

Fondation de placement Swiss Life

Actions Etranger ESG Indexées

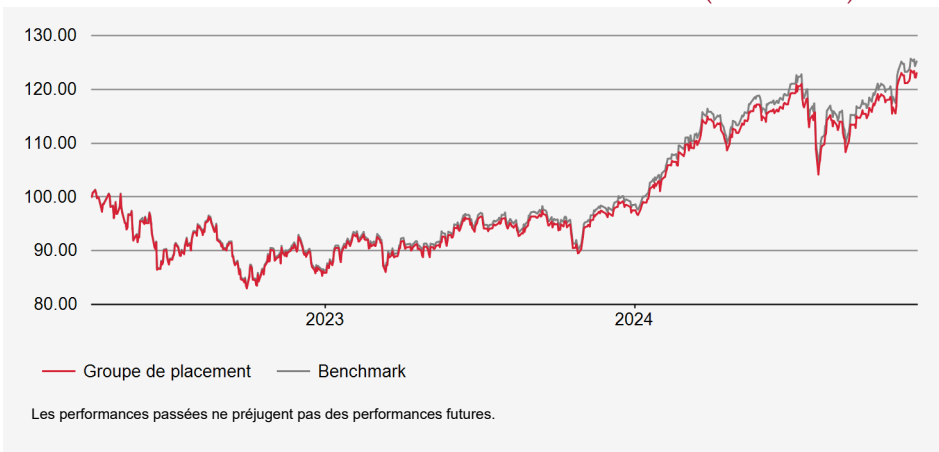


Fortune nette (VNI) en mio. CHF : 458.24
Valeur nette d'inventaire par droit en CHF : 123.04

Stratégie d'investissement

Placements dans des titres de participation de sociétés figurant dans le MSCI World ex Switzerland ESG Leaders, en CHF. Sont également autorisés les titres de participation de sociétés qui, en raison d'adaptations de l'indice de référence, n'y figurent pas encore ou plus (écart max. +0,5 point de pourcentage). Mise en œuvre via Swiss Life iFunds (CH) Equity ESG Global ex Switzerland (CHF).

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



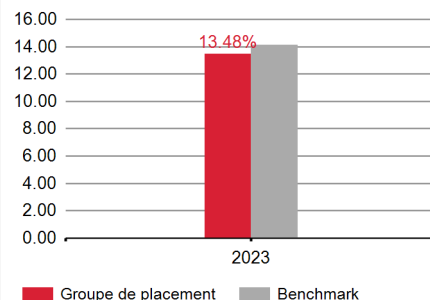
Performances en devise de référence

	Performances cumulées				Performances annualisées			
	YTD	1 mois	3 mois	1 an	3 ans	5 ans	10 ans	Origine
Groupe de placement	26.19%	6.54%	7.96%	27.85%	-	-	-	8.08%
Benchmark	27.09%	6.63%	8.16%	28.78%	-	-	-	8.79%

Données statistiques (annualisées)

	1 an	3 ans	5 ans	10 ans	Origine
Volatilité du groupe de placement (en %)	10.61	-	-	-	14.79
Volatilité du Benchmark (en %)	10.64	-	-	-	14.82
Tracking Error ex post (en %)	0.06	-	-	-	0.14
Information Ratio	-14.79	-	-	-	-4.97
Sharpe Ratio	2.19	-	-	-	0.44
Corrélation	1.00	-	-	-	1.00
Beta	1.00	-	-	-	1.00
Jensen alpha	-0.87	-	-	-	-0.69
Maximum Drawdown (en %)	-13.92	-	-	-	-18.04
Recovery Period (ans)	0.26	-	-	-	1.30

Performance



Info. sur le produit

Numéro de valeur: 117189932
ISIN: CH1171899326
LEI: 254900Q154AKVWL8UQ41
Code Bloomberg: SWAEICI SW
Benchmark: MSCI World ex Switzerland ESG Leaders Net Return
Monnaie: CHF
Pays d'origine: Suisse
Date de création: 31/03/2022
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@: UBS SA

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
Taux des charges d'exploitation TER KGAST
au préalable: 0.52%
à posteriori au: 30/09/2024 0.52%

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	Benchmark
Technologie de l'information	28.41%	28.66%
Finance	15.52%	15.58%
Consommation discrétionnaire	10.98%	11.05%
Industrie	10.59%	10.67%
Santé	10.11%	10.16%
Services de communication	8.07%	8.15%
Biens de consommation de base	5.77%	5.80%
Matériaux	3.46%	3.46%
Energie	2.51%	2.53%
Immobilier	2.24%	2.25%
Services aux collectivités	1.68%	1.69%
Liquidités	0.66%	-

Structure du portefeuille selon les pays/régions

	Groupe de placement	Benchmark
Etats-Unis	75.38%	76.05%
Japon	6.04%	5.88%
Canada	3.32%	3.34%
Grande-Bretagne	3.32%	3.36%
France	2.51%	2.56%
Allemagne	1.09%	1.08%
Autres pays européens	5.45%	5.50%
Autres pays Asie	2.24%	2.23%
Autres	-	-
Liquidités	0.66%	-

Les positions principales

	Groupe de placement	Benchmark
NVIDIA CORP	9.18%	9.28%
MICROSOFT CORP	8.11%	8.18%
ALPHABET INC	5.00%	5.05%
TESLA INC	2.69%	2.72%
ELI LILLY & CO	1.74%	1.76%
VISA INC	1.43%	1.44%
MASTERCARD INC	1.19%	1.20%
HOME DEPOT INC/THE	1.16%	1.17%
PROCTER & GAMBLE CO/THE	1.14%	1.15%
JOHNSON & JOHNSON	1.02%	1.02%

Structure du portefeuille selon les monnaies

	Groupe de placement	Benchmark
USD	76.10%	76.05%
EUR	6.61%	6.67%
JPY	5.88%	5.88%
GBP	3.40%	3.37%
Autres	8.01%	8.02%