

30 avril 2022

Fondation de placement Swiss Life

Actions Etranger ESG PM

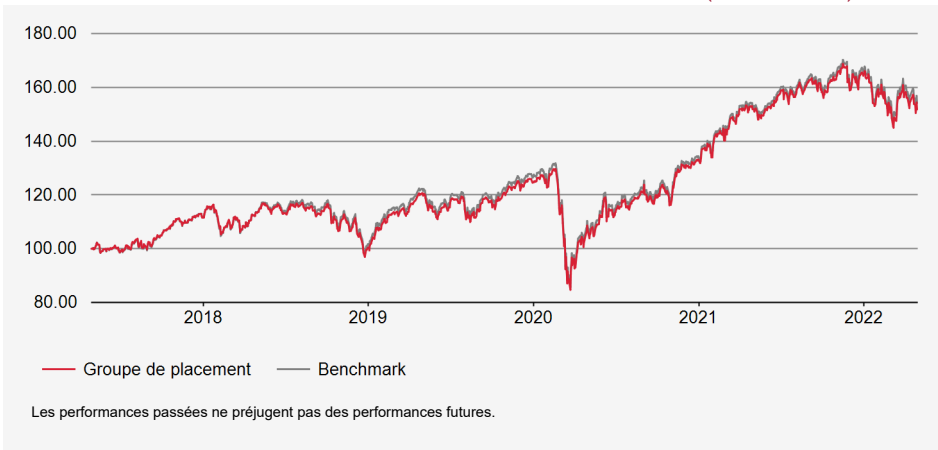


Fortune nette (VNI) en mio. CHF : 343.19
Valeur nette d'inventaire par droit en CHF : 167.64

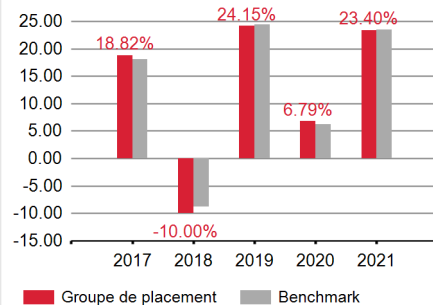
Stratégie d'investissement

Placement dans des titres de participation émis par des sociétés domiciliées à l'étranger. Les grosses & moyennes capitalisations sont couvertes passivement, les petites capitalisations ainsi que le secteur des marchés émergents sont gérés activement («core-satellite»). Limite par société: 5% (exception : si la pondération est supérieure à 5% au sein de l'indice; alors 10% au maximum). Sociétés hors benchmark: max. 10%. Réalisation au moyen du Swiss Life iFunds (CH) Equity ESG Global ex Switzerland (CHF), Invesco Global Small Cap Equity Fund, Dimensional Global Small Cap Equity Fund et du fonds Candriam Sustainable Equity Emerging Markets.

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



Performance



Info. sur le produit

Numéro de valeur: 3026051
ISIN: CH0030260514
LEI: 2549000B6X3SG0K4LZ68
Code Bloomberg: SLAAUPM SW
Benchmark: 80% MSCI World ex CH ESG Leaders en CHF, 15% MSCI AC World Small Cap en CHF, 5% MSCI Emerging Markets en CHF
Monnaie: CHF
Pays d'origine: Suisse
Date de création: 31/05/2007
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® Large&Mid Caps (passive)
 UBS SA
Small Caps (active)
 50% Invesco / 50% Dimensional
Emerging Markets (active)
 Candriam Investors Group

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	-7.64%	-2.90%	-4.29%	-0.07%	7.95%	8.69%	10.04%	3.52%
BENCHMARK	-7.07%	-2.78%	-3.92%	0.73%	8.02%	9.03%	10.41%	4.00%

Données statistiques (annualisées)

	1 AN	3 ANS	5 ANS	10 ANS	ORIGINE
Volatilité du groupe de placement (en %)	9.89	17.38	15.48	13.41	15.89
Volatilité du Benchmark (en %)	9.87	17.29	15.40	13.36	15.89
Tracking Error ex post (en %)	0.42	0.45	0.54	0.67	0.97
Information Ratio	-1.92	-0.17	-0.62	-0.56	-0.49
Sharpe Ratio	0.06	0.48	0.59	0.75	0.23
Corrélation	1.00	1.00	1.00	1.00	1.00
Beta	1.00	1.01	1.00	1.00	1.00
Jensen alpha	-0.80	-0.12	-0.38	-0.41	-0.47
Maximum Drawdown (en %)	-14.05	-34.64	-34.64	-34.64	-59.96
Recovery Period (ans)	-	0.67	0.67	0.67	7.75

Conseil externe:
 PPCmetrics fournit les prestations suivantes: conseil concernant les bonnes structures de mandat («core-satellite»), aide à la sélection de gestionnaires de fortune adéquats et soutien dans le cadre de la surveillance continue des gestionnaires 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: 0.38%
a posteriori au: 30/09/2021 0.37%

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

Benchmark: Jusqu'au 31.12.2009 100% MSCI World, ex CH, en CHF

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
TECHNOLOGIE DE L'INFORMATION	20.00%	20.33%
FINANCE	14.66%	14.29%
SANTÉ	12.30%	12.12%
CONSOMMATION DISCRÉTIONNAIRE	12.08%	11.91%
INDUSTRIE	10.98%	10.90%
SERVICES DE TÉLÉCOMMUNICATION	8.19%	8.11%
BIENS DE CONSOMMATION DE BASE	7.03%	7.20%
MATÉRIAUX	5.53%	5.68%
IMMOBILIER	3.46%	4.11%
ENERGIE	2.95%	3.22%
SERVICES AUX COLLECTIVITÉS	1.89%	2.12%
LIQUIDITÉS	0.92%	-

Structure du portefeuille selon les pays/régions

	Groupe de placement	Benchmark
ETATS-UNIS	63.65%	64.32%
JAPON	6.77%	6.74%
GRANDE-BRETAGNE	4.26%	4.23%
CANADA	3.49%	3.70%
FRANCE	2.76%	2.68%
ALLEMAGNE	2.02%	2.00%
AUTRES PAYS EUROPÉENS	6.94%	6.65%
AUTRES PAYS ASIE	6.55%	7.09%
AUTRES	2.64%	2.59%
LIQUIDITÉS	0.92%	-

Les positions principales

	Groupe de placement	Benchmark
MICROSOFT CORP.	5.94%	6.00%
ALPHABET INC	4.04%	4.07%
TESLA INC	2.23%	2.25%
JOHNSON & JOHNSON	1.43%	1.44%
NVIDIA	1.39%	1.41%
PROCTER & GAMBLE	1.17%	1.18%
VISA INC	1.07%	1.08%
MASTERCARD INC	0.96%	0.97%
HOME DEPOT	0.94%	0.95%
COCA COLA	0.80%	0.80%

Indications supplémentaires sur les sociétés

Nombre de sociétés	7,631
Part de sociétés hors du benchmark	4.05%