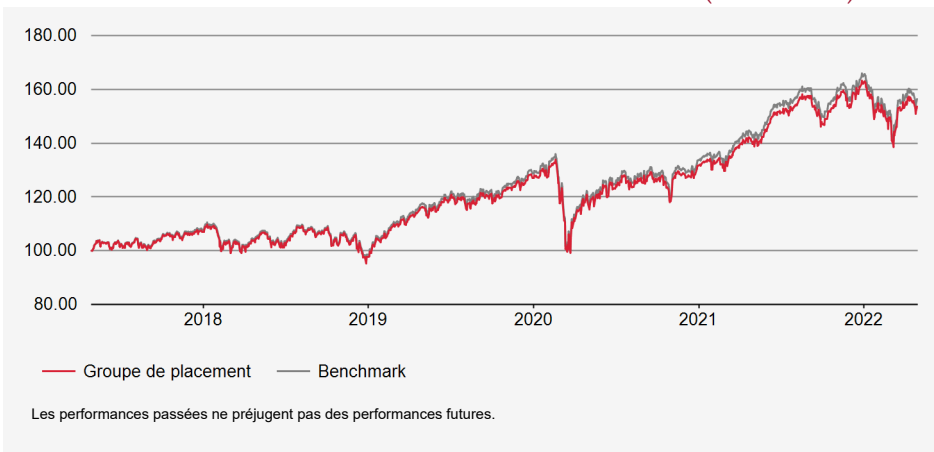


Fortune nette (VNI) en mio. CHF : 457.10
Valeur nette d'inventaire par droit en CHF : 343.64

Stratégie d'investissement

Placement dans des titres de participation de sociétés représentées dans le Swiss Performance Index (SPI). Les grosses capitalisations sont couvertes passivement, les petites et moyennes capitalisations sont gérées activement («core-satellite»). Limite par société: 5% (exception: à condition que les sociétés soient dans le benchmark; max. 5% points de plus que pondération dans le benchmark). Réalisation au moyen du Swiss Life iFunds (CH) Equity Switzerland (CHF) et Equity Switzerland Small & Mid Cap (CHF); fonds de la catégorie "Autres fonds en placements traditionnels".

Évolution de la valeur en devise de référence (base 100)



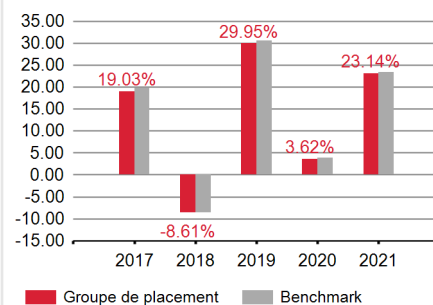
Performances en devise de référence

	PERFORMANCES CUMULÉES				PERFORMANCES ANNUELISÉES			
	YTD	1 MOIS	3 MOIS	1 AN	3 ANS	5 ANS	10 ANS	ORIGINE
GROUPE DE PLACEMENT	-5.23%	0.39%	0.30%	10.01%	9.71%	8.96%	10.18%	6.18%
BENCHMARK	-5.12%	0.42%	0.58%	10.04%	9.96%	9.35%	10.60%	6.72%

Données statistiques (annualisées)

	1 AN	3 ANS	5 ANS	10 ANS	ORIGINE
Volatilité du groupe de placement (en %)	13.13	12.35	11.71	11.34	12.90
Volatilité du Benchmark (en %)	13.11	12.40	11.75	11.38	13.26
Tracking Error ex post (en %)	0.38	0.34	0.32	0.31	1.30
Information Ratio	-0.08	-0.74	-1.24	-1.33	-0.42
Sharpe Ratio	0.78	0.81	0.80	0.90	0.46
Corrélation	1.00	1.00	1.00	1.00	1.00
Beta	1.00	0.99	1.00	1.00	0.97
Jensen alpha	-0.05	-0.20	-0.35	-0.37	-0.34
Maximum Drawdown (en %)	-15.11	-25.88	-25.88	-25.88	-54.46
Recovery Period (ans)	-	0.83	0.83	0.83	4.97

Performance



Info. sur le produit

Numéro de valeur: 1245481
ISIN: CH0012454812
LEI: 254900UNZU5YPIKQTQ23
Code Bloomberg: SWAAKCH SW
Benchmark: Swiss Performance Index
Monnaie: CHF
Pays d'origine: Suisse
Date de création: 30/09/2001
Valeur de lancement: 100.00
Clôture de l'exercice: 30.09
Souscription/Rachat: journalier
Délai final d'acceptation: 14h30
Commission de souscription/rachat: aucune
Pratique de distribution: Capitalisation
Asset Manager selon Swiss Life Best Select Invest Plus® Large Caps (passive)
 Pictet Asset Management SA
Small&Mid Caps (active)
 Privatbank Von Graffenried AG
Conseil externe:
 PPCmetrics fournit les prestations suivantes: conseil concernant les bonnes structures de mandat («core-satellite»), aide à la sélection de gestionnaires de fortune adéquats et soutien dans le cadre de la surveillance continue des gestionnaires de fortune, ainsi qu'évaluation des résultats des placements.
Publication de cours: Bloomberg: ASSL
www.swisslife.ch/fondationdeplacement
Taux des charges d'exploitation TER KGAST
au préalable: 0.55%
a posteriori au: 30/09/2021 0.55%

Asset Manager: La sélection des gestionnaires, leur surveillance continue et le suivi complet du processus sont effectués par Swiss Life Asset Management SA selon des critères objectifs, conformément à une excellente pratique institutionnelle.

Taux des charges d'exploitation TER KGAST: Le taux des charges d'exploitation TER KGAST couvre tous les coûts à l'exception des frais de transaction et des prélèvements fiscaux sur les transactions.

Performance: Produit total sur une période sous revue considérée, basé sur des rendements pondérés dans le temps.

Données statistiques: Les chiffres clés du risque reposent sur des rendements logarithmés, mensuels, pondérés dans le temps.

Structure du portefeuille par branches

	Groupe de placement	Benchmark
SANTÉ	34.79%	34.91%
BIENS DE CONSOMMATION	26.96%	27.40%
INDUSTRIE	15.51%	15.23%
FINANCE	14.54%	16.54%
MATÉRIAUX DE BASE	2.42%	2.52%
TECHNOLOGIE	1.96%	1.61%
TÉLÉCOMMUNICATION	0.86%	0.97%
SERVICES AUX CONSOMMATEURS	0.47%	0.66%
SERVICES AUX COLLECTIVITÉS	0.34%	0.17%
PÉTROLE ET GAZ	-	-
LIQUIDITÉS	2.14%	-

Les positions principales

	Groupe de placement	Benchmark
NESTLE SA-REG	20.82%	20.79%
ROCHE HOLDING AG	14.95%	14.93%
NOVARTIS AG-REG	12.36%	12.35%
ZURICH INSURANCE GROUP AG	3.94%	3.93%
CIE FINANCIERE RICHEMONT-REG	3.54%	3.53%
UBS GROUP AG-REG	3.30%	3.29%
ABB LTD-REG	2.80%	2.79%
SIKA AG	2.71%	2.70%
LONZA GROUP AG-REG	2.53%	2.53%
ALCON INC	2.06%	2.06%

Structure du portefeuille en fonction de la taille de l'entreprise

	Groupe de placement		Benchmark	
	Particip.	Nombre	Particip.	Nombre
Grandes entreprises	81.06%	20	81.00%	20
Moyennes entreprises	16.00%	47	17.09%	80
Liquidity	1.47%	-	-	-
Petites entreprises	0.80%	6	1.92%	120