

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%

Informations sur le produit

| | |
|---------------------------|----------------------|
| Numéro de valeur | 1245606 |
| ISIN | CH0012456064 |
| LEI | 254900SR5GM6HP44F130 |
| Bloomberg Ticker | SWABM35 SW |
| Benchmark | customized |
| Monnaie | CHF |
| Date de création | 30.09.2001 |
| Valeur de lancement | 100.00 |
| Clôture de l'exercice | 30.09. |
| Souscription/Rachat | journalier |
| Délai final d'acceptation | 14h00 |

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

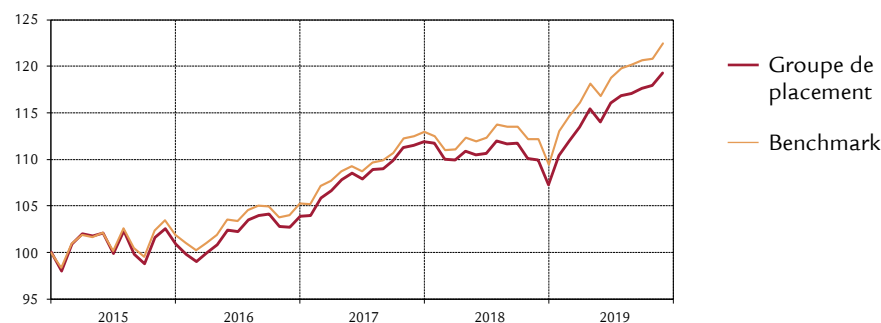
| | |
|---------------------------------------------------------|--------------------------------------------------------------------------------------------------|
| Publication de cours | Bloomberg: ASSL |
| | www.swisslife.ch/fondationdeplacement |
| Taux des charges d'exploitation TER _{KGAST} ** | |
| - au préalable | 0.59% |
| - a posteriori au 30.09.2019 | 0.60% |
| Comm. de souscription/rachat *** | aucune |
| Pratique de distribution | Capitalisation |

* 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

** 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

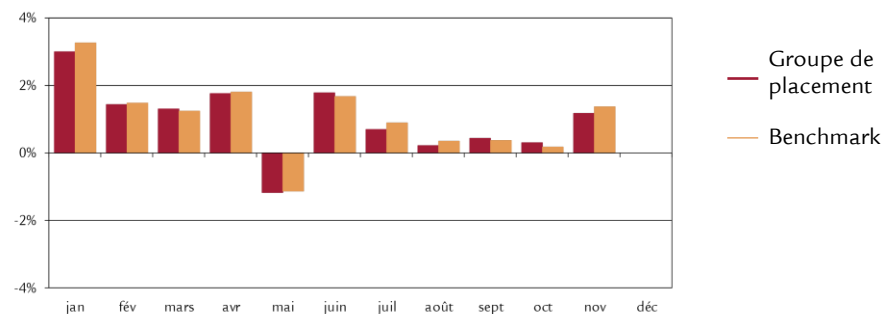
*** Toute disposition divergente dans les règlements relatifs aux émoluments des fondations de libre passage et des fondations de prévoyance 3a demeure réservée

Evolution du cours indexée et performance



| Performance | 1M | 3M | 1A | 3A | 5A | 10Ap.a. depuis | |
|----------------------------|-------|-------|------|------|------|----------------|----------|
| | | | | p.a. | p.a. | p.a. | 30.09.01 |
| Groupe de placement (en %) | 1.15 | 1.88 | 8.49 | 5.11 | 3.66 | 4.91 | 3.63 |
| Benchmark (en %) | 1.37 | 1.91 | 9.22 | 5.61 | 4.24 | 5.26 | 4.26 |
| | YTD | 2018 | 2017 | 2016 | 2015 | 2014 | 2013 |
| Groupe de placement (en %) | 11.26 | -4.20 | 7.79 | 2.89 | 0.92 | 9.01 | 7.87 |
| Benchmark (en %) | 11.91 | -3.07 | 7.29 | 3.32 | 1.86 | 9.36 | 7.99 |

Performance mensuelle



Données statistiques (annualisées)

| | 1A | 3A | 5A | 10A | depuis | |
|------------------------------------------|-------|-------|-------|-------|----------|--|
| | | | | | 30.09.01 | |
| Volatilité du groupe de placement (en %) | 4.99 | 3.69 | 4.39 | 4.06 | 4.91 | |
| Volatilité Benchmark (en %) | 5.07 | 3.66 | 4.15 | 3.81 | 4.78 | |
| Tracking Error ex post (en %) | 0.46 | 0.49 | 0.55 | 0.52 | 0.63 | |
| Tracking Error ex ante (en %) | 0.50 | | | | | |
| Information Ratio | -1.59 | -1.03 | -1.05 | -0.68 | -1.00 | |
| Sharpe Ratio | 1.78 | 1.55 | 0.98 | 1.26 | 0.65 | |
| Corrélation | 1.00 | 0.99 | 0.99 | 0.99 | 0.99 | |
| Beta | 0.98 | 1.00 | 1.05 | 1.06 | 1.02 | |
| Jensen-Alpha | -0.48 | -0.48 | -0.80 | -0.66 | -0.68 | |
| Maximum Drawdown (en %) | -3.35 | -5.72 | -6.84 | -9.99 | -21.36 | |
| Recovery Period (ans) | 0.09 | 0.23 | 0.44 | 0.44 | 3.00 | |

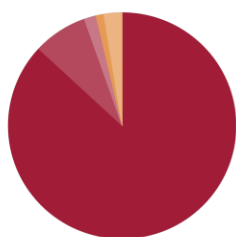
Chiffres caractéristiques

| | 31.12.2018 | 30.11.2019 |
|-------------------------------------------|------------|------------|
| Fortune en mio. CHF | 182.0 | 210.8 |
| Valeur nette d'inventaire par part en CHF | 171.86 | 191.21 |

Structure de portefeuille par groupes de placement

| | Groupe de placement | Benchmark | max. OPP2 |
|------------------------------------------------|---------------------|-------------|-----------|
| Liquidités | 0.4% | 2% | |
| Obligations suisses en CHF | 9.4% | 14% | |
| Obligations étrangères en CHF | 4.5% | 7% | |
| Obl. en monnaies étrangères (couvertes en CHF) | 28.8% | 24% | |
| Actions Suisse | 16.6% | 18% | |
| Actions Etranger | 13.1% | 17% | |
| Actions Etranger (couv. en CHF) | 10.2% | 0% | |
| Immobilier Suisse | 12.9% | 11% | 30% |
| Immobilier étranger (couvert en CHF) | 2.0% | 2% | 10% |
| Placements alternatifs (couverts en CHF) | 2.1% | 5% | 15% |
| Total | 100.0% | 100% | |
| <hr/> | | | |
| Total actions (Suisse et Etranger) | 39.9% | 35% | 50% |
| Total monnaies étrangères | 13.1% | 17% | 30% |

Structure du portefeuille selon les monnaies



| | |
|--------|-------|
| CHF | 86.9% |
| USD | 7.7% |
| EUR | 1.7% |
| JPY | 1.1% |
| Autres | 2.6% |

Caractéristiques des placements à revenu fixe

| | |
|-------------------|------|
| Modified Duration | 6.05 |
| Rating moyenne | A |

Composition du benchmark

| | |
|-----------------------------------------------------|---------------|
| Citigroup CHF 1 M Euro Depo | 2% |
| SBI Domestic AAA-BBB | 14% |
| SBI Foreign AAA-BBB | 7% |
| BB* Gl. Agg Treas ex CH TR (couv. en CHF) | 3.5% |
| BB* Gl. Agg. Corp. (couv. en CHF) | 7.5% |
| BB* Gl. Agg. Corp. Short Term (couv. en CHF) | 8% |
| JP Morgan CEMBI Broad Div IG Index (couv. en CHF) | 5% |
| Swiss Performance Index | 18% |
| MSCI World ex CH, en CHF | 13.6% |
| MSCI AC World Small Cap, en CHF | 2.55% |
| MSCI Emerging Markets, en CHF | 0.85% |
| KGAST Immo-Index | 11% |
| SL REF (LUX) German Core Real Estate (couv. en CHF) | 2% |
| HFRX Global Hedge Funds (couv. en CHF) | 5% |
| Total | 100.0% |

* Bloomberg Barclays

Disclaimer

La présente publication ne constitue ni une incitation ni une recommandation pour la vente ou l'achat d'instruments de placement, et son but est uniquement d'informer. Tous les documents constituant la base légale dans le cadre d'un éventuel placement peuvent être obtenus gratuitement auprès de la Fondation de placement Swiss Life, case postale, 8022 Zurich, tél. 043 284 79 79. Le cercle des investisseurs est limité aux institutions du 2e pilier et du pilier 3a, ainsi que les autres institutions de prévoyance professionnelle exonérées d'impôts avec siège en Suisse et aux personnes qui gèrent des placements collectifs pour les institutions selon l'al. 1, let. a, qui sont soumises à la surveillance de l'Autorité fédérale de surveillance des marchés financiers et qui ne placent dans la fondation que des fonds destinés à ces institutions.

La performance passée ne saurait présumer de l'évolution en cours ou à venir. Les données relatives aux performances ne tiennent pas compte des commissions et frais éventuellement prélevés au moment de l'émission ou du rachat des parts.