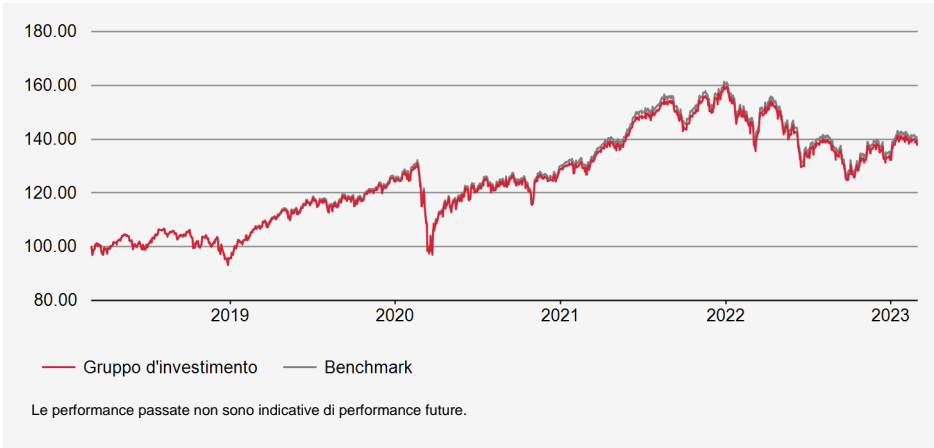


Patrimonio netto (NAV) in mio. CHF: 467.04
Valore d'inventario netto per diritto in CHF: 315.19

Strategia d'investimento

Investimenti in titoli di partecipazione di società rappresentate allo Swiss Performance Index (SPI). La copertura per i Large Cap è passiva, gli Small & Mid Caps vengono gestiti attivamente (core satellite). Limitazione per società: 5% (eccezione: se rappresentati nel benchmark; max. 5%-punti in più della ponderazione del benchmark). Realizzazione tramite Swiss Life iFunds (CH) Equity Switzerland (CHF) e Equity Switzerland Small & Mid Cap (CHF); Fondi d'investimento di diritto svizzero della categoria "altri fondi per investimenti tradizionali".

Evoluzione del valore nella valuta di riferimento (base 100)



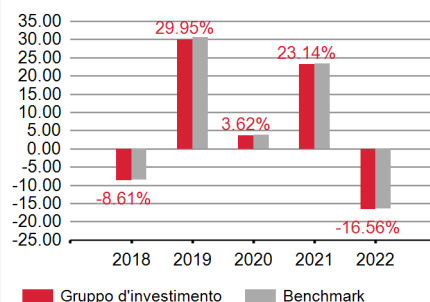
Performance nella valuta di riferimento

| | PERFORMANCE CUMULATA | | | | PERFORMANCE ANNUALIZZATA | | | |
|------------------------------|----------------------|--------|--------|--------|--------------------------|--------|---------|--------|
| | YTD | 1 MESE | 3 MESI | 1 ANNO | 3 ANNI | 5 ANNI | 10 ANNI | INIZIO |
| GRUPPO D'INVESTIMENTO | 4.18% | -1.22% | 0.75% | -5.81% | 6.19% | 6.63% | 6.99% | 5.50% |
| BENCHMARK | 4.14% | -1.29% | 0.73% | -5.72% | 6.32% | 6.87% | 7.37% | 6.02% |

Dati statistici (annualizzati)

| | 1 ANNO | 3 ANNI | 5 ANNI | 10 ANNI | INIZIO |
|---|--------|--------|--------|---------|--------|
| Volatilità Gruppo d'investimento (in %) | 15.41 | 14.15 | 13.23 | 11.87 | 13.06 |
| Volatilità del Benchmark (in %) | 15.43 | 14.18 | 13.26 | 11.90 | 13.40 |
| Tracking Error ex post (in %) | 0.24 | 0.32 | 0.31 | 0.31 | 1.21 |
| Information Ratio | -0.37 | -0.42 | -0.79 | -1.21 | -0.50 |
| Sharpe Ratio | -0.39 | 0.46 | 0.53 | 0.62 | 0.40 |
| Correlazione | 1.00 | 1.00 | 1.00 | 1.00 | 1.00 |
| Beta | 1.00 | 1.00 | 1.00 | 1.00 | 0.97 |
| Jensen alfa | -0.10 | -0.12 | -0.22 | -0.34 | -0.35 |

Performance



Informazioni sul prodotto

Numero di valore: 1245481
ISIN: CH0012454812
LEI: 254900UNZU5YPIKQTQ23
Codice Bloomberg: SWAAKCH SW
Benchmark: Swiss Performance Index
Moneta: CHF
Domicilio: Svizzera
Data di creazione: 30/09/2001
Prezzo di prima emissione: 100.00
Chiusura d'esercizio: 30.09
Emissione/Riscatto: giornalmente
Termine d'accettazione: 14.30
Commissione d'emissione/riscatto: nessuna
Prassi di distribuzione: Capitalizzazione
Asset Manager in base al Swiss Life Best Select Invest Plus® Large Caps (passivo)
 Pictet Asset Management SA
Small&Mid Caps (attivo)
 Privatbank Von Graffenried AG

Consulenza esterna:
 PPCmetrics fornisce i seguenti servizi: consulenza sulle strutture idonee del mandato (core satellite), supporto nella selezione di asset manager adeguati nonché supporto nel controllo costante dell'asset manager e valutazione dei risultati d'investimento.

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

Quote spese operative TER KGAST

ex ante: 0.53%

ex post al: 30/09/2022 0.53%

Struttura del portafoglio per settore

| | Gruppo d'investimento | Benchmark |
|-----------------------------|-----------------------|-----------|
| SALUTE | 31.81% | 32.48% |
| GENERI DI CONSUMO | 26.71% | 27.13% |
| INDUSTRIE | 17.13% | 16.68% |
| FINANZA | 16.50% | 18.30% |
| MATERIALI DI BASE | 2.06% | 2.12% |
| TECNOLOGIA | 1.90% | 1.36% |
| TELECOMUNICAZIONI | 0.95% | 1.08% |
| SERVIZI PER IL CONSUMATORE | 0.44% | 0.64% |
| SERVIZI DI PUBBLICA UTILITÀ | 0.44% | 0.21% |
| PETROLIO E GAS | - | - |
| LIQUIDITÀ | 2.06% | - |

Le principali posizioni

| | Gruppo d'investimento | Benchmark |
|------------------------------|-----------------------|-----------|
| NESTLE SA-REG | 18.84% | 19.07% |
| ROCHE HOLDING AG | 12.33% | 12.49% |
| NOVARTIS AG-REG | 11.69% | 11.84% |
| CIE FINANCIERE RICHEMONT-REG | 4.78% | 4.84% |
| ZURICH INSURANCE GROUP AG | 4.34% | 4.39% |
| UBS GROUP AG-REG | 4.15% | 4.20% |
| ABB LTD-REG | 3.28% | 3.32% |
| LONZA GROUP AG-REG | 2.70% | 2.73% |
| SIKA AG | 2.62% | 2.65% |
| HOLCIM LTD | 2.12% | 2.14% |

Struttura del portafoglio in base al volume dell'impresa

| | Gruppo d'investimento | | Benchmark | |
|-----------------|-----------------------|--------|-----------|--------|
| | Partecip. | Numero | Partecip. | Numero |
| Grandi imprese | 79.26% | 21 | 79.93% | 20 |
| Medie imprese | 18.03% | 47 | 18.08% | 80 |
| Piccole imprese | 0.65% | 5 | 1.99% | 117 |
| Liquidità | 2.06% | - | - | - |