

30 septembre 2024

Fondation de placement Swiss Life

LPP-Mix 25

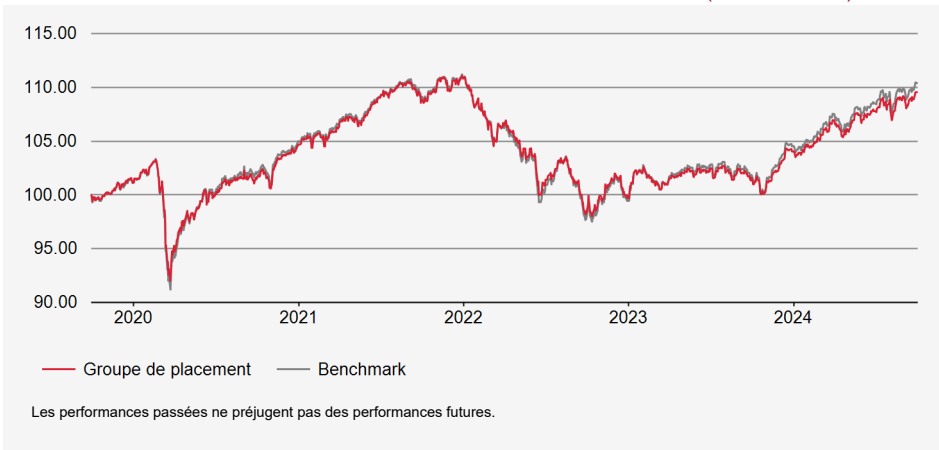


Fortune nette (VNI) en mio. CHF : 703.90
Valeur nette d'inventaire par droit en CHF : 200.31

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)



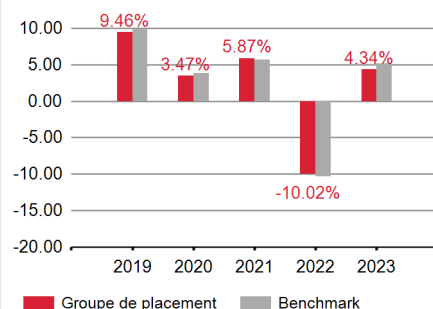
Performances en devise de référence

	Performances cumulées True				Performances annualisées			
	YTD	1 mois	3 mois	1 an	3 ans	5 ans	10 ans	Origine
Groupe de placement	5.29%	0.35%	1.63%	7.84%	0.22%	1.84%	2.55%	3.06%
Benchmark	5.58%	0.49%	1.73%	8.39%	0.40%	1.99%	2.89%	3.55%

Données statistiques (annualisées)

	1 an	3 ans	5 ans	10 ans	Origine
Volatilité du groupe de placement (en %)	3.31	4.81	5.10	4.29	4.09
Volatilité du Benchmark (en %)	3.60	5.24	5.46	4.42	4.09
Tracking Error ex post (en %)	0.41	0.59	0.55	0.52	0.58
Information Ratio	-1.33	-0.31	-0.28	-0.67	-0.83
Sharpe Ratio	1.83	-0.10	0.33	0.66	0.69
Corrélation	1.00	1.00	1.00	0.99	0.99
Beta	0.92	0.91	0.93	0.96	0.99
Jensen alpha	0.04	-0.21	-0.03	-0.23	-0.46
Maximum Drawdown (en %)	-1.88	-11.75	-11.75	-11.75	-14.16
Recovery Period (ans)	0.04	-	-	-	0.98

Performance



Info. sur le produit

Numéro de valeur: 1245601
ISIN: CH0012456015
LEI: 5493000KUC3Z24U77V93
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: 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: 0.56%

a posteriori au: 30/09/2024 0.59%

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	1.96%	2.00%	-
Hypothèques Suisse	0.89%	-	-
Obligations suisses en CHF	15.00%	16.00%	-
Obligations étrangères en CHF	9.07%	9.00%	-
Obl. en monnaies étrangères (couvertes en CHF)	26.85%	28.00%	-
Actions Suisse	13.23%	13.00%	-
Actions Etranger	12.02%	12.00%	-
Actions Etranger (couv. en CHF)	-	-	-
Immobilier Suisse	15.28%	13.00%	30.00%
Immobilier étranger (couvert en CHF)	3.22%	2.00%	10.00%
Placements alternatifs (couverts en CHF)	2.47%	5.00%	15.00%
Total actions (Suisse et Etranger)	25.25%	25.00%	50.00%
Total monnaies étrangères	12.02%	12.00%	30.00%

Les principales positions en actions

NESTLE SA-REG	1.82%
NOVARTIS AG-REG	1.63%
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	1.56%
MICROSOFT CORP	0.71%
NVIDIA CORP	0.70%
UBS GROUP AG-REG	0.69%
ABB LTD-REG	0.64%
ZURICH INSURANCE GROUP AG	0.61%
CIE FINANCIERE RICHEMO-A REG	0.59%
ALPHABET INC	0.42%

Composition du benchmark

1M Saron	2.00%
SBI Domestic AAA-BBB	16.00%
SBI Foreign AAA-BBB	9.00%
Bloomberg Gl. Agg. Treas. ex CH TR (couv. en CHF)	4.00%
Bloomberg Gl. Agg. Corp. (couv. en CHF)	9.00%
Bloomberg 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 ESG Leaders, in 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%

Structure du portefeuille selon les monnaies

CHF	87.98%
USD	8.16%
EUR	0.89%
JPY	0.76%
Autres	2.21%

Caractéristiques d'investissements sur instruments à taux fixe

Modified Duration	5.82
Note moyenne	A