

### 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                       | 3026057                       |
| ISIN                                   | CH0030260571                  |
| LEI                                    | 254900UNZU5YPIKQTQ23          |
| Bloomberg Ticker                       | SLACHPM SW                    |
| Benchmark                              | Swiss Performance Index       |
| Monnaie                                | CHF                           |
| Date de création                       | 31.05.2007                    |
| 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  |  |
|  | <a href="http://www.swisslife.ch/fondationplacement">www.swisslife.ch/fondationplacement</a> |  |
| Taux des charges d'exploitation TER <sub>KGAST</sub> *** |  |  |
| - au préalable   | 0.30%  |  |
| - a posteriori au 30.09.2018                             | 0.30%  |  |
| Commission de souscription/rachat                        | aucune   |  |
| Pratique de distribution                                 | Capitalisation   |  |

\* Acquisition de cette tranche n'est possible que dans le cadre d'une convention spéciale avec Swiss Life Asset Managers

\*\* 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

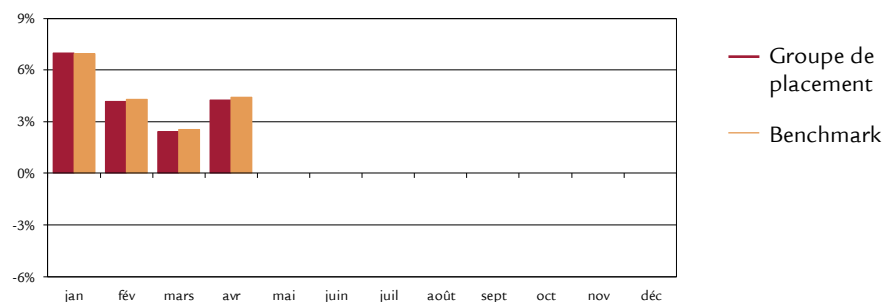
\*\*\* Le taux des charges d'exploitation TER<sub>KGAST</sub> couvre tous les coûts à l'exception des frais de transaction et des prélèvements fiscaux sur les transactions

### Evolution du cours indexée et performance



| Performance                | 1M    | 3M    | 1A    | 3A    | 5A   | 10A   | p.a. depuis 31.05.07 |
|----------------------------|-------|-------|-------|-------|------|-------|----------------------|
|                            | YTD   | 2018  | 2017  | 2016  | 2015 | 2014  | 2013                 |
| Groupe de placement (en %) | 4.26  | 11.32 | 11.25 | 10.93 | 6.82 | 9.95  | 3.25                 |
| Benchmark (en %)           | 4.39  | 11.61 | 11.50 | 11.06 | 7.09 | 10.09 | 3.62                 |
| Groupe de placement (en %) | 19.09 | -8.39 | 19.30 | -1.19 | 2.30 | 12.10 | 24.68                |
| 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 31.05.07 |
|--|--------|--------|--------|--------|-----------------|
| Volatilité du groupe de placement (en %) | 13.93  | 10.11  | 11.65  | 11.19  | 12.96           |
| Volatilité Benchmark (en %)              | 13.89  | 10.14  | 11.67  | 11.21  | 12.95           |
| Tracking Error ex post (en %)            | 0.26   | 0.29   | 0.30   | 0.44   | 0.77            |
| Tracking Error ex ante (en %)            | 0.30   |        |        |        |                 |
| Information Ratio                        | -0.95  | -0.45  | -0.88  | -0.31  | -0.48           |
| Sharpe Ratio                             | 0.82   | 1.10   | 0.62   | 0.87   | 0.24            |
| Corrélation                              | 1.00   | 1.00   | 1.00   | 1.00   | 1.00            |
| Beta                                     | 1.00   | 1.00   | 1.00   | 1.00   | 1.00            |
| Jensen-Alpha                             | -0.25  | -0.08  | -0.23  | -0.10  | -0.35           |
| Maximum Drawdown (en %)                  | -12.65 | -12.99 | -19.45 | -43.05 | -54.13          |
| Recovery Period (ans)                    | 0.16   | 0.16   | 1.14   | 1.76   | 4.83            |

### Chiffres caractéristiques

|   | 31.12.2018 | 30.04.2019 |
|---|------------|------------|
| Fortune en mio. CHF                       | 197.1      | 240.0      |
| Valeur nette d'inventaire par part en CHF | 122.99     | 146.47     |

30 avril 2019

# Fondation de placement Swiss Life

## Actions Suisse PM



### Structure du portefeuille en fonction de la taille de l'entreprise<sup>1)</sup>

|                      | 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    |

<sup>1)</sup> Compte tenu des dérivés et des placements collectifs

### Structure du portefeuille par branches<sup>2)</sup>

|                            | 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%    |

<sup>2)</sup> Compte tenu des dérivés et des placements collectifs

### Les principales positions en actions<sup>3)</sup>

|                        | 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%      |

<sup>3)</sup> 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 ces institutions, 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 qui ont passé une convention spéciale avec Swiss Life Asset Managers. 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.