

# Fondation de placement Swiss Life

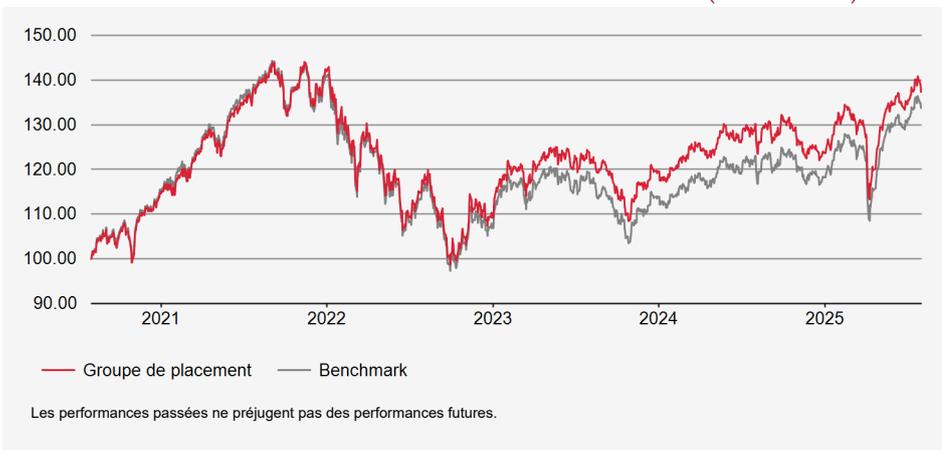
## Actions Suisse Small & Mid Caps PM

**Fortune nette (VNI) en mio. CHF : 175.54**  
**Valeur nette d'inventaire par droit en CHF : 139.11**

### Stratégie d'investissement

Placement dans des titres de participation de sociétés représentées dans le Swiss Performance Index Extra. Sélection active des branches et des titres. Limite par société: 5% (exception: à condition que les sociétés soient dans le benchmark; max. 5% points de plus que pondération dans le benchmark). Réalisation au moyen du Swiss Life iFunds (CH) Equity Switzerland Small & Mid Cap (CHF); Fonds de placement de droit suisse de la catégorie "Autres fonds en investissements traditionnels"

### 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	11.02%	1.85%	7.90%	5.51%	5.30%	6.55%	-	4.50%
Benchmark	13.11%	2.36%	9.21%	8.73%	4.86%	5.99%	-	3.83%

### Données statistiques (annualisées)

	1 an	3 ans	5 ans	10 ans	Origine
Volatilité du groupe de placement (en %)	11.32	12.90	14.45	-	15.01
Volatilité du Benchmark (en %)	10.63	12.64	14.24	-	14.94
Tracking Error ex post (en %)	1.10	1.71	1.63	-	1.59
Information Ratio	-2.91	0.26	0.34	-	0.42
Sharpe Ratio	0.42	0.32	0.42	-	0.30
Corrélation	1.00	0.99	0.99	-	0.99
Beta	1.06	1.01	1.01	-	1.00
Jensen alpha	-3.71	0.40	0.51	-	0.67
Maximum Drawdown (en %)	-15.74	-17.68	-31.46	-	-31.46
Recovery Period (ans)	0.11	0.34	-	-	-

**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.

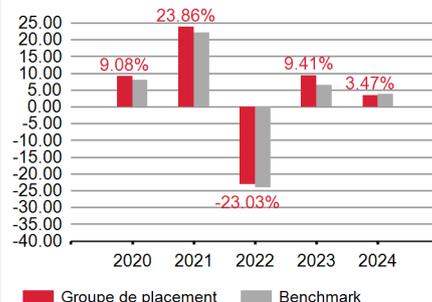
**Protection antidilution:** Aperçu des conditions disponible à l'adresse: [www.swisslife.ch/fondationdeplacement](http://www.swisslife.ch/fondationdeplacement), «Documents juridiques» (modifications possibles à tout moment sans préavis).

**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.

### Performance



### Info. sur le produit

**Numéro de valeur:** 39561897

**ISIN:** CH0395618975

**LEI:** 254900QGENUS1GIJ4549

**Code Bloomberg:** SWLSMPM SW

**Benchmark:** SPI EXTRA® Total Return

**Monnaie:** CHF

**Pays d'origine:** Suisse

**Date de création:** 31/01/2018

**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.

**Asset Manager selon**

**Swiss Life Best Select Invest Plus®:**

Privatbank Von Graffenried 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](http://www.swisslife.ch/fondationdeplacement)

**Taux des charges d'exploitation TER KGAST**

**au préalable:** 0.72%

**a posteriori au:** 30/09/2024 0.72%

### Structure du portefeuille par branches

	Groupe de placement	Benchmark
Industrie	32.21%	29.57%
Santé	23.49%	22.39%
Finance	12.76%	17.05%
Biens de consommation de base	10.30%	9.71%
Technologie de l'information	5.76%	4.48%
Immobilier	3.06%	7.65%
Matériaux	2.72%	3.33%
Utilities	2.13%	1.20%
Consommation discrétionnaire	1.50%	3.40%
Services de communication	-	1.19%
Energie	-	0.05%
Liquidités	6.08%	-

### Les positions principales

	Groupe de placement	Benchmark
LINDT & SPRÜNGLI	7.11%	7.37%
SANDOZ GROUP AG	6.23%	5.92%
SGS SA	5.23%	3.98%
SCHINDLER HOLDING AG	4.72%	5.15%
JULIUS BAER GROUP LTD	3.94%	3.28%
GALDERMA GROUP AG	3.94%	4.35%
BELIMO HOLDING AG	3.74%	2.72%
STRAUMANN HOLDING AG	3.65%	3.37%
BALOISE HOLDING AG	2.71%	2.33%
VAT GROUP AG	2.61%	2.23%

### Structure du portefeuille en fonction de la taille de l'entreprise

	Groupe de placement		Benchmark	
	Particip.	Nombre	Particip.	Nombre
Grandes entreprises	11.62%	3	9.30%	2
Moyennes entreprises	79.23%	44	81.86%	78
Petites entreprises	3.07%	4	8.84%	104
Liquidités	6.08%	-	-	-