

31 mars 2024

Fondation de placement Swiss Life

Actions Suisse Protect Flex

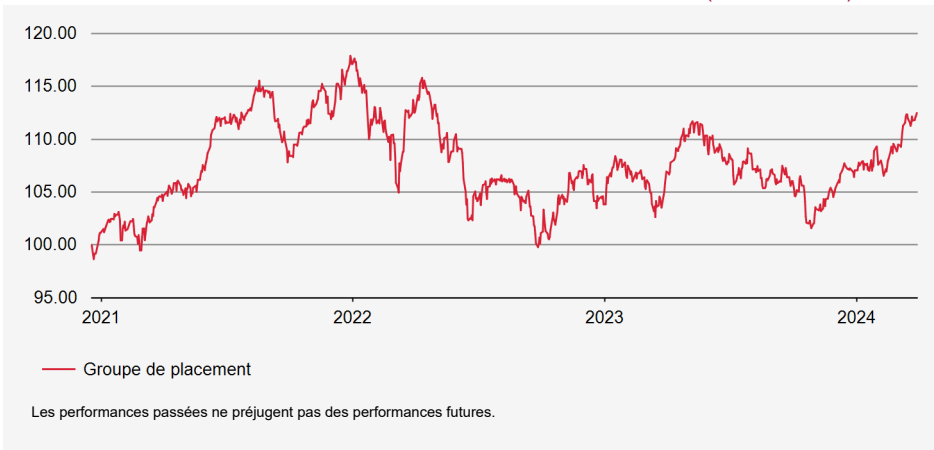


Fortune nette (VNI) en mio. CHF : 174.04
Valeur nette d'inventaire par droit en CHF : 112.49

Stratégie d'investissement

Stratégie d'investissement indexée sur l'indice SMI avec stratégie de couverture des options gérée activement. L'univers de placement du groupe de placement se compose de sociétés du SMI; pondération en fonction de la capitalisation. Possibilité d'effectuer des investissements sous forme de titres de participation, de placements collectifs ou d'instruments dérivés. Mise en place d'une stratégie de couverture complémentaire composée d'options sous forme de liquidités permet, en cas de fortes baisses des marchés, de réduire les pertes de cours, et, en cas de fortes hausses, de limiter le potentiel haussier. Selon les estimations du marché, il est possible de renoncer à la vente d'options put et/ou d'option call. Réalisation au moyen du SLF (CH) Equity Switzerland Protect Enhanced.

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



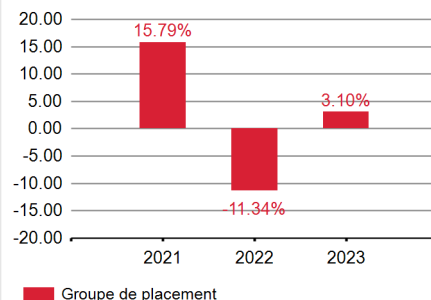
Performances en devise de référence

| | Performances cumulées | | | | Performances annualisées | | | |
|---------------------|-----------------------|--------|--------|-------|--------------------------|-------|--------|---------|
| | YTD | 1 mois | 3 mois | 1 an | 3 ans | 5 ans | 10 ans | Origine |
| Groupe de placement | 5.07% | 3.15% | 5.07% | 5.19% | 2.60% | - | - | 3.66% |

Données statistiques (annualisées)

| | 1 an | 3 ans | 5 ans | 10 ans | Origine |
|--|-------|--------|-------|--------|---------|
| Volatilité du groupe de placement (en %) | 7.52 | 9.16 | - | - | 9.06 |
| Sharpe Ratio | 0.46 | 0.24 | - | - | 0.36 |
| Maximum Drawdown (en %) | -9.05 | -15.35 | - | - | -15.35 |
| Recovery Period (ans) | 0.38 | - | - | - | - |

Performance



Info. sur le produit

Numéro de valeur: 58002332
ISIN: CH0580023320
LEI: 254900ZUTROYHLYQ4E86
Code Bloomberg: SLSPFC SW
Monnaie: CHF
Pays d'origine: Suisse
Date de création: 18/12/2020
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 Asset Management SA
Publication de cours: Bloomberg: ASSL
www.swisslife.ch/fondationdeplacement
Taux des charges d'exploitation TER KGAST
au préalable: 0.45%
a posteriori au: 30/09/2023 0.45%

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 |
|-------------------------------|---------------------|
| Santé | 33.57% |
| Finance | 18.26% |
| Biens de consommation de base | 14.91% |
| Matériaux | 9.09% |
| Industrie | 7.64% |
| Consommation discrétionnaire | 5.67% |
| Future sur indice actions | 1.34% |
| Services de communication | 1.08% |
| Technologie de l'information | 1.02% |
| Liquidités / Pensions | 7.42% |

Les positions principales

| | Groupe de placement |
|------------------------------|---------------------|
| NESTLE SA-REG | 14.91% |
| NOVARTIS AG-REG | 14.21% |
| ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN | 12.42% |
| UBS GROUP AG-REG | 6.52% |
| CIE FINANCIERE RICHEMO-A REG | 5.67% |
| ZURICH INSURANCE GROUP AG | 5.47% |
| ABB LTD-REG | 5.20% |
| HOLCIM LTD | 3.32% |
| SIKA AG-REG | 3.31% |
| LONZA GROUP AG-REG | 3.09% |