

Fondation de placement Swiss Life

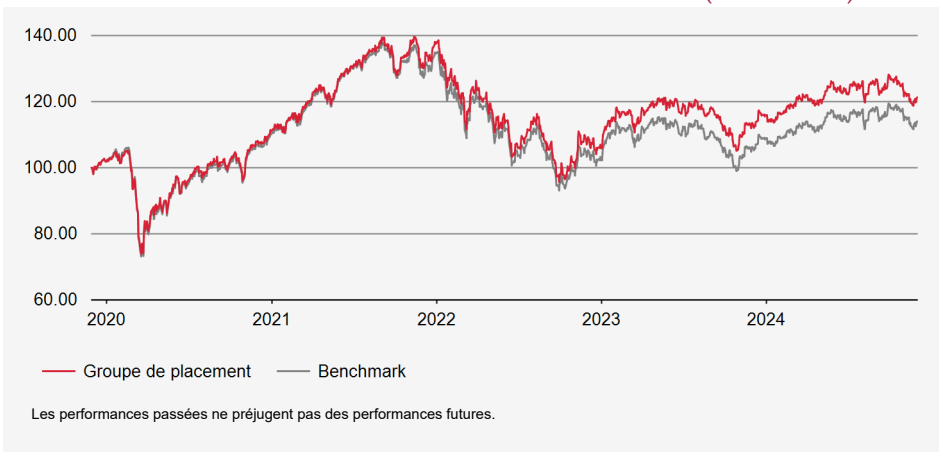
Actions Suisse Small & Mid Caps PM

Fortune nette (VNI) en mio. CHF : 131.07
Valeur nette d'inventaire par droit en CHF : 126.76

Stratégie d'investissement

Placement dans des titres de participation de sociétés représentées dans le Swiss Performance Index Extra. Sélection active des branches et des titres. Limite par société: 5% (exception: à condition que les sociétés soient dans le benchmark; max. 5% points de plus que pondération dans le benchmark). Réalisation au moyen du Swiss Life iFunds (CH) Equity Switzerland Small & Mid Cap (CHF); Fonds de placement de droit suisse de la catégorie "Autres fonds en investissements traditionnels"

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



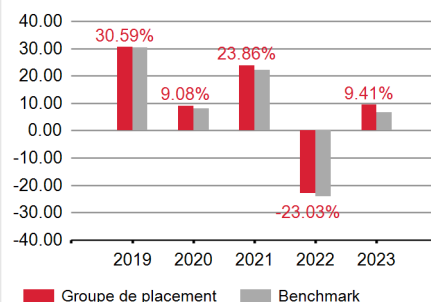
Performances en devise de référence

	Performances cumulées				Performances annualisées			
	YTD	1 mois	3 mois	1 an	3 ans	5 ans	10 ans	Origine
Groupe de placement	4.67%	-0.23%	-4.29%	6.84%	-2.35%	3.93%	-	3.53%
Benchmark	4.71%	-0.22%	-3.61%	7.31%	-3.72%	2.66%	-	2.48%

Données statistiques (annualisées)

	1 an	3 ans	5 ans	10 ans	Origine
Volatilité du groupe de placement (en %)	8.46	14.82	15.69	-	15.31
Volatilité du Benchmark (en %)	8.09	14.62	15.72	-	15.25
Tracking Error ex post (en %)	1.47	1.71	1.65	-	1.60
Information Ratio	-0.32	0.80	0.77	-	0.66
Sharpe Ratio	0.62	-0.21	0.23	-	0.23
Corrélation	0.99	0.99	0.99	-	0.99
Beta	1.03	1.01	0.99	-	1.00
Jensen alpha	-0.64	1.40	1.29	-	1.06
Maximum Drawdown (en %)	-7.34	-30.92	-31.46	-	-31.46
Recovery Period (ans)	-	-	-	-	-

Performance



Info. sur le produit

Numéro de valeur: 39561897
ISIN: CH0395618975
LEI: 254900QGENUS1GIJ4549
Code Bloomberg: SWLSMPM SW
Benchmark: SPI EXTRA® 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: 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®:
 Privatbank Von Graffenried 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

Taux des charges d'exploitation TER KGAST

au préalable: 0.72%

a posteriori au: 30/09/2024 0.72%

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.

Structure du portefeuille par branches

	Groupe de placement	Benchmark
Industrie	38.68%	32.23%
Santé	19.12%	19.72%
Finance	16.53%	24.73%
Biens de consommation de base	14.21%	12.23%
Technologie de l'information	3.97%	2.99%
Consommation discrétionnaire	2.74%	3.09%
Matériaux	2.13%	2.39%
Services aux collectivités	1.97%	1.09%
Services de communication	-	1.52%
Energie	-	-
Liquidités	0.64%	-

Les positions principales

	Groupe de placement	Benchmark
LINDT & SPRÜNGLI	7.31%	6.84%
SANDOZ GROUP AG	5.67%	5.55%
SGS SA	5.37%	4.30%
SCHINDLER HOLDING AG	4.74%	4.96%
JULIUS BAER GROUP LTD	4.57%	3.85%
STRAUMANN HOLDING AG	4.57%	4.34%
VAT GROUP AG	3.55%	3.03%
BELIMO HOLDING AG	3.12%	1.87%
BALOISE HOLDING AG	2.90%	2.33%
GALENICA AG	2.74%	1.23%

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

	Groupe de placement		Benchmark	
	Particip.	Nombre	Particip.	Nombre
Grandes entreprises	12.15%	3	9.89%	2
Moyennes entreprises	83.88%	45	81.94%	78
Petites entreprises	3.33%	4	8.17%	105
Liquidités	0.64%	-	-	-