

31 mars 2024

Fondation de placement Swiss Life Actions Etranger ESG Indexées PM

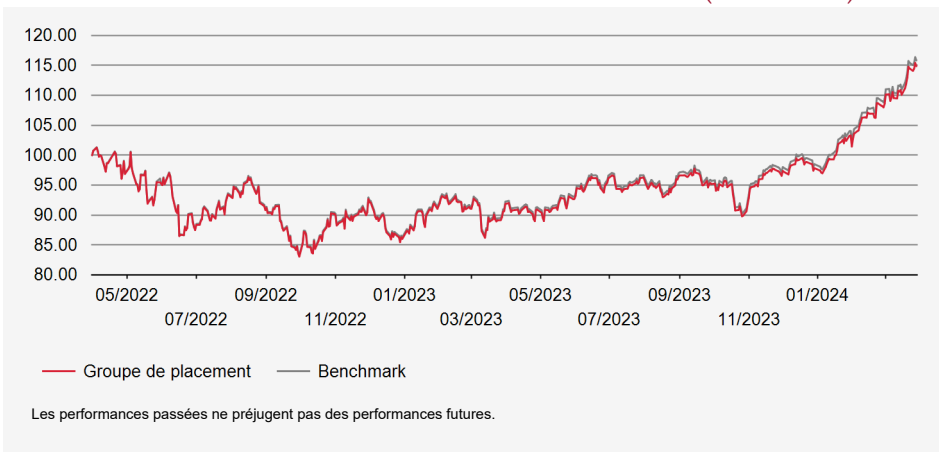


Fortune nette (VNI) en mio. CHF : 270.75
Valeur nette d'inventaire par droit en CHF : 114.87

Stratégie d'investissement

Placements dans des titres de participation de sociétés figurant dans le MSCI World ex Switzerland ESG Leaders, en CHF. Sont également autorisés les titres de participation de sociétés qui, en raison d'adaptations de l'indice de référence, n'y figurent pas encore ou plus (écart max. +0,5 point de pourcentage). Mise en œuvre via Swiss Life iFunds (CH) Equity ESG Global ex Switzerland (CHF).

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



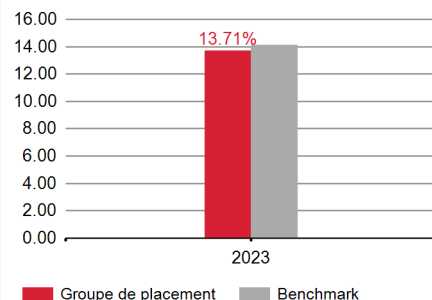
Performances en devise de référence

	Performances cumulées				Performances annualisées			
	YTD	1 mois	3 mois	1 an	3 ans	5 ans	10 ans	Origine
Groupe de placement	17.39%	5.75%	17.39%	25.02%	-	-	-	7.20%
Benchmark	17.59%	5.81%	17.59%	25.55%	-	-	-	7.65%

Données statistiques (annualisées)

	1 an	3 ans	5 ans	10 ans	Origine
Volatilité du groupe de placement (en %)	10.89	-	-	-	16.25
Volatilité du Benchmark (en %)	10.94	-	-	-	16.27
Tracking Error ex post (en %)	0.20	-	-	-	0.15
Information Ratio	-2.65	-	-	-	-2.85
Sharpe Ratio	1.90	-	-	-	0.35
Corrélation	1.00	-	-	-	1.00
Beta	1.00	-	-	-	1.00
Jensen alpha	-0.43	-	-	-	-0.44
Maximum Drawdown (en %)	-8.12	-	-	-	-17.96
Recovery Period (ans)	0.07	-	-	-	1.30

Performance



Info. sur le produit

Numéro de valeur: 117189938
ISIN: CH1171899383
LEI: 254900Q154AKVWL8UQ41
Code Bloomberg: SWAEIPC SW
Benchmark: MSCI World ex Switzerland ESG Leaders Net Return
Monnaie: CHF
Pays d'origine: Suisse
Date de création: 31/03/2022
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@: UBS 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/fondationdeplacement
Taux des charges d'exploitation TER KGAST au préalable: 0.32%
à posteriori au: 30/09/2023 0.32%

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	26.94%	27.20%
Finance	14.24%	14.30%
Santé	11.63%	11.74%
Industrie	10.69%	10.77%
Consommation discrétionnaire	9.97%	10.06%
Services de télécommunication	8.29%	8.37%
Biens de consommation de base	6.36%	6.40%
Matériaux	4.00%	4.04%
Energie	2.97%	2.99%
Immobilier	2.45%	2.48%
Services aux collectivités	1.61%	1.65%
Liquidités	0.86%	-

Les positions principales

	Groupe de placement	Benchmark
MICROSOFT CORP.	9.06%	9.15%
NVIDIA CORP	6.81%	6.88%
ALPHABET INC	5.12%	5.17%
ELI LILLY & CO	1.91%	1.93%
TESLA INC	1.53%	1.55%
VISA INC	1.35%	1.36%
NOVO NORDISK A/S	1.28%	1.28%
MASTERCARD INC	1.24%	1.24%
ASML HOLDING NV	1.19%	1.20%
HOME DEPOT INC/THE	1.17%	1.18%

Structure du portefeuille selon les pays/régions

	Groupe de placement	Benchmark
Etats-Unis	72.79%	73.49%
Japon	6.77%	6.78%
France	3.38%	3.47%
Grande-Bretagne	3.32%	3.41%
Canada	3.11%	3.14%
Allemagne	1.30%	1.27%
Autres pays européens	6.24%	6.23%
Autres pays Asie	2.22%	2.21%
Autres	-	-
Liquidités	0.86%	-

Structure du portefeuille selon les monnaies

	Groupe de placement	Benchmark
USD	73.41%	73.30%
EUR	8.07%	8.16%
JPY	6.78%	6.78%
GBP	3.49%	3.57%
Autres	8.24%	8.18%