

31 mars 2025

Fondation de placement Swiss Life

Actions Global Protect Flex PM (couvertes en CHF)

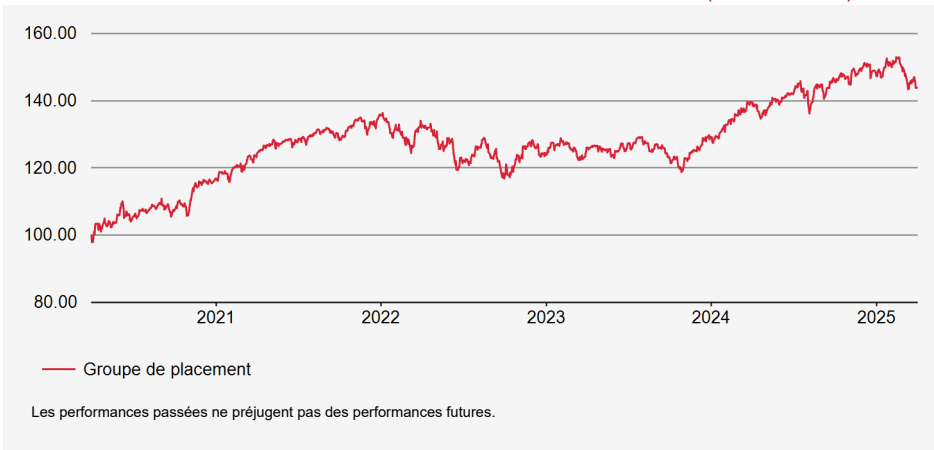


Fortune nette (VNI) en mio. CHF : 426.82
Valeur nette d'inventaire par droit en CHF : 158.17

Stratégie d'investissement

Stratégie d'actions active basée sur des règles avec stratégie de couverture complémentaire. L'univers de placement se compose de sociétés des indices boursiers étrangers (notamment S&P 500, Euro Stoxx 50, FTSE 100 et Nikkei 225) ainsi que du SMI; pondération selon la capitalisation. Les risques de change sont couverts à raison de 90 % au moins par rapport au franc suisse. Possibilité d'effectuer des investissements sous forme de titres de participation, de placements collectifs ou d'instruments dérivés. Mise en place d'une stratégie de couverture complémentaire composée d'options sous forme de liquidités permet, en cas de fortes baisses des marchés, de réduire les pertes de cours, et, en cas de fortes hausses, de limiter le potentiel haussier (Put Spread Collar). Selon les estimations du marché, il est possible de renoncer à la vente d'options put et/ou d'option call. Réalisation au moyen du SLF (CH) Equity Global Protect (CHF hedged).

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



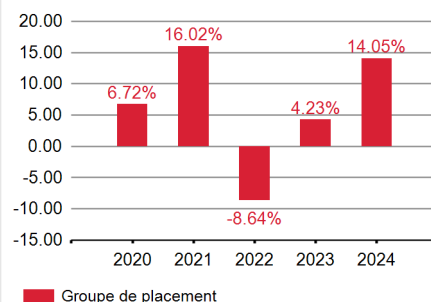
Performances en devise de référence

	Performances cumulées				Performances annualisées			
	YTD	1 mois	3 mois	1 an	3 ans	5 ans	10 ans	Origine
Groupe de placement	-2.35%	-3.94%	-2.35%	3.14%	2.91%	7.54%	-	5.27%

Données statistiques (annualisées)

	1 an	3 ans	5 ans	10 ans	Origine
Volatilité du groupe de placement (en %)	7.81	10.07	9.72	-	8.46
Sharpe Ratio	0.27	0.19	0.72	-	0.63
Maximum Drawdown (en %)	-6.60	-12.21	-14.29	-	-15.96
Recovery Period (ans)	0.14	1.36	1.42	-	0.63

Performance



Info. sur le produit

Numéro de valeur: 31954200
ISIN: CH0319542004
LEI: 254900LUAQC3MC0MWL48
Code Bloomberg: SLAGCPM SW
Monnaie: CHF
Pays d'origine: Suisse
Date de création: 29/04/2016
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 Asset Management SA
Publication de cours: Bloomberg: ASSL
www.swisslife.ch/fondationdeplacement
Taux des charges d'exploitation TER KGAST
au préalable: 0.14%
a posteriori au: 30/09/2024 0.15%

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

Fondation de placement Swiss Life

Actions Global Protect Flex PM (couvertes en CHF)

Structure du portefeuille par branches

	Groupe de placement
Technologie de l'information	15.72%
Finance	15.61%
Santé	12.48%
Industrie	11.31%
Biens de consommation de base	7.81%
Consommation discrétionnaire	7.71%
Services aux collectivités	5.87%
Services de communication	5.21%
Energie	3.47%
Immobilier	3.46%
Matériaux	2.72%
Future sur indice actions	1.11%
Liquidités	7.51%

Principales positions

	Groupe de placement
CONSOLIDATED EDISON INC	0.89%
CHUBB LTD	0.85%
INTL BUSINESS MACHINES CORP	0.84%
WALMART INC	0.79%
PROGRESSIVE CORP	0.78%
REPUBLIC SERVICES INC	0.72%
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	0.72%
WASTE CONNECTIONS INC	0.69%
ABBVIE INC	0.69%
AUTOZONE INC	0.68%

Structure du portefeuille selon les pays/régions

	Groupe de placement
USA et Canada	68.38%
Région Européenne (EUR)	10.15%
Région Asie et Pacifique	7.15%
Région Européenne (Ex EUR)	5.29%
Future sur indice actions	1.11%
Marchés Émergents Amériques	0.42%
Liquidités	7.51%