

30 septembre 2021

Fondation de placement Swiss Life

LPP-Mix 25

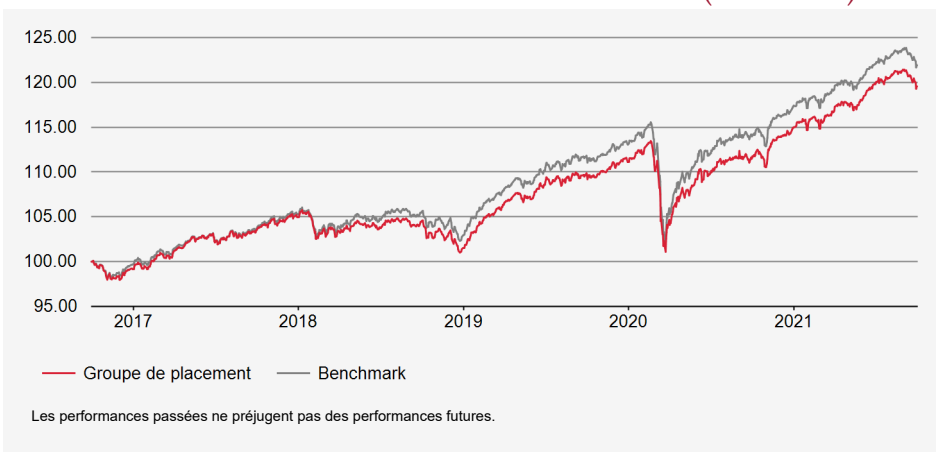


Fortune nette (VNI) en mio. CHF : 795.14
Valeur nette d'inventaire par droit en CHF : 198.98

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	3.97%	-1.46%	-0.20%	7.17%	4.59%	3.64%	4.74%	3.50%
BENCHMARK	3.81%	-1.43%	-0.15%	6.92%	4.92%	4.03%	5.01%	4.03%

Données statistiques (annualisées)

	1 AN	3 ANS	5 ANS	10 ANS	ORIGINE
Volatilité du groupe de placement (en %)	4.13	5.02	4.12	3.72	3.97
Volatilité du Benchmark (en %)	4.08	5.23	4.25	3.65	3.89
Tracking Error ex post (en %)	0.23	0.48	0.46	0.50	0.57
Information Ratio	1.08	-0.69	-0.87	-0.55	-0.92
Sharpe Ratio	1.83	1.04	1.05	1.38	0.83
Corrélation	1.00	1.00	0.99	0.99	0.99
Beta	1.01	0.96	0.97	1.01	1.01
Jensen alpha	0.17	-0.09	-0.23	-0.34	-0.57
Maximum Drawdown (en %)	-1.76	-10.89	-10.89	-10.89	-14.16
Recovery Period (ans)	-	0.65	0.65	0.65	0.98

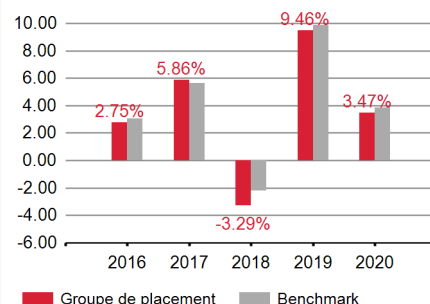
Asset Manager: La sélection des gestionnaires, leur surveillance continue et le suivi complet du processus sont effectués par Swiss Life Asset Management SA selon des critères objectifs, conformément à une excellente pratique institutionnelle.

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.

Performance



Info. sur le produit

Numéro de valeur: 1245601
ISIN: CH0012456015
LEI: 254900JNOBNDNHDGRO53
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: 0.57%

a posteriori au: 30/09/2021 0.59%

Structure de portefeuille par groupes de placement

	Groupe de placement	Benchmark	max. OPP2
Liquidités	1.16%	2.00%	-
Obligations suisses en CHF	12.02%	16.00%	-
Obligations étrangères en CHF	6.94%	9.00%	-
Obl. en monnaies étrangères (couvertes en CHF)	30.23%	28.00%	-
Actions Suisse	13.56%	13.00%	-
Actions Etranger	11.52%	12.00%	-
Actions Etranger (couv. en CHF)	4.17%	-	-
Immobilier Suisse	15.97%	13.00%	30.00%
Immobilier étranger (couvert en CHF)	2.31%	2.00%	10.00%
Placements alternatifs (couverts en CHF)	2.12%	5.00%	15.00%
Total actions (Suisse et Etranger)	29.25%	25.00%	50.00%
Total monnaies étrangères	11.52%	12.00%	30.00%

Structure du portefeuille selon les monnaies

CHF	88.48%
USD	8.07%
EUR	1.32%
JPY	0.80%
AUTRES	1.33%

Composition du benchmark

CITIGROUP CHF 1 M EURO DEPO	2.00%
SBI DOMESTIC AAA-BBB	16.00%
SBI FOREIGN AAA-BBB	9.00%
BB* GL. AGG TREAS EX CH TR (COUV. EN CHF)	4.00%
BB* GL. AGG. CORP. (COUV. EN CHF)	9.00%
BB* 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, EN 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%

* Bloomberg Barclays

Caractéristiques d'investissements sur instruments à taux fixe

Modified Duration	5.94
Note moyenne	A