Fondation de placement Swiss Life LPP-Mix 15



Fortune nette (VNI) en mio. CHF: 217.26 Valeur nette d'inventaire par droit en CHF: 176.18

Stratégie d'investissement

Placement dans toutes les catégories autorisées selon la LPP (part d'actions stratégique: 15%). Allocation active d'actifs. Limitation pour titres de participation: 20%. 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 6.5%.

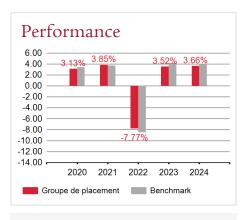
Évolution de la valeur en devise de référence (base 100)



Performances en devise de référence

Performances cumulées				Perfor	mances ar	nualisées		
	YTD	1 mois	3 mois	1 an	3 ans	5 ans	10 ans	Origine
Groupe de placement	0.40%	-0.78%	0.40%	2.29%	0.87%	2.08%	1.76%	2.64%
Benchmark	0.31%	-0.82%	0.31%	2.52%	1.01%	2.16%	1.92%	2.93%

Données statistiques (annualisées)	1 an	3 ans	5 ans	10 ans	Origine
Volatilité du groupe de placement (en %)	2.38	3.48	3.33	3.09	2.82
Volatilité du Benchmark (en %)	2.42	3.97	3.68	3.24	2.86
Tracking Error ex post (en %)	0.31	0.63	0.55	0.52	0.57
Information Ratio	-0.73	-0.23	-0.15	-0.32	-0.51
Sharpe Ratio	0.54	-0.02	0.53	0.65	0.87
Corrélation	0.99	0.99	0.99	0.99	0.98
Beta	0.98	0.87	0.90	0.94	0.97
Jensen alpha	-0.19	-0.13	0.11	-0.04	-0.21
Maximum Drawdown (en %)	-1.46	-6.22	-9.12	-9.12	-9.12
Recovery Period (ans)	-	1.46	2.34	2.34	2.34



Info. sur le produit

Numéro de valeur: 1564965 ISIN: CH0015649657

LEI: 254900RW4KJYAQTH6Y97 Code Bloomberg: SWABM15 SW

Benchmark: Customized

Monnaie: CHF

Pays d'origine: Suisse

Date de création: 30/06/2003 Valeur de lancement: 100.00 Clôture de l'exercice: 30.09 Souscription/Rachat: journalier Délai final d'acceptation: 12h00

Protection antidilution:

Commission d'émission / de rachat en faveur du groupe de placement selon

l'aperçu des conditions.

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

au préalable: 0.55%

a posteriori au: 30/09/2024 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 Asset Manager: La selection des gestionnianes, eur sur remande commination 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.

Protection antiditution: Aperçu des conditions disponible à l'adresse: www.swisslife.ch/fondationdeplacement, «Documents juridiques» (modifications possibles à tout moment sans préavis).

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.

Fondation de placement Swiss Life LPP-Mix 15



Structure de portefeuille par groupes de placement

	Groupe de placement	Benchmark	max. OPP2
Liquidités	1.37%	2.00%	-
Hypothèques Suisse	12.95%	13.00%	-
Obligations suisses en CHF	12.23%	13.00%	-
Obligations étrangères en CHF	5.08%	6.00%	-
Obl. en monnaies étrangères (couvertes en CHF)	25.38%	28.00%	-
Actions Suisse	8.97%	8.00%	-
Actions Etranger	8.11%	7.00%	-
Actions Etranger (couv. en CHF)	0.41%	-	-
Immobilier Suisse	19.50%	15.00%	30.00%
Immobilier étranger (couvert en CHF)	3.42%	3.00%	10.00%
Placements alternatifs (couverts en CHF)	2.58%	5.00%	15.00%
Total actions (Suisse et Etranger)	17.49%	15.00%	50.00%
Total monnaies étrangères	8.11%	7.00%	30.00%

Les principales positions en actions

NESTLE SA-REG	1.28%
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	1.11%
NOVARTIS AG-REG	1.05%
ZURICH INSURANCE GROUP AG	0.49%
UBS GROUP AG-REG	0.47%
CIE FINANCIERE RICHEMO-A REG	0.45%
NVIDIA CORP	0.44%
MICROSOFT CORP	0.44%
ABB LTD-REG	0.39%
HOLCIM LTD	0.28%

Composition du benchmark

1M Saron	2.00%
SBI Domestic AAA-A 1-3Y	13.00%
SBI Domestic AAA-BBB	13.00%
SBI Foreign AAA-BBB	6.00%
Bloomberg Gl. Agg. Treas. ex CH TR (couv. en CHF)	5.00%
Bloomberg Gl. Agg. Corp. (couv. en CHF)	12.00%
Bloomberg Gl. Agg. Corp. Short Term (couv. en CHF)	7.00%
JP Morgan CEMBI Broad Div IG Index (couv. en CHF)	4.00%
SPI® Total Return	8.00%
MSCI World ex CH ESG Leaders, in CHF	5.60%
MSCI AC World Small Cap, en CHF	1.05%
MSCI Emerging Markets, en CHF	0.35%
KGAST Immo-Index	15.00%
SL REF (LUX) German Core Real Estate (couv. en CHF)	3.00%
HFRX Global Hedge Funds (couv. en CHF)	5.00%

Structure du portefeuille selon les monnaies

CHF	91.49%
USD	5.47%
JPY	0.47%
EUR	0.09%
Autres	2.08%

Caractéristiques d'investissements sur instruments à taux fixe

Modified Duration	4.54
Note moyenne	A+