

Stratégie d'investissement

- Placement dans des titres de participation de sociétés représentées dans le Swiss Performance Index (SPI)
- Les grosses capitalisations sont couvertes passivement, les petites et moyennes capitalisations sont gérées activement («core-satellite»)
- Limite par société: 5% (exception: à condition que les sociétés soient dans le benchmark; max. 5% points de plus que pondération dans le benchmark)
- Réalisation au moyen du Swiss Life iFunds (CH) Equity Switzerland (CHF) et Equity Switzerland Small & Mid Cap (CHF); fonds de placement de droit suisse de la catégorie "Autres fonds en investissements traditionnels"

Informations sur le produit

Numéro de valeur	1245481
ISIN	CH0012454812
LEI	254900UNZU5YPIKQTQ23
Bloomberg Ticker	SWAAKCH SW
Benchmark	Swiss Performance Index
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 Caps (passive)
	Pictet Asset Management SA
	Small&Mid Caps (active)
	Privatbank Von Graffenried AG

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 0.54%
- a posteriori au 30.09.2018 0.54%

Commission de souscription/rachat aucune

Pratique de distribution Capitalisation

* 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

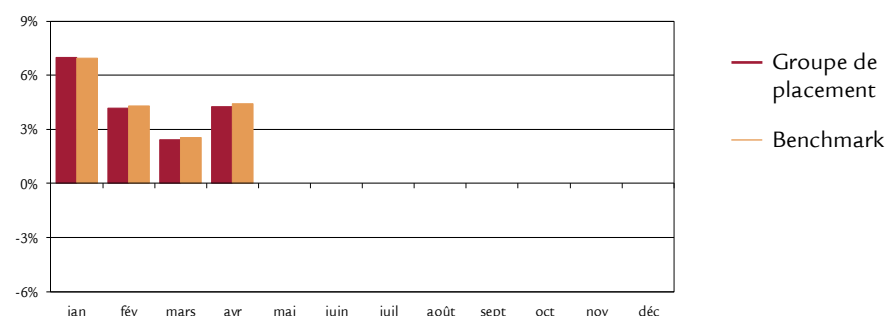
** Le taux des charges d'exploitation TER_{KGAST} couvre tous les coûts à l'exception des frais de transaction et des prélèvements fiscaux sur les transactions

Evolution du cours indexée et performance



Performance	1M	3M	1A	3A	5A	10A	p.a depuis 30.09.01
Groupe de placement (en %)	4.24	11.25	10.99	10.67	6.57	9.68	5.59
Benchmark (en %)	4.39	11.61	11.50	11.06	7.09	10.09	6.18
	YTD	2018	2017	2016	2015	2014	2013
Groupe de placement (en %)	19.00	-8.61	19.03	-1.44	2.06	11.84	24.38
Benchmark (en %)	19.38	-8.57	19.92	-1.41	2.68	13.00	24.60

Performance mensuelle



Données statistiques (annualisées)

	1A	3A	5A	10A	depuis 30.09.01
Volatilité du groupe de placement (en %)	13.93	10.11	11.65	11.18	12.93
Volatilité Benchmark (en %)	13.89	10.14	11.67	11.21	13.32
Tracking Error ex post (en %)	0.27	0.29	0.30	0.44	1.35
Tracking Error ex ante (en %)	0.30				
Information Ratio	-1.93	-1.35	-1.73	-0.93	-0.44
Sharpe Ratio	0.80	1.08	0.60	0.85	0.39
Corrélation	1.00	1.00	1.00	1.00	1.00
Beta	1.00	1.00	1.00	1.00	0.97
Jensen-Alpha	-0.49	-0.32	-0.46	-0.34	-0.37
Maximum Drawdown (en %)	-12.72	-13.18	-19.54	-28.03	-54.46
Recovery Period (ans)	0.16	0.16	1.17	1.15	4.96

Chiffres caractéristiques

	31.12.2018	30.04.2019
Fortune en mio. CHF	197.1	240.0
Valeur nette d'inventaire par part en CHF	218.68	260.23

30 avril 2019

Fondation de placement Swiss Life Actions Suisse



Structure du portefeuille en fonction de la taille de l'entreprise¹⁾

	Groupe de placement		Benchmark	
	Particip.	Nombre	Particip.	Nombre
Grandes entreprises	79.4%	19	78.7%	19
Moyennes entreprises	18.6%	51	19.3%	79
Petites entreprises	0.9%	8	2.0%	115
Liquidités	1.1%	-	-	-
Total	100.0%	78	100.0%	213

¹⁾ Compte tenu des dérivés et des placements collectifs

Structure du portefeuille par branches²⁾

	Groupe de placement	Benchmark
Santé	34.2%	34.9%
Biens de consommation	27.0%	26.9%
Sociétés financières	16.1%	18.8%
Industries	15.6%	13.5%
Matériaux de base	2.1%	2.2%
Télécommunication	1.1%	1.0%
Technologie	1.4%	1.7%
Services aux consommateurs	1.0%	0.9%
Services aux collectivités	0.4%	0.1%
Pétrole et gaz	0.0%	0.0%
Liquidités	1.1%	-
Total	100.0%	100.0%

²⁾ Compte tenu des dérivés et des placements collectifs

Les positions principales³⁾

	Groupe de placement	Benchmark
Nestlé	21.4%	21.2%
Novartis	15.2%	15.0%
Roche BJ	13.5%	13.3%
UBS	3.8%	3.7%
Cie Fin Richemont	3.5%	3.5%
Zurich Insurance Group	2.8%	2.8%
ABB	2.7%	2.7%
Credit Suisse Group	2.4%	2.3%
Swiss Re	2.1%	2.1%
LafargeHolcim	2.0%	2.0%

³⁾ Compte tenu des dérivés et des placements collectifs

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 2^e 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.