

Fondation de placement Swiss Life

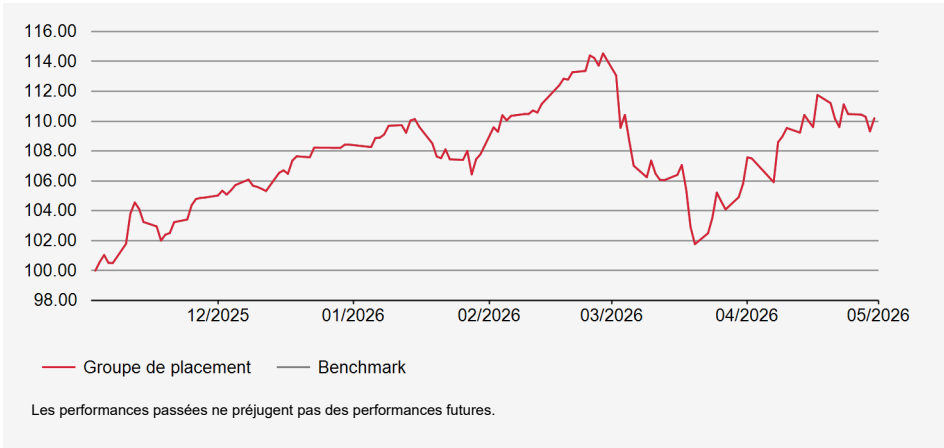
Actions Suisse Large Caps Indexées SPM

Fortune nette (VNI) en mio. CHF : 574.53
Valeur nette d'inventaire par droit en CHF : 1,101.94

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 SPI® 20 Total Return. Réalisation au moyen du Swiss Life Index Funds (CH) Equity Switzerland Large Cap; 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	1.62%	4.15%	2.24%	-	-	-	-	-
Benchmark	1.63%	4.15%	2.24%	-	-	-	-	-

Données statistiques (annualisées)

	1 an	3 ans	5 ans	10 ans	Origine
Volatilité du groupe de placement (en %)	-	-	-	-	17.98
Volatilité du Benchmark (en %)	-	-	-	-	17.75
Tracking Error ex post (en %)	-	-	-	-	0.01
Information Ratio	-	-	-	-	-2.33
Sharpe Ratio	-	-	-	-	1.08
Corrélation	-	-	-	-	1.00
Beta	-	-	-	-	1.00
Jensen alpha	-	-	-	-	-0.03
Maximum Drawdown (en %)	-	-	-	-	-11.14
Recovery Period (ans)	-	-	-	-	-

Performance

Historique de données insuffisant

Info. sur le produit

Numéro de valeur: 149293219
ISIN: CH1492932194
LEI: 254900P0FZIREAGSUQ60
Code Bloomberg: SWACLCS SW
Benchmark: SPI® 20 Total Return
Monnaie: CHF
Pays d'origine: Suisse
Date de création: 03/11/2025
Valeur de lancement: 100.00
Clôture de l'exercice: 30.09
Souscription/Rachat: journalier
Délai final d'acceptation: 13h00
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 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

SPM-Tranche: La tranche SPM est accessible aussi bien aux investisseurs ayant conclu une convention spéciale avec Swiss Life Asset Management SA (SLAM CH) qu'aux clients de gestion de fortune et à ceux des partenaires de coopération de SLAM CH (avec convention complémentaire).

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, «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.

Fondation de placement Swiss Life

Actions Suisse Large Caps Indexées SPM

Principales positions

	Groupe de placement	Benchmark
NOVARTIS AG-REG	16.79%	16.79%
ROCHE HOLDING AG	16.50%	16.50%
NESTLE SA-REG	15.03%	15.03%
ABB LTD-REG	9.14%	9.14%
UBS GROUP AG-REG	7.81%	7.81%
ZURICH INSURANCE GROUP AG	6.16%	6.16%
CIE FINANCIERE RICHEMO-A REG	5.89%	5.89%
HOLCIM LTD	2.86%	2.86%
SWISS RE AG	2.78%	2.78%
LONZA GROUP AG-REG	2.48%	2.48%

Structure du portefeuille selon les pays/régions

	Groupe de placement	Benchmark
Suisse	99.99%	100.00%
Liquidités	0.01%	-

Structure du portefeuille par branches

	Groupe de placement	Benchmark
Santé	37.92%	37.93%
Finance	20.09%	20.09%
Biens de consommation de base	15.03%	15.03%
Industrie	11.20%	11.20%
Matériaux	7.80%	7.80%
Consommation discrétionnaire	5.89%	5.89%
Services de communication	1.24%	1.24%
Technologie de l'information	0.82%	0.82%
Liquidités	0.01%	-

Structure du portefeuille selon les monnaies

	Groupe de placement	Benchmark
CHF	99.99%	100.00%
USD	0.01%	-