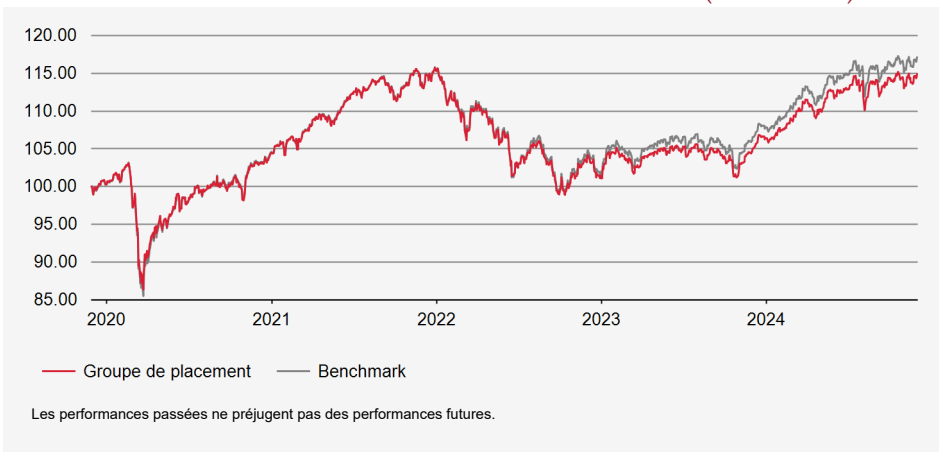


Fortune nette (VNI) en mio. CHF : 685.04
Valeur nette d'inventaire par droit en CHF : 224.36

Stratégie d'investissement

Placement dans toutes les catégories autorisées selon la LPP (part d'actions stratégique: 45%). Allocation active d'actifs. Limitation pour titres de participation: 50%. 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 20%.

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



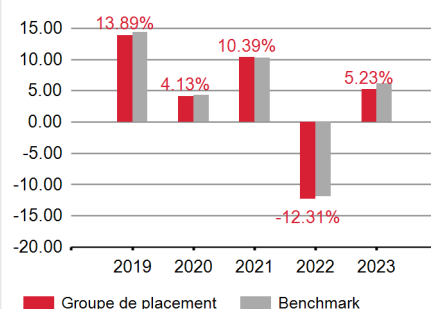
Performances en devise de référence

	Performances cumulées				Performances annualisées			
	YTD	1 mois	3 mois	1 an	3 ans	5 ans	10 ans	Origine
Groupe de placement	8.01%	1.69%	0.69%	9.86%	0.53%	2.82%	3.45%	3.55%
Benchmark	8.61%	1.75%	0.96%	10.43%	1.12%	3.21%	3.99%	4.20%

Données statistiques (annualisées)

	1 an	3 ans	5 ans	10 ans	Origine
Volatilité du groupe de placement (en %)	4.10	6.76	7.23	6.43	6.43
Volatilité du Benchmark (en %)	4.07	7.10	7.55	6.49	6.41
Tracking Error ex post (en %)	0.21	0.55	0.55	0.58	0.66
Information Ratio	-2.78	-1.07	-0.72	-0.94	-0.98
Sharpe Ratio	1.96	-0.04	0.36	0.57	0.51
Corrélation	1.00	1.00	1.00	1.00	0.99
Beta	1.00	0.95	0.96	0.99	1.00
Jensen alpha	-0.61	-0.58	-0.26	-0.49	-0.65
Maximum Drawdown (en %)	-3.98	-14.55	-16.22	-16.22	-28.27
Recovery Period (ans)	0.19	-	0.67	0.67	3.76

Performance



Info. sur le produit

Numéro de valeur: 1245607
ISIN: CH0012456072
LEI: 2549001XL79VZWJO5Q69
Code Bloomberg: SWABM45 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: 0.58%

a posteriori au: 30/09/2024 0.59%

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	1.73%	2.00%	-
Hypothèques Suisse	0.59%	-	-
Obligations suisses en CHF	11.09%	12.00%	-
Obligations étrangères en CHF	5.02%	5.00%	-
Obl. en monnaies étrangères (couvertes en CHF)	19.62%	20.00%	-
Actions Suisse	23.15%	23.00%	-
Actions Etranger	23.96%	22.00%	-
Actions Etranger (couv. en CHF)	-	-	-
Immobilier Suisse	10.61%	9.00%	30.00%
Immobilier étranger (couvert en CHF)	1.74%	2.00%	10.00%
Placements alternatifs (couverts en CHF)	2.49%	5.00%	15.00%
Total actions (Suisse et Etranger)	47.12%	45.00%	50.00%
Total monnaies étrangères	23.96%	22.00%	30.00%

Les principales positions en actions

NESTLE SA-REG	2.97%
NOVARTIS AG-REG	2.82%
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	2.66%
NVIDIA CORP	1.48%
UBS GROUP AG-REG	1.36%
MICROSOFT CORP	1.31%
ZURICH INSURANCE GROUP AG	1.21%
ABB LTD-REG	1.19%
CIE FINANCIERE RICHEMO-A REG	0.98%
ALPHABET INC	0.72%

Composition du benchmark

1M Saron	2.00%
SBI Domestic AAA-BBB	12.00%
SBI Foreign AAA-BBB	5.00%
Bloomberg Gl. Agg. Treas. ex CH TR (couv. en CHF)	2.50%
Bloomberg Gl. Agg. Corp. (couv. en CHF)	6.50%
Bloomberg Gl. Agg. Corp. Short Term (couv. en CHF)	7.00%
JP Morgan CEMBI Broad Div IG Index (couv. en CHF)	4.00%
Swiss Performance Index	23.00%
MSCI World ex CH ESG Leaders, in CHF	17.60%
MSCI AC World Small Cap, en CHF	3.30%
MSCI Emerging Markets, en CHF	1.10%
KGAST Immo-Index	9.00%
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	76.04%
USD	14.42%
JPY	1.40%
EUR	1.37%
Autres	6.78%

Caractéristiques d'investissements sur instruments à taux fixe

Modified Duration	5.85
Note moyenne	A