

30 avril 2022

Fondation de placement Swiss Life Actions Global Protect Flex (couvertes en CHF)

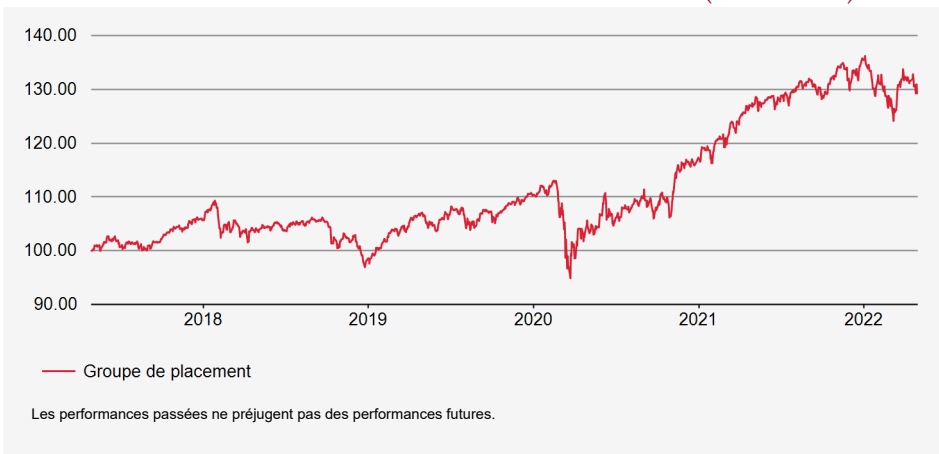


Fortune nette (VNI) en mio. CHF : 1,150.12
Valeur nette d'inventaire par droit en CHF : 138.65

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 ou d'un schéma de pondération alternatif (p. ex. pondération identique ou volatilité minimum). 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 Enhanced (CHF hedged).

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



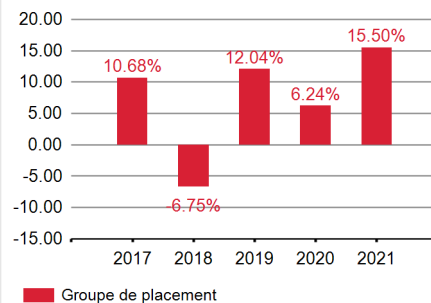
Performances en devise de référence

	PERFORMANCES CUMULÉES				PERFORMANCES ANNUALISÉES			
	YTD	1 MOIS	3 MOIS	1 AN	3 ANS	5 ANS	10 ANS	ORIGINE
GROUPE DE PLACEMENT	-4.62%	-1.85%	-1.59%	1.93%	6.46%	5.26%	-	5.59%

Données statistiques (annualisées)

	1 AN	3 ANS	5 ANS	10 ANS	ORIGINE
Volatilité du groupe de placement (en %)	8.46	9.24	8.19	-	7.60
Sharpe Ratio	0.30	0.75	0.72	-	0.81
Maximum Drawdown (en %)	-8.85	-15.99	-15.99	-	-15.99
Recovery Period (ans)	-	0.63	0.63	-	0.63

Performance



Info. sur le produit

Numéro de valeur: 31952442
ISIN: CH0319524424
LEI: 254900LUAQC3MC0MWL48
Code Bloomberg: SLAGPCH 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: 14h30
Commission de souscription/rachat: aucune
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: 0.60%
a posteriori au: 30/09/2021 0.60%

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.

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 (couvertes en CHF)

Structure du portefeuille par branches

	Groupe de placement
FINANCE	14.37%
TECHNOLOGIE DE L'INFORMATION	12.32%
INDUSTRIE	10.65%
SANTÉ	10.08%
CONSOMMATION DISCRÉTIONNAIRE	8.92%
BIENS DE CONSOMMATION DE BASE	8.58%
SERVICES DE COMMUNICATION	6.90%
IMMOBILIER	6.31%
FUTURE SUR INDICE ACTIONS	6.13%
MATÉRIAUX	5.57%
SERVICES AUX COLLECTIVITÉS	5.18%
ENERGIE	3.21%
LIQUIDITÉS / PENSIONS	1.78%

Les positions principales

	Groupe de placement
ALPHABET INC-CL C	1.31%
ELI LILLY & CO	1.28%
HOME DEPOT INC	0.79%
MICROSOFT CORP	0.76%
WASTE CONNECTIONS INC	0.75%
NEWMONT CORP	0.72%
CHEVRON CORP	0.70%
JOHNSON & JOHNSON	0.66%
PROLOGIS INC	0.66%
FAST RETAILING CO LTD	0.63%

Structure du portefeuille selon les pays/régions

	Groupe de placement
USA ET CANADA	59.57%
RÉGION EUROPÉENNE (EUR)	15.78%
RÉGION EUROPÉENNE (EX EUR)	9.77%
RÉGION ASIE ET PACIFIQUE	6.72%
FUTURE SUR INDICE ACTIONS	6.13%
MARCHÉS ÉMERGENTS ASIE-PACIFIQUE	0.26%
LIQUIDITÉS / PENSIONS	1.78%