31 mars 2024

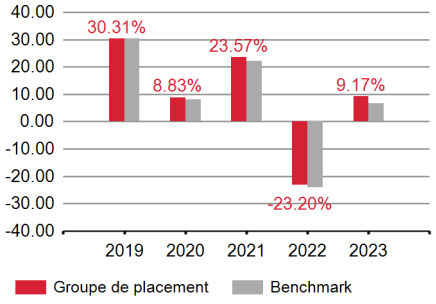
Fondation de placement Swiss Life Actions Suisse Small & Mid Caps

Fortune nette (VNI) en mio. CHF : 125.15
Valeur nette d'inventaire par droit en CHF : 125.55

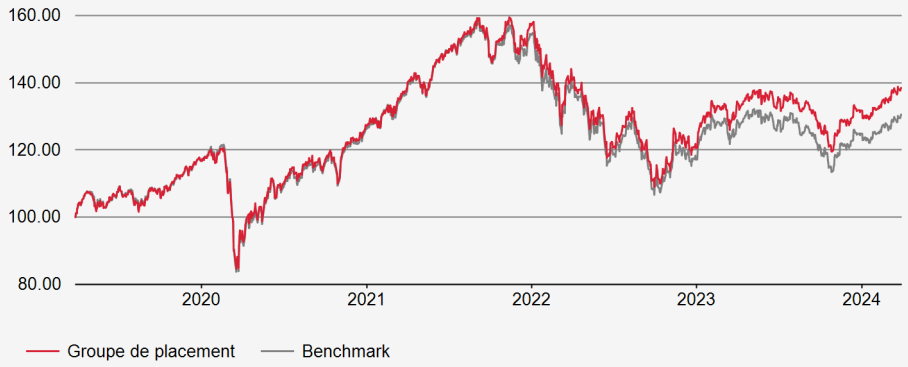
Stratégie d'investissement

Placement dans des titres de participa-tion 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"

Performance



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



Les performances passées ne préjugent pas des performances futures.

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	5.18%	3.24%	5.18%	3.01%	0.09%	6.47%	-	3.77%
Benchmark	4.61%	3.74%	4.61%	1.32%	-1.69%	5.25%	-	2.74%

Données statistiques (annualisées)

	1 an	3 ans	5 ans	10 ans	Origine
Volatilité du groupe de placement (en %)	11.11	15.29	15.87	-	15.86
Volatilité du Benchmark (en %)	11.26	15.08	16.00	-	15.83
Tracking Error ex post (en %)	2.17	1.78	1.70	-	1.63
Information Ratio	0.78	0.99	0.73	-	0.63
Sharpe Ratio	0.12	-0.02	0.40	-	0.25
Corrélation	0.98	0.99	0.99	-	0.99
Beta	0.97	1.01	0.99	-	1.00
Jensen alpha	1.69	1.79	1.31	-	1.04
Maximum Drawdown (en %)	-13.31	-31.60	-31.60	-	-31.60
Recovery Period (ans)	0.38	-	-	-	-

Info. sur le produit

Numéro de valeur: 39561890
ISIN: CH0395618900
LEI: 254900QGENUS1GIJ4549
Code Bloomberg: SWLASMC SW
Benchmark: SPI EXTRA Total Return
Monnaie: CHF
Pays d'origine: Suisse
Date de création: 01/02/2018
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 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
Taux des charges d'exploitation TER KGAST
au préalable: 0.95%
a posteriori au: 30/09/2023 0.95%

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.

31 mars 2024

Fondation de placement Swiss Life Actions Suisse Small & Mid Caps

Structure du portefeuille par branches

	Groupe de placement	Benchmark
Industrie	37.01%	33.27%
Santé	17.56%	17.94%
Finance	14.36%	22.84%
Biens de consommation	13.79%	13.93%
Technologie	4.85%	3.84%
Services aux consommateurs	2.52%	3.62%
Matériaux de base	2.12%	2.82%
Services aux collectivités	1.68%	1.04%
Pétrole et gaz	-	-
Télécommunication	-	0.69%
Liquidités	6.12%	-

Les positions principales

	Groupe de placement	Benchmark
STRAUMANN HOLDING AG	6.00%	5.20%
LINDT & SPRALNGLI AG PS	5.90%	3.51%
VAT GROUP AG	4.81%	4.01%
SGS SA	4.80%	4.23%
JULIUS BAER GROUP LTD	4.14%	3.42%
SCHINDLER HOLDING AG PS	4.06%	2.95%
SANDOZ GROUP AG	3.83%	3.74%
SIG GROUP AG	3.05%	2.21%
GALENICA AG	2.52%	1.20%
BALOISE HOLDING AG	2.50%	2.07%

Structure du portefeuille en fonction de la taille de l‘entreprise

	Groupe de placement		Benchmark	
	Particip.	Nombre	Particip.	Nombre
Grandes entreprises	16.19%	4	13.17%	3
Moyennes entreprises	74.05%	44	77.48%	77
Petites entreprises	3.64%	4	9.35%	112
Liquidités	6.12%	-	-	-

Avertissement: La présente publication ne constitue ni une incitation ni une recommandation pour la vente ou l'achat d'instruments de placement, et son but est uniquement d’informer. Tous les documents constituant la base légale dans le cadre d’un éventuel placement peuvent être obtenus gratuitement auprès de la Fondation de placement Swiss Life, c/o Swiss Life SA, case postale, 8022 Zurich, tél. 043 547 71 11 et sur www.swisslife.ch/anlagestiftung. Le cercle des investisseurs est limité aux institutions du 2e pilier et du pilier 3a, ainsi que les autres institutions de prévoyance professionnelle exonérées d’impôts avec siège en Suisse et aux personnes qui gèrent des placements collectifs pour les institutions, qui sont soumises à la surveillance de l’Autorité fédérale de surveillance des marchés financiers FINMA et qui ne placent dans la fondation que des fonds destinés à ces institutions. La performance passée ne saurait présumer de l’évolution en cours ou à venir. Leur utilisation n’implique aucune adhésion ni affiliation de leur part. **Source:** Swiss Life Asset Managers. Tous droits réservés.