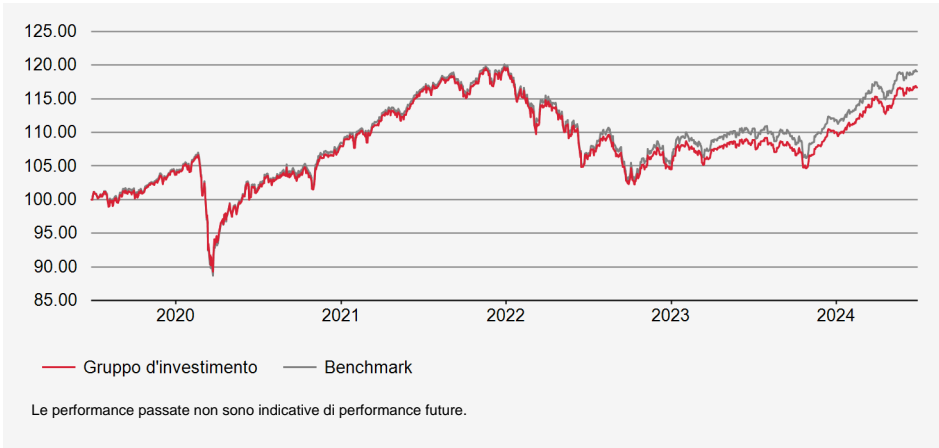


Patrimonio netto (NAV) in mio. CHF: 755.94
Valore d'inventario netto per diritto in CHF: 220.31

Strategia d'investimento

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

Evoluzione del valore nella valuta di riferimento (base 100)



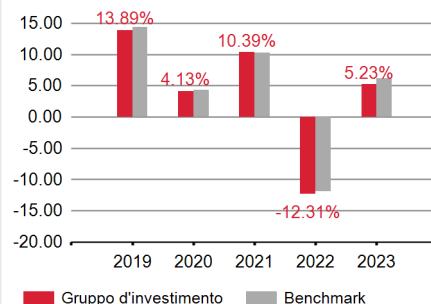
Performance nella valuta di riferimento

	Performance cumulata				Performance annualizzata			
	YTD	1 mese	3 mesi	1 anno	3 anni	5 anni	10 anni	Inizio
Gruppo d'investimento	6.06%	0.69%	1.21%	7.17%	0.17%	3.13%	3.72%	3.53%
Benchmark	6.43%	0.74%	1.38%	7.70%	0.74%	3.55%	4.24%	4.19%

Dati statistici (annualizzati)

	1 anno	3 anni	5 anni	10 anni	Inizio
Volatilità Gruppo d'investimento (in %)	5.42	6.85	7.20	6.42	6.47
Volatilità del Benchmark (in %)	5.61	7.18	7.52	6.48	6.46
Tracking Error ex post (in %)	0.30	0.55	0.57	0.58	0.67
Information Ratio	-1.74	-1.03	-0.73	-0.90	-0.97
Sharpe Ratio	0.98	-0.06	0.42	0.62	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	-0.32	-0.56	-0.26	-0.46	-0.65
Maximum Drawdown (in %)	-4.14	-14.55	-16.22	-16.22	-28.27
Recovery Period (anni)	0.11	-	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: 14.00
Commissione d'emissione / riscatto: nessuna
Prassi di distribuzione: Capitalizzazione
Asset Manager:
Asset allocation tattica
 Swiss Life Asset Management SA
Gruppi d'investimento puri impiegati
 Diversi in base al
 Swiss Life Best Select Invest Plus®
Consulenza esterna:
 PPCmetrics fornisce i seguenti servizi all'interno dei gruppi d'investimento puri: consulenza sulla struttura idonea del mandato, supporto nella selezione di asset manager adeguati nonché supporto nel controllo costante dell'asset manager e valutazione dei risultati d'investimento.
Pubblicazioni di corsi: Bloomberg: ASSL
www.swisslife.ch/fondazioneinvestimento
Quote spese operative TER KGAST
ex ante: 0.59%
ex post al: 30/09/2023 0.60%

Struttura del portafoglio per gruppo d'investimento

	Gruppo d'investimento	Benchmark	max. OPP2
Liquidità	4.04%	2.00%	-
Ipotecche Svizzera	0.52%	-	-
Obbligazioni CHF Svizzera	10.84%	12.00%	-
Obbligazioni CHF Estero	4.82%	5.00%	-
Obbligazioni valute estere (CHF hedged)	20.62%	20.00%	-
Azioni Svizzera	22.90%	23.00%	-
Azioni Estero	22.22%	22.00%	-
Azioni Estero (CHF hedged)	-	-	-
Immobili Svizzera	10.12%	9.00%	30.00%
Immobili estero (CHF hedged)	1.66%	2.00%	10.00%
Investimenti alternativi (CHF hedged)	2.27%	5.00%	15.00%
Totale azioni (Svizzera ed Estero)	45.12%	45.00%	50.00%
Totale valute estere	22.22%	22.00%	30.00%

Maggiori posizioni azionarie

NESTLE SA-REG	3.46%
NOVARTIS AG-REG	2.83%
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	2.52%
MICROSOFT CORP	1.63%
NVIDIA CORP	1.59%
UBS GROUP AG-REG	1.23%
ABB LTD-REG	1.15%
CIE FINANCIERE RICHEMO-A REG	1.09%
ALPHABET INC	1.03%
ZURICH INSURANCE GROUP AG	1.01%

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	75.91%
USD	15.33%
EUR	1.64%
JPY	1.34%
Altri	5.78%

Qualità degli investimenti a reddito fisso

Modified Duration	5.82
Rating medio	A