

31 mars 2025

Fondation de placement Swiss Life

Actions Suisse Protect Flex PM



Fortune nette (VNI) en mio. CHF : 107.45
Valeur nette d'inventaire par droit en CHF : 122.08

Stratégie d'investissement

Stratégie d'investissement indexée sur l'indice SMI avec stratégie de couverture des options gérée activement. L'univers de placement du groupe de placement se compose de sociétés du SMI; pondération en fonction de la capitalisation. 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. 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 Switzerland Protect Enhanced.

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



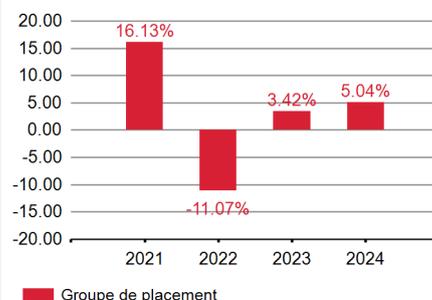
Performances en devise de référence

	Performances cumulées				Performances annualisées			
	YTD	1 mois	3 mois	1 an	3 ans	5 ans	10 ans	Origine
Groupe de placement	7.58%	-1.52%	7.58%	7.46%	2.62%	-	-	4.77%

Données statistiques (annualisées)

	1 an	3 ans	5 ans	10 ans	Origine
Volatilité du groupe de placement (en %)	9.97	9.05	-	-	9.18
Sharpe Ratio	0.62	0.18	-	-	0.45
Maximum Drawdown (en %)	-7.08	-13.72	-	-	-15.16
Recovery Period (ans)	0.11	1.63	-	-	1.69

Performance



Info. sur le produit

Numéro de valeur: 58002364
ISIN: CH0580023643
LEI: 254900ZUTROYHLYQ4E86
Code Bloomberg: SLSPFPM SW
Monnaie: CHF
Pays d'origine: Suisse
Date de création: 18/12/2020
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: 0.15%

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.

Structure du portefeuille par branches

	Groupe de placement
Santé	34.98%
Finance	19.09%
Biens de consommation de base	14.45%
Matériaux	8.10%
Industrie	7.20%
Future sur indice actions	6.62%
Consommation discrétionnaire	5.76%
Services de communication	0.91%
Technologie de l'information	0.85%
Liquidités	2.04%

Principales positions

	Groupe de placement
NESTLE SA-REG	14.45%
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	14.30%
NOVARTIS AG-REG	14.05%
ZURICH INSURANCE GROUP AG	6.31%
UBS GROUP AG-REG	6.09%
CIE FINANCIERE RICHEMO-A REG	5.76%
ABB LTD-REG	5.12%
HOLCIM LTD	3.59%
SWISS RE AG	3.05%
ALCON INC	2.91%