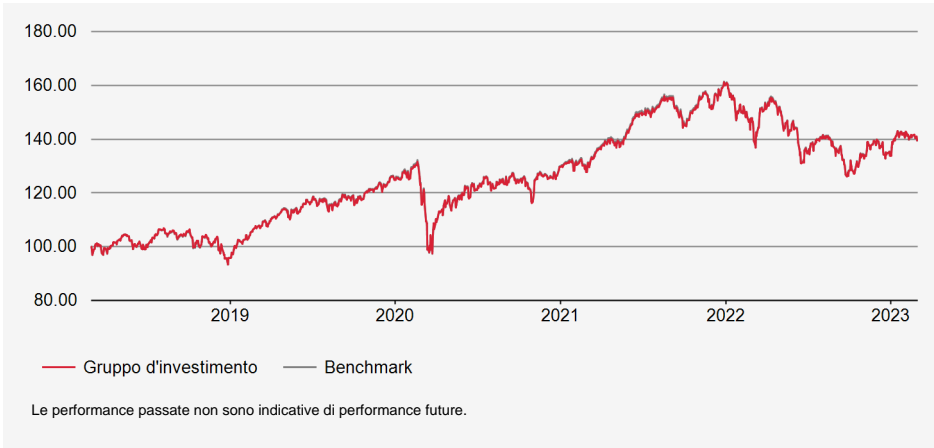


**Patrimonio netto (NAV) in mio. CHF: 467.04**  
**Valore d'inventario netto per diritto in CHF: 179.02**

### 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)



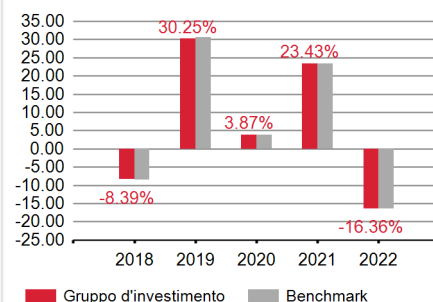
### Performance nella valuta di riferimento

	PERFORMANCE CUMULATA				PERFORMANCE ANNUALIZZATA			
	YTD	1 MESE	3 MESI	1 ANNO	3 ANNI	5 ANNI	10 ANNI	INIZIO
<b>GRUPPO D'INVESTIMENTO</b>	4.22%	-1.20%	0.81%	-5.59%	6.44%	6.88%	7.25%	3.76%
<b>BENCHMARK</b>	4.14%	-1.29%	0.73%	-5.72%	6.32%	6.87%	7.37%	4.02%

### 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	13.10
Volatilità del Benchmark (in %)	15.43	14.18	13.26	11.90	13.10
Tracking Error ex post (in %)	0.25	0.32	0.31	0.31	0.70
Information Ratio	0.54	0.36	0.03	-0.39	-0.37
Sharpe Ratio	-0.37	0.47	0.55	0.64	0.29
Correlazione	1.00	1.00	1.00	1.00	1.00
Beta	1.00	1.00	1.00	1.00	1.00
Jensen alfa	0.12	0.14	0.03	-0.09	-0.26

### Performance



### Informazioni sul prodotto

**Numero di valore:** 3026057  
**ISIN:** CH0030260571  
**LEI:** 254900UNZU5YPIKQTQ23  
**Codice Bloomberg:** SLACHPM SW  
**Benchmark:** Swiss Performance Index  
**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:** 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](http://www.swisslife.ch/fondazioneinvestimento)  
**Quote spese operative TER KGAST ex ante:** 0.30%  
**ex post al:** 30/09/2022 0.30%

**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	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%	-	-	-