31 mars 2024

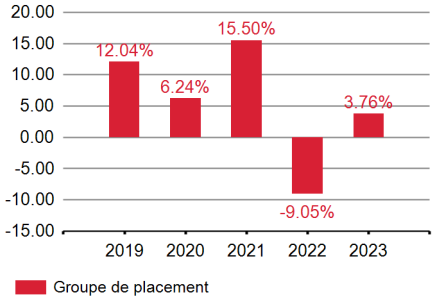
Fondation de placement Swiss Life
Actions Global Protect Flex (couvertes en CHF)

Fortune nette (VNI) en mio. CHF : 1,391.13
Valeur nette d'inventaire par droit en CHF : 147.97

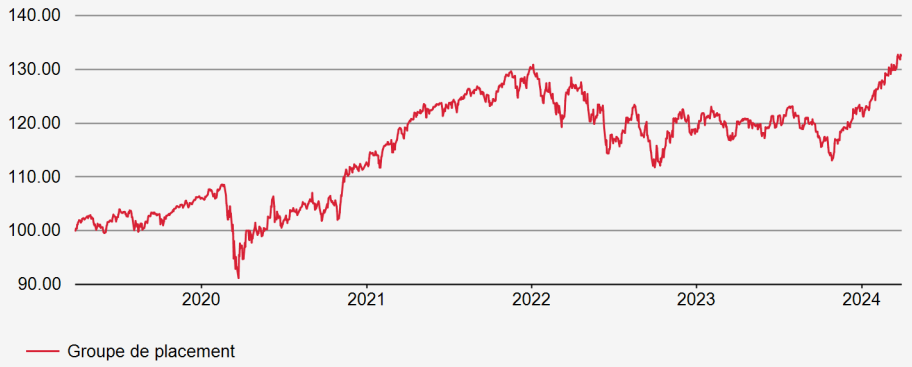
Stratégie d'investissement

Stratégie d'actions active basée sur des règles avec stratégie de couverture complémentaire. L'univers de placement se compose de sociétés des indices boursiers étrangers (notamment S&P 500, Euro Stoxx 50, FTSE 100 et Nikkei 225) ainsi que du SMI; pondération selon la capitalisation. Les risques de change sont couverts à raison de 90 % au moins par rapport au franc suisse. 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 (Put Spread Collar). 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 Global Protect (CHF hedged).

Performance



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



Les performances passées ne préjugent pas des performances futures.

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	7.87%	2.86%	7.87%	10.15%	3.77%	5.70%	-	5.07%

Données statistiques (annualisées)

	1 an	3 ans	5 ans	10 ans	Origine
Volatilité du groupe de placement (en %)	9.46	10.26	9.97	-	8.57
Sharpe Ratio	0.85	0.32	0.56	-	0.61
Maximum Drawdown (en %)	-8.15	-14.58	-15.99	-	-15.99
Recovery Period (ans)	0.17	1.43	0.63	-	0.63

Info. sur le produit

Numéro de valeur: 31952442
ISIN: CH0319524424
LEI: 254900LUAQC3MC0MWL48
Code Bloomberg: SLAGPCH SW
Monnaie: CHF
Pays d'origine: Suisse
Date de création: 29/04/2016
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: 0.60%
a posteriori au: 30/09/2023 0.60%

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 Global Protect Flex (couvertes en CHF)

Structure du portefeuille par branches

	Groupe de placement
Technologie de l'information	16.24%
Finance	14.09%
Industrie	13.61%
Santé	12.65%
Consommation discrétionnaire	8.98%
Biens de consommation de base	6.76%
Services de communication	5.43%
Services aux collectivités	5.05%
Matériaux	4.61%
Energie	2.79%
Immobilier	2.43%
Future sur indice actions	0.60%
Liquidités / Pensions	6.77%

Les positions principales

	Groupe de placement
BROADCOM INC	0.98%
ELI LILLY & CO	0.92%
REPUBLIC SERVICES INC	0.80%
WASTE MANAGEMENT INC	0.78%
MICROSOFT CORP	0.73%
INTL BUSINESS MACHINES CORP	0.68%
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	0.67%
AMPHENOL CORP-CL A	0.67%
DUKE ENERGY CORP	0.65%
TEXAS INSTRUMENTS INC	0.65%

Structure du portefeuille selon les pays/régions

	Groupe de placement
USA et Canada	66.28%
Région Européenne (EUR)	10.38%
Région Asie et Pacifique	9.78%
Région Européenne (Ex EUR)	5.92%
Future sur indice actions	0.60%
Marchés Émergents Amériques	0.28%
Liquidités / Pensions	6.77%

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 les 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. 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.