

Fondation de placement Swiss Life

Actions Global ex Suisse ESG PM

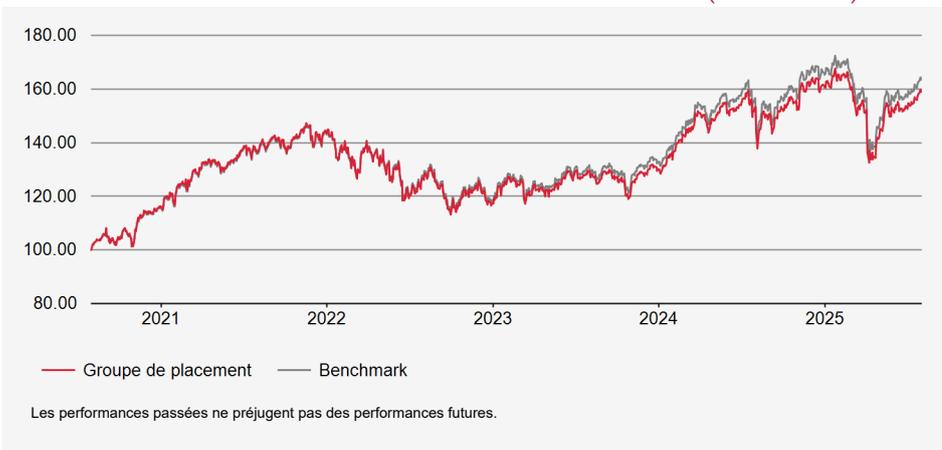


Fortune nette (VNI) en mio. CHF : 53.67
Valeur nette d'inventaire par droit en CHF : 201.07

Stratégie d'investissement

Placement dans des titres de participation émis par des sociétés domiciliées à l'étranger. Les grosses & moyennes capitalisations sont couvertes passivement, les petites capitalisations ainsi que le secteur des marchés émergents sont gérés activement («core-satellite»). Limite par société: 5% (exception : si la pondération est supérieure à 5% au sein de l'indice; alors 10% au maximum). Sociétés hors benchmark: max. 10%. Réalisation au moyen du Swiss Life Index Funds II (CH) Equity ESG Global ex Switzerland PF, Invesco Global Small Cap Equity Fund, Dimensional Global Small Cap Equity Fund, du fonds Amundi Emerging Markets Equity Focus et du fonds Robeco Emerging Markets Equities.

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	-1.03%	3.62%	11.94%	3.70%	7.79%	9.70%	7.57%	3.92%
Benchmark	-1.13%	3.63%	11.94%	4.34%	8.53%	10.32%	8.11%	4.45%

Données statistiques (annualisées)

	1 an	3 ans	5 ans	10 ans	Origine
Volatilité du groupe de placement (en %)	14.51	14.18	14.32	14.81	15.74
Volatilité du Benchmark (en %)	14.44	14.17	14.28	14.73	15.74
Tracking Error ex post (en %)	0.63	0.50	0.51	0.58	0.90
Information Ratio	-1.02	-1.49	-1.21	-0.94	-0.59
Sharpe Ratio	0.21	0.46	0.62	0.51	0.24
Corrélation	1.00	1.00	1.00	1.00	1.00
Beta	1.00	1.00	1.00	1.00	1.00
Jensen alpha	-0.66	-0.74	-0.63	-0.59	-0.53
Maximum Drawdown (en %)	-20.89	-20.89	-23.15	-34.64	-59.96
Recovery Period (ans)	-	-	1.47	0.67	7.75

PM tranche: L'acquisition de cette tranche n'est possible que dans le cadre d'une convention spéciale avec Swiss Life Asset Management SA.

Benchmark: Jusqu'au 31.03.2022 80% MSCI World ex CH en CHF, 15% MSCI AC World Small Cap en CHF, 5% MSCI Emerging Markets en CHF - Jusqu'au 31.12.2009 100% MSCI World, ex CH, en CHF.

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.

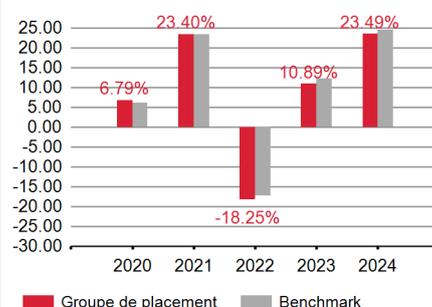
Taux des charges d'exploitation TER KGAST: Le taux des charges d'exploitation TER KGAST couvre tous les coûts à l'exception des frais de transaction et des prélèvements fiscaux sur les transactions.

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.

Performance



Info. sur le produit

Numéro de valeur: 3026051

ISIN: CH0030260514

LEI: 2549000B6X3SG0K4LZ68

Code Bloomberg: SLAAUPM SW

Benchmark: 80% MSCI World ex Switzerland Selection TR, 15% MSCI AC World Small Cap NR, 5% MSCI Emerging Markets NR

Monnaie: CHF

Pays d'origine: Suisse

Date de création: 31/05/2007

Valeur de lancement: 100.00

Clôture de l'exercice: 30.09

Souscription/Rachat: journalier

Délai final d'acceptation: 14h00 (J-1)

Protection antidilution:

Commission d'émission / de rachat en faveur du groupe de placement selon l'aperçu des conditions.

Asset Management selon

Swiss Life Best Select Invest Plus @:

Large & Mid Caps (Indexée) Swiss Life Asset Management SA Small Caps (active) 50% Invesco / 50% Dimensional marchés Émergents (active) 50% Amundi / 50% Robeco

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: ASL
www.swisslife.ch/fondationdeplacement

Taux des charges d'exploitation TER KGAST

au préalable: 0.28%

a posteriori au: 30/09/2024 0.38%

Structure du portefeuille par branches

	Groupe de placement	Benchmark
Technologie de l'information	29.22%	28.02%
Finance	16.88%	16.34%
Industrie	11.27%	12.10%
Consommation discrétionnaire	10.16%	9.99%
Santé	8.56%	8.77%
Services de communication	8.18%	7.84%
Biens de consommation de base	5.20%	5.38%
Matériaux	3.40%	3.90%
Immobilier	2.46%	2.94%
Energie	2.26%	2.65%
Services aux collectivités	1.98%	2.07%
Liquidités	0.42%	-

Structure du portefeuille selon les pays/régions

	Groupe de placement	Benchmark
Etats-Unis	66.88%	68.27%
Autres pays Asie	5.89%	4.50%
Japon	5.38%	6.32%
Autres pays européens	4.93%	5.30%
Royaume-Uni	3.04%	2.90%
Canada	2.98%	3.22%
France	2.71%	2.65%
Allemagne	1.20%	1.21%
Grande-Bretagne	0.44%	0.65%
Autres	6.13%	4.98%
Liquidités	0.42%	-

Les positions principales

	Groupe de placement	Benchmark
NVIDIA CORP	9.41%	8.96%
MICROSOFT CORP	8.17%	7.78%
ALPHABET INC-CL A	2.43%	2.31%
ALPHABET INC-CL C	2.07%	1.97%
TESLA INC	1.93%	1.84%
ELI LILLY & CO	1.29%	1.23%
VISA INC-CLASS A SHARES	1.29%	1.23%
MASTERCARD INC - A	1.00%	0.95%
TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFACTURING CO LT	0.88%	0.54%
JOHNSON & JOHNSON	0.86%	0.82%

Structure du portefeuille selon les monnaies

	Groupe de placement	Benchmark
USD	68.02%	68.76%
EUR	7.67%	7.32%
JPY	5.39%	6.32%
GBP	3.45%	3.55%
CHF	0.10%	0.25%
Autres	15.38%	13.81%