

30 juin 2024

# Fondation de placement Swiss Life

## LPP-Mix 45

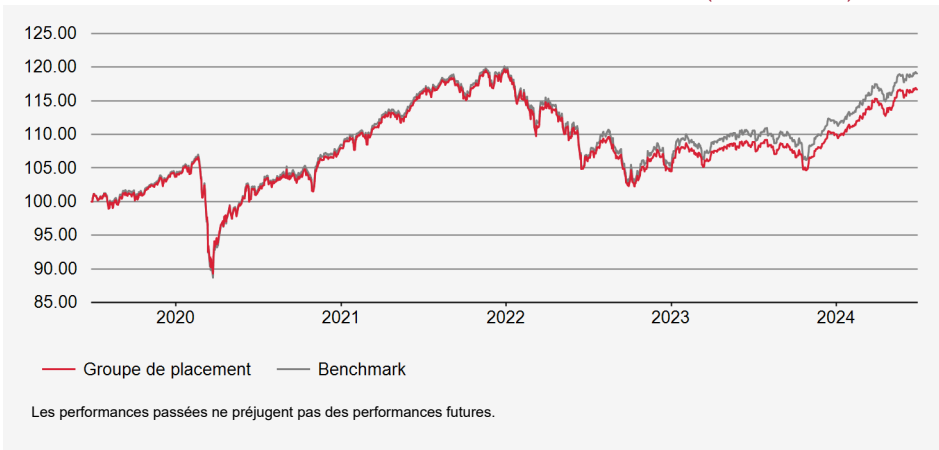


**Fortune nette (VNI) en mio. CHF : 755.94**  
**Valeur nette d'inventaire par droit en CHF : 220.31**

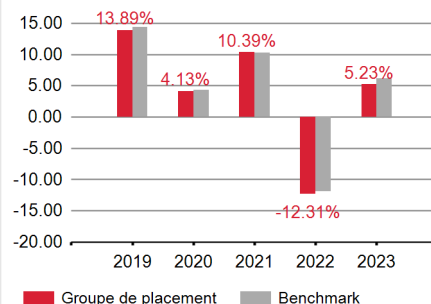
### Stratégie d'investissement

Placement dans toutes les catégories autorisées selon la LPP (part d'actions stratégique: 45%). Allocation active d'actifs. Limitation pour titres de participation: 50%. 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 20%.

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



### Performance



### Info. sur le produit

**Numéro de valeur:** 1245607  
**ISIN:** CH0012456072  
**LEI:** 2549001XL79VZWJO5Q69  
**Code Bloomberg:** SWABM45 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®

### 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	6.06%	0.69%	1.21%	7.17%	0.17%	3.13%	3.72%	3.53%
Benchmark	6.43%	0.74%	1.38%	7.70%	0.74%	3.55%	4.24%	4.19%

### Données statistiques (annualisées)

	1 an	3 ans	5 ans	10 ans	Origine
Volatilité du groupe de placement (en %)	5.42	6.85	7.20	6.42	6.47
Volatilité du Benchmark (en %)	5.61	7.18	7.52	6.48	6.46
Tracking Error ex post (en %)	0.30	0.55	0.57	0.58	0.67
Information Ratio	-1.74	-1.03	-0.73	-0.90	-0.97
Sharpe Ratio	0.98	-0.06	0.42	0.62	0.51
Corrélation	1.00	1.00	1.00	1.00	0.99
Beta	0.97	0.95	0.96	0.99	1.00
Jensen alpha	-0.32	-0.56	-0.26	-0.46	-0.65
Maximum Drawdown (en %)	-4.14	-14.55	-16.22	-16.22	-28.27
Recovery Period (ans)	0.11	-	0.67	0.67	3.76

### 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](http://www.swisslife.ch/fondationdeplacement)

**Taux des charges d'exploitation TER KGAST**

**au préalable:** 0.59%

**a posteriori au:** 30/09/2023 0.60%

**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	4.04%	2.00%	-
Hypothèques Suisse	0.52%	-	-
Obligations suisses en CHF	10.84%	12.00%	-
Obligations étrangères en CHF	4.82%	5.00%	-
Obl. en monnaies étrangères (couvertes en CHF)	20.62%	20.00%	-
Actions Suisse	22.90%	23.00%	-
Actions Etranger	22.22%	22.00%	-
Actions Etranger (couv. en CHF)	-	-	-
Immobilier Suisse	10.12%	9.00%	30.00%
Immobilier étranger (couvert en CHF)	1.66%	2.00%	10.00%
Placements alternatifs (couverts en CHF)	2.27%	5.00%	15.00%
Total actions (Suisse et Etranger)	45.12%	45.00%	50.00%
Total monnaies étrangères	22.22%	22.00%	30.00%

## Les principales positions en actions

NESTLE SA-REG	3.46%
NOVARTIS AG-REG	2.83%
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	2.52%
MICROSOFT CORP	1.63%
NVIDIA CORP	1.59%
UBS GROUP AG-REG	1.23%
ABB LTD-REG	1.15%
CIE FINANCIERE RICHEMO-A REG	1.09%
ALPHABET INC	1.03%
ZURICH INSURANCE GROUP AG	1.01%

## Composition du benchmark

1M Saron	2.00%
SBI Domestic AAA-BBB	12.00%
SBI Foreign AAA-BBB	5.00%
Bloomberg Gl. Agg. Treas. ex CH TR (couv. en CHF)	2.50%
Bloomberg Gl. Agg. Corp. (couv. en CHF)	6.50%
Bloomberg Gl. Agg. Corp. Short Term (couv. en CHF)	7.00%
JP Morgan CEMBI Broad Div IG Index (couv. en CHF)	4.00%
Swiss Performance Index	23.00%
MSCI World ex CH ESG Leaders, in CHF	17.60%
MSCI AC World Small Cap, en CHF	3.30%
MSCI Emerging Markets, en CHF	1.10%
KGAST Immo-Index	9.00%
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	75.91%
USD	15.33%
EUR	1.64%
JPY	1.34%
Autres	5.78%

## Caractéristiques d'investissements sur instruments à taux fixe

Modified Duration	5.82
Note moyenne	A