluttuari	5.60%	5.60%
Servizi di comunicazione	1.09%	1.09%
Tecnologia dell'informazione	0.97%	0.97%
Liquidità / Prestito	0.04%	-

Le principali posizioni

	Gruppo d'investimento	Benchmark
NESTLE SA-REG	17.34%	17.34%
NOVARTIS AG-REG	15.47%	15.48%
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	14.81%	14.81%
UBS GROUP AG-REG	6.56%	6.56%
ABB LTD-REG	6.09%	6.09%
ZURICH INSURANCE GROUP AG	5.81%	5.81%
CIE FINANCIERE RICHEMO-A REG	5.60%	5.60%
SIKA AG-REG	3.50%	3.50%
HOLCIM LTD	3.48%	3.49%
ALCON INC	3.28%	3.28%

Nota legale: La presente pubblicazione non rappresenta né un invito, né una raccomandazione ad acquistare o vendere strumenti d'investimento, ma funge meramente da veicolo informativo. È possibile richiedere gratuitamente tutti i documenti che costituiscono la base giuridica di un eventuale investimento presso la Fondazione d'investimento Swiss Life, c/o Swiss Life SA, casella postale 8022 Zurigo, telefono 043 547 71 11 e su www.swisslife.ch/aniagestiftung. La cerchia degli investitori è limitata alle istituzioni del secondo pilastro e del pilastro 3a, nonché istituzioni esonerate dall'obbligo tributario, con sede in Svizzera e che secondo l'oggetto sociale perseguono la previdenza professionale e persone che gestiscono investimenti collettivi per queste istituzioni, sono sorvegliate dall'Autorità federale di vigilanza sui mercati finanziari FINMA e che investono presso la fondazione esclusivamente capitali per queste istituzioni. Inoltre, gli investitori citati devono aver concluso un accordo speciale con Swiss Life Asset Management SA. La performance precedente non rappresenta un indicatore né per l'evoluzione attuale, né per quella futura. L'utilizzo non implica alcuna affiliazione con o sponsorizzazione da parte di quest'ultimi. **Fonte:** Swiss Life Asset Managers. Tutti i diritti riservati.

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

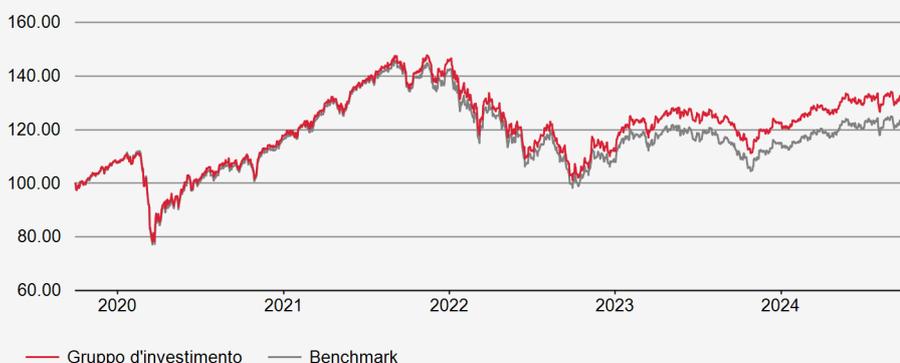


Patrimonio netto (NAV) in mio. CHF: 137.24
Valore d'inventario netto per diritto in CHF: 133.40

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)



Le performance passate non sono indicative di performance future.

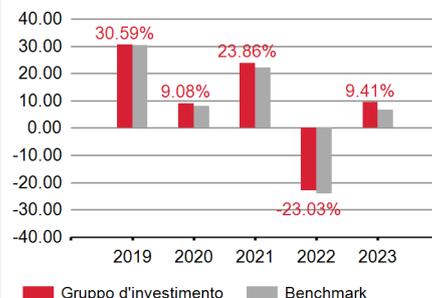
Performance nella valuta di riferimento

	Performance cumulata				Performance annualizzata			
	YTD	1 mese	3 mesi	1 anno	3 anni	5 anni	10 anni	Inizio
Gruppo d'investimento	10.16%	0.72%	4.46%	13.40%	-0.60%	6.19%	-	4.42%
Benchmark	9.26%	0.58%	4.53%	12.27%	-2.75%	4.67%	-	3.20%

Dati statistici (annualizzati)

	1 anno	3 anni	5 anni	10 anni	Inizio
Volatilità Gruppo d'investimento (in %)	10.42	14.78	15.60	-	15.37
Volatilità del Benchmark (in %)	10.33	14.64	15.71	-	15.35
Tracking Error ex post (in %)	1.28	1.70	1.63	-	1.57
Information Ratio	0.88	1.27	0.93	-	0.78
Sharpe Ratio	1.06	-0.09	0.38	-	0.29
Correlazione	0.99	0.99	0.99	-	0.99
Beta	1.00	1.00	0.99	-	1.00
Jensen alfa	1.12	2.17	1.57	-	1.23
Maximum Drawdown (in %)	-6.61	-31.46	-31.46	-	-31.46
Recovery Period (anni)	0.05	-	-	-	-

Performance



Informazioni sul prodotto

Numero di valore: 39561897
ISIN: CH0395618975
LEI: 254900QGENUS1GIJ4549
Codice Bloomberg: SWLSMPM SW
Benchmark: SPI EXTRA® 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: 13.00
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: 30/09/2024 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	37.46%	33.25%
Salute	19.12%	19.67%
Finanza	14.73%	22.90%
Beni di prima necessità	13.71%	13.07%
Tecnologia dell'informazione	4.56%	3.58%
Beni voluttuari	2.38%	3.27%
Materiali	1.99%	2.68%
Servizi di pubblica utilità	1.97%	1.09%
Servizi di comunicazione	-	0.50%
Energia	-	-
Liquidità	4.08%	-

Le principali posizioni

	Gruppo d'investimento	Benchmark
LINDT & SPRÜNGLI	6.77%	7.12%
STRAUMANN HOLDING AG	5.43%	5.07%
SGS SA	5.42%	4.49%
SANDOZ GROUP AG	4.91%	4.72%
SCHINDLER HOLDING AG	4.27%	4.66%
VAT GROUP AG	4.17%	3.60%
JULIUS BAER GROUP LTD	3.94%	3.25%
BALOISE HOLDING AG	2.87%	2.33%
BELIMO HOLDING AG	2.76%	1.85%
SIEGFRIED HOLDING AG	2.41%	1.51%

Struttura del portafoglio in base al volume dell'impresa

	Gruppo d'investimento		Benchmark	
	Partecip.	Numero	Partecip.	Numero
Grandi imprese	12.18%	3	9.78%	2
Medie imprese	80.04%	45	82.01%	78
Piccole imprese	3.69%	4	8.21%	106
Liquidità	4.08%	-	-	-

Fondazione d'investimento Swiss Life

Azioni Svizzera Protect Flex PM



Patrimonio netto (NAV) in mio. CHF: 175.59
Valore d'inventario netto per diritto in CHF: 118.19

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)



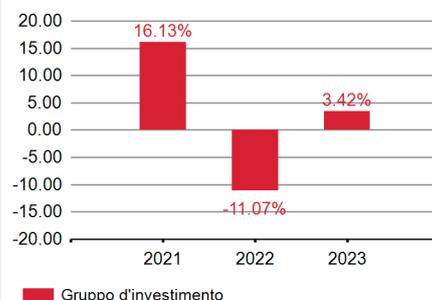
Performance nella valuta di riferimento

	Performance cumulata				Performance annualizzata			
	YTD	1 mese	3 mesi	1 anno	3 anni	5 anni	10 anni	Inizio
Gruppo d'investimento	9.39%	-1.75%	0.92%	10.53%	2.69%	-	-	4.51%

Dati statistici (annualizzati)

	1 anno	3 anni	5 anni	10 anni	Inizio
Volatilità Gruppo d'investimento (in %)	8.56	8.91	-	-	8.97
Sharpe Ratio	1.00	0.22	-	-	0.44
Maximum Drawdown (in %)	-4.81	-15.16	-	-	-15.16
Recovery Period (anni)	0.06	1.69	-	-	1.69

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: 13.00
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: 0.15%
ex post al: 30/09/2024 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 Svizzera Protect Flex PM



Struttura del portafoglio per settore

	Gruppo d'investimento
Salute	35.66%
Finanza	17.78%
Beni di prima necessità	14.38%
Materiali	9.28%
Industrie	8.10%
Beni voluttuari	5.27%
Servizi di comunicazione	1.03%
Tecnologia dell'informazione	0.91%
Future su indice azionario	0.07%
Liquidità / Prestito	7.51%

Posizioni principali

	Gruppo d'investimento
NOVARTIS AG-REG	14.61%
NESTLE SA-REG	14.38%
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	13.94%
UBS GROUP AG-REG	6.18%
ABB LTD-REG	5.81%
ZURICH INSURANCE GROUP AG	5.47%
CIE FINANCIERE RICHEMO-A REG	5.27%
SIKA AG-REG	3.29%
HOLCIM LTD	3.28%
ALCON INC	3.09%

Fondazione d'investimento Swiss Life

Azioni Estero ESG PM

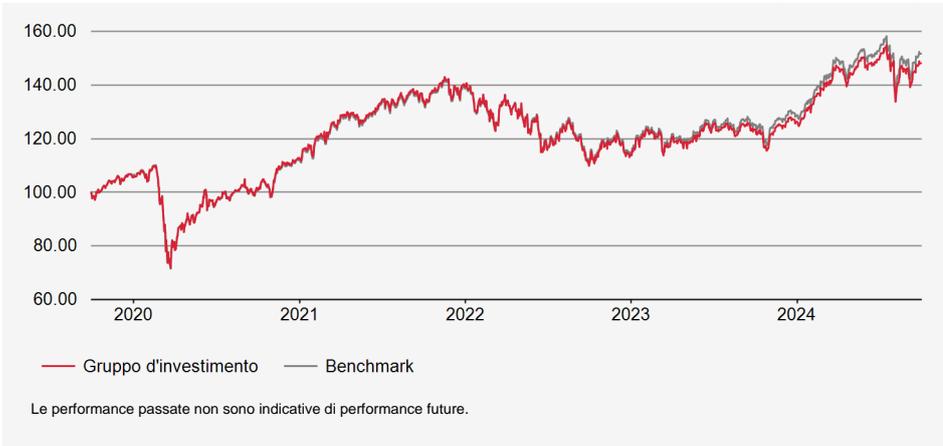


Patrimonio netto (NAV) in mio. CHF: 473.76
Valore d'inventario netto per diritto in CHF: 193.07

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, Amundi Emerging Markets Equity Focus Fund e fondo Robeco Emerging Markets Equities.

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	17.35%	1.33%	-0.90%	20.04%	3.37%	8.17%	7.73%	3.87%
Benchmark	17.89%	1.61%	-0.62%	21.15%	4.35%	8.68%	8.26%	4.41%

Dati statistici (annualizzati)

	1 anno	3 anni	5 anni	10 anni	Inizio
Volatilità Gruppo d'investimento (in %)	11.33	14.16	16.33	14.81	15.77
Volatilità del Benchmark (in %)	11.17	14.17	16.30	14.77	15.78
Tracking Error ex post (in %)	0.48	0.41	0.46	0.61	0.91
Information Ratio	-2.33	-2.39	-1.10	-0.87	-0.59
Sharpe Ratio	1.48	0.19	0.47	0.52	0.24
Correlazione	1.00	1.00	1.00	1.00	1.00
Beta	1.01	1.00	1.00	1.00	1.00
Jensen alfa	-1.38	-0.97	-0.52	-0.54	-0.53
Maximum Drawdown (in %)	-13.59	-23.15	-34.64	-34.64	-59.96
Recovery Period (anni)	-	1.47	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: 13.00
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)
 50% Amundi / 50% Robeco
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: 0.38%
ex post al: 30/09/2024 0.38%

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	23.59%	25.11%
Finanza	15.70%	15.28%
Industrie	13.28%	11.86%
Beni voluttuari	11.46%	11.25%
Salute	10.45%	10.64%
Servizi di comunicazione	6.79%	7.38%
Beni di prima necessità	5.68%	5.99%
Materiali	4.53%	4.50%
Immobili	3.44%	3.22%
Energia	2.82%	2.80%
Servizi di pubblica utilità	1.82%	1.97%
Liquidità	0.40%	-

Le principali posizioni

	Gruppo d'investimento	Benchmark
MICROSOFT CORP	5.88%	6.78%
NVIDIA CORP	5.78%	6.67%
ALPHABET INC	3.52%	4.06%
TESLA INC	1.45%	1.68%
ELI LILLY & CO	1.38%	1.60%
VISA INC	0.84%	0.97%
MASTERCARD INC	0.80%	0.91%
PROCTER & GAMBLE CO/THE	0.79%	0.91%
HOME DEPOT INC/THE	0.78%	0.90%
JOHNSON & JOHNSON	0.75%	0.87%

Struttura del portafoglio secondo il paese/regione

	Gruppo d'investimento	Benchmark
USA	66.65%	67.84%
Giappone	6.30%	6.73%
Gran Bretagna	4.19%	3.67%
Canada	2.79%	3.11%
Francia	2.55%	2.55%
Germania	1.16%	1.00%
Resto dell'Europa	6.95%	6.23%
Altri paesi Asia	6.16%	6.29%
Altri	2.84%	2.56%
Liquidità	0.40%	-

Struttura del portafoglio secondo le valute

	Gruppo d'investimento	Benchmark
USD	67.87%	68.03%
EUR	7.41%	6.90%
JPY	6.32%	6.73%
GBP	4.29%	3.68%
CHF	0.47%	0.21%
Altri	13.63%	14.43%

Ulteriori informazioni sulle società

Numero di società	7,778
Quota di società senza benchmark	6.07%

30 settembre 2024

Fondazione d'investimento Swiss Life

Azioni Estero ESG Indicizzate PM

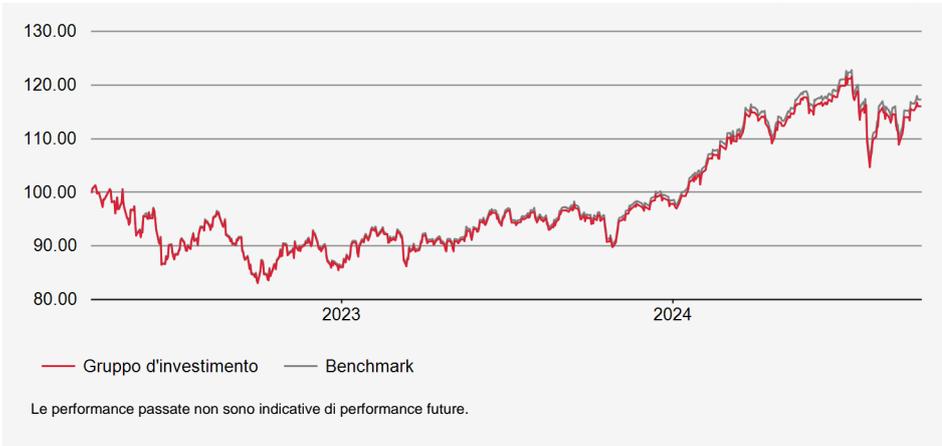


Patrimonio netto (NAV) in mio. CHF: 610.15
Valore d'inventario netto per diritto in CHF: 116.03

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)



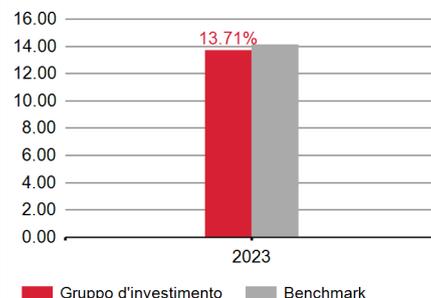
Performance nella valuta di riferimento

	Performance cumulata				Performance annualizzata			
	YTD	1 mese	3 mesi	1 anno	3 anni	5 anni	10 anni	Inizio
Gruppo d'investimento	18.58%	1.30%	-1.46%	21.89%	-	-	-	6.12%
Benchmark	19.08%	1.34%	-1.32%	22.55%	-	-	-	6.58%

Dati statistici (annualizzati)

	1 anno	3 anni	5 anni	10 anni	Inizio
Volatilità Gruppo d'investimento (in %)	11.39	-	-	-	14.83
Volatilità del Benchmark (in %)	11.42	-	-	-	14.85
Tracking Error ex post (in %)	0.07	-	-	-	0.14
Information Ratio	-9.10	-	-	-	-3.24
Sharpe Ratio	1.61	-	-	-	0.32
Correlazione	1.00	-	-	-	1.00
Beta	1.00	-	-	-	1.00
Jensen alfa	-0.59	-	-	-	-0.46
Maximum Drawdown (in %)	-13.90	-	-	-	-17.96
Recovery Period (anni)	-	-	-	-	1.30

Performance



Informazioni sul prodotto

Numero di valore: 117189938
ISIN: CH1171899383
LEI: 254900Q154AKVWL8UQ41
Codice Bloomberg: SWAEIPC SW
Benchmark: MSCI World ex Switzerland ESG Leaders Net Return
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: 13.00
Commissione d'emissione / riscatto: nessuna
Prassi di distribuzione: Capitalizzazione
Asset Manager in base al Swiss Life Best Select Invest Plus@: UBS 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: 0.32%
ex post al: 30/09/2024 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	27.69%	27.88%
Finanza	14.82%	14.89%
Salute	11.22%	11.27%
Industrie	10.64%	10.70%
Beni voluttuari	10.61%	10.68%
Servizi di comunicazione	8.01%	8.05%
Beni di prima necessità	6.19%	6.24%
Materiali	3.73%	3.73%
Energia	2.45%	2.46%
Immobili	2.29%	2.32%
Servizi di pubblica utilità	1.74%	1.78%
Liquidità	0.60%	-

Le principali posizioni

	Gruppo d'investimento	Benchmark
MICROSOFT CORP	8.42%	8.48%
NVIDIA CORP	8.28%	8.34%
ALPHABET INC	5.04%	5.08%
TESLA INC	2.08%	2.10%
ELI LILLY & CO	1.98%	2.00%
VISA INC	1.20%	1.21%
MASTERCARD INC	1.14%	1.14%
PROCTER & GAMBLE CO/THE	1.13%	1.14%
HOME DEPOT INC/THE	1.11%	1.12%
JOHNSON & JOHNSON	1.08%	1.09%

Struttura del portafoglio secondo il paese/regione

	Gruppo d'investimento	Benchmark
USA	73.77%	74.18%
Giappone	6.24%	6.24%
Gran Bretagna	3.61%	3.66%
Canada	3.19%	3.22%
Francia	2.92%	2.98%
Germania	1.04%	1.02%
Resto dell'Europa	6.20%	6.25%
Altri paesi Asia	2.42%	2.44%
Altri	-	-
Liquidità	0.60%	-

Struttura del portafoglio secondo le valute

	Gruppo d'investimento	Benchmark
USD	74.20%	74.18%
EUR	7.42%	7.51%
JPY	6.26%	6.24%
GBP	3.74%	3.67%
Altri	8.38%	8.39%

30 settembre 2024

Fondazione d'investimento Swiss Life Azioni Global Small Caps PM

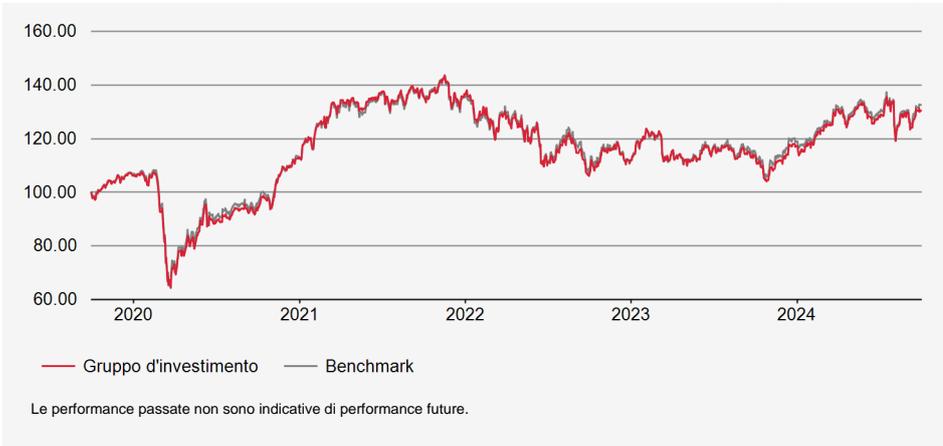


Patrimonio netto (NAV) in mio. CHF: 468.19
Valore d'inventario netto per diritto in CHF: 124.27

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)



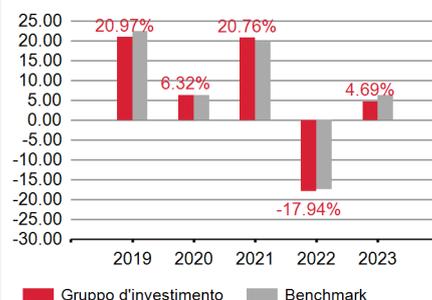
Performance nella valuta di riferimento

	Performance cumulata				Performance annualizzata			
	YTD	1 mese	3 mesi	1 anno	3 anni	5 anni	10 anni	Inizio
Gruppo d'investimento	11.30%	0.62%	1.85%	14.60%	-1.34%	5.46%	-	3.35%
Benchmark	11.54%	1.54%	2.13%	14.91%	-0.79%	5.80%	-	4.84%

Dati statistici (annualizzati)

	1 anno	3 anni	5 anni	10 anni	Inizio
Volatilità Gruppo d'investimento (in %)	14.43	15.99	20.19	-	19.30
Volatilità del Benchmark (in %)	13.85	15.96	19.77	-	18.98
Tracking Error ex post (in %)	1.78	1.80	1.90	-	2.35
Information Ratio	-0.18	-0.31	-0.18	-	-0.63
Sharpe Ratio	0.84	-0.13	0.26	-	0.18
Correlazione	0.99	0.99	1.00	-	0.99
Beta	1.03	1.00	1.02	-	1.01
Jensen alfa	-0.77	-0.56	-0.43	-	-1.53
Maximum Drawdown (in %)	-12.06	-27.52	-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: 13.00
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: 0.59%
ex post al: 30/09/2024 0.59%

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
Industrie	22.01%	19.72%
Finanza	16.42%	14.82%
Beni voluttuari	12.64%	13.48%
Tecnologia dell'informazione	12.11%	11.22%
Salute	10.03%	9.64%
Materiali	6.80%	7.91%
Immobili	6.29%	8.59%
Beni di prima necessità	4.46%	4.89%
Energia	3.87%	3.96%
Servizi di comunicazione	3.22%	3.13%
Servizi di pubblica utilità	1.78%	2.64%
Liquidità	0.37%	-

Le principali posizioni

	Gruppo d'investimento	Benchmark
TAYLOR MORRISON	0.66%	0.04%
CACTUS	0.63%	0.02%
PLANISWARE	0.59%	0.00%
WEATHERFORD INTERNAT	0.56%	0.03%
SPROUTS FARMERS MARKET	0.54%	0.06%
PIPER SANDLER	0.49%	0.03%
SIGMAROC	0.46%	-
TMX	0.44%	-
PINNACLE FINANCIAL PARTNERS	0.44%	0.04%
HELIOS TOWERS	0.41%	0.01%

Struttura del portafoglio secondo il paese/regione

	Gruppo d'investimento	Benchmark
USA	60.31%	56.65%
Giappone	7.69%	11.61%
Gran Bretagna	6.55%	4.95%
Canada	2.26%	3.57%
Francia	2.00%	1.10%
Germania	1.72%	1.24%
Resto dell'Europa	10.36%	8.20%
Altri paesi Asia	5.56%	8.66%
Altri	3.17%	4.03%
Liquidità	0.37%	-

Struttura del portafoglio secondo le valute

	Gruppo d'investimento	Benchmark
USD	62.28%	56.90%
EUR	8.52%	5.80%
JPY	7.73%	11.60%
GBP	6.62%	4.97%
CHF	1.86%	1.42%
Altri	12.99%	19.31%

Ulteriori informazioni sulle società

Numero di società	6,835
Quota di società senza benchmark	23.05%

30 settembre 2024

Fondazione d'investimento Swiss Life

Azioni Emerging Markets ESG PM



Patrimonio netto (NAV) in mio. CHF: 261.74
Valore d'inventario netto per diritto in CHF: 88.34

Strategia d'investimento

Investimenti in titoli di partecipazione di società domiciliate in Paesi emergenti. Selezione attiva di Paesi, settori e titoli. Realizzazione tramite Amundi Emerging Markets Equity Focus e Robeco Emerging Markets Equities Fund; SICAV di diritto lussemburghese secondo l'OICVM.

Evoluzione del valore nella valuta di riferimento (base 100)



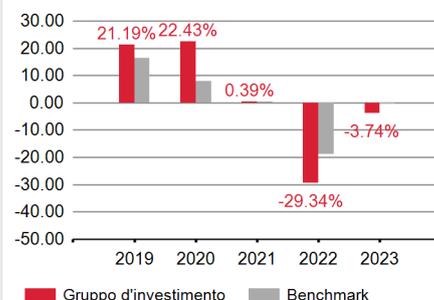
Performance nella valuta di riferimento

	Performance cumulata				Performance annualizzata			
	YTD	1 mese	3 mesi	1 anno	3 anni	5 anni	10 anni	Inizio
Gruppo d'investimento	14.43%	4.94%	-0.28%	13.47%	-9.81%	0.65%	-	-1.84%
Benchmark	17.13%	6.06%	2.06%	16.23%	-2.91%	2.27%	-	0.03%

Dati statistici (annualizzati)

	1 anno	3 anni	5 anni	10 anni	Inizio
Volatilità Gruppo d'investimento (in %)	12.18	13.88	16.60	-	16.60
Volatilità del Benchmark (in %)	12.95	14.52	16.38	-	16.01
Tracking Error ex post (in %)	2.50	4.73	5.16	-	5.16
Information Ratio	-1.10	-1.46	-0.31	-	-0.36
Sharpe Ratio	0.92	-0.79	0.03	-	-0.11
Correlazione	0.98	0.94	0.95	-	0.95
Beta	0.92	0.90	0.96	-	0.99
Jensen alfa	-1.63	-7.26	-1.54	-	-1.87
Maximum Drawdown (in %)	-13.84	-40.27	-44.96	-	-44.96
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: 13.00
Commissione d'emissione / riscatto: nessuna
Prassi di distribuzione: Capitalizzazione
Asset Manager in base al Swiss Life Best Select Invest Plus@: 50% Amundi / 50% Robeco

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: 0.46%
ex post al: 30/09/2024 0.46%

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	18.23%	22.92%
Tecnologia dell'informazione	18.00%	22.50%
Beni voluttuari	13.17%	13.79%
Servizi di comunicazione	5.90%	9.36%
Industrie	4.51%	6.76%
Immobili	4.13%	1.58%
Beni di prima necessità	3.66%	5.20%
Materiali	3.28%	6.63%
Servizi di pubblica utilità	2.54%	2.92%
Energia	2.17%	4.77%
Salute	1.36%	3.57%
Liquidità	22.99%	-

Struttura del portafoglio secondo il paese/regione

	Gruppo d'investimento	Benchmark
Cina	18.60%	27.24%
India	14.90%	19.63%
Taiwan	11.59%	17.79%
Corea	10.07%	10.53%
Brasile	4.51%	4.85%
Africa del sud	2.84%	3.03%
Altri paesi Asia	5.85%	5.26%
Altri paesi EMEA	6.45%	8.97%
Altr paesi America	2.22%	2.71%
Liquidità	22.99%	-

Ulteriori informazioni sulle società

Numero di società	265
Quota di società senza benchmark	3.39%

Le principali posizioni

	Gruppo d'investimento	Benchmark
TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFACTURING CO LT	7.29%	9.18%
SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	3.11%	2.96%
ALIBABA GROUP HOLDING LTD	2.44%	2.51%
TENCENT HOLDINGS LTD	2.08%	2.22%
HDFC BANK LTD	2.05%	1.07%
NASPERS LTD	1.55%	0.26%
INFOSYS LTD	1.48%	0.46%
ICICI BANK LTD ADR	1.32%	-
HON HAI PRECISION INDUSTRY CO LTD	0.97%	0.45%
SK HYNIX INC	0.88%	0.44%

Struttura del portafoglio secondo le valute

	Gruppo d'investimento	Benchmark
HKD	13.74%	21.19%
TWD	12.26%	17.82%
INR	12.20%	19.63%
KRW	10.11%	10.53%
USD	6.25%	3.00%
EUR	1.19%	0.46%
CHF	0.00%	-
Altri	44.29%	27.32%

Fondazione d'investimento Swiss Life

Azioni Global Protect Flex PM (CHF hedged)

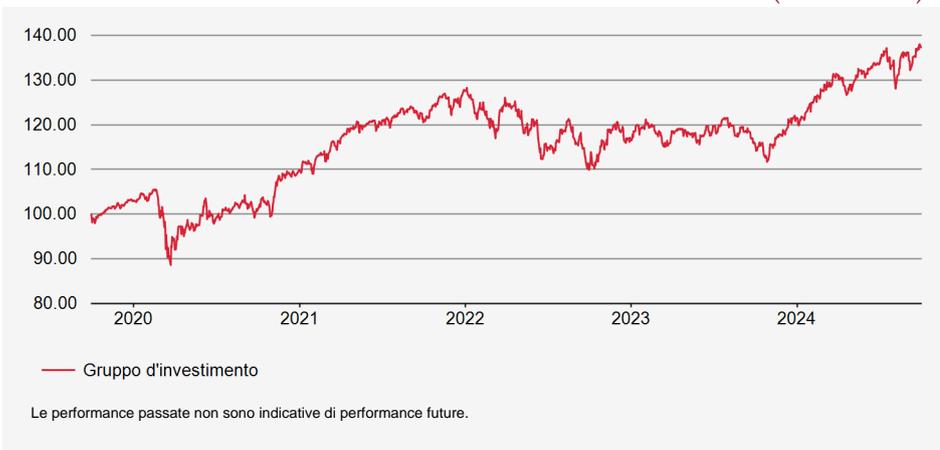


Patrimonio netto (NAV) in mio. CHF: 787.44
Valore d'inventario netto per diritto in CHF: 160.49

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. 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 (CHF hedged).

Evoluzione del valore nella valuta di riferimento (base 100)



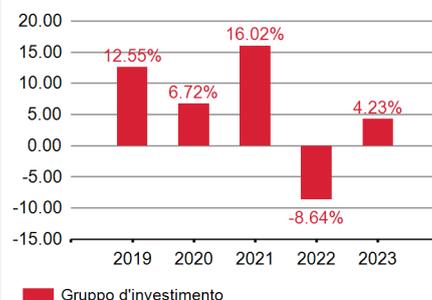
Performance nella valuta di riferimento

	Performance cumulata				Performance annualizzata			
	YTD	1 mese	3 mesi	1 anno	3 anni	5 anni	10 anni	Inizio
Gruppo d'investimento	13.01%	0.82%	2.83%	18.50%	4.42%	6.54%	-	5.77%

Dati statistici (annualizzati)

	1 anno	3 anni	5 anni	10 anni	Inizio
Volatilità Gruppo d'investimento (in %)	7.68	10.30	9.88	-	8.44
Sharpe Ratio	2.02	0.35	0.63	-	0.69
Maximum Drawdown (in %)	-6.60	-14.29	-15.96	-	-15.96
Recovery Period (anni)	0.14	1.42	0.63	-	0.63

Performance



Informazioni sul prodotto

Numero di valore: 31954200
ISIN: CH0319542004
LEI: 254900LUAQC3MCOMWL48
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: 13.00
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: 0.15%
ex post al: 30/09/2024 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
Tecnologia dell'informazione	16.09%
Finanza	15.02%
Salute	12.68%
Industrie	12.46%
Beni di prima necessità	7.75%
Beni voluttuari	7.44%
Servizi di pubblica utilità	5.41%
Servizi di comunicazione	5.05%
Materiali	3.95%
Energia	2.95%
Immobili	2.84%
Future su indice azionario	0.78%
Liquidità / Prestito	7.57%

Posizioni principali

	Gruppo d'investimento
INTL BUSINESS MACHINES CORP	0.79%
T-MOBILE US INC	0.77%
WALMART INC	0.74%
CHUBB LTD	0.69%
CISCO SYSTEMS INC	0.68%
JOHNSON & JOHNSON	0.68%
PEPSICO INC	0.66%
MOTOROLA SOLUTIONS INC	0.61%
ACCENTURE PLC-CL A	0.61%
ELI LILLY & CO	0.61%

Struttura del portafoglio secondo il paese/regione

	Gruppo d'investimento
USA e Canada	67.57%
Regione Europea (EUR)	10.15%
Regione Asia e Pacifico	7.88%
Regione Europea (Ex EUR)	5.67%
Future su indice azionario	0.78%
Mercati Emergenti in America	0.35%
Mercati Emergenti in Europa	0.03%
Liquidità / Prestito	7.57%

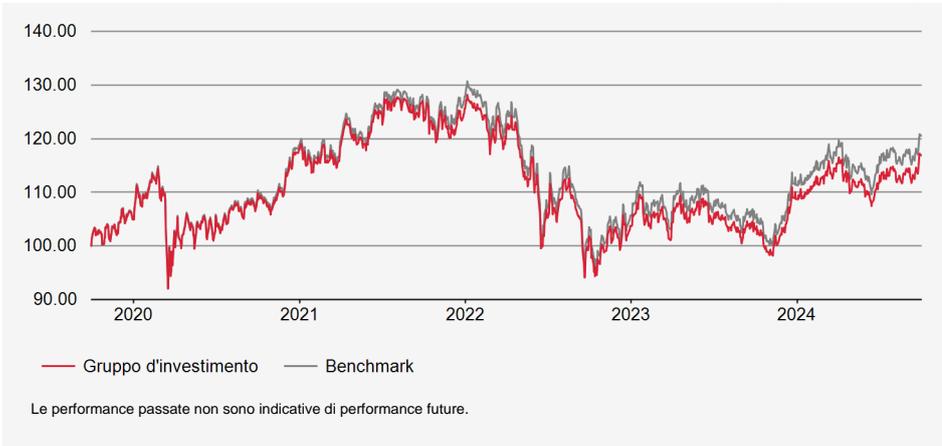
Nota legale: La presente pubblicazione non rappresenta né un invito, né una raccomandazione ad acquistare o vendere strumenti d'investimento, ma funge meramente da veicolo informativo. È possibile richiedere gratuitamente tutti i documenti che costituiscono la base giuridica di un eventuale investimento presso la Fondazione d'investimento Swiss Life, c/o Swiss Life SA, casella postale 8022 Zurigo, telefono 043 547 71 11 e su www.swisslife.ch/anlagestiftung. La cerchia degli investitori è limitata alle istituzioni del secondo pilastro e del pilastro 3a, nonché istituzioni esonerate dall'obbligo tributario, con sede in Svizzera e che secondo l'oggetto sociale perseguono la previdenza professionale e persone che gestiscono investimenti collettivi per queste istituzioni, sono sorvegliate dall'Autorità federale di vigilanza sui mercati finanziari FINMA e che investono presso la fondazione esclusivamente capitali per queste istituzioni. Inoltre, gli investitori citati devono aver concluso un accordo speciale con Swiss Life Asset Management SA. La performance precedente non rappresenta un indicatore né per l'evoluzione attuale, né per quella futura. L'utilizzo non implica alcuna affiliazione con o sponsorizzazione da parte di quest'ultimi. **Fonte:** Swiss Life Asset Managers. Tutti i diritti riservati.

Patrimonio netto (NAV) in mio. CHF: 416.61
Valore d'inventario netto per diritto in CHF: 173.19

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. Il gruppo d'investimento viene gestito con un approccio indicizzato. L'obiettivo d'investimento consiste nel replicare al meglio il benchmark SXI Real Estate® Funds Broad Total Return. Realizzazione tramite Swiss Life Index Funds III (CH) Real Estate Switzerland.

Evoluzione del valore nella valuta di riferimento (base 100)



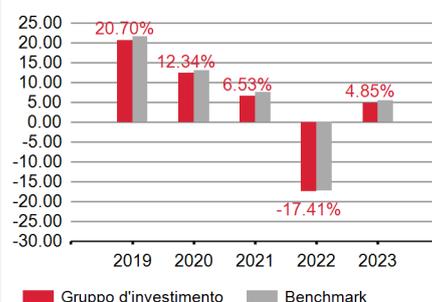
Performance nella valuta di riferimento

	Performance cumulata				Performance annualizzata			
	YTD	1 mese	3 mesi	1 anno	3 anni	5 anni	10 anni	Inizio
Gruppo d'investimento	7.47%	2.58%	4.60%	13.23%	-2.17%	3.17%	4.50%	4.12%
Benchmark	8.24%	2.62%	4.67%	14.33%	-1.46%	3.80%	5.25%	4.80%

Dati statistici (annualizzati)

	1 anno	3 anni	5 anni	10 anni	Inizio
Volatilità Gruppo d'investimento (in %)	10.52	10.05	9.94	9.00	8.31
Volatilità del Benchmark (in %)	10.95	10.42	10.24	9.28	8.58
Tracking Error ex post (in %)	0.60	0.53	0.44	0.48	0.50
Information Ratio	-1.82	-1.33	-1.44	-1.58	-1.37
Sharpe Ratio	1.04	-0.29	0.30	0.52	0.51
Correlazione	1.00	1.00	1.00	1.00	1.00
Beta	0.96	0.96	0.97	0.97	0.97
Jensen alfa	-0.59	-0.79	-0.53	-0.58	-0.51
Maximum Drawdown (in %)	-7.76	-26.55	-26.55	-26.55	-26.55
Recovery Period (anni)	0.29	-	-	-	-

Performance



Informazioni sul prodotto

Numero di valore: 12468565
ISIN: CH0124685659
LEI: 254900VB5XEQLYLQJ518
Codice Bloomberg: SWLIMPM SW
Benchmark: SXI Real Estate® Funds Broad Total Return
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: 13.00
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: 0.94%
ex post al: 30/09/2024 0.98%

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

Fondi immobiliari Svizzera Indicizzati PM



Le principali posizioni

UBS PRPRTY FD SW MIXD SIMA	16.48%
CREDIT SUISSE REAL EST SIAT	6.00%
UBS PRPRTY FD SW RESIDTL ANF	4.98%
CS REAL ESTATE LIVINGPLUS	4.86%
SWISS L REF CH ESG SWISS PRO	3.93%
ED DE ROTHSCHILD REAL ESTATE	3.80%
CS REAL ESTATE FD GREEN PROP	3.68%
LA FONCIERE	3.19%
IMMOFONDS	3.18%
UBS PRPRTY FD LEMAN RESD FON	3.00%

30 settembre 2024

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



Patrimonio netto (NAV) in mio. CHF: 201.23
Valore d'inventario netto per diritto in CHF: 112.53

Commento di management e prospettive

Nel periodo in rassegna (T3 2024) non vi sono state ulteriori chiamate di capitale per gli investitori. Il gruppo d'investimento Infrastruttura globale ESG (EUR) ha tuttavia continuato a investire in investimenti target. Si trattava di collocamenti in fondi target e di chiamate di capitale da due investimenti diretti. Il patrimonio del gruppo d'investimento ha registrato un'evoluzione positiva nel terzo trimestre 2024. Le valute estere nel patrimonio dei gruppi d'investimento hanno avuto un effetto leggermente negativo sulla valutazione complessiva. Nel quarto trimestre 2024 è prevista un'ulteriore chiamata di capitale per gli investitori.

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	-0.15%	0.06%	0.39%	3.34%	-	-	3.59%

Principali dati indicativi

Capitale impegnato*	259.1
Capitale richiamato*	191.3
Patrimonio netto (NAV)*	201.2
Impegni di capitale in investimenti del portafoglio*	234.8
Numero di investimenti del portafoglio (panoramica)	15
Numero di partecipazioni (panoramica)	30

*in milioni CHF

Informazioni sul prodotto

Numero di valore: 59605226

ISIN: CH0596052263

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 Global Services SE
Leudelange Lussemburgo
succursale Basilea

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: 1.22%

ex post al: 30/09/2024 1.22%

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).

Fondazione d'investimento Swiss Life

Infrastruttura globale ESG PM (CHF hedged)

Investimenti del portafoglio*

	Impegni di capitale	Patrimonio netto
Swiss Life Funds (LUX) ESG Global Infrastructure Opportunities III	30.86%	34.36%
Swiss Life Funds (LUX) ESG GIO III Co-Invest	11.70%	12.57%
FONTAVIS ESG Renewable Infrastructure Fund II («FORTE II»)	9.58%	7.58%
Swiss Life Funds (LUX) ESG Global Infrastructure Opportunities Growth II	8.51%	3.39%
FONTAVIS ESG Renewable Infrastructure Fund Europe («FORTE»)	5.32%	7.21%
Co-Investment Transition Network Operator Amprion	5.32%	3.46%
Co-Investment District Heating UK	4.99%	5.43%
Co-Investment Saffir (offshore Norway)	4.69%	5.03%
Co-Investment TTT via Bazalgette (Investments) Ltd	3.72%	4.54%
Co-Investment JFK via JLC Terminal One Co-Invest L.P.	3.40%	2.21%
Altri	11.91%	14.22%

*Senza liquidità

Attività per settore*

Energie rinnovabili / Energia	32.49%
Comunicazione	31.10%
Trasporto	12.82%
Infrastrutture sociali	12.42%
Servizi di pubblica utilità	11.17%
Altri	-

*Senza liquidità

Asset per regione*

Europa (incl. Gran Bretagna)	79.96%
America del Nord	18.49%
Svizzera	1.55%
Altre regioni	-

*Senza liquidità

Attività per stadio*

Brownfield	91.33%
Greenfield	8.67%

*Senza liquidità

Attività per valuta*

EUR	60.76%
USD	19.53%
GBP	18.16%
CHF	1.55%

*Senza liquidità

30 settembre 2024

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



Patrimonio netto (NAV) in mio. EUR: 430.97
Valore d'inventario netto per diritto in EUR: 119.12

Commento di management e prospettive

Nel periodo in rassegna (T3 2024) il gruppo d'investimento Infrastruttura globale ESG (EUR) ha investito circa 10 milioni di euro nei suoi investimenti target. Si trattava di chiamate di capitale dei fondi target (circa 7 milioni di euro) e di due investimenti diretti (circa 3 milioni di euro). Il patrimonio dei gruppi d'investimento ha continuato a registrare un andamento stabile e positivo nel periodo in rassegna. Nel quarto trimestre 2024 è prevista un'ulteriore chiamata di capitale per gli investitori. Il Portfolio Management verifica nuove allocazioni di capitale nel settore dei fondi e degli investimenti diretti.

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	1.92%	0.82%	3.13%	5.40%	-	-	5.59%

Principali dati indicativi

Capitale impegnato*	502.3
Capitale richiamato*	395.8
Patrimonio netto (NAV)*	431.0
Impegni di capitale in investimenti del portafoglio*	470.0
Numero di investimenti del portafoglio (panoramica)	15
Numero di partecipazioni (panoramica)	30

*in milioni EUR

Informazioni sul prodotto

Numero di valore: 59600218

ISIN: CH0596002185

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

Ultima distribuzione al:

21/02/2024 EUR 0.85

Asset Manager:

Swiss Life Asset Management SA

Amministratore:

Northern Trust Global Services SE
Leudelange Lussemburgo
succursale Basilea

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: 1.32%

ex post al: 30/09/2024 1.32%

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.

Investimenti del portafoglio*

	Impegni di capitale	Patrimonio netto
Swiss Life Funds (LUX) ESG Global Infrastructure Opportunities III	30.86%	34.36%
Swiss Life Funds (LUX) ESG GIO III Co-Invest	11.70%	12.57%
FONTAVIS ESG Renewable Infrastructure Fund II («FORTE II»)	9.58%	7.58%
Swiss Life Funds (LUX) ESG Global Infrastructure Opportunities Growth II	8.51%	3.39%
FONTAVIS ESG Renewable Infrastructure Fund Europe («FORTE»)	5.32%	7.21%
Co-Investment Transition Network Operator Amprion	5.32%	3.46%
Co-Investment District Heating UK	4.99%	5.43%
Co-Investment Saffir (offshore Norway)	4.69%	5.03%
Co-Investment TTT via Bazalgette (Investments) Ltd	3.72%	4.54%
Co-Investment JFK via JLC Terminal One Co-Invest L.P.	3.40%	2.21%
Altri	11.91%	14.22%

*Senza liquidità

Attività per settore*

Energie rinnovabili / Energia	32.49%
Comunicazione	31.10%
Trasporto	12.82%
Infrastrutture sociali	12.42%
Servizi di pubblica utilità	11.17%
Altri	-

*Senza liquidità

Asset per regione*

Europa (incl. Gran Bretagna)	79.96%
America del Nord	18.49%
Svizzera	1.55%
Altre regioni	-

*Senza liquidità

Attività per stadio*

Brownfield	91.33%
Greenfield	8.67%

*Senza liquidità

Attività per valuta*

EUR	60.76%
USD	19.53%
GBP	18.16%
CHF	1.55%

*Senza liquidità

30 settembre 2024

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

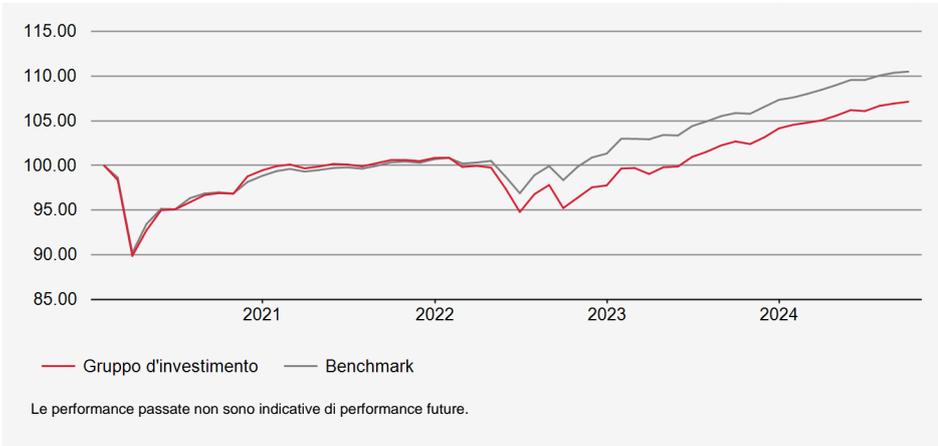


Patrimonio netto (NAV) in mio. CHF: 143.61
Valore d'inventario netto per diritto in CHF: 107.13

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)



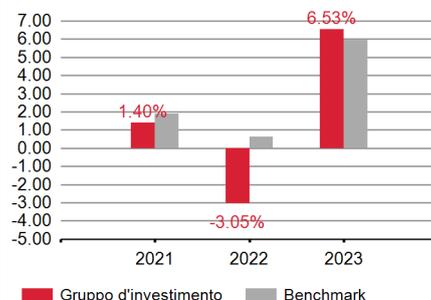
Performance nella valuta di riferimento

	Performance cumulata				Performance annualizzata			
	YTD	1 mese	3 mesi	1 anno	3 anni	5 anni	10 anni	Inizio
Gruppo d'investimento	2.86%	0.19%	0.99%	4.32%	2.11%	-	-	1.49%
Benchmark	2.94%	0.11%	0.85%	4.37%	3.26%	-	-	2.16%

Dati statistici (annualizzati)

	1 anno	3 anni	5 anni	10 anni	Inizio
Volatilità Gruppo d'investimento (in %)	1.20	3.63	-	-	5.62
Volatilità del Benchmark (in %)	0.89	2.81	-	-	5.24
Tracking Error ex post (in %)	0.47	1.06	-	-	1.02
Information Ratio	-0.10	-1.08	-	-	-0.66
Sharpe Ratio	2.30	0.38	-	-	0.22
Correlazione	0.94	0.98	-	-	0.98
Beta	1.28	1.26	-	-	1.06
Jensen alfa	-0.84	-1.81	-	-	-0.78
Maximum Drawdown (in %)	-0.28	-6.02	-	-	-10.11
Recovery Period (anni)	0.08	1.00	-	-	0.91

Performance



Informazioni sul prodotto

Numero di valore: 51215723
ISIN: CH0512157238
LEI: 254900TFN2RL5B1QJ986
Codice Bloomberg: SWSSLPM SW
Benchmark: JPM Lev Loans Upper Tier (80% US + 20% EU) 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: 0.48%

ex post al: 30/09/2024 0.48%

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 del 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.

Struttura del portafoglio per settore

	Gruppo d'investimento	Benchmark
Servizi	16.71%	9.93%
Tecnologia	9.32%	7.68%
Salute	8.16%	8.58%
Finanza	7.67%	5.41%
Giochi/Tempo libero	7.31%	10.54%
Chimica	6.94%	6.06%
Edilizia	5.48%	4.05%
Cavo e Satellite	5.04%	4.18%
Automobile	3.96%	4.02%
Alimentazione e Bevande	3.73%	4.87%
Altri	21.99%	34.70%
Liquidità	3.68%	-

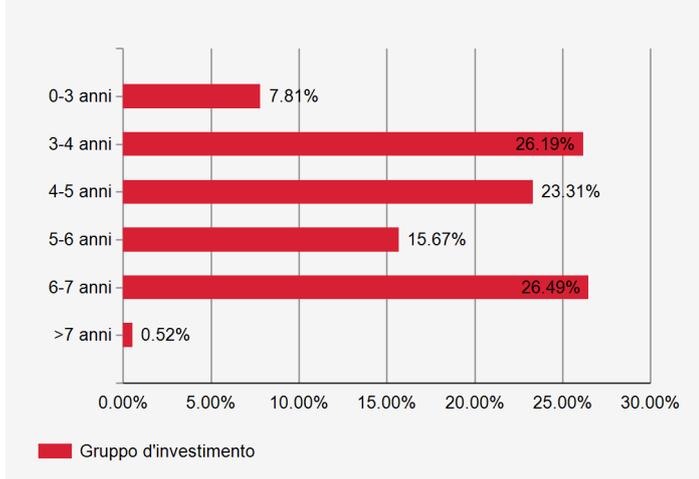
Principali debitori e rating

	Gruppo d'investimento	Benchmark
Action Nederland	BB	1.50%
INEOS Quattro	BB	1.47%
Entain	BB-	1.42%
Belron	BB-	1.41%
Asurion	B+	1.39%

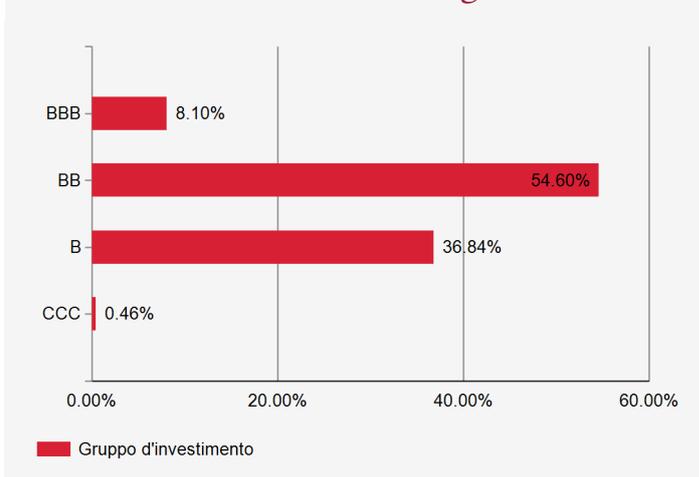
Ulteriori informazioni sui debitori

Numero di debitori	223
--------------------	-----

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	69.03%	7.85%	80.00%	7.19%
EUR	30.97%	7.02%	20.00%	6.52%
Media	-	7.59%	-	7.06%

Struttura del portafoglio secondo il paese/regione

	Gruppo d'investimento	Benchmark
Stati Uniti	57.71%	83.34%
Regno Unito	8.92%	5.66%
Paesi Bassi	6.14%	2.11%
Germania	3.90%	0.40%
Lussemburgo	3.89%	0.29%
Belgio	2.76%	1.09%
Francia	1.84%	-
Svizzera	1.82%	0.17%
Spagna	1.62%	0.81%
Canada	1.41%	2.39%
Altri	6.32%	3.75%
Liquidità	3.68%	-

30 settembre 2024

Fondazione d'investimento Swiss Life Ipoteche Svizzera ESG PM

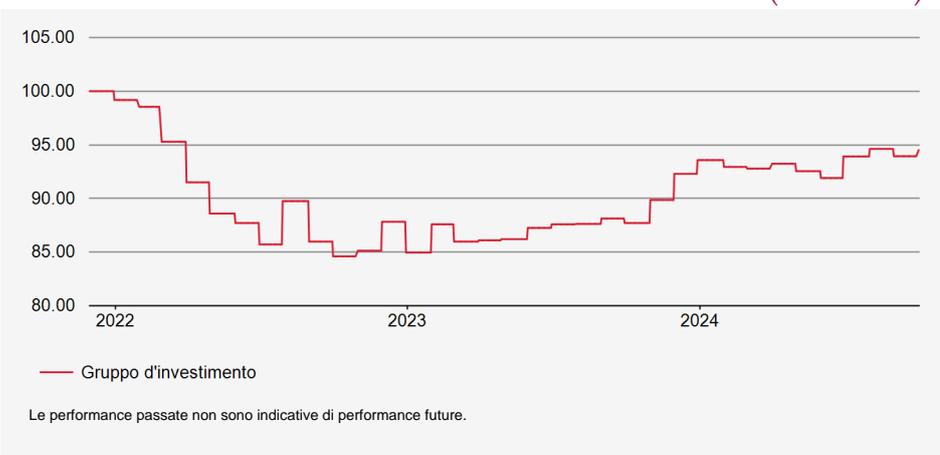


Patrimonio netto (NAV) in mio. CHF: 219.34
Valore d'inventario netto per diritto in CHF: 94.52

Strategia d'investimento

Investimenti in ipoteche svizzere sostenibili: almeno l'85% previa deduzione di eventuali attività liquide. 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

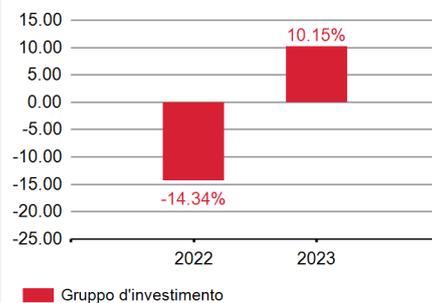
	Performance cumulata				Performance annualizzata			
	YTD	1 mese	3 mesi	1 anno	3 anni	5 anni	10 anni	Inizio
Gruppo d'investimento	1.00%	0.62%	0.64%	7.75%	-	-	-	-1.97%

Dati statistici

Durata residua media (anni)	8.41
Modified Duration (excl. ipoteche a termine)*	7.13
Modified Duration (incl. ipoteche a termine)*	7.61
Rendimento lordo alla scadenza	1.60%
Anticipo medio	59%
Numero ipoteche	699
Differenza di rendimento rispetto ai titoli di Stato svizzeri	1.20%

*incl. liquidità

Performance



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: 30/09/2023 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 logaritmizzati mensili.

Struttura patrimoniale

Ipotecche	94.00%
Fondi Comuni Monetari	3.14%
Liquidità	2.86%
Derivati	0.00%

Distribuzione in base all'ammontare dell'anticipo

<40%	8.89%
40 - 50%	14.10%
50 - 60%	13.86%
60 - 70%	51.47%
>70%	11.68%

Tipo di oggetti messi in pegno

CASE UNIFAMILIARE	35.00%
PROPRIETÀ PER PIANI	52.94%
CASE PLURIFAMILIARI	7.43%
IMMOBILI A USO COMMERCIALE	4.62%

Tipi d'ipoteca

Ipotecche a tasso fisso	98.39%
Ipotecche Saron	1.38%
Ipotecche a tasso variabile	0.23%

Ipotecche con pagamenti scoperti di ben 90 giorni

Anticipo medio	-
Numero debitori ipotecari	-
Relativo Valore globale delle ipotecche con pagamenti scoperti	-

Ripartizione geografica degli immobili

Zurigo	27.18%
Espace Mittelland	15.86%
Svizzera centrale	8.00%
Svizzera nordoccidentale	6.89%
Svizzera orientale	1.92%
Ticino	1.08%
Regione del Lemano	39.07%

Struttura alla scadenza delle ipotecche

1-3 ANNI	7.80%
3-5 ANNI	17.88%
5-7 ANNI	5.09%
7-10 ANNI	49.62%
10-15 ANNI	12.46%
>15 ANNI	7.16%

Distribuzione ESG

Minergie	51.89%
CECE	45.41%
THPE	2.61%
Nessuna etichetta/certificato	0.09%

30 settembre 2024

Fondazione d'investimento Swiss Life

Obbligazioni Global Imprese Short Term SPM (CHF hedged)

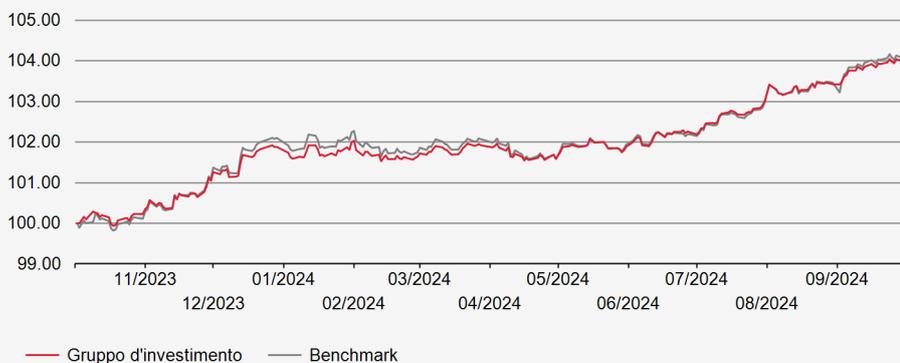


Patrimonio netto (NAV) in mio. CHF: 1,376.35
Valore d'inventario netto per diritto in CHF: 103.91

Strategia d'investimento

Investimenti in titoli di credito 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%. Titoli di credito di 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)



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	2.07%	0.55%	1.71%	-	-	-	-	-
Benchmark	1.92%	0.58%	1.83%	-	-	-	-	-

Dati statistici (annualizzati)

	1 anno	3 anni	5 anni	10 anni	Inizio
Volatilità Gruppo d'investimento (in %)	-	-	-	-	1.35
Volatilità del Benchmark (in %)	-	-	-	-	1.66
Tracking Error ex post (in %)	-	-	-	-	0.38
Information Ratio	-	-	-	-	-0.19
Sharpe Ratio	-	-	-	-	1.81
Correlazione	-	-	-	-	0.99
Beta	-	-	-	-	0.80
Jensen alfa	-	-	-	-	0.43
Maximum Drawdown (in %)	-	-	-	-	-0.49
Recovery Period (anni)	-	-	-	-	0.25

Performance

Storia insufficiente di dati

Informazioni sul prodotto

Numero di valore: 129127773

ISIN: CH1291277734

LEI: 2549003DSGO0RN37K507

Codice Bloomberg: SWLOSPM SW

Benchmark: BLOOMBERG GLO AGG CORP 1-3 YR IND HEDGED CHF

Moneta: CHF

Domicilio: Svizzera

Data di creazione: 02/10/2023

Prezzo di prima emissione: 100.00

Chiusura d'esercizio: 30.09

Emissione/Riscatto: giornalmente

Termine d'accettazione: 13.00

Commissione d'emissione / riscatto: nessuna

Prassi di distribuzione: Capitalizzazione

Asset Manager in base al Swiss Life Best Select Invest Plus@:

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: 0.04%

ex post al: 30/09/2024 0.04%

Il cerchio degli investitori è limitato alla Fondazione d'investimento Swiss Life.

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 SPM (CHF hedged)

Struttura del portafoglio per settore

	Gruppo d'investimento	Benchmark
Finanza	53.44%	50.99%
Consumo non ciclico	11.59%	12.11%
Consumo ciclico	8.52%	9.88%
Comunicazione	4.67%	5.39%
Energia	4.08%	4.13%
Tecnologia	3.75%	4.08%
Beni Industriali	3.36%	5.91%
Servizi di pubblica utilità	2.52%	5.24%
Altri	2.88%	2.28%
Liquidità	3.58%	-
Copertura del rischio di cambio	1.60%	-

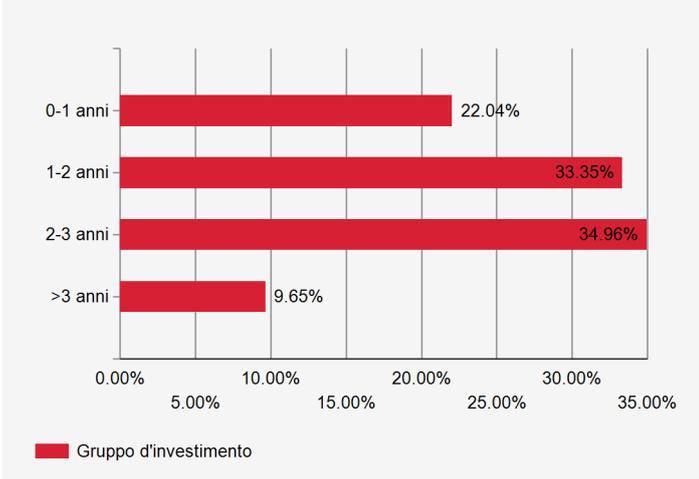
Principali debitori e rating

		Gruppo d'investimento
Banco Santander SA, Madrid	A-	3.06%
Credit Agricole Group	BBB+	2.65%
Citigroup Inc	BBB+	2.33%
Barclays Capital PLC, London	BBB	2.14%
Morgan Stanley NE US	A	2.03%

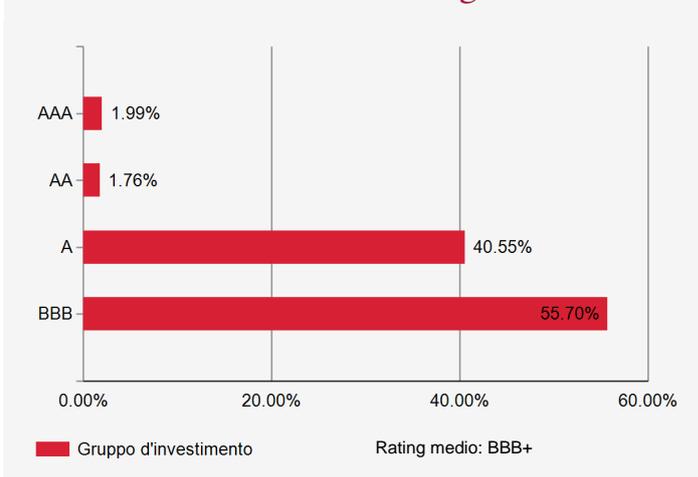
Ulteriori informazioni sui debitori

Numero di debitori	149
Quota di debitori senza benchmark	6.63%

Struttura della scadenza dei titoli



Investimenti secondo il rating



Durata e rendimento alla scadenza

	Gruppo d'investimento	Benchmark
Modified Duration	1.9	1.8
Rendimento alla scadenza teorica*	3.76%	3.89%

* 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	58.79%	1.89	60.04%	1.88
EUR	25.44%	1.97	29.79%	1.96
CHF	11.25%	1.31	0.47%	1.91
GBP	3.47%	1.47	3.86%	1.89
Altri	1.05%	2.00	5.84%	1.97

Struttura del portafoglio secondo il paese/regione

	Gruppo d'investimento	Benchmark
Stati Uniti	34.19%	45.94%
Francia	8.95%	7.59%
Regno Unito	7.84%	6.85%
Canada	7.56%	5.77%
Germania	6.45%	6.20%
Svizzera	6.14%	2.05%
Spagna	5.60%	3.33%
Regione Europea (EUR)	6.14%	6.62%
Mercati Emergenti Asia Pacifico	4.69%	2.36%
Regione Asia e Pacifico	3.55%	4.63%
Altri	3.70%	8.67%
Liquidità, copertura	5.19%	-