

31 mars 2024

Fondation de placement Swiss Life

Actions Suisse Protect Flex PM

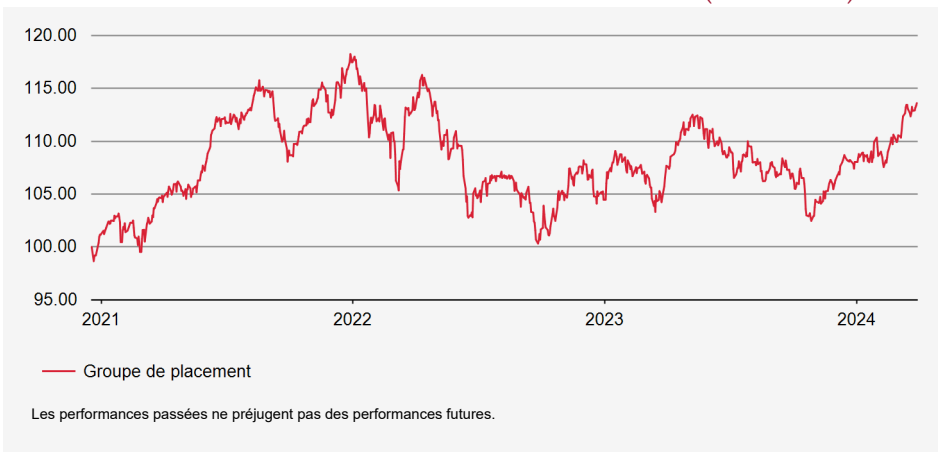


Fortune nette (VNI) en mio. CHF : 174.04
Valeur nette d'inventaire par droit en CHF : 113.61

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)



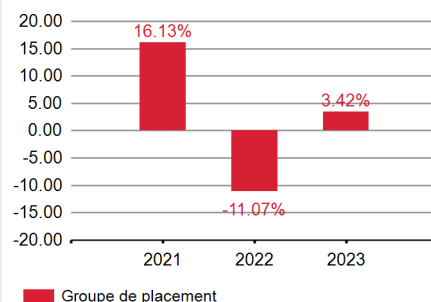
Performances en devise de référence

	Performances cumulées				Performances annualisées			
	YTD	1 mois	3 mois	1 an	3 ans	5 ans	10 ans	Origine
Groupe de placement	5.16%	3.18%	5.16%	5.51%	2.91%	-	-	3.97%

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	0.50	0.27	-	-	0.39
Maximum Drawdown (en %)	-8.92	-15.16	-	-	-15.16
Recovery Period (ans)	0.37	-	-	-	-

Performance



Info. sur le produit

Numéro de valeur: 58002364
ISIN: CH0580023643
LEI: 254900ZUTROYHLYQ4E86
Code Bloomberg: SLSPFPM 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: 0.15%
a posteriori au: 30/09/2023 0.15%

PM tranche: L'acquisition de cette tranche n'est possible que dans le cadre d'une convention spéciale avec Swiss Life Asset Management SA.
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.

31 mars 2024

Fondation de placement Swiss Life Actions Suisse Protect Flex PM



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%

Avertissement: La présente publication ne constitue ni une incitation ni une recommandation pour la vente ou l'achat d'instruments de placement, et son but est uniquement d'informer. Tous les documents constituant la base légale dans le cadre d'un éventuel placement peuvent être obtenus gratuitement auprès de la Fondation de placement Swiss Life, c/o Swiss Life SA, case postale, 8022 Zurich, tél. 043 547 71 11 et sur www.swisslife.ch/anlagestiftung. Le cercle des investisseurs est limité aux institutions du 2e pilier et du pilier 3a, ainsi que les autres institutions de prévoyance professionnelle exonérées d'impôts avec siège en Suisse et aux personnes qui gèrent des placements collectifs pour ces institutions, qui sont soumises à la surveillance de l'Autorité fédérale de surveillance des marchés financiers FINMA et qui ne placent dans la fondation que des fonds destinés à ces institutions. En outre, les investisseurs mentionnés doivent avoir conclu une convention spéciale avec Swiss Life Asset Management SA. La performance passée ne saurait présumer de l'évolution en cours ou à venir. Leur utilisation n'implique aucune adhésion ni affiliation de leur part. **Source:** Swiss Life Asset Managers. Tous droits réservés.