

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 | 40068790 |
| ISIN | CH0400687908 |
| LEI | 254900XCUD9NTWJQU706 |
| Bloomberg Ticker | SLAGSPM 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 0.95%

- a posteriori au 30.09.2018 0.95%

Commission de souscription/rachat aucune

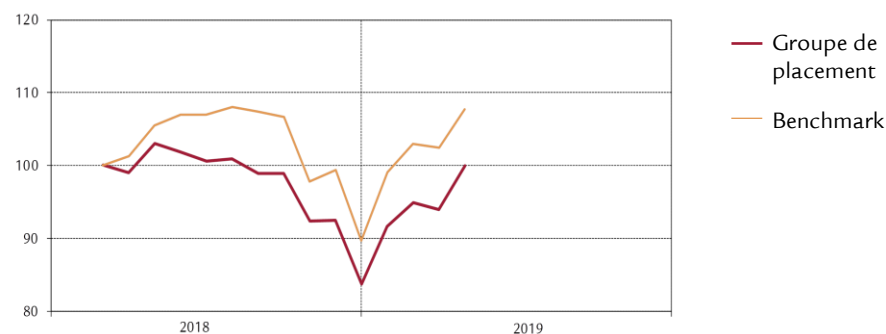
Pratique de distribution Capitalisation

* 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

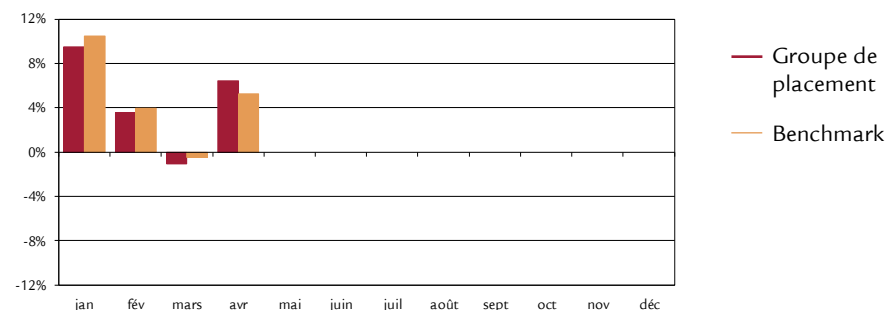
*** Le taux des charges d'exploitation TER_{KGAST} couvre tous les coûts à l'exception des frais de transaction et des prélèvements fiscaux sur les transactions

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 %) | 6.44 | 9.09 | -2.95 | | -0.01 | |
| Benchmark (en %) | 5.22 | 8.81 | 2.16 | | 6.61 | |
| | YTD | 2018 | 2017 | 2016 | 2015 | 2014 |
| Groupe de placement (en %) | 19.49 | | | | | |
| Benchmark (en %) | 20.23 | | | | | |

Performance mensuelle



Données statistiques (annualisées)

| | 1A | 3A | 5A depuis 28.02.18 |
|--|--------|----|--------------------|
| Volatilité du groupe de placement (en %) | 17.68 | | 16.75 |
| Volatilité Benchmark (en %) | 18.79 | | 17.66 |
| Tracking Error ex post (en %) | 4.27 | | 4.27 |
| Tracking Error ex ante (en %) | 4.30 | | |
| Information Ratio | -1.20 | | -1.55 |
| Sharpe Ratio | -0.13 | | 0.04 |
| Corrélation | 0.97 | | 0.97 |
| Beta | 0.92 | | 0.92 |
| Jensen-Alpha | -4.90 | | -5.85 |
| Maximum Drawdown (en %) | -21.38 | | -21.38 |
| 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 | 83.68 | 99.99 |

30 avril 2019

Fondation de placement Swiss Life Actions Global Small Caps PM



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 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.