

Stratégie d'investissement

- Placement dans des titres de participation de sociétés représentées dans le Swiss Performance Index Extra
- Sélection active des branches et des titres
- 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 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	39561890
ISIN	CH0395618900
LEI	254900QGENUS1GIJ4549
Bloomberg Ticker	SWLASMC SW
Benchmark	Swiss Performance Index Extra
Monnaie	CHF
Date de création	01.02.2018
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® *

Privatbank Von Graffenried AG

Conseil externe

PPCmetrics fournit les prestations suivantes: conseil concernant la bonne structure de mandat, aide à la sélection de gestionnaires de fortune adéquats et soutien dans le cadre de la surveillance continue du gestionnaire de fortune, ainsi qu'évaluation des résultats des placements

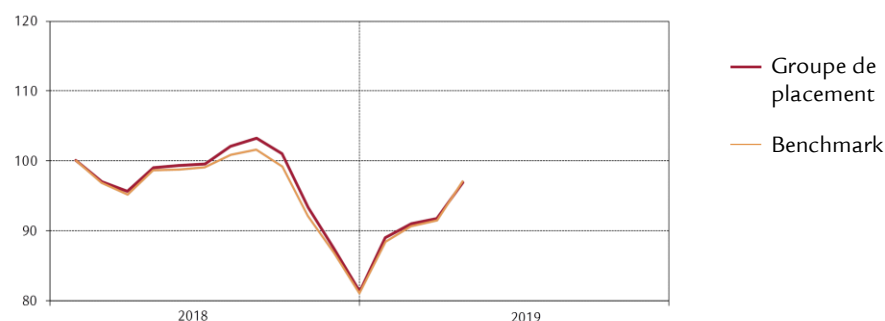
Publication de cours Bloomberg: ASSL
www.swisslife.ch/fondationdeplacement

Taux des charges d'exploitation TER _{KGAST} **	
- au préalable	0.95%
- a posteriori au 30.09.2018	0.95%
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

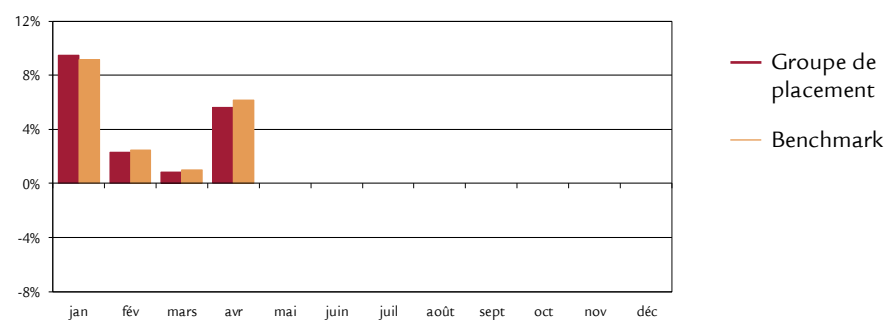
** Le taux des charges d'exploitation TER_{KGAST} couvre tous les coûts à l'exception des frais de transaction et des prélèvements fiscaux sur les transactions

Evolution du cours indexée et performance



Performance	1M	3M	1A	3A	5A p.a. depuis	
				p.a.	p.a. 01.02.18	
Groupe de placement (en %)	5.61	8.95	-2.16		-2.50	
Benchmark (en %)	6.16	9.82	-1.58		-2.34	
	YTD	2018	2017	2016	2015	2014
Groupe de placement (en %)	19.25					
Benchmark (en %)	19.88					

Performance mensuelle



Données statistiques (annualisées)

	1A	3A	5A	depuis
				01.02.18
Volatilité du groupe de placement (en %)	17.69			16.31
Volatilité Benchmark (en %)	17.06			15.88
Tracking Error ex post (en %)	1.42			1.35
Tracking Error ex ante (en %)	1.50			
Information Ratio	-0.41			-0.12
Sharpe Ratio	-0.08			-0.11
Corrélation	1.00			1.00
Beta	1.03			1.02
Jensen-Alpha	-0.56			-0.13
Maximum Drawdown (en %)	-23.34			-23.34
Recovery Period (ans)	-			-

Chiffres caractéristiques

	31.12.2018	30.04.2019
Fortune en mio. CHF	39.4	53.0
Valeur nette d'inventaire par part en CHF	81.24	96.88

30 avril 2019

Fondation de placement Swiss Life Actions Suisse Small & Mid Caps



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

	Groupe de placement		Benchmark	
	Particip.	Nombre	Particip.	Nombre
Grandes entreprises	7.3%	1	6.3%	1
Moyennes entreprises	82.4%	49	83.6%	77
Petites entreprises	4.9%	8	10.1%	115
Liquidités	5.4%	-	-	-
Total	100.0%	58	100.0%	193

¹⁾ Compte tenu des dérivés et des placements collectifs

Structure du portefeuille par branches²⁾

	Groupe de placement	Benchmark
Industries	37.0%	24.7%
Sociétés financières	17.0%	30.7%
Santé	10.0%	14.7%
Biens de consommation	11.6%	11.6%
Technologie	7.3%	8.8%
Services aux consommateurs	5.2%	4.4%
Matériaux de base	3.1%	3.7%
Télécommunication	1.2%	0.8%
Services aux collectivités	2.2%	0.6%
Pétrole et gaz	0.0%	0.0%
Liquidités	5.4%	-
Total	100.0%	100.0%

²⁾ Compte tenu des dérivés et des placements collectifs

Les positions principales³⁾

	Groupe de placement	Benchmark
Partners Group Holding AG	7.3%	6.3%
Schindler Holding AG (PS)	5.5%	3.2%
Kuehne + Nagel International AG	4.6%	3.0%
Baloise Holding AG	3.7%	3.1%
Lindt & Sprüngli (PS)	3.5%	3.0%
Temenos AG	3.4%	3.9%
Logitech International	3.3%	2.5%
Sonova Holding AG	3.1%	4.1%
Vifor Pharma AG	2.9%	1.8%
Georg Fischer AG	2.9%	1.5%

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 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.