

Stratégie d'investissement

- Placement dans des titres de participation émis par des sociétés domiciliées à l'étranger
- Les grosses & moyennes capitalisations sont couvertes passivement, les petites capitalisations ainsi que le secteur des marchés émergents sont gérés activement («core-satellite»)
- Limite par société: 5%
- Sociétés hors benchmark: max. 10%
- Réalisation au moyen du Swiss Life iFunds (CH) Equity Global ex Switzerland (CHF), Invesco Global Small Cap Equity Fund et du fonds Candriam Equities L Emerging Markets

Informations sur le produit

Numéro de valeur	1245539
ISIN	CH0012455397
LEI	2549000B6X3SG0K4LZ68
Bloomberg Ticker	SWAAKAU SW
Benchmark *	

80% MSCI World ex CH, en CHF
15% MSCI AC World Small Cap, en CHF
5% MSCI Emerging Markets, en CHF

Monnaie CHF

Date de création 30.09.2001

Valeur de lancement 100.00

Clôture de l'exercice 30.09.

Souscription/Rachat journalier

Délai final d'acceptation 14h30

Asset Manager selon

Swiss Life Best Select Invest Plus® **

Large & Mid Caps (passive) UBS SA

Small Caps (active) Invesco

EmMa (actifs) Candriam Investors Group

Conseil externe

PPCmetrics fournit les prestations suivantes: conseil concernant les bonnes structures de mandat («core-satellite»), aide à la sélection de gestionnaires de fortune adéquats et soutien dans le cadre de la surveillance continue des gestionnaires 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 0.78%

- a posteriori au 30.09.2018 0.78%

Commission de souscription/rachat aucune

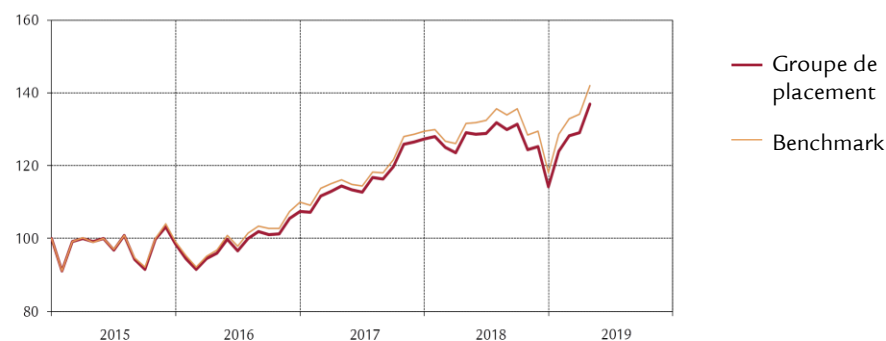
Pratique de distribution Capitalisation

* Jusqu'au 31.12.2009 100% MSCI World, ex CH, en CHF

** La sélection des gestionnaires, leur surveillance continue et le suivi complet du processus sont effectués par Swiss Life Asset Management SA selon des critères objectifs, conformément à une excellente pratique institutionnelle

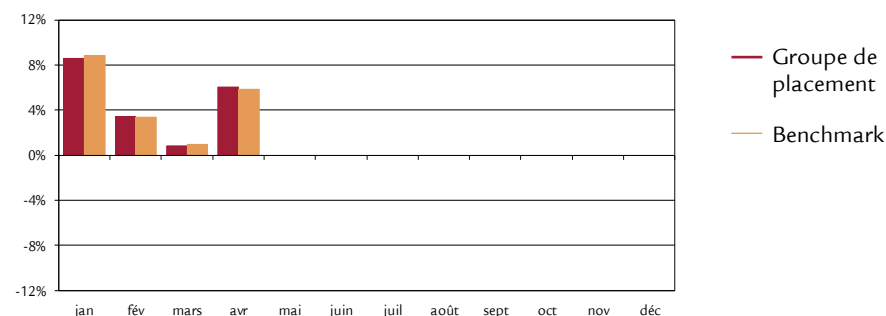
*** Le taux des charges d'exploitation TER_{KGAST} couvre tous les coûts à l'exception des frais de transaction et des prélèvements fiscaux sur les transactions

Evolution du cours indexée et performance



Performance	1M	3M	1A	3A	5A	10A	p.a. depuis 30.09.01
				p.a.	p.a.	p.a.	
Groupe de placement (en %)	6.04	10.51	6.08	12.62	9.42	9.44	2.89
Benchmark (en %)	5.82	10.41	7.82	13.61	10.39	10.30	4.19
	YTD	2018	2017	2016	2015	2014	2013
Groupe de placement (en %)	19.99	-10.32	18.39	9.06	-1.46	15.46	21.28
Benchmark (en %)	20.19	-8.82	17.79	10.82	-0.80	16.54	22.32

Performance mensuelle



Données statistiques (annualisées)

	1A	3A	5A	10A	depuis 30.09.01
Volatilité du groupe de placement (en %)	15.96	11.12	12.60	12.21	15.00
Volatilité Benchmark (en %)	15.98	11.14	12.60	12.25	15.31
Tracking Error ex post (en %)	0.69	0.77	0.82	0.81	1.56
Tracking Error ex ante (en %)	0.80				
Information Ratio	-2.52	-1.28	-1.19	-1.06	-0.84
Sharpe Ratio	0.42	1.14	0.77	0.76	0.16
Corrélation	1.00	1.00	1.00	1.00	0.99
Beta	1.00	1.00	1.00	0.99	0.97
Jensen-Alpha	-1.60	-0.81	-0.86	-0.73	-1.17
Maximum Drawdown (en %)	-15.92	-15.92	-18.61	-36.35	-60.40
Recovery Period (ans)	0.31	0.31	0.78	1.43	7.84

Chiffres caractéristiques

	31.12.2018	30.04.2019
Fortune en mio. CHF	196.8	241.5
Valeur nette d'inventaire par part en CHF	137.46	164.94

30 avril 2019

Fondation de placement Swiss Life Actions Etranger



Structure du portefeuille selon les pays/régions¹⁾

	Groupe de placement	Benchmark		Groupe de placement	Benchmark
Amérique du Nord	61.6%	63.3%	Etats-Unis	58.6%	60.0%
Europe	19.2%	18.4%	Grande-Bretagne	6.1%	5.8%
Asie	15.1%	14.7%	France	3.7%	3.4%
Autres	4.1%	3.6%	Allemagne	2.7%	2.8%
Liquidités	0.0%	-	Japon	8.2%	8.3%
Total	100.0%	100.0%			

¹⁾ Compte tenu des dérivés et des placements collectifs

Structure du portefeuille par branches²⁾

	Groupe de placement	Benchmark
Sociétés financières	16.5%	16.1%
Technologie de l'information	16.4%	16.2%
Consommation discrétionnaire	11.5%	11.1%
Industries	12.1%	11.9%
Santé	10.6%	10.8%
Biens de consommation de base	7.1%	7.3%
Energie	5.7%	5.8%
Matière première	4.8%	5.0%
Services de télécommunication	8.1%	8.1%
Immeubles	4.1%	4.4%
Services aux collectivités	3.1%	3.3%
Liquidités	0.0%	-
Total	100.0%	100.0%

²⁾ Compte tenu des dérivés et des placements collectifs

Les positions principales³⁾

	Groupe de placement	Benchmark
Apple Inc.	1.9%	1.9%
Microsoft Corp.	1.9%	1.9%
Amazon.com, Inc.	1.6%	1.6%
Alphabet Inc	1.5%	1.5%
Facebook, Inc. Class A	0.9%	0.9%
JPMorgan Chase & Co.	0.8%	0.8%
Johnson & Johnson	0.8%	0.8%
Exxon Mobil Corp.	0.7%	0.7%
Visa Inc	0.6%	0.6%
Bank of America Corp	0.6%	0.6%

³⁾ Compte tenu des dérivés et des placements collectifs

Indications supplémentaires sur les débiteurs

Nombre de débiteurs	7'834
Part de débiteurs hors du benchmark	4.8%

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.