

Stratégie d'investissement

- Placement dans des titres de participation à faible capitalisation du monde entier
- Sélection active des pays, des branches et des titres
- Limite par société: 5%
- Réalisation au moyen du Invesco Global Small Cap Equity Fund

Informations sur le produit

Numéro de valeur	40068789
ISIN	CH0400687890
LEI	254900XCUD9NTWJQU706
Bloomberg Ticker	SWLAGSC SW
Benchmark	MSCI AC World Small Cap, en CHF
Monnaie	CHF
Date de création	28.02.2018
Valeur de lancement	100.00
Clôture de l'exercice	30.09.
Souscription/Rachat	journalier
Délai final d'acceptation *	11h00
Asset Manager selon	Swiss Life Best Select Invest Plus® *

Invesco

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

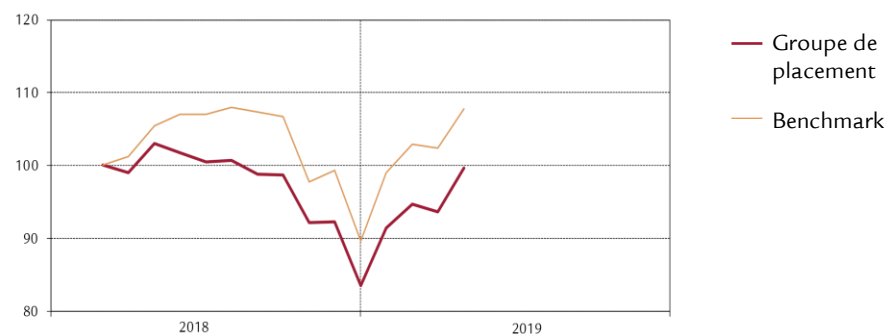
Publication de cours Bloomberg: ASSL
www.swisslife.ch/fondationdeplacement

Taux des charges d'exploitation TER _{KGAST} **	
- au préalable	1.25%
- a posteriori au 30.09.2018	1.25%
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

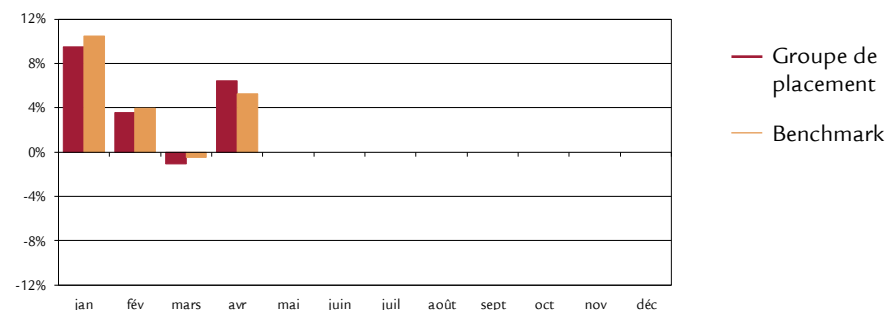
** Le taux des charges d'exploitation TER_{KGAST} couvre tous les coûts à l'exception des frais de transaction et des prélèvements fiscaux sur les transactions

Evolution du cours indexée et performance



Performance	1M	3M	1A	3A p.a.	5Ap.a. depuis p.a. 28.02.18	
Groupe de placement (en %)	6.43	9.03	-3.22		-0.29	
Benchmark (en %)	5.22	8.81	2.16		6.61	
	YTD	2018	2017	2016	2015	2014
Groupe de placement (en %)	19.40					
Benchmark (en %)	20.23					

Performance mensuelle



Données statistiques (annualisées)

	1A	3A	5A depuis 28.02.18
Volatilité du groupe de placement (en %)	17.69		16.76
Volatilité Benchmark (en %)	18.79		17.66
Tracking Error ex post(en %)	4.26		4.27
Tracking Error ex ante (en %)	4.30		
Information Ratio	-1.26		-1.62
Sharpe Ratio	-0.14		0.03
Corrélation	0.97		0.97
Beta	0.92		0.92
Jensen-Alpha	-5.18		-6.13
Maximum Drawdown (en %)	-21.52		-21.52
Recovery Period (ans)	-		-

Chiffres caractéristiques

	31.12.2018	30.04.2019
Fortune en mio. CHF	14.5	19.4
Valeur nette d'inventaire par part en CHF	83.47	99.66

30 avril 2019

Fondation de placement Swiss Life Actions Global Small Caps



Structure du portefeuille selon les pays/régions

	Groupe de placement	Benchmark		Groupe de placement	Benchmark
Amérique du Nord	48.7%	58.5%	Etats-Unis	46.7%	55.2%
Europe	26.4%	21.2%	Grande-Bretagne	8.9%	7.0%
Asie	18.7%	16.0%	France	4.1%	1.3%
Autres	4.0%	4.3%	Allemagne	1.5%	2.2%
Liquidités	2.2%	-	Japon	10.2%	11.0%
Total	100.0%	100.0%			

Structure du portefeuille par branches

	Groupe de placement	Benchmark
Industries	19.6%	16.9%
Sociétés financières	15.7%	13.6%
Consommation discrétionnaire	12.7%	11.7%
Technologie de l'information	13.5%	13.7%
Santé	7.5%	10.7%
Immeubles	8.8%	11.4%
Matière première	6.3%	7.2%
Biens de consommation de base	3.3%	4.4%
Energie	4.1%	3.8%
Services de télécommunication	4.6%	3.7%
Services aux collectivités	1.7%	2.9%
Liquidités	2.2%	-
Total	100.0%	100.0%

Les principales positions en actions

	Groupe de placement	Benchmark
Eurazeo	0.9%	0.9%
Soitec	0.7%	0.7%
Iridium Communications	0.7%	0.7%
Altran	0.7%	0.7%
Spx	0.7%	0.7%
Tkh Group	0.7%	0.7%
Kendrion	0.7%	0.7%
CIT	0.7%	0.7%
Don Quijote	0.6%	0.6%
Aurobindo Pharma	0.6%	0.6%

Indications supplémentaires sur les débiteurs

Nombre de débiteurs	6'039
Part de débiteurs hors du benchmark	26.4%

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.