

31 mars 2025

# Fondation de placement Swiss Life

## Actions Global Small Caps PM

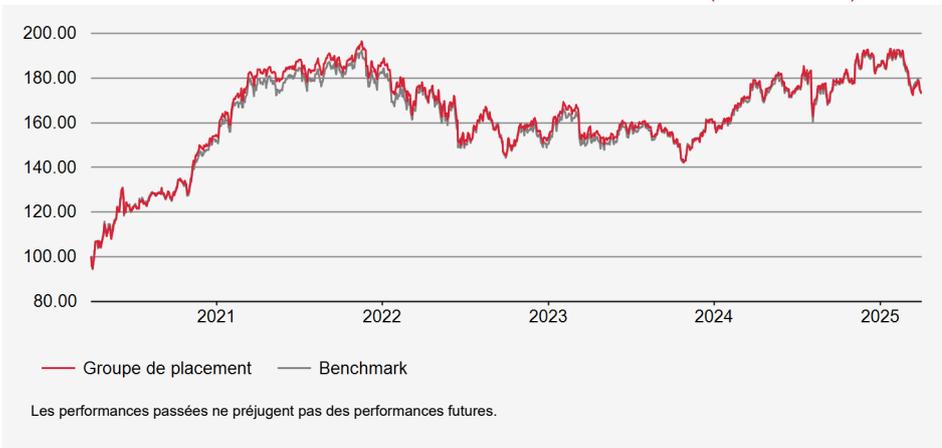


**Fortune nette (VNI) en mio. CHF : 208.69**  
**Valeur nette d'inventaire par droit en CHF : 120.59**

### Stratégie d'investissement

Placement dans des titres de participation à faible capitalisation du monde entier. Sélection active des pays, des branches et des titres. Limite par société: 5%. Réalisation au moyen du Invesco Global Small Cap Equity Fund et Dimensional Global Small Cap Equity Fund.

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



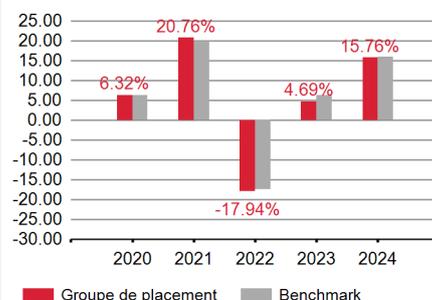
### Performances en devise de référence

	Performances cumulées				Performances annualisées			
	YTD	1 mois	3 mois	1 an	3 ans	5 ans	10 ans	Origine
Groupe de placement	-6.70%	-5.99%	-6.70%	-3.24%	-0.21%	11.61%	-	2.68%
Benchmark	-6.25%	-5.15%	-6.25%	-2.14%	0.25%	11.68%	-	4.11%

### Données statistiques (annualisées)

	1 an	3 ans	5 ans	10 ans	Origine
Volatilité du groupe de placement (en %)	13.85	16.86	16.85	-	19.12
Volatilité du Benchmark (en %)	12.49	16.55	16.37	-	18.71
Tracking Error ex post (en %)	2.16	1.91	1.93	-	2.33
Information Ratio	-0.51	-0.24	-0.04	-	-0.62
Sharpe Ratio	-0.31	-0.07	0.64	-	0.14
Corrélation	0.99	0.99	0.99	-	0.99
Beta	1.10	1.01	1.02	-	1.01
Jensen alpha	-0.79	-0.44	-0.33	-	-1.49
Maximum Drawdown (en %)	-12.06	-19.38	-27.52	-	-41.60
Recovery Period (ans)	0.25	0.40	-	-	0.73

### Performance



### Info. sur le produit

**Numéro de valeur:** 40068790  
**ISIN:** CH0400687908  
**LEI:** 254900XCUD9NTWJQU706  
**Code Bloomberg:** SLAGSPM SW  
**Benchmark:** MSCI AC World Small Cap, en CHF  
**Monnaie:** CHF  
**Pays d'origine:** Suisse  
**Date de création:** 28/02/2018  
**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@:** 50% Invesco / 50% Dimensional  
**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](http://www.swisslife.ch/fondationdeplacement)  
**Taux des charges d'exploitation TER KGAST**  
**au préalable:** 0.59%  
**a posteriori au:** 30/09/2024 0.59%

**PM tranche:** L'acquisition de cette tranche n'est possible que dans le cadre d'une convention spéciale avec Swiss Life Asset Management SA.  
**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](http://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
Industrie	20.35%	19.66%
Finance	17.19%	15.77%
Consommation discrétionnaire	13.04%	12.54%
Santé	11.93%	9.38%
Technologie de l'information	11.78%	10.48%
Matériaux	6.94%	7.95%
Immobilier	6.04%	8.46%
Biens de consommation de base	4.11%	4.92%
Services de communication	3.34%	3.48%
Energie	3.04%	4.39%
Services aux collectivités	1.69%	2.97%
Liquidités	0.55%	-

### Structure du portefeuille selon les pays/régions

	Groupe de placement	Benchmark
Etats-Unis	59.17%	56.45%
Japon	8.09%	12.08%
Grande-Bretagne	6.91%	4.49%
Canada	2.28%	3.48%
France	2.02%	1.11%
Allemagne	1.80%	1.38%
Autres pays européens	10.58%	8.48%
Autres pays Asie	5.52%	8.29%
Autres	3.09%	4.23%
Liquidités	0.55%	-

### Indications supplémentaires sur les sociétés

Nombre de sociétés	6,667
Part de sociétés hors du benchmark	22.96%

### Les positions principales

	Groupe de placement	Benchmark
ASKER HEALTHCARE	1.11%	-
SIGMAROC	0.55%	0.01%
CACTUS	0.53%	0.02%
PINNACLE FINANCIAL PARTNERS	0.51%	0.05%
OLLIES BARGAIN OUTLET	0.50%	0.04%
CASTROL INDIA	0.49%	0.01%
MR COOPER	0.47%	0.04%
PIPER SANDLER	0.46%	0.02%
PLANISWARE	0.45%	0.00%
BANCORP	0.44%	0.01%

### Structure du portefeuille selon les monnaies

	Groupe de placement	Benchmark
USD	61.73%	56.78%
EUR	8.34%	6.15%
JPY	8.13%	12.08%
GBP	6.51%	4.49%
CHF	1.78%	1.50%
Autres	13.50%	19.00%