

30 avril 2024

Fondation de placement Swiss Life

LPP-Mix 25

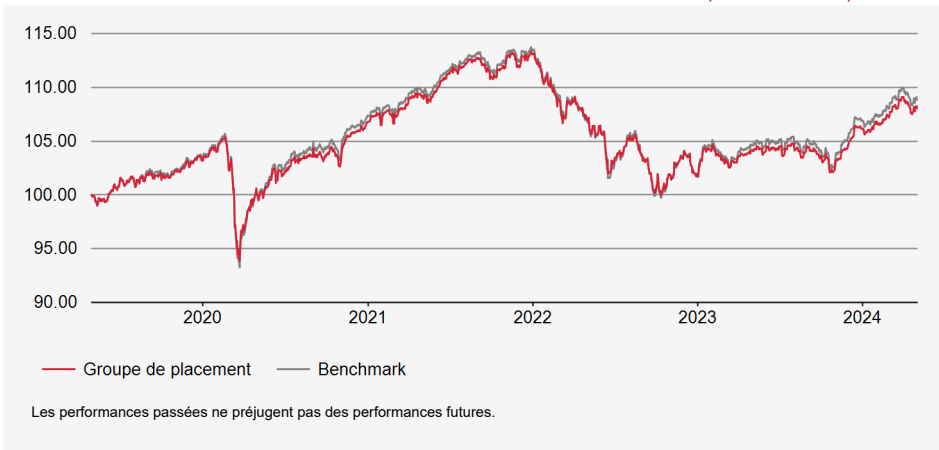


Fortune nette (VNI) en mio. CHF : 727.76
Valeur nette d'inventaire par droit en CHF : 193.63

Stratégie d'investissement

Placement dans toutes les catégories autorisées selon la LPP (part d'actions stratégique: 25%). Allocation active d'actifs. Limitation pour titres de participation: 35%. Limitation pour monnaies étrangères: 30%. Note moyenne des obligations: BBB+ au minimum. Réalisation au moyen de placements collectifs de même nature. Réserves de fluctuation recommandées: plus de 10%.

Évolution de la valeur en devise de référence (base 100)



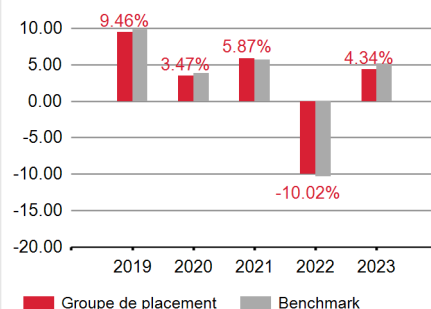
Performances en devise de référence

	Performances cumulées				Performances annualisées			
	YTD	1 mois	3 mois	1 an	3 ans	5 ans	10 ans	Origine
Groupe de placement	1.78%	-0.97%	1.36%	3.75%	-0.31%	1.56%	2.54%	2.97%
Benchmark	1.78%	-1.01%	1.41%	3.98%	-0.21%	1.71%	2.85%	3.45%

Données statistiques (annualisées)

	1 an	3 ans	5 ans	10 ans	Origine
Volatilité du groupe de placement (en %)	3.61	4.91	5.12	4.30	4.12
Volatilité du Benchmark (en %)	3.92	5.30	5.48	4.43	4.12
Tracking Error ex post (en %)	0.40	0.59	0.56	0.52	0.58
Information Ratio	-0.59	-0.18	-0.27	-0.58	-0.82
Sharpe Ratio	0.57	-0.15	0.31	0.67	0.66
Corrélation	1.00	1.00	1.00	0.99	0.99
Beta	0.92	0.92	0.93	0.96	0.99
Jensen alpha	-0.05	-0.15	-0.03	-0.19	-0.46
Maximum Drawdown (en %)	-2.56	-11.75	-11.75	-11.75	-14.16
Recovery Period (ans)	0.11	-	-	-	0.98

Performance



Info. sur le produit

Numéro de valeur: 1245601
ISIN: CH0012456015
LEI: 5493000KUC3Z24U77V93
Code Bloomberg: SWABM25 SW
Benchmark: Customized
Monnaie: CHF
Pays d'origine: Suisse
Date de création: 30/09/2001
Valeur de lancement: 100.00
Clôture de l'exercice: 30.09
Souscription/Rachat: journalier
Délai final d'acceptation: 14h00
Commission de souscription / rachat: aucune
Pratique de distribution: Capitalisation
Asset Manager:
Allocation d'actifs tactique
Swiss Life Asset Management SA
Groupes de placement de même nature utilisés
Divers selon
Swiss Life Best Select Invest Plus®
Conseil externe:
Au sein des groupes de placement de même nature, 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: 0.56%
a posteriori au: 30/09/2023 0.58%

Asset Manager: 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.

Taux des charges d'exploitation TER KGAST: 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.

Commission: Toute disposition divergente dans les règlements relatifs aux émoluments des fondations de libre passage et des fondations de prévoyance 3a demeure réservée.

Performance: Produit total sur une période sous revue considérée, basé sur des rendements pondérés dans le temps.

Données statistiques: Les chiffres clés du risque reposent sur des rendements logarithmés, mensuels, pondérés dans le temps.

Tracking error ex ante: La tracking error attendue pour les 12 prochains mois correspond à la tracking error ex post des 3 dernières années.

Structure de portefeuille par groupes de placement

	Groupe de placement	Benchmark	max. OPP2
Liquidités	3.94%	2.00%	-
Hypothèques Suisse	0.86%	-	-
Obligations suisses en CHF	14.96%	16.00%	-
Obligations étrangères en CHF	8.95%	9.00%	-
Obl. en monnaies étrangères (couvertes en CHF)	24.43%	28.00%	-
Actions Suisse	12.50%	13.00%	-
Actions Etranger	12.33%	12.00%	-
Actions Etranger (couv. en CHF)	0.66%	-	-
Immobilier Suisse	15.86%	13.00%	30.00%
Immobilier étranger (couvert en CHF)	3.20%	2.00%	10.00%
Placements alternatifs (couverts en CHF)	2.31%	5.00%	15.00%
Total actions (Suisse et Etranger)	25.49%	25.00%	50.00%
Total monnaies étrangères	12.33%	12.00%	30.00%

Les principales positions en actions

NESTLE SA-REG	2.02%
NOVARTIS AG-REG	1.50%
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	1.27%
MICROSOFT CORP.	0.86%
NVIDIA CORP	0.67%
UBS GROUP AG-REG	0.64%
ABB LTD-REG	0.60%
ALPHABET INC	0.57%
CIE FINANCIERE RICHEMONT-REG	0.56%
ZURICH INSURANCE GROUP AG	0.53%

Composition du benchmark

1M Saron	2.00%
SBI Domestic AAA-BBB	16.00%
SBI Foreign AAA-BBB	9.00%
Bloomberg Gl. Agg. Treas. ex CH TR (couv. en CHF)	4.00%
Bloomberg Gl. Agg. Corp. (couv. en CHF)	9.00%
Bloomberg Gl. Agg. Corp. Short Term (couv. en CHF)	9.00%
JP Morgan CEMBI Broad Div IG Index (couv. en CHF)	6.00%
Swiss Performance Index	13.00%
MSCI World ex CH ESG Leaders, in CHF	9.60%
MSCI AC World Small Cap, en CHF	1.80%
MSCI Emerging Markets, en CHF	0.60%
KGAST Immo-Index	13.00%
SL REF (LUX) German Core Real Estate (couv. en CHF)	2.00%
HFRX Global Hedge Funds (couv. en CHF)	5.00%

Structure du portefeuille selon les monnaies

CHF	85.51%
USD	8.32%
EUR	1.00%
JPY	0.81%
Autres	4.36%

Caractéristiques d'investissements sur instruments à taux fixe

Modified Duration	5.56
Note moyenne	A