

31 mars 2025

Fondation de placement Swiss Life Actions Suisse Large Caps Indexées

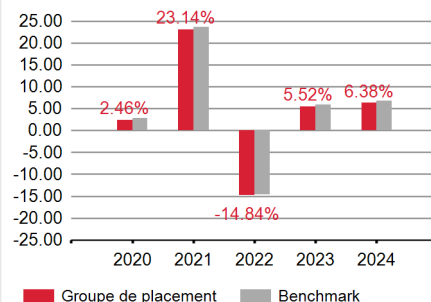


Fortune nette (VNI) en mio. CHF : 699.96
Valeur nette d'inventaire par droit en CHF : 162.83

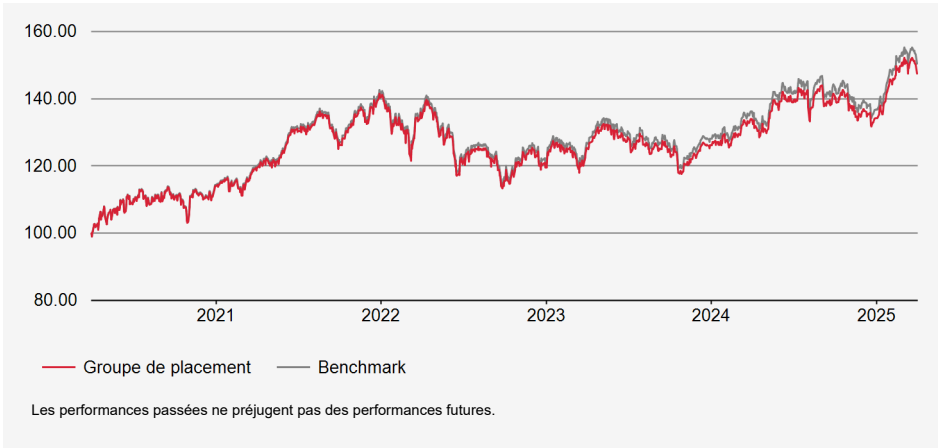
Stratégie d'investissement

Le groupe de placement est géré selon une approche indexée et se distingue par une large diversification et une faible erreur de suivi. L'objectif de placement consiste à reproduire au mieux le benchmark SPI® 20 Total Return. Réalisation au moyen du Swiss Life Index Funds (CH) Equity Switzerland Large Cap; fonds de placement contractuel de droit suisse du type "Autres fonds en placements traditionnels". Aucun securities lending (prêt de valeurs mobilières) n'est pratiqué et aucun investissement n'est effectué dans des titres dont l'exclusion est recommandée par l'Association suisse pour des investissements responsables (www.svvk-asir.ch).

Performance



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



Info. sur le produit

Numéro de valeur: 39561885
ISIN: CH0395618850
LEI: 254900P0FZIREAGSUQ60
Code Bloomberg: SLASLCI SW
Benchmark: SPI® 20 Total Return
Monnaie: CHF
Pays d'origine: Suisse
Date de création: 01/02/2018
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®:
Swiss Life Asset Management AG

Conseil externe:
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: 0.16%

a posteriori au: 30/09/2024 0.26%

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	9.86%	-1.90%	9.86%	10.10%	3.18%	8.08%	-	7.04%
Benchmark	9.97%	-1.90%	9.97%	10.43%	3.57%	8.51%	-	7.45%

Données statistiques (annualisées)

	1 an	3 ans	5 ans	10 ans	Origine
Volatilité du groupe de placement (en %)	12.62	12.38	12.50	-	12.40
Volatilité du Benchmark (en %)	12.74	12.45	12.56	-	12.45
Tracking Error ex post (en %)	0.15	0.10	0.09	-	0.08
Information Ratio	-2.27	-3.90	-5.01	-	-4.95
Sharpe Ratio	0.69	0.18	0.60	-	0.55
Corrélation	1.00	1.00	1.00	-	1.00
Beta	0.99	0.99	1.00	-	1.00
Jensen alpha	-0.24	-0.37	-0.39	-	-0.38
Maximum Drawdown (en %)	-8.49	-18.85	-19.89	-	-25.04
Recovery Period (ans)	0.11	1.69	1.69	-	1.00

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.

Principales positions

	Groupe de placement	Benchmark
NESTLE SA-REG	17.72%	17.72%
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	15.45%	15.45%
NOVARTIS AG-REG	14.60%	14.60%
ZURICH INSURANCE GROUP AG	6.81%	6.81%
UBS GROUP AG-REG	6.46%	6.46%
CIE FINANCIERE RICHEMO-A REG	6.22%	6.23%
ABB LTD-REG	5.46%	5.46%
HOLCIM LTD	3.88%	3.88%
SWISS RE AG	3.34%	3.34%
ALCON INC	3.15%	3.15%

Structure du portefeuille par branches

	Groupe de placement	Benchmark
Santé	37.11%	37.12%
Finance	20.49%	20.49%
Biens de consommation de base	17.72%	17.72%
Matériaux	8.80%	8.80%
Industrie	7.71%	7.71%
Consommation discrétionnaire	6.22%	6.23%
Services de communication	0.98%	0.98%
Technologie de l'information	0.94%	0.95%
Liquidités	0.03%	-

Structure du portefeuille selon les pays/régions

	Groupe de placement	Benchmark
Suisse	99.97%	100.00%
Liquidités	0.03%	-

Structure du portefeuille selon les monnaies

	Groupe de placement	Benchmark
CHF	100.00%	100.00%