

# Fondation de placement Swiss Life

## Actions Global ex Suisse ESG Indexées PM (couvertes en CHF)

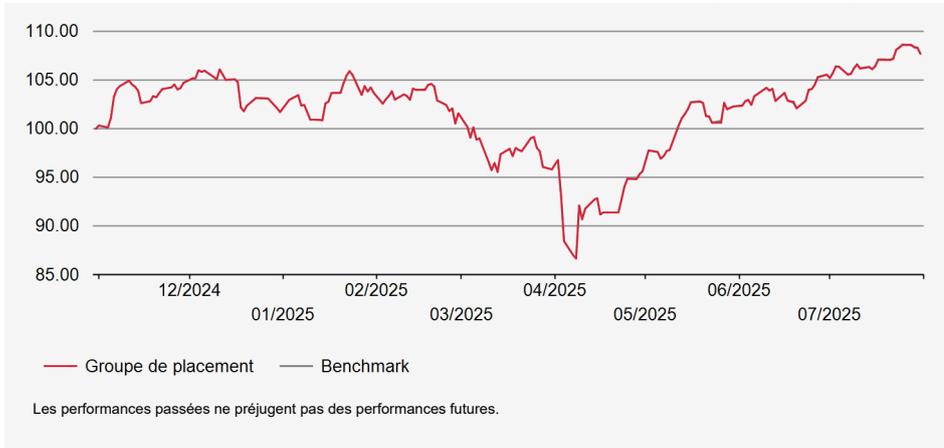


**Fortune nette (VNI) en mio. CHF : 502.81**  
**Valeur nette d'inventaire par droit en CHF : 1,076.69**

### Stratégie d'investissement

Le groupe de placement est géré selon une approche indexée et se distingue par une large diversification et une faible erreur de suivi. L'objectif de placement consiste à reproduire au mieux le benchmark MSCI World ex Switzerland Selection Total Return (CHF hedged). Réalisation au moyen du Swiss Life Index Funds II (CH) Equity ESG Global ex Switzerland PF (CHF hedged); fonds de placement contractuel de droit suisse du type "Autres fonds en placements traditionnels". Aucun securities lending (prêt de valeurs mobilières) n'est pratiqué et aucun investissement n'est effectué dans des titres dont l'exclusion est recommandée par l'Association suisse pour des investissements responsables (www.svvk-asir.ch).

### 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 | 5.86%                 | 2.01%  | 12.58% | -    | -                        | -     | -      | -       |
| Benchmark           | 5.90%                 | 2.04%  | 12.61% | -    | -                        | -     | -      | -       |

### Données statistiques (annualisées)

|  | 1 an | 3 ans | 5 ans | 10 ans | Origine |
|--|------|-------|-------|--------|---------|
| Volatilité du groupe de placement (en %) | -    | -     | -     | -      | 12.91   |
| Volatilité du Benchmark (en %)           | -    | -     | -     | -      | 12.91   |
| Tracking Error ex post (en %)            | -    | -     | -     | -      | 0.05    |
| Information Ratio                        | -    | -     | -     | -      | -1.37   |
| Sharpe Ratio                             | -    | -     | -     | -      | 0.66    |
| Corrélation                              | -    | -     | -     | -      | 1.00    |
| Beta                                     | -    | -     | -     | -      | 1.00    |
| Jensen alpha                             | -    | -     | -     | -      | -0.07   |
| Maximum Drawdown (en %)                  | -    | -     | -     | -      | -18.29  |
| Recovery Period (ans)                    | -    | -     | -     | -      | 0.24    |

**PM tranche:** L'acquisition de cette tranche n'est possible que dans le cadre d'une convention spéciale avec Swiss Life Asset Management SA.

**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.

**Protection antidilution:** Aperçu des conditions disponible à l'adresse: [www.swisslife.ch/fondationdeplacement](http://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.

### Performance

Historique de données insuffisant

### Info. sur le produit

**Numéro de valeur:** 137660514

**ISIN:** CH1376605148

**LEI:** 25490086E6SZEPE5IJ48

**Code Bloomberg:** SLAIAEP SW

**Benchmark:** MSCI World ex Switzerland Selection (TR) (CHF hdg)

**Monnaie:** CHF

**Pays d'origine:** Suisse

**Date de création:** 31/10/2024

**Valeur de lancement:** 1000.00

**Clôture de l'exercice:** 30.09

**Souscription/Rachat:** journalier

**Délai final d'acceptation:** 14h00 (J-1)

**Protection antidilution:**

Commission d'émission / de rachat en faveur du groupe de placement selon l'aperçu des conditions.

**Asset Manager selon**

**Swiss Life Best Select Invest Plus@:**

Swiss Life Asset Management 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](http://www.swisslife.ch/fondationdeplacement)

**Taux des charges d'exploitation TER KGAST**

**au préalable:** 0.02%

### Principales positions

|                         | Groupe de placement | Benchmark |
|-------------------------|---------------------|-----------|
| NVIDIA CORP             | 11.24%              | 11.20%    |
| MICROSOFT CORP          | 9.76%               | 9.73%     |
| ALPHABET INC-CL A       | 2.90%               | 2.89%     |
| ALPHABET INC-CL C       | 2.47%               | 2.46%     |
| TESLA INC               | 2.31%               | 2.30%     |
| ELI LILLY & CO          | 1.54%               | 1.54%     |
| VISA INC-CLASS A SHARES | 1.54%               | 1.54%     |
| MASTERCARD INC - A      | 1.19%               | 1.19%     |
| JOHNSON & JOHNSON       | 1.03%               | 1.02%     |
| HOME DEPOT INC          | 0.95%               | 0.94%     |

### Structure du portefeuille selon les pays/régions

|             | Groupe de placement | Benchmark |
|-------------|---------------------|-----------|
| États-Unis  | 74.68%              | 74.71%    |
| Japon       | 5.75%               | 5.72%     |
| Royaume-Uni | 3.62%               | 3.62%     |
| Canada      | 3.38%               | 3.39%     |
| France      | 3.09%               | 3.09%     |
| Pays-Bas    | 1.69%               | 1.69%     |
| Australie   | 1.48%               | 1.47%     |
| Allemagne   | 1.23%               | 1.23%     |
| Suède       | 1.13%               | 1.13%     |
| Danemark    | 0.82%               | 0.82%     |
| Espagne     | 0.72%               | 0.72%     |
| Italie      | 0.70%               | 0.70%     |
| Autres      | 1.69%               | 1.69%     |
| Liquidités  | 0.03%               | -         |

### Structure du portefeuille par branches

|                               | Groupe de placement | Benchmark |
|-------------------------------|---------------------|-----------|
| Technologie de l'information  | 31.29%              | 31.29%    |
| Finance                       | 16.03%              | 16.03%    |
| Industrie                     | 10.73%              | 10.73%    |
| Consommation discrétionnaire  | 9.35%               | 9.35%     |
| Santé                         | 9.08%               | 9.08%     |
| Services de communication     | 8.49%               | 8.50%     |
| Biens de consommation de base | 5.56%               | 5.57%     |
| Matériaux                     | 3.14%               | 3.14%     |
| Energie                       | 2.29%               | 2.29%     |
| Immobilier                    | 2.10%               | 2.10%     |
| Services aux collectivités    | 1.90%               | 1.91%     |
| Liquidités                    | 0.03%               | -         |