

30 septembre 2024

Fondation de placement Swiss Life

LPP-Mix 35

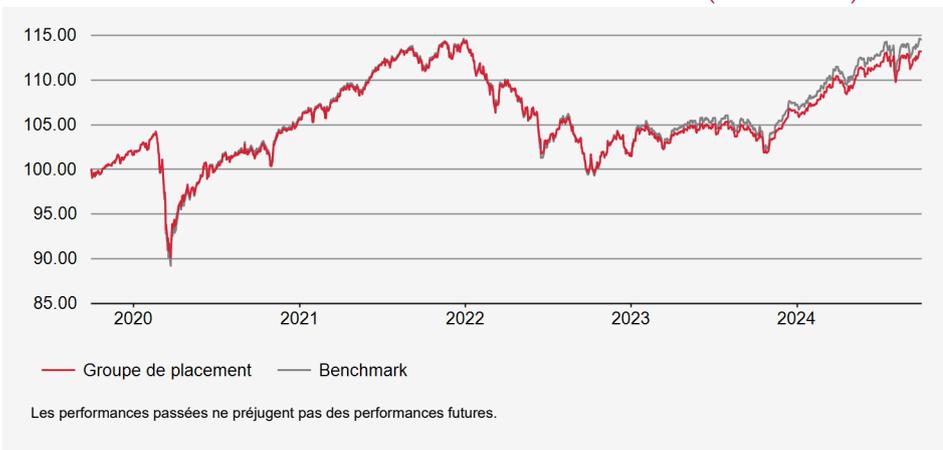


Fortune nette (VNI) en mio. CHF : 403.62
Valeur nette d'inventaire par droit en CHF : 213.34

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)



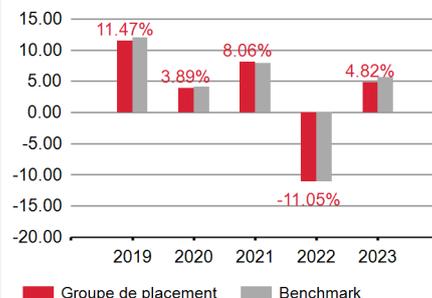
Performances en devise de référence

| | Performances cumulées True | | | | Performances annualisées | | | |
|---------------------|----------------------------|--------|--------|-------|--------------------------|-------|--------|---------|
| | YTD | 1 mois | 3 mois | 1 an | 3 ans | 5 ans | 10 ans | Origine |
| Groupe de placement | 6.38% | 0.25% | 1.48% | 8.88% | 0.54% | 2.51% | 3.12% | 3.35% |
| Benchmark | 6.76% | 0.42% | 1.58% | 9.49% | 0.86% | 2.75% | 3.53% | 3.89% |

Données statistiques (annualisées)

| | 1 an | 3 ans | 5 ans | 10 ans | Origine |
|------------------------------------------|-------|--------|--------|--------|---------|
| Volatilité du groupe de placement (en %) | 4.11 | 5.72 | 6.06 | 5.27 | 5.20 |
| Volatilité du Benchmark (en %) | 4.35 | 6.11 | 6.46 | 5.40 | 5.19 |
| Tracking Error ex post (en %) | 0.38 | 0.59 | 0.61 | 0.58 | 0.63 |
| Information Ratio | -1.64 | -0.55 | -0.40 | -0.71 | -0.84 |
| Sharpe Ratio | 1.71 | -0.03 | 0.38 | 0.64 | 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 | -0.15 | -0.31 | -0.07 | -0.30 | -0.52 |
| Maximum Drawdown (en %) | -2.93 | -13.03 | -13.41 | -13.41 | -21.36 |
| Recovery Period (ans) | 0.14 | - | 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: 12h00
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: 30/09/2024 0.57%

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 | 3.26% | 2.00% | - |
| Hypothèques Suisse | 0.60% | - | - |
| Obligations suisses en CHF | 13.10% | 14.00% | - |
| Obligations étrangères en CHF | 7.13% | 7.00% | - |
| Obl. en monnaies étrangères (couvertes en CHF) | 24.95% | 24.00% | - |
| Actions Suisse | 17.88% | 18.00% | - |
| Actions Etranger | 16.98% | 17.00% | - |
| Actions Etranger (couv. en CHF) | - | - | - |
| Immobilier Suisse | 11.74% | 11.00% | 30.00% |
| Immobilier étranger (couvert en CHF) | 2.06% | 2.00% | 10.00% |
| Placements alternatifs (couverts en CHF) | 2.29% | 5.00% | 15.00% |
| Total actions (Suisse et Etranger) | 34.87% | 35.00% | 50.00% |
| Total monnaies étrangères | 16.98% | 17.00% | 30.00% |

Les principales positions en actions

| | |
|------------------------------|-------|
| NESTLE SA-REG | 2.46% |
| NOVARTIS AG-REG | 2.20% |
| ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN | 2.10% |
| MICROSOFT CORP | 1.00% |
| NVIDIA CORP | 0.98% |
| UBS GROUP AG-REG | 0.93% |
| ABB LTD-REG | 0.87% |
| ZURICH INSURANCE GROUP AG | 0.83% |
| CIE FINANCIERE RICHEMO-A REG | 0.80% |
| ALPHABET INC | 0.60% |

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 | 83.02% |
| USD | 11.53% |
| EUR | 1.26% |
| JPY | 1.07% |
| Autres | 3.12% |

Caractéristiques d'investissements sur instruments à taux fixe

| | |
|-------------------|------|
| Modified Duration | 5.68 |
| Note moyenne | A |