31 décembre 2023

Fondation de placement Swiss Life LPP-Mix 75

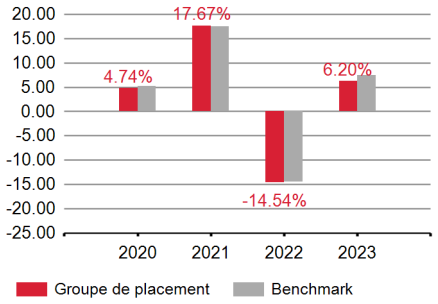
(Part d'actions et de devises étrangères dépassée selon OPP 2)

Fortune nette (VNI) en mio. CHF : 186.68
Valeur nette d'inventaire par droit en CHF : 126.67

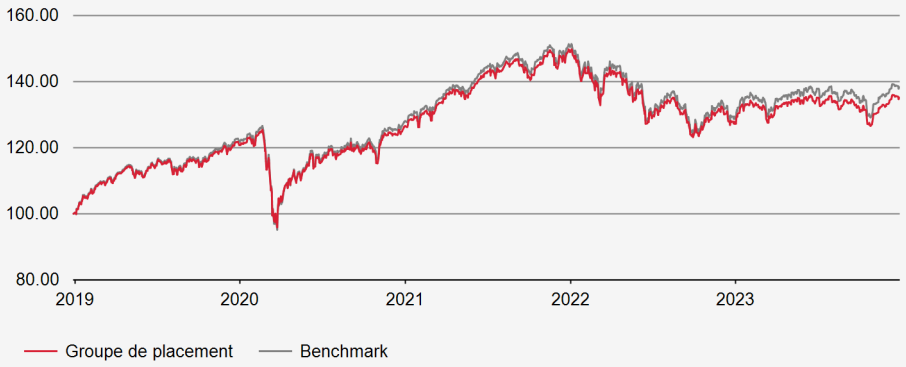
Stratégie d'investissement

Placement dans toutes les catégories autorisées selon la LPP (part d'actions stratégique: 75%). Allocation active d'actifs. Limitation pour titres de participation: 85%. Limitation pour monnaies étrangères: 50%. Note moyenne des obligations: BBB au minimum. Réalisation au moyen de placements collectifs de même nature. Au vu de sa part élevée en actions et en devises étrangères, ce groupe de placement implique un risque plus élevé qu'un LPP-Mix dont la part en actions est de 50% et en devises étrangères est de 30% au maximum.

Performance



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



Les performances passées ne préjugent pas des performances futures.

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	6.20%	1.96%	1.97%	6.20%	2.22%	6.15%	-	4.68%
Benchmark	7.44%	1.96%	2.21%	7.44%	2.61%	6.64%	-	5.20%

Données statistiques (annualisées)

	1 an	3 ans	5 ans	10 ans	Origine
Volatilité du groupe de placement (en %)	7.60	9.93	10.72	-	10.92
Volatilité du Benchmark (en %)	8.01	10.32	11.24	-	11.41
Tracking Error ex post (en %)	0.53	0.71	0.87	-	0.86
Information Ratio	-2.33	-0.55	-0.57	-	-0.60
Sharpe Ratio	0.60	0.20	0.57	-	0.44
Corrélation	1.00	1.00	1.00	-	1.00
Beta	0.95	0.96	0.95	-	0.96
Jensen alpha	-0.93	-0.30	-0.17	-	-0.28
Maximum Drawdown (en %)	-6.81	-17.76	-23.54	-	-23.54
Recovery Period (ans)	0.13	-	0.74	-	0.74

Info. sur le produit

Numéro de valeur: 43583002
ISIN: CH0435830028
LEI: 2549007MI5RG5X8NMB06
Code Bloomberg: SWABM75 SW
Benchmark: Customized
Monnaie: CHF
Pays d'origine: Suisse
Date de création: 31/10/2018
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: 0.64%
a posteriori au: 30/09/2023 0.64%

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.

31 décembre 2023

Fondation de placement Swiss Life LPP-Mix 75

(Part d'actions et de devises étrangères dépassée selon OPP 2)

Structure de portefeuille par groupes de placement

	Groupe de placement	Benchmark	max. OPP2
Liquidités	3.72%	2.00%	-
Hypothèques Suisse	0.37%	-	-
Obl. en monnaies étrangères (couvertes en CHF)	12.34%	13.00%	-
Actions Suisse	37.97%	38.00%	-
Actions Etranger	33.95%	37.00%	-
Actions Etranger (couv. en CHF)	1.90%	-	-
Immobilier Suisse	6.98%	5.00%	30.00%
Immobilier étranger (couvert en CHF)	0.41%	-	10.00%
Placements alternatifs (couverts en CHF)	2.36%	5.00%	15.00%
Total actions (Suisse et Etranger)	73.82%	75.00%	50.00%
Total monnaies étrangères	33.95%	37.00%	30.00%

Les principales positions en actions

NESTLE SA-REG	6.72%
NOVARTIS AG-REG	4.63%
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	4.44%
MICROSOFT CORP.	2.40%
UBS GROUP AG-REG	2.06%
ZURICH INSURANCE GROUP AG	1.66%
CIE FINANCIERE RICHEMONT-REG	1.61%
ABB LTD-REG	1.56%
ALPHABET INC	1.42%
SIKA AG	1.13%

Composition du benchmark

1M Saron	2.00%
Bloomberg Gl. Agg. Treas. ex CH TR (couv. en CHF)	2.00%
Bloomberg Gl. Agg. Corp. (couv. en CHF)	4.00%
Bloomberg Gl. Agg. Corp. Short Term (couv. en CHF)	4.00%
JP Morgan CEMBI Broad Div IG Index (couv. en CHF)	3.00%
Swiss Performance Index	38.00%
MSCI World ex CH ESG Leaders, in CHF	29.60%
MSCI AC World Small Cap, en CHF	5.55%
MSCI Emerging Markets, en CHF	1.85%
KGAST Immo-Index	5.00%
HFRX Global Hedge Funds (couv. en CHF)	5.00%

Structure du portefeuille selon les monnaies

CHF	66.05%
USD	23.97%
EUR	3.82%
JPY	2.25%
Autres	3.92%

Caractéristiques d'investissements sur instruments à taux fixe

Modified Duration	4.71
Note moyenne	A-

Avertissement: La présente publication ne constitue ni une incitation ni une recommandation pour la vente ou l'achat d'instruments de placement, et son but est uniquement d'informer. Tous les documents constituant la base légale dans le cadre d'un éventuel placement peuvent être obtenus gratuitement auprès de la Fondation de placement Swiss Life, c/o Swiss Life SA, case postale, 8022 Zurich, tél. 043 547 71 11 et sur www.swisslife.ch/anlagestiftung. Le cercle des investisseurs est limité aux institutions du 2e pilier et du pilier 3a, ainsi que les autres institutions de prévoyance professionnelle exonérées d'impôts avec siège en Suisse et aux personnes qui gèrent des placements collectifs pour les institutions, qui sont soumises à la surveillance de l'Autorité fédérale de surveillance des marchés financiers FINMA et qui ne placent dans la fondation que des fonds destinés à ces institutions. La performance passée ne saurait présumer de l'évolution en cours ou à venir. Leur utilisation n'implique aucune adhésion ni affiliation de leur part. **Source:** Swiss Life Asset Managers. Tous droits réservés.