

Fondation de placement Swiss Life

Actions Etranger Protect (couvertes en CHF)



Stratégie d'investissement

- Placement indexé avec stratégie de couverture complémentaire et basée sur des règles précises
- Univers de placement composé de sociétés faisant partie des principaux indices boursiers étrangers (S&P500, Eurostoxx50, FTSE100 et Nikkei225) ainsi que du SMI; pondération selon la capitalisation du marché) en couvrant les risques de change par rapport au franc suisse au moins 90%
- Possibilité d'effectuer des investissements sous forme de titres de participation, de placements collectifs ou d'instruments dérivés
- Limite par société: 5%
- 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 (Put Spread Collar)
- Possibilité de placer sur le marché les liquidités pouvant être conservées grâce à l'utilisation d'instruments dérivés

Informations sur le produit

| | |
|---|--|
| Numéro de valeur | 13016964 |
| ISIN | CH0130169649 |
| LEI | 5493009CH5U7IN4LEI63 |
| Bloomberg Ticker | SWLAUSP SW |
| Benchmark | - |
| Monnaie * | CHF |
| Date de création | 30.06.2011 |
| Valeur de lancement | 100.00 |
| Clôture de l'exercice | 30.09. |
| Souscription/Rachat | journalier |
| Délai final d'acceptation | 14h30 |
| 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 | 0.59% |
| - a posteriori 30.09.2018 | 0.62% |
| Commission de souscription/rachat | aucune |
| Pratique de distribution | Capitalisation |

* Jusqu'au 31.12.2012 (découvert)

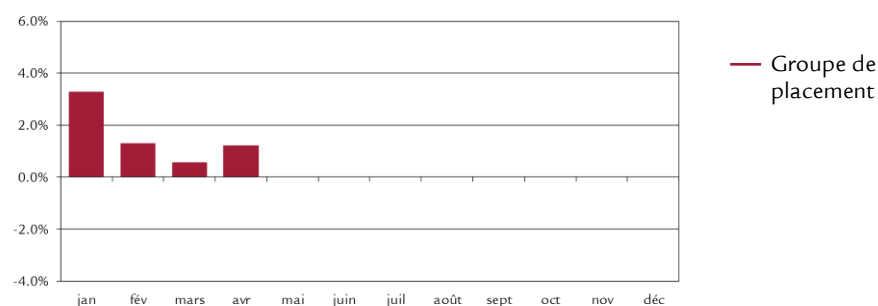
** Le taux des charges d'exploitation TER_{KGAST} couvre tous les coûts à l'exception des frais de transaction et des prélèvements fiscaux sur les transactions

Evolution du cours indexée et performance



| Performance | 1M | 3M | 1A | 3A p.a. | 5A p.a. | depuis 30.06.11 |
|----------------------------|------|-------|------|---------|---------|-----------------|
| Groupe de placement (en %) | 1.21 | 3.08 | 0.64 | 4.18 | 3.65 | 5.10 |
| | YTD | 2018 | 2017 | 2016 | 2015 | 2014 |
| Groupe de placement (en %) | 6.45 | -5.99 | 6.95 | 5.27 | 1.43 | 5.32 |

Performance mensuelle



Données statistiques (annualisées)

| | 1A | 3A | 5A | depuis 30.06.11 |
|---------------------------------------|-------|-------|-------|-----------------|
| Volatilité Groupe de placement (en %) | 8.09 | 5.19 | 5.65 | 6.44 |
| Sharpe Ratio | 0.17 | 0.93 | 0.75 | 0.83 |
| Maximum Drawdown (en %) | -9.18 | -9.18 | -9.18 | -23.41 |
| Recovery Period (ans) | - | - | - | 0.19 |

Chiffres caractéristiques

| | 31.12.2018 | 30.04.2019 |
|---|------------|------------|
| Fortune en mio. CHF | 232.4 | 282.8 |
| Valeur nette d'inventaire par part en CHF | 138.68 | 147.63 |

30 avril 2019

Fondation de placement Swiss Life

Actions Etranger Protect (couvertes en CHF)



Détails de la valeur de la stratégie de couverture

| | Groupe de placement |
|---------------------------------------|---------------------|
| Long Put sur S&P500 à 2'395.80 | 0.65% |
| Short Put sur SMI à 2'017.51 | -0.21% |
| Short Call sur S&P500 à 2'749.51 | -6.75% |
| Long Put sur Eurostoxx50 à 2'726.55 | 0.10% |
| Short Put sur Eurostoxx50 à 2'296.04 | -0.03% |
| Short Call sur Eurostoxx50 à 3'123.91 | -1.58% |
| Long Put sur FTSE100 à 6'174.40 | 0.09% |
| Short Put sur FTSE100 à 5'199.50 | -0.02% |
| Short Call sur FTSE100 à 7'059.15 | -0.60% |
| Long Put sur Nikkei225 à 18'567.30 | 0.17% |
| Short Put sur Nikkei225 à 15'635.54 | -0.06% |
| Short Call sur Nikkei225 à 21'676.00 | -0.85% |
| Total | -9.09% |

Structure de portefeuille

| | Groupe de placement |
|---|---------------------|
| S&P500 (exposition via futures synthétiques) | 71.2% |
| Eurostoxx50 (exposition via futures synthétiques) | 14.4% |
| FTSE100 (exposition via futures synthétiques) | 10.0% |
| Nikkei225 (exposition via futures synthétiques) | 13.5% |
| Stratégie de couverture (Put Spread Collar) | -9.1% |
| Contrats à terme normalisés sur devises | 0.0% |
| Liquidités | 0.0% |
| Total | 100.0% |

Détails relatifs aux placements des liquidités

| | Groupe de placement |
|--|---------------------|
| Fonds du marché monétaire | 33.9% |
| Avoirs bancaires, postales, compte sur marge auprès des banques | 66.1% |
| Total | 100.0% |

Disclaimer

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, case postale, 8022 Zurich, tél. 043 284 79 79. 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 les institutions selon l'al. 1, let. a, qui sont soumises à la surveillance de l'Autorité fédérale de surveillance des marchés financiers et qui ne placent dans la fondation que des fonds destinés à ces institutions.

La performance passée ne saurait présumer de l'évolution en cours ou à venir. Les données relatives aux performances ne tiennent pas compte des commissions et frais éventuellement prélevés au moment de l'émission ou du rachat des parts.