

30 avril 2022

Fondation de placement Swiss Life

Actions Global Small Caps

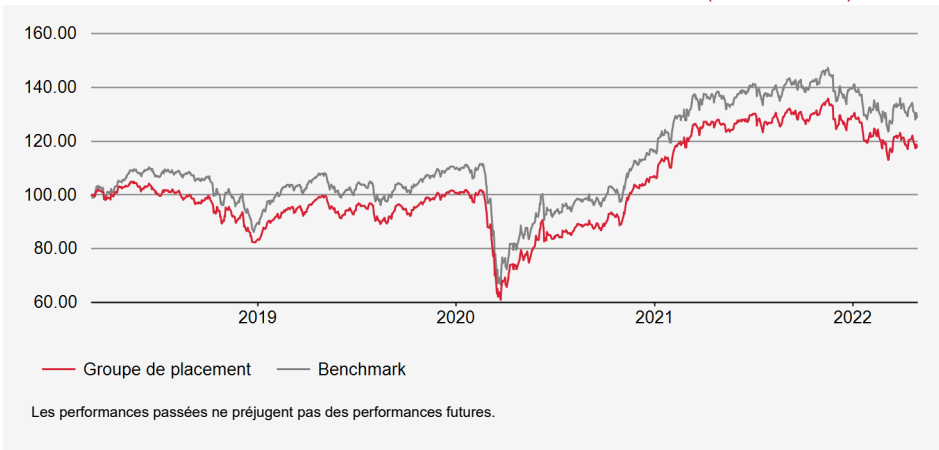


Fortune nette (VNI) en mio. CHF : 127.20
Valeur nette d'inventaire par droit en CHF : 117.81

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)



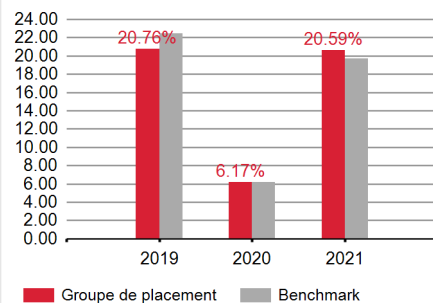
Performances en devise de référence

	PERFORMANCES CUMULÉES				PERFORMANCES ANNUALISÉES			
	YTD	1 MOIS	3 MOIS	1 AN	3 ANS	5 ANS	10 ANS	ORIGINE
GROUPE DE PLACEMENT	-8.72%	-2.19%	-3.28%	-7.13%	5.74%	-	-	4.01%
BENCHMARK	-7.58%	-2.40%	-2.55%	-5.75%	6.15%	-	-	6.28%

Données statistiques (annualisées)

	1 AN	3 ANS	5 ANS	10 ANS	ORIGINE
Volatilité du groupe de placement (en %)	9.13	22.11	-	-	20.40
Volatilité du Benchmark (en %)	9.56	21.36	-	-	19.92
Tracking Error ex post (en %)	1.35	1.86	-	-	2.56
Information Ratio	-1.02	-0.22	-	-	-0.87
Sharpe Ratio	-0.74	0.28	-	-	0.23
Corrélation	0.99	1.00	-	-	0.99
Beta	0.95	1.03	-	-	1.02
Jensen alpha	-1.66	-0.63	-	-	-2.38
Maximum Drawdown (en %)	-16.78	-40.05	-	-	-41.83
Recovery Period (ans)	-	0.67	-	-	0.73

Performance



Info. sur le produit

Numéro de valeur: 40068789
ISIN: CH0400687890
LEI: 254900XCUD9NTWJQU706
Code Bloomberg: SWLAGSC 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: 11h00
Commission de souscription/rachat: aucune
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
Taux des charges d'exploitation TER KGAST au préalable: 0.94%
a posteriori au: 30/09/2021 0.94%

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.
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	19.55%	18.46%
FINANCE	15.37%	13.11%
CONSOMMATION DISCRÉTIONNAIRE	14.06%	12.23%
TECHNOLOGIE DE L'INFORMATION	11.97%	11.95%
SANTÉ	9.69%	9.24%
MATÉRIAUX	7.66%	8.36%
IMMOBILIER	6.76%	10.57%
ENERGIE	4.71%	5.23%
BIENS DE CONSOMMATION DE BASE	3.73%	4.71%
SERVICES DE TÉLÉCOMMUNICATION	2.89%	3.07%
SERVICES AUX COLLECTIVITÉS	2.36%	3.07%
LIQUIDITÉS	1.24%	-

Structure du portefeuille selon les pays/régions

	Groupe de placement	Benchmark
ETATS-UNIS	54.10%	55.85%
JAPON	9.48%	9.18%
GRANDE-BRETAGNE	6.35%	5.80%
CANADA	2.49%	3.84%
FRANCE	2.28%	1.22%
ALLEMAGNE	1.87%	1.80%
AUTRES PAYS EUROPÉENS	11.58%	9.72%
AUTRES PAYS ASIE	6.11%	7.74%
AUTRES	4.49%	4.84%
LIQUIDITÉS	1.24%	-

Les positions principales

	Groupe de placement	Benchmark
WEATHERFORD INTERNAT	0.43%	0.01%
LPL FINANCIAL	0.41%	0.09%
CACTUS	0.40%	0.02%
PIPER SANDLER	0.39%	0.01%
ONEMAIN	0.39%	0.02%
WILLSCOT MOBILE MINI	0.38%	0.04%
CLEVELAND-CLIFFS	0.38%	0.07%
TRAVEL & LEISURE	0.36%	0.03%
EASTGROUP PROPERTIES	0.35%	0.05%
CHIBA BANK	0.34%	-

Indications supplémentaires sur les sociétés

Nombre de sociétés	6,849
Part de sociétés hors du benchmark	21.62%