

Fondation de placement Swiss Life

Actions Global Small Caps PM

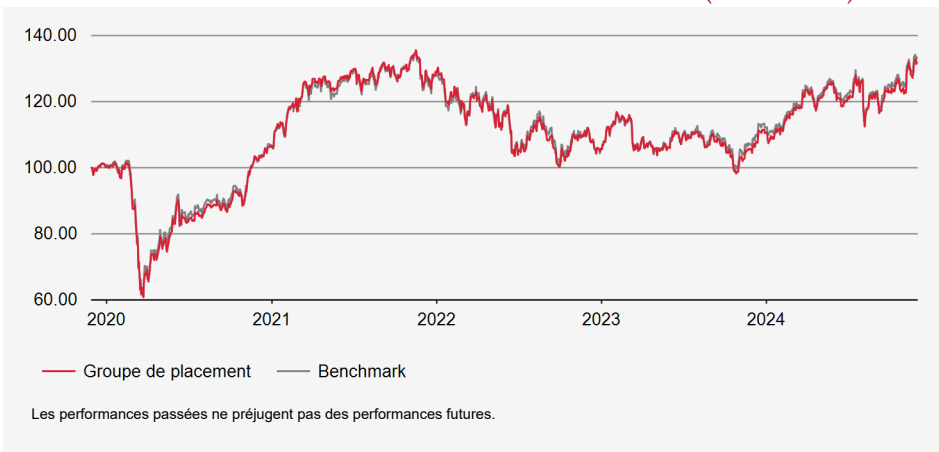


Fortune nette (VNI) en mio. CHF : 395.02
Valeur nette d'inventaire par droit en CHF : 133.04

Stratégie d'investissement

Placement dans des titres de participation à faible capitalisation du monde entier. Sélection active des pays, des branches et des titres. Limite par société: 5%. Réalisation au moyen du Invesco Global Small Cap Equity Fund et Dimensional Global Small Cap Equity Fund.

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	19.16%	7.73%	7.72%	26.27%	1.52%	5.69%	-	4.32%
Benchmark	19.00%	7.19%	8.34%	25.41%	2.19%	5.93%	-	5.73%

Données statistiques (annualisées)

	1 an	3 ans	5 ans	10 ans	Origine
Volatilité du groupe de placement (en %)	12.92	16.48	20.36	-	19.26
Volatilité du Benchmark (en %)	12.10	16.33	19.91	-	18.91
Tracking Error ex post (en %)	1.79	1.79	1.92	-	2.33
Information Ratio	0.48	-0.37	-0.13	-	-0.61
Sharpe Ratio	1.70	0.04	0.26	-	0.22
Corrélation	0.99	0.99	1.00	-	0.99
Beta	1.06	1.00	1.02	-	1.01
Jensen alpha	-0.56	-0.67	-0.35	-	-1.47
Maximum Drawdown (en %)	-12.06	-24.59	-40.04	-	-41.60
Recovery Period (ans)	0.25	1.05	0.67	-	0.73

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.

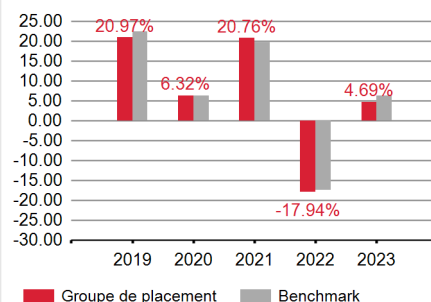
Protection antidilution: Aperçu des conditions disponible à l'adresse: www.swisslife.ch/fondationdeplacement, «Documents juridiques» (modifications possibles à tout moment sans préavis).

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



Info. sur le produit

Numéro de valeur: 40068790

ISIN: CH0400687908

LEI: 254900XCUD9NTWJQU706

Code Bloomberg: SLAGSPM SW

Benchmark: MSCI AC World Small Cap, en CHF

Monnaie: CHF

Pays d'origine: Suisse

Date de création: 28/02/2018

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.

Pratique de distribution: Capitalisation

Asset Manager selon

Swiss Life Best Select Invest Plus®:

50% Invesco / 50% Dimensional

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: 0.59%

a posteriori au: 30/09/2024 0.59%

Structure du portefeuille par branches

	Groupe de placement	Benchmark
Industrie	21.31%	19.79%
Finance	16.56%	15.82%
Consommation discrétionnaire	12.60%	12.94%
Technologie de l'information	12.15%	11.50%
Santé	9.80%	9.52%
Matériaux	6.62%	7.59%
Immobilier	5.56%	8.06%
Biens de consommation de base	3.90%	4.68%
Energie	3.51%	4.21%
Services de communication	2.87%	3.26%
Services aux collectivités	1.45%	2.63%
Liquidités	3.66%	-

Les positions principales

	Groupe de placement	Benchmark
CACTUS	0.66%	0.02%
TAYLOR MORRISON	0.63%	0.04%
PIPER SANDLER	0.53%	0.03%
PINNACLE FINANCIAL PARTNERS	0.52%	0.05%
WEATHERFORD INTERNAT	0.49%	0.03%
IES	0.48%	0.01%
Q2	0.45%	0.03%
PLANISWARE	0.43%	0.00%
SIGMAROC	0.43%	0.00%
XPO	0.42%	0.09%

Structure du portefeuille selon les pays/régions

	Groupe de placement	Benchmark
Etats-Unis	62.09%	60.29%
Japon	6.75%	10.83%
Grande-Bretagne	5.87%	4.27%
Canada	2.06%	3.46%
France	1.67%	0.96%
Allemagne	1.44%	1.06%
Autres pays européens	8.89%	7.21%
Autres pays Asie	4.83%	8.03%
Autres	2.74%	3.89%
Liquidités	3.66%	-

Structure du portefeuille selon les monnaies

	Groupe de placement	Benchmark
USD	64.44%	60.54%
EUR	7.22%	5.08%
JPY	6.78%	10.83%
GBP	5.92%	4.27%
CHF	1.55%	1.29%
Autres	14.08%	17.98%

Indications supplémentaires sur les sociétés

Nombre de sociétés	6,772
Part de sociétés hors du benchmark	20.66%