

30 avril 2022

Fondation de placement Swiss Life

LPP-Mix 45

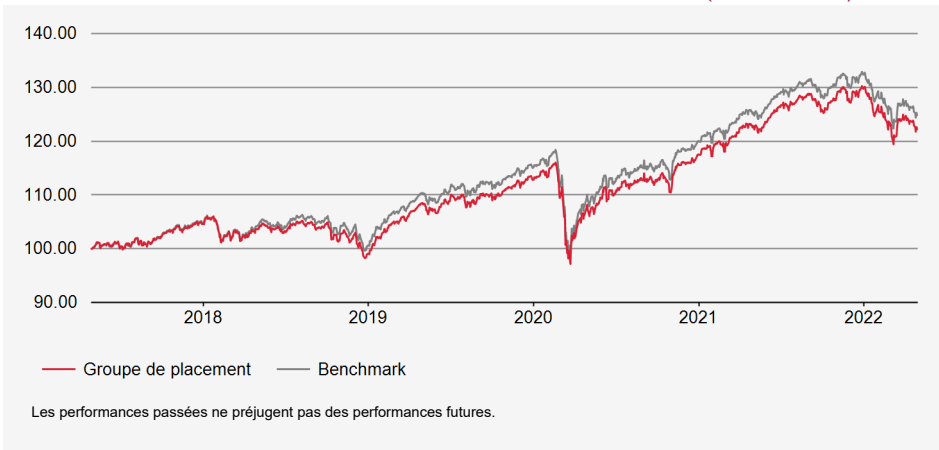


Fortune nette (VNI) en mio. CHF : 540.53
Valeur nette d'inventaire par droit en CHF : 212.06

Stratégie d'investissement

Placement dans toutes les catégories autorisées selon la LPP (part d'actions stratégique: 45%). Allocation active d'actifs. Limitation pour titres de participation: 50%. 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 20%.

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



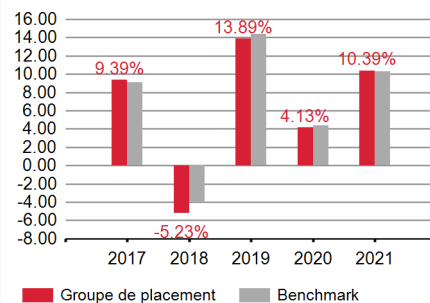
Performances en devise de référence

| | PERFORMANCES CUMULÉES | | | | PERFORMANCES ANNUALISÉES | | | |
|----------------------------|-----------------------|--------|--------|--------|--------------------------|-------|--------|---------|
| | YTD | 1 MOIS | 3 MOIS | 1 AN | 3 ANS | 5 ANS | 10 ANS | ORIGINE |
| GROUPE DE PLACEMENT | -5.79% | -1.40% | -3.17% | -0.27% | 4.05% | 4.09% | 5.44% | 3.72% |
| BENCHMARK | -5.71% | -1.40% | -3.14% | -0.19% | 4.18% | 4.53% | 5.78% | 4.37% |

Données statistiques (annualisées)

| | 1 AN | 3 ANS | 5 ANS | 10 ANS | ORIGINE |
|--|-------|--------|--------|--------|---------|
| Volatilité du groupe de placement (en %) | 5.99 | 7.23 | 6.42 | 5.82 | 6.40 |
| Volatilité du Benchmark (en %) | 5.76 | 7.42 | 6.53 | 5.72 | 6.32 |
| Tracking Error ex post (en %) | 0.34 | 0.53 | 0.52 | 0.54 | 0.67 |
| Information Ratio | -0.24 | -0.25 | -0.84 | -0.62 | -0.96 |
| Sharpe Ratio | 0.06 | 0.65 | 0.74 | 1.01 | 0.55 |
| Corrélation | 1.00 | 1.00 | 1.00 | 1.00 | 0.99 |
| Beta | 1.04 | 0.97 | 0.98 | 1.01 | 1.01 |
| Jensen alpha | -0.10 | 0.00 | -0.33 | -0.43 | -0.68 |
| Maximum Drawdown (en %) | -8.29 | -16.22 | -16.22 | -16.22 | -28.27 |
| Recovery Period (ans) | - | 0.67 | 0.67 | 0.67 | 3.76 |

Performance



Info. sur le produit

Numéro de valeur: 1245607
ISIN: CH0012456072
LEI: 2549001XL79VZWO5Q69
Code Bloomberg: SWABM45 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: 0.59%
a posteriori au: 30/09/2021 0.62%

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 | 6.13% | 2.00% | - |
| Hypothèques Suisse | 0.72% | - | - |
| Obligations suisses en CHF | 6.58% | 12.00% | - |
| Obligations étrangères en CHF | 4.18% | 5.00% | - |
| Obl. en monnaies étrangères (couvertes en CHF) | 24.72% | 20.00% | - |
| Actions Suisse | 23.57% | 23.00% | - |
| Actions Etranger | 20.97% | 22.00% | - |
| Actions Etranger (couv. en CHF) | 1.22% | - | - |
| Immobilier Suisse | 7.76% | 9.00% | 30.00% |
| Immobilier étranger (couvert en CHF) | 2.05% | 2.00% | 10.00% |
| Placements alternatifs (couverts en CHF) | 2.09% | 5.00% | 15.00% |
| Total actions (Suisse et Etranger) | 45.76% | 45.00% | 50.00% |
| Total monnaies étrangères | 20.97% | 22.00% | 30.00% |

Structure du portefeuille selon les monnaies

| | |
|--------|--------|
| CHF | 79.03% |
| USD | 14.49% |
| EUR | 2.42% |
| JPY | 1.40% |
| AUTRES | 2.66% |

Composition du benchmark

| | |
|---|--------|
| 1M SARON | 2.00% |
| SBI DOMESTIC AAA-BBB | 12.00% |
| SBI FOREIGN AAA-BBB | 5.00% |
| BB* GL. AGG TREAS EX CH TR (COUV. EN CHF) | 2.50% |
| BB* GL. AGG. CORP. (COUV. EN CHF) | 6.50% |
| BB* GL. AGG. CORP. SHORT TERM (COUV. EN CHF) | 7.00% |
| JP MORGAN CEMBI BROAD DIV IG INDEX (COUV. EN CHF) | 4.00% |
| SWISS PERFORMANCE INDEX | 23.00% |
| MSCI WORLD EX CH, EN CHF | 17.60% |
| MSCI AC WORLD SMALL CAP, EN CHF | 3.30% |
| MSCI EMERGING MARKETS, EN CHF | 1.10% |
| KGAST IMMO-INDEX | 9.00% |
| 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 | 5.16 |
| Note moyenne | A |