

31 mars 2024

Fondation de placement Swiss Life

Actions Global ESG PM

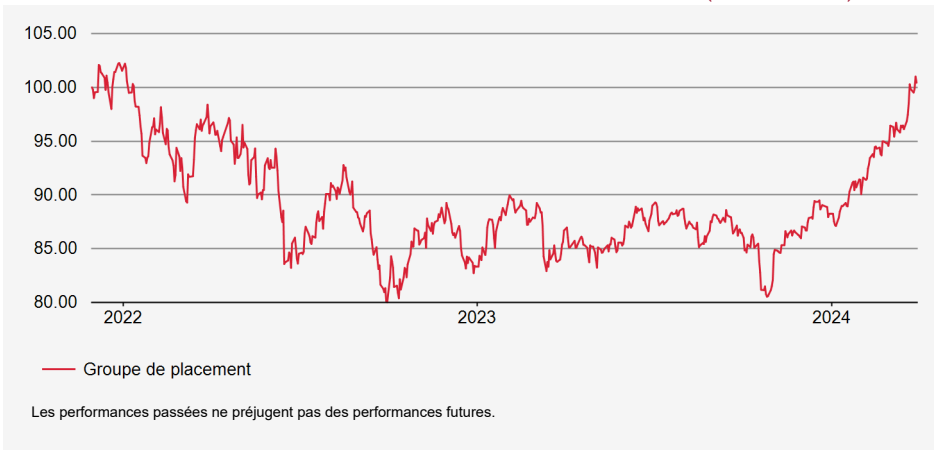


Fortune nette (VNI) en mio. CHF : 6.42
Valeur nette d'inventaire par droit en CHF : 100.43

Stratégie d'investissement

Le groupe de placement suit une approche core-satellite. La partie core du portefeuille, qui s'élève à environ 70%, est gérée activement et investit majoritairement dans des petites et moyennes capitalisations. Elle se distingue par un solide profil ESG. La mise en œuvre est assurée via le Swiss Life Funds (LUX) Equity ESG Global. La partie satellite du portefeuille, qui s'élève à environ 30%, investit majoritairement dans des petites et moyennes capitalisations, qui génèrent une grande partie de leurs revenus avec des produits et services qui promeuvent la durabilité écologique. La mise en œuvre des satellites se fait à hauteur d'environ 10% respectivement dans Swiss Life Funds (LUX) Equity Climate Impact, Swiss Life Funds (LUX) Equity Green Buildings & Infrastructure Impact et Swiss Life Funds (LUX) Equity Environment & Biodiversity Impact. Les pourcentages peuvent varier dans des fourchettes prédéfinies. La limite par société est de 5%.

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



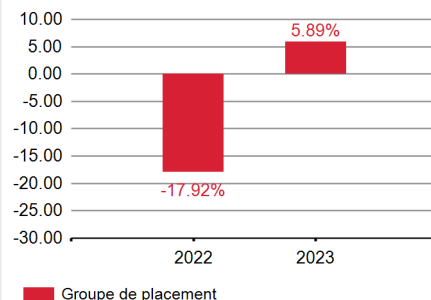
Performances en devise de référence

	Performances cumulées				Performances annualisées			
	YTD	1 mois	3 mois	1 an	3 ans	5 ans	10 ans	Origine
Groupe de placement	13.80%	5.60%	13.80%	15.85%	-	-	-	0.18%

Données statistiques (annualisées)

	1 an	3 ans	5 ans	10 ans	Origine
Volatilité du groupe de placement (en %)	12.30	-	-	-	16.30
Sharpe Ratio	1.06	-	-	-	-0.03
Maximum Drawdown (en %)	-9.81	-	-	-	-21.73
Recovery Period (ans)	0.13	-	-	-	-

Performance



Info. sur le produit

Numéro de valeur: 113873878
ISIN: CH1138738781
LEI: 254900RNJ8UYJ3OTB72
Code Bloomberg: SWAGEPC SW
Monnaie: CHF
Pays d'origine: Suisse
Date de création: 30/11/2021
Valeur de lancement: 100.00
Clôture de l'exercice: 30.9
Souscription/Rachat: journalier
Délai final d'acceptation: 11h00
Commission de souscription/rachat: aucune
Pratique de distribution: Capitalisation
Asset Manager
Swiss Life Asset Management SA
Publication de cours: Bloomberg: ASSL
www.swisslife.ch/fondationdeplacement
Taux des charges d'exploitation TER KGAST
au préalable: 0.24%
à posteriori au: 30/09/2023 0.24%

PM tranche: Le cercle des investisseurs est limité aux investisseurs qualifiés, qui ont signé un contrat de gestion de fortune ou un autre contrat de services financiers onéreux avec Swiss Life Asset Management SA ou avec une autre société appartenante au groupe Swiss Life.

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
Technologie de l'information	22.18%
Industrie	18.35%
Finance	10.16%
Consommation discrétionnaire	9.34%
Santé	8.30%
Biens de consommation de base	5.90%
Services de communication	5.78%
Services aux collectivités	4.86%
Matériaux	4.82%
Immobilier	3.84%
Energie	2.98%
Liquidités	3.30%
Equity index future	0.20%

Structure du portefeuille selon les
pays/régions

	Groupe de placement
USA et Canada	64.75%
Région Asie et Pacifique	11.31%
Région Européenne (EUR)	9.22%
Région Européenne (Ex EUR)	9.18%
Norway	1.15%
Marchés Émergents Moyen-Orient	0.46%
Marchés Émergents Asie-Pacifique	0.38%
Future sur indice actions	0.20%
Portugal	0.06%
Liquidités	3.30%

Les positions principales

	Groupe de placement
MICROSOFT CORP	3.72%
NVIDIA CORP	3.41%
APPLE INC	2.37%
ALPABET INC-CL	1.48%
AMAZON.COM INC	1.46%
META PLATFORMS INC-CLASS A	0.87%
JPMORGAN CHASE & CO	0.82%
REPUBLIC SERVICES INC	0.77%
UNITEDHEALTH GROUP INC	0.69%
NOVO NORDISK A/S-B	0.64%

Structure du portefeuille selon les
monnaies

	Groupe de placement
USD	60.30%
EUR	11.87%
JPY	8.52%
GBP	3.79%
CHF	1.55%
Autres	13.97%