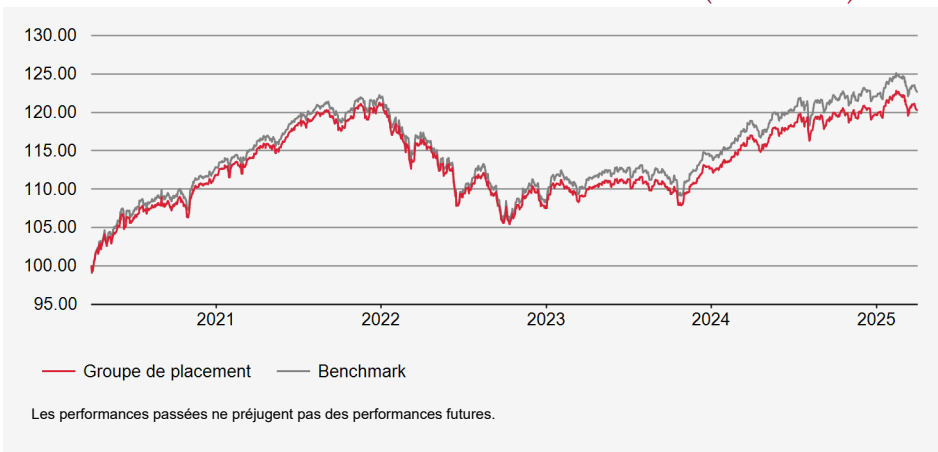


**Fortune nette (VNI) en mio. CHF : 397.19**  
**Valeur nette d'inventaire par droit en CHF : 213.98**

## 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)



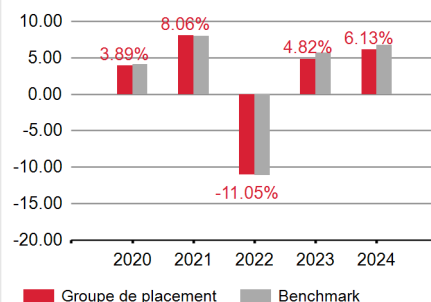
## Performances en devise de référence

|                     | Performances cumulées |        |        |       | Performances annualisées |       |        |         |
|---------------------|-----------------------|--------|--------|-------|--------------------------|-------|--------|---------|
|                     | YTD                   | 1 mois | 3 mois | 1 an  | 3 ans                    | 5 ans | 10 ans | Origine |
| Groupe de placement | 0.54%                 | -1.60% | 0.54%  | 2.82% | 1.24%                    | 3.76% | 2.73%  | 3.29%   |
| Benchmark           | 0.48%                 | -1.64% | 0.48%  | 3.19% | 1.69%                    | 4.17% | 3.13%  | 3.82%   |

## Données statistiques (annualisées)

|  | 1 an  | 3 ans | 5 ans  | 10 ans | Origine |
|--|-------|-------|--------|--------|---------|
| Volatilité du groupe de placement (en %) | 3.99  | 5.62  | 5.52   | 5.23   | 5.19    |
| Volatilité du Benchmark (en %)           | 3.97  | 6.02  | 5.80   | 5.39   | 5.18    |
| Tracking Error ex post (en %)            | 0.24  | 0.55  | 0.52   | 0.56   | 0.63    |
| Information Ratio                        | -1.55 | -0.82 | -0.79  | -0.72  | -0.84   |
| Sharpe Ratio                             | 0.45  | 0.05  | 0.62   | 0.56   | 0.58    |
| Corrélation                              | 1.00  | 1.00  | 1.00   | 0.99   | 0.99    |
| Beta                                     | 1.00  | 0.93  | 0.95   | 0.97   | 0.99    |
| Jensen alpha                             | -0.38 | -0.40 | -0.21  | -0.29  | -0.52   |
| Maximum Drawdown (en %)                  | -2.93 | -9.47 | -13.03 | -13.41 | -21.36  |
| Recovery Period (ans)                    | 0.14  | 1.44  | 2.28   | 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](http://www.swisslife.ch/fondationdeplacement)

**Taux des charges d'exploitation TER KGAST**

**au préalable:** 0.55%

**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](http://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                                     | 3.79%               | 2.00%     | -         |
| Hypothèques Suisse                             | 0.62%               | -         | -         |
| Obligations suisses en CHF                     | 13.09%              | 14.00%    | -         |
| Obligations étrangères en CHF                  | 6.92%               | 7.00%     | -         |
| Obl. en monnaies étrangères (couvertes en CHF) | 21.58%              | 24.00%    | -         |
| Actions Suisse                                 | 18.83%              | 18.00%    | -         |
| Actions Etranger                               | 17.90%              | 17.00%    | -         |
| Actions Etranger (couv. en CHF)                | 0.75%               | -         | -         |
| Immobilier Suisse                              | 11.84%              | 11.00%    | 30.00%    |
| Immobilier étranger (couvert en CHF)           | 2.00%               | 2.00%     | 10.00%    |
| Placements alternatifs (couverts en CHF)       | 2.69%               | 5.00%     | 15.00%    |
| Total actions (Suisse et Etranger)             | 37.48%              | 35.00%    | 50.00%    |
| Total monnaies étrangères                      | 17.90%              | 17.00%    | 30.00%    |

## Les principales positions en actions

|                              |       |
|------------------------------|-------|
| NESTLE SA-REG                | 2.68% |
| ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN | 2.34% |
| NOVARTIS AG-REG              | 2.21% |
| ZURICH INSURANCE GROUP AG    | 1.03% |
| NVIDIA CORP                  | 0.98% |
| MICROSOFT CORP               | 0.98% |
| UBS GROUP AG-REG             | 0.98% |
| CIE FINANCIERE RICHEMO-A REG | 0.94% |
| ABB LTD-REG                  | 0.83% |
| HOLCIM LTD                   | 0.59% |

## 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%  |
| SPI® Total Return                                   | 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    | 81.38% |
| USD    | 12.06% |
| JPY    | 1.03%  |
| EUR    | 0.21%  |
| Autres | 4.60%  |

## Caractéristiques d'investissements sur instruments à taux fixe

|                   |      |
|-------------------|------|
| Modified Duration | 5.50 |
| Note moyenne      | A    |