

30 avril 2022

# Fondation de placement Swiss Life

## Actions Suisse Large Caps Indexées PM

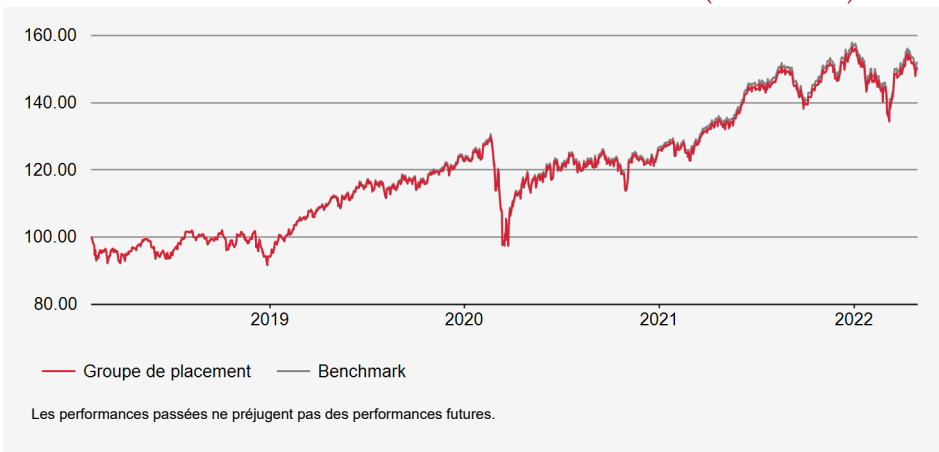


**Fortune nette (VNI) en mio. CHF : 329.43**  
**Valeur nette d'inventaire par droit en CHF : 150.44**

### Stratégie d'investissement

Placement dans des titres de participation de sociétés représentées dans le SPI 20. Mise en oeuvre indexée, le benchmark étant entièrement reproduit («full replication»). L'écart entre la pondération par société et celle du benchmark ne peut être supérieur à +/- 0,5 point de pourcentage. Réalisation au moyen du Swiss Life iFunds (CH) Equity Switzerland (CHF); fonds de placement de droit suisse de la catégorie "Autres fonds en placements traditionnels".

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



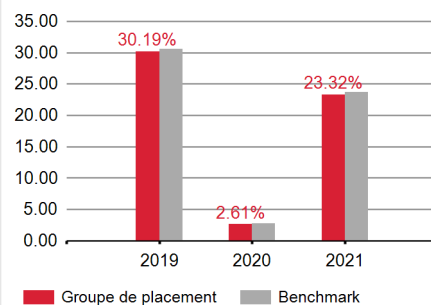
### Performances en devise de référence

	PERFORMANCES CUMULÉES				PERFORMANCES ANNUALISÉES			
	YTD	1 MOIS	3 MOIS	1 AN	3 ANS	5 ANS	10 ANS	ORIGINE
<b>GROUPE DE PLACEMENT</b>	-3.10%	1.32%	2.21%	13.39%	10.27%	-	-	10.10%
<b>BENCHMARK</b>	-3.01%	1.35%	2.30%	13.69%	10.54%	-	-	10.37%

### Données statistiques (annualisées)

	1 AN	3 ANS	5 ANS	10 ANS	ORIGINE
Volatilité du groupe de placement (en %)	13.01	11.94	-	-	12.28
Volatilité du Benchmark (en %)	13.04	11.98	-	-	12.33
Tracking Error ex post (en %)	0.04	0.06	-	-	0.07
Information Ratio	-7.23	-4.24	-	-	-3.78
Sharpe Ratio	1.02	0.88	-	-	0.83
Corrélation	1.00	1.00	-	-	1.00
Beta	1.00	1.00	-	-	1.00
Jensen alpha	-0.27	-0.23	-	-	-0.23
Maximum Drawdown (en %)	-14.06	-25.03	-	-	-25.03
Recovery Period (ans)	-	1.00	-	-	1.00

### Performance



### Info. sur le produit

**Numéro de valeur:** 39561886  
**ISIN:** CH0395618868  
**LEI:** 254900P0FZIREAGSUQ60  
**Code Bloomberg:** SLASLPM SW  
**Benchmark:** SPI 20 Total Return@  
**Monnaie:** CHF  
**Pays d'origine:** Suisse  
**Date de création:** 31/01/2018  
**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®:** Pictet 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/fondationplacement](http://www.swisslife.ch/fondationplacement)  
**Taux des charges d'exploitation TER KGAST**  
**au préalable:** 0.20%  
**a posteriori au:** 30/09/2021 0.20%

**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.

**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.

### Structure du portefeuille par branches

	Groupe de placement	Benchmark
SANTÉ	39.45%	39.47%
BIENS DE CONSOMMATION	30.13%	30.14%
FINANCE	14.90%	14.91%
INDUSTRIE	11.35%	11.35%
MATÉRIAUX DE BASE	2.25%	2.25%
TÉLÉCOMMUNICATION	1.07%	1.06%
TECHNOLOGIE	0.81%	0.81%
SERVICES AUX CONSOMMATEURS	-	-
PÉTROLE ET GAZ	-	-
SERVICES AUX COLLECTIVITÉS	-	-
LIQUIDITÉS	0.04%	-

### Les positions principales

	Groupe de placement	Benchmark
NESTLE SA-REG	25.75%	25.76%
ROCHE HOLDING AG	18.48%	18.49%
NOVARTIS AG-REG	15.29%	15.30%
ZURICH INSURANCE GROUP AG	4.87%	4.87%
CIE FINANCIERE RICHEMONT-REG	4.38%	4.38%
UBS GROUP AG-REG	4.08%	4.08%
ABB LTD-REG	3.46%	3.46%
SIKA AG	3.35%	3.35%
LONZA GROUP AG-REG	3.13%	3.13%
ALCON INC	2.55%	2.55%

### Structure du portefeuille en fonction de la taille de l'entreprise

	Groupe de placement		Benchmark	
	Particip.	Nombre	Particip.	Nombre
Grandes entreprises	98.89%	19	98.94%	19
Moyennes entreprises	1.07%	1	1.06%	1
Petites entreprises	-	-	-	-
Liquidités	0.04%	-	-	-