

30 avril 2022

# Fondation de placement Swiss Life

## Fonds immobiliers Suisse

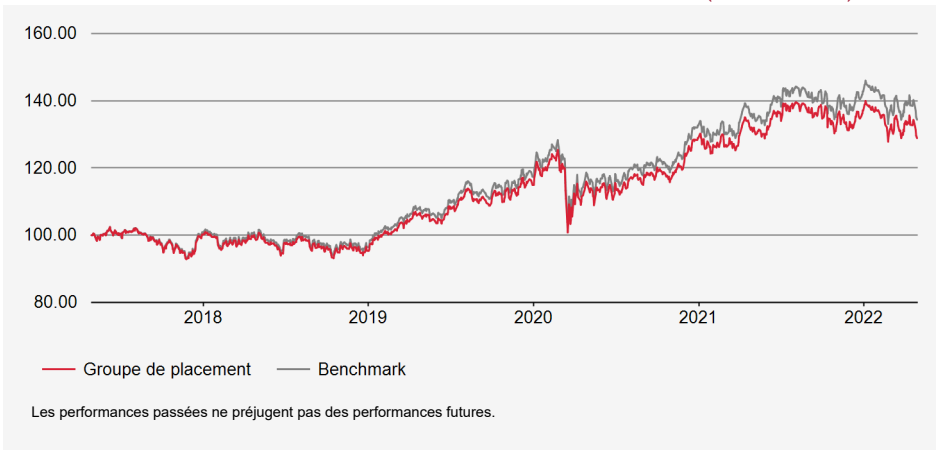


**Fortune nette (VNI) en mio. CHF : 403.88**  
**Valeur nette d'inventaire par droit en CHF : 171.80**

### Stratégie d'investissement

Le groupe de placement investit dans des fonds immobiliers de droit suisse libellés en francs et investissant exclusivement dans des biens immobiliers suisses. Sélection active des fonds immobiliers. Réalisation au moyen du Swiss Life Funds (CH) Real Estate Switzerland Fund of Funds.

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



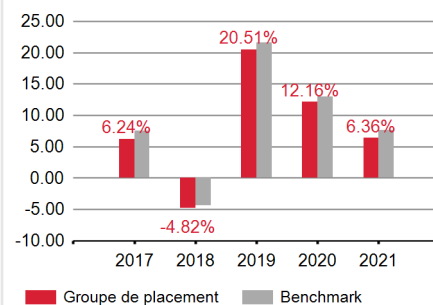
### Performances en devise de référence

	PERFORMANCES CUMULÉES				PERFORMANCES ANNUELISÉES			
	YTD	1 MOIS	3 MOIS	1 AN	3 ANS	5 ANS	10 ANS	ORIGINE
<b>GROUPE DE PLACEMENT</b>	-6.04%	-1.56%	-5.92%	-1.51%	7.09%	5.20%	5.10%	4.96%
<b>BENCHMARK</b>	-5.89%	-1.58%	-6.00%	-0.37%	8.03%	6.08%	5.99%	5.86%

### Données statistiques (annualisées)

	1 AN	3 ANS	5 ANS	10 ANS	ORIGINE
Volatilité du groupe de placement (en %)	9.20	9.54	8.65	8.18	7.81
Volatilité du Benchmark (en %)	9.55	9.77	8.85	8.45	8.06
Tracking Error ex post (en %)	0.64	0.40	0.34	0.52	0.50
Information Ratio	-1.78	-2.33	-2.60	-1.71	-1.77
Sharpe Ratio	-0.10	0.79	0.67	0.68	0.68
Corrélation	1.00	1.00	1.00	1.00	1.00
Beta	0.96	0.98	0.98	0.97	0.97
Jensen alpha	-1.13	-0.73	-0.73	-0.67	-0.69
Maximum Drawdown (en %)	-8.66	-19.59	-19.59	-19.59	-19.59
Recovery Period (ans)	-	0.73	0.73	0.73	0.73

### Performance



### Info. sur le produit

**Numéro de valeur:** 12468379  
**ISIN:** CH0124683795  
**LEI:** 254900VB5XEQLYLQJ518  
**Code Bloomberg:** SWLIMSC SW  
**Benchmark:** SXI Swiss Real Estate® TR  
**Monnaie:** CHF  
**Pays d'origine:** Suisse  
**Date de création:** 28/02/2011  
**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:** Swiss Life Asset Management SA  
**Publication de cours:** Bloomberg: ASSL  
[www.swisslife.ch/fondationdeplacement](http://www.swisslife.ch/fondationdeplacement)  
**Taux des charges d'exploitation TER KGAST**  
**au préalable:** 1.17%  
**a posteriori au:** 30/09/2021 1.16%

**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.

## Immeubles en fonction du type d'utilisation\*

	Groupe de placement	Benchmark
HABITATION	60.00%	60.00%
COMMERCE	30.80%	30.80%
MIXTE	8.20%	8.20%
TERRAIN À BÂTIR, PROJETS	1.00%	1.00%

\*Selon les dernières données disponibles

## Répartition géographique des immeubles\*

	Groupe de placement	Benchmark
ZURICH	32.50%	32.60%
BERNE	7.50%	7.50%
SUISSE CENTRALE	6.80%	6.80%
SUISSE ROMANDE	4.30%	4.30%
SUISSE DU NORD-OUEST	17.50%	17.50%
SUISSE ORIENTALE	5.80%	5.80%
SUISSE MÉRIDIONALE	2.30%	2.30%
LAC LÉMAN	23.30%	23.20%

\*Selon les dernières données disponibles

## Les positions principales

	Groupe de placement	Benchmark
UBS SWISS SIMA	28.70%	30.00%
CS REF SIAT	11.50%	11.60%
CS REF LIVING PLUS	10.10%	10.20%
UBS SWISS ANFOS	9.30%	9.40%
CS REF GREEN PROPERTY	9.30%	9.40%