

Stratégie d'investissement

- Le groupe de placement investit dans des fonds immobiliers de droit suisse libellés en francs et investissant exclusivement dans des biens immobiliers suisses
- Sélection active des fonds immobiliers
- Réalisation au moyen du Swiss Life Funds (CH) Real Estate Switzerland Fund of Funds

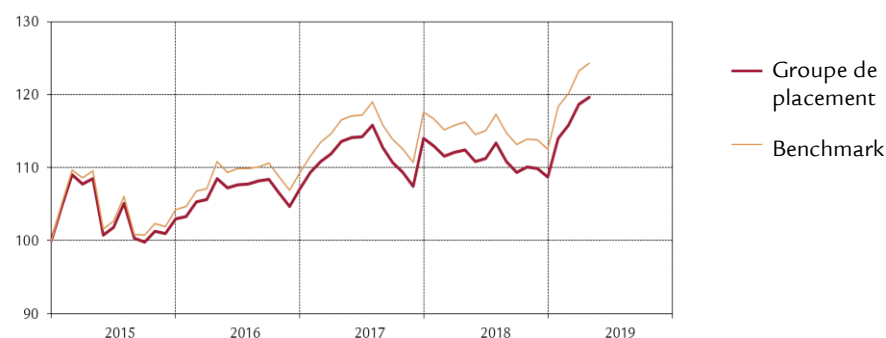
Informations sur le produit

| | |
|---|--|
| Numéro de valeur | 12468565 |
| ISIN | CH0124685659 |
| LEI | 254900VB5XEQLYLQJ518 |
| Bloomberg Ticker | SWLIMPM SW |
| Benchmark | SXI Swiss Real Estate® Funds |
| Monnaie | CHF |
| Date de création | 28.02.2011 |
| Valeur de lancement | 100.00 |
| Clôture de l'exercice | 30.09. |
| Souscription/Rachat | journalier |
| Délai final d'acceptation * | 14h30 |
| Asset Manager | Swiss Life Asset Management SA |
| Publication de cours | Bloomberg: ASSL www.swisslife.ch/fondationdeplacement |
| Taux des charges d'exploitation TER _{KGAST} ** | |
| - au préalable | 1.04% |
| - a posteriori au 30.09.2018 | 1.04% |
| 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

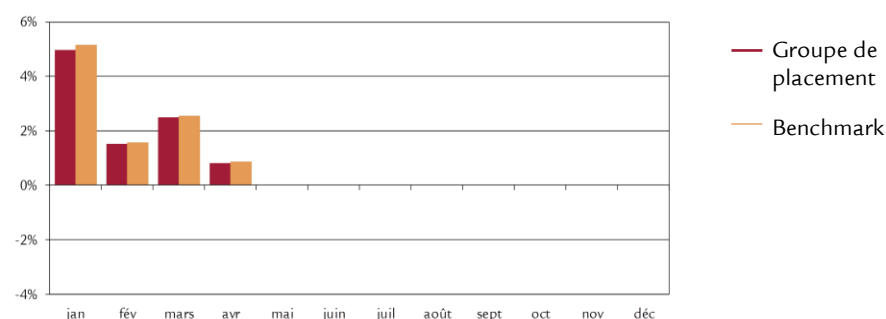
** Le taux des charges d'exploitation TER_{KGAST} couvre tous les coûts à l'exception des frais de transaction et des prélèvements fiscaux sur les transactions

Evolution du cours indexée et performance



| Performance | 1M | 3M | 1A | 3A p.a. | 5A p.a. | depuis 28.02.11 |
|----------------------------|-------|-------|------|---------|---------|-----------------|
| Groupe de placement (en %) | 0.80 | 4.85 | 6.38 | 3.29 | 5.39 | 4.36 |
| Benchmark (en %) | 0.85 | 5.02 | 6.93 | 3.89 | 6.30 | 5.07 |
| | YTD | 2018 | 2017 | 2016 | 2015 | 2014 |
| Groupe de placement (en %) | 10.04 | -4.66 | 6.41 | 4.06 | 2.93 | 14.03 |
| Benchmark (en %) | 10.42 | -4.36 | 7.58 | 4.93 | 4.21 | 14.47 |

Performance mensuelle



Données statistiques (annualisées)

| | 1A | 3A | 5A | depuis 28.02.11 |
|--|-------|-------|--------|-----------------|
| Volatilité du groupe de placement (en %) | 6.93 | 6.53 | 7.66 | 7.16 |
| Volatilité Benchmark (en %) | 7.12 | 6.68 | 7.95 | 7.42 |
| Tracking Error ex post (en %) | 0.20 | 0.33 | 0.54 | 0.54 |
| Tracking Error ex ante (en %) | 0.40 | | | |
| Information Ratio | -2.76 | -1.79 | -1.67 | -1.32 |
| Sharpe Ratio | 1.00 | 0.61 | 0.77 | 0.65 |
| Corrélation | 1.00 | 1.00 | 1.00 | 1.00 |
| Beta | 0.97 | 0.98 | 0.96 | 0.96 |
| Jensen-Alpha | -0.32 | -0.47 | -0.60 | -0.48 |
| Maximum Drawdown (en %) | -7.45 | -9.23 | -11.39 | -11.39 |
| Recovery Period (ans) | 0.30 | 1.29 | 0.89 | 0.89 |

Chiffres caractéristiques

| | 31.12.2018 | 30.04.2019 |
|---|------------|------------|
| Fortune en mio. CHF | 87.0 | 193.6 |
| Valeur nette d'inventaire par part en CHF | 128.82 | 141.75 |

30 avril 2019

Fondation de placement Swiss Life Fonds immobiliers Suisse PM



Immeubles en fonction du type d'utilisation¹⁾

| | Groupe de placement | Benchmark |
|--------------------------|---------------------|-----------|
| Habitation | 50.1% | 50.1% |
| Commerce | 41.3% | 41.3% |
| Mixte | 7.0% | 7.0% |
| Terrain à bâtir, projets | 1.6% | 1.6% |
| Total | 100.0% | 100.0% |

¹⁾ Selon les dernières données disponibles

Répartition géographique des immeubles²⁾

| | Groupe de placement | Benchmark |
|----------------------|---------------------|-----------|
| Zurich | 36.7% | 36.8% |
| Berne | 9.4% | 9.4% |
| Suisse centrale | 8.1% | 8.1% |
| Suisse romande | 2.7% | 2.7% |
| Suisse du Nord-Ouest | 20.7% | 20.7% |
| Suisse orientale | 7.2% | 7.1% |
| Suisse méridionale | 2.1% | 2.1% |
| Lac Léman | 13.1% | 13.1% |
| Total | 100.0% | 100.0% |

²⁾ Selon les dernières données disponibles

Les positions principales

| | Groupe de placement | Benchmark |
|-----------------------|---------------------|-----------|
| UBS SIMA | 29.8% | 30.4% |
| CS REF Siat | 11.2% | 11.3% |
| CS REF LivingPlus | 10.4% | 10.5% |
| UBS Anfos | 9.5% | 9.5% |
| CS REF Green Property | 9.5% | 9.5% |

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.