

30 juin 2024

Fondation de placement Swiss Life

LPP-Mix 35

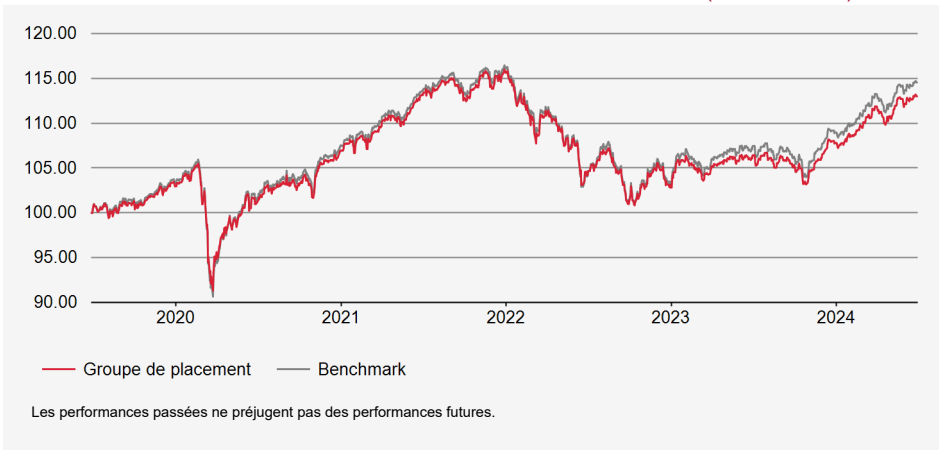


Fortune nette (VNI) en mio. CHF : 396.65
Valeur nette d'inventaire par droit en CHF : 210.23

Stratégie d'investissement

Placement dans toutes les catégories autorisées selon la LPP (part d'actions stratégique: 35%). Allocation active d'actifs. Limitation pour titres de participation: 45%. 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 15%.

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



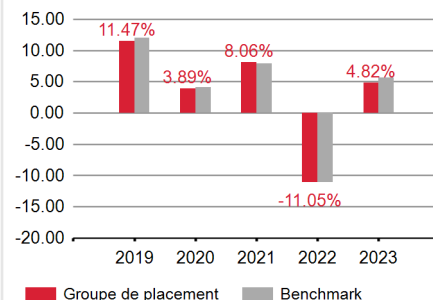
Performances en devise de référence

	Performances cumulées				Performances annualisées			
	YTD	1 mois	3 mois	1 an	3 ans	5 ans	10 ans	Origine
Groupe de placement	4.83%	0.75%	1.01%	6.18%	-0.04%	2.47%	3.18%	3.32%
Benchmark	5.10%	0.79%	1.15%	6.61%	0.28%	2.75%	3.57%	3.86%

Données statistiques (annualisées)

	1 an	3 ans	5 ans	10 ans	Origine
Volatilité du groupe de placement (en %)	4.50	5.82	6.05	5.28	5.23
Volatilité du Benchmark (en %)	4.78	6.20	6.45	5.41	5.22
Tracking Error ex post (en %)	0.35	0.58	0.61	0.58	0.64
Information Ratio	-1.24	-0.54	-0.46	-0.68	-0.84
Sharpe Ratio	0.97	-0.10	0.40	0.66	0.59
Corrélation	1.00	1.00	1.00	0.99	0.99
Beta	0.94	0.93	0.94	0.97	0.99
Jensen alpha	-0.14	-0.33	-0.10	-0.28	-0.52
Maximum Drawdown (en %)	-3.29	-13.03	-13.41	-13.41	-21.36
Recovery Period (ans)	0.11	-	0.65	0.65	3.00

Performance



Info. sur le produit

Numéro de valeur: 1245606
ISIN: CH0012456064
LEI: 254900SR5GM6HP44F130
Code Bloomberg: SWABM35 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: 0.58%

a posteriori au: 30/09/2023 0.59%

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	3.67%	2.00%	-
Hypothèques Suisse	0.60%	-	-
Obligations suisses en CHF	13.37%	14.00%	-
Obligations étrangères en CHF	7.09%	7.00%	-
Obl. en monnaies étrangères (couvertes en CHF)	24.17%	24.00%	-
Actions Suisse	17.85%	18.00%	-
Actions Etranger	17.20%	17.00%	-
Actions Etranger (couv. en CHF)	-	-	-
Immobilier Suisse	11.60%	11.00%	30.00%
Immobilier étranger (couvert en CHF)	2.17%	2.00%	10.00%
Placements alternatifs (couverts en CHF)	2.28%	5.00%	15.00%
Total actions (Suisse et Etranger)	35.05%	35.00%	50.00%
Total monnaies étrangères	17.20%	17.00%	30.00%

Les principales positions en actions

NESTLE SA-REG	2.70%
NOVARTIS AG-REG	2.21%
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	1.97%
MICROSOFT CORP	1.26%
NVIDIA CORP	1.23%
UBS GROUP AG-REG	0.96%
ABB LTD-REG	0.89%
CIE FINANCIERE RICHEMO-A REG	0.85%
ALPHABET INC	0.80%
ZURICH INSURANCE GROUP AG	0.79%

Composition du benchmark

1M Saron	2.00%
SBI Domestic AAA-BBB	14.00%
SBI Foreign AAA-BBB	7.00%
Bloomberg Gl. Agg. Treas. ex CH TR (couv. en CHF)	3.50%
Bloomberg Gl. Agg. Corp. (couv. en CHF)	7.50%
Bloomberg Gl. Agg. Corp. Short Term (couv. en CHF)	8.00%
JP Morgan CEMBI Broad Div IG Index (couv. en CHF)	5.00%
Swiss Performance Index	18.00%
MSCI World ex CH ESG Leaders, in CHF	13.60%
MSCI AC World Small Cap, en CHF	2.55%
MSCI Emerging Markets, en CHF	0.85%
KGAST Immo-Index	11.00%
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	81.25%
USD	11.87%
EUR	1.27%
JPY	1.04%
Autres	4.58%

Caractéristiques d'investissements sur instruments à taux fixe

Modified Duration	5.78
Note moyenne	A