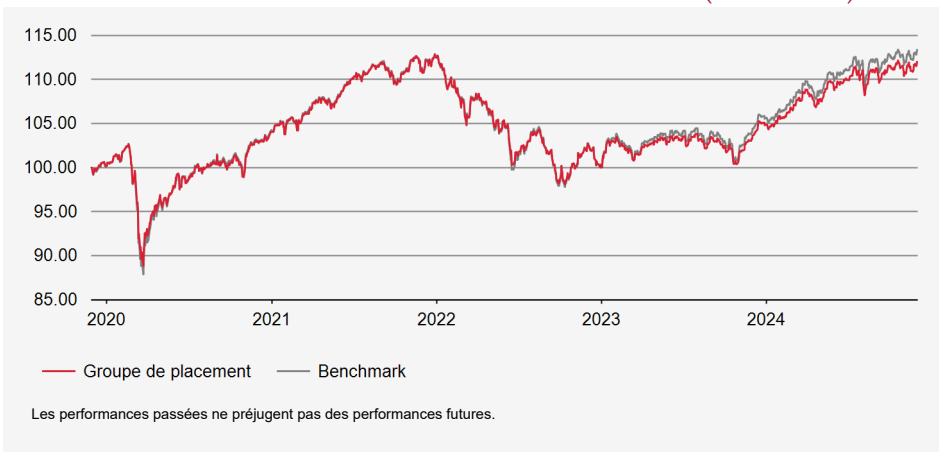


Fortune nette (VNI) en mio. CHF : 389.92
Valeur nette d'inventaire par droit en CHF : 214.20

Stratégie d'investissement

Placement dans toutes les catégories autorisées selon la LPP (part d'actions stratégique: 35%). Allocation active d'actifs. Limitation pour titres de participation: 45%. Limitation pour monnaies étrangères: 30%. Note moyenne des obligations: BBB+ au minimum. Réalisation au moyen de placements collectifs de même nature. Réserves de fluctuation recommandées: plus de 15%.

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



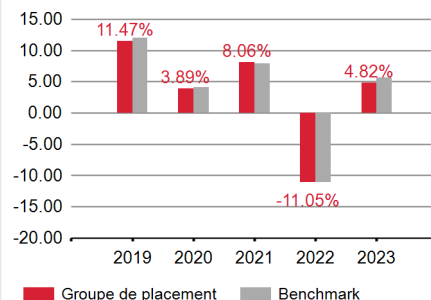
Performances en devise de référence

	Performances cumulées				Performances annualisées			
	YTD	1 mois	3 mois	1 an	3 ans	5 ans	10 ans	Origine
Groupe de placement	6.81%	1.45%	0.65%	8.48%	0.37%	2.29%	2.97%	3.34%
Benchmark	7.30%	1.52%	0.93%	9.02%	0.71%	2.54%	3.38%	3.88%

Données statistiques (annualisées)

	1 an	3 ans	5 ans	10 ans	Origine
Volatilité du groupe de placement (en %)	3.43	5.78	6.10	5.29	5.19
Volatilité du Benchmark (en %)	3.46	6.17	6.48	5.42	5.19
Tracking Error ex post (en %)	0.20	0.58	0.60	0.58	0.63
Information Ratio	-2.77	-0.58	-0.41	-0.71	-0.85
Sharpe Ratio	1.97	-0.07	0.34	0.61	0.59
Corrélation	1.00	1.00	1.00	0.99	0.99
Beta	0.99	0.93	0.94	0.97	0.99
Jensen alpha	-0.47	-0.34	-0.10	-0.30	-0.52
Maximum Drawdown (en %)	-2.93	-13.03	-13.41	-13.41	-21.36
Recovery Period (ans)	0.14	-	0.65	0.65	3.00

Performance



Info. sur le produit

Numéro de valeur: 1245606
ISIN: CH0012456064
LEI: 254900SR5GM6HP44F130
Code Bloomberg: SWABM35 SW
Benchmark: Customized
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: 12h00
Protection antidilution:
Commission d'émission / de rachat en faveur du groupe de placement selon l'aperçu des conditions.

Pratique de distribution: Capitalisation

Asset Manager:
Allocation d'actifs tactique
Swiss Life Asset Management SA
Groupes de placement de même nature utilisés

Divers selon
Swiss Life Best Select Invest Plus®

Conseil externe:
Au sein des groupes de placement de même nature, PPCmetrics fournit les prestations suivantes: conseil concernant la bonne structure de mandat, aide à la sélection de gestionnaires de fortune adéquats et soutien dans le cadre de la surveillance continue du gestionnaire 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: 0.57%

a posteriori au: 30/09/2024 0.57%

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.

Commission: Toute disposition divergente dans les règlements relatifs aux émoluments des fondations de libre passage et des fondations de prévoyance 3a demeure réservée.

Protection antidilution: Aperçu des conditions disponible à l'adresse: www.swisslife.ch/fondationdeplacement, «Documents juridiques» (modifications possibles à tout moment sans préavis).

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.

Tracking error ex ante: La tracking error attendue pour les 12 prochains mois correspond à la tracking error ex post des 3 dernières années.

Structure de portefeuille par groupes de placement

	Groupe de placement	Benchmark	max. OPP2
Liquidités	2.16%	2.00%	-
Hypothèques Suisse	0.62%	-	-
Obligations suisses en CHF	13.08%	14.00%	-
Obligations étrangères en CHF	7.08%	7.00%	-
Obl. en monnaies étrangères (couvertes en CHF)	23.55%	24.00%	-
Actions Suisse	18.18%	18.00%	-
Actions Etranger	19.14%	17.00%	-
Actions Etranger (couv. en CHF)	-	-	-
Immobilier Suisse	11.82%	11.00%	30.00%
Immobilier étranger (couvert en CHF)	2.08%	2.00%	10.00%
Placements alternatifs (couverts en CHF)	2.31%	5.00%	15.00%
Total actions (Suisse et Etranger)	37.32%	35.00%	50.00%
Total monnaies étrangères	19.14%	17.00%	30.00%

Les principales positions en actions

NESTLE SA-REG	2.33%
NOVARTIS AG-REG	2.22%
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	2.09%
NVIDIA CORP	1.17%
UBS GROUP AG-REG	1.07%
MICROSOFT CORP	1.04%
ZURICH INSURANCE GROUP AG	0.95%
ABB LTD-REG	0.93%
CIE FINANCIERE RICHEMO-A REG	0.77%
HOLCIM LTD	0.56%

Composition du benchmark

1M Saron	2.00%
SBI Domestic AAA-BBB	14.00%
SBI Foreign AAA-BBB	7.00%
Bloomberg Gl. Agg. Treas. ex CH TR (couv. en CHF)	3.50%
Bloomberg Gl. Agg. Corp. (couv. en CHF)	7.50%
Bloomberg Gl. Agg. Corp. Short Term (couv. en CHF)	8.00%
JP Morgan CEMBI Broad Div IG Index (couv. en CHF)	5.00%
Swiss Performance Index	18.00%
MSCI World ex CH ESG Leaders, in CHF	13.60%
MSCI AC World Small Cap, en CHF	2.55%
MSCI Emerging Markets, en CHF	0.85%
KGAST Immo-Index	11.00%
SL REF (LUX) German Core Real Estate (couv. en CHF)	2.00%
HFRX Global Hedge Funds (couv. en CHF)	5.00%

Structure du portefeuille selon les monnaies

CHF	80.86%
USD	11.05%
JPY	1.11%
EUR	1.05%
Autres	5.92%

Caractéristiques d'investissements sur instruments à taux fixe

Modified Duration	5.73
Note moyenne	A