

31 mars 2025

Fondation de placement Swiss Life Actions Suisse

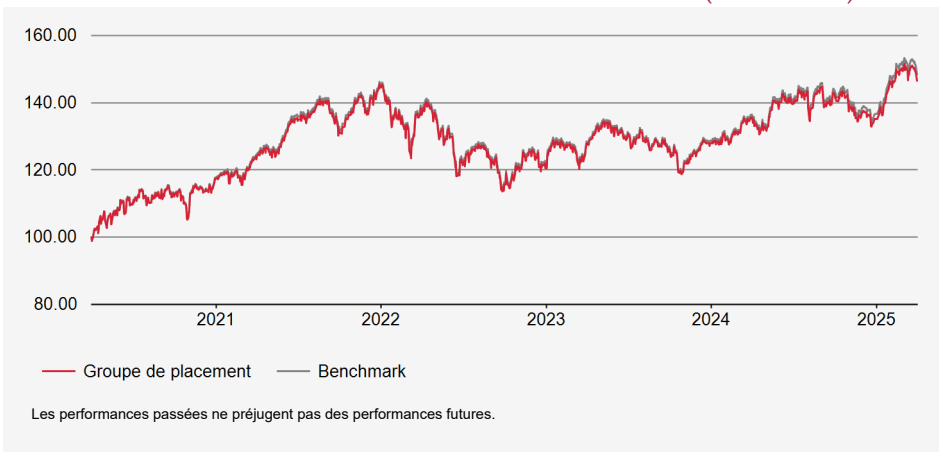


Fortune nette (VNI) en mio. CHF : 578.23
Valeur nette d'inventaire par droit en CHF : 367.67

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 Index Funds (CH) Equity Switzerland Large Cap et SL iFunds 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)



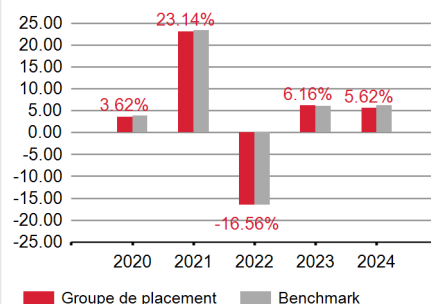
Performances en devise de référence

	Performances cumulées				Performances annualisées			
	YTD	1 mois	3 mois	1 an	3 ans	5 ans	10 ans	Origine
Groupe de placement	8.38%	-2.14%	8.38%	8.06%	2.41%	7.94%	5.96%	5.69%
Benchmark	8.58%	-2.04%	8.58%	8.79%	2.63%	8.21%	6.27%	6.20%

Données statistiques (annualisées)

	1 an	3 ans	5 ans	10 ans	Origine
Volatilité du groupe de placement (en %)	12.03	12.39	12.59	11.98	12.84
Volatilité du Benchmark (en %)	11.98	12.41	12.60	12.02	13.16
Tracking Error ex post (en %)	0.18	0.32	0.32	0.31	1.16
Information Ratio	-4.07	-0.71	-0.87	-1.00	-0.50
Sharpe Ratio	0.56	0.12	0.58	0.51	0.41
Corrélation	1.00	1.00	1.00	1.00	1.00
Beta	1.00	1.00	1.00	1.00	0.97
Jensen alpha	-0.76	-0.22	-0.27	-0.29	-0.34
Maximum Drawdown (en %)	-8.13	-18.94	-21.88	-25.88	-54.46
Recovery Period (ans)	0.11	1.64	2.35	0.83	4.97

Performance



Info. sur le produit

Numéro de valeur: 1245481
ISIN: CH0012454812
LEI: 254900UNZU5YPIKQTQ23
Code Bloomberg: SWAAKCH SW
Benchmark: SPI® Total Return
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: 13h00
Protection antidilution:
Commission d'émission / de rachat en faveur du groupe de placement selon l'aperçu des conditions.

Pratique de distribution: Capitalisation

Asset Manager selon Swiss Life Best Select Invest Plus® Large Caps (passive)
Swiss Life Asset Management AG
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: 0.44%

a posteriori au: 30/09/2024 0.51%

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.

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 du portefeuille par branches

	Groupe de placement	Benchmark
Santé	34.04%	33.99%
Finance	19.07%	19.96%
Biens de consommation de base	16.53%	16.33%
Industrie	12.08%	11.77%
Matériaux	7.80%	7.85%
Consommation discrétionnaire	5.31%	5.72%
Technologie de l'information	1.75%	1.59%
Services de communication	0.79%	1.03%
Immobilier	0.60%	1.55%
Services aux collectivités	0.38%	0.22%
Energie	-	-
Liquidités	1.65%	-

Les positions principales

	Groupe de placement	Benchmark
NESTLE SA-REG	14.25%	14.26%
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	12.42%	12.44%
NOVARTIS AG-REG	11.74%	11.75%
ZURICH INSURANCE GROUP AG	5.48%	5.48%
UBS GROUP AG-REG	5.19%	5.20%
CIE FINANCIERE RICHEMO-A REG	5.00%	5.01%
ABB LTD-REG	4.39%	4.40%
HOLCIM LTD	3.12%	3.12%
SWISS RE AG	2.68%	2.69%
ALCON INC	2.53%	2.53%

Avertissement: 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, c/o Swiss Life SA, case postale, 8022 Zurich, tél. 043 547 71 11 et sur www.swisslife.ch/anlagestiftung. 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, qui sont soumises à la surveillance de l'Autorité fédérale de surveillance des marchés financiers FINMA 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. Leur utilisation n'implique aucune adhésion ni affiliation de leur part. **Source:** Swiss Life Asset Managers. Tous droits réservés.