31 mars 2024

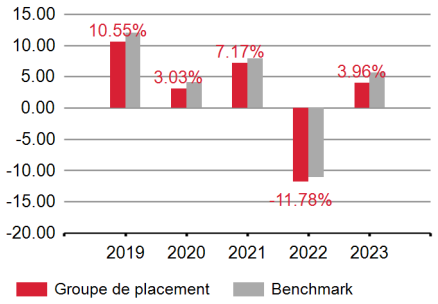
Fondation de placement Swiss Life LPP-Mix 35 P

Fortune nette (VNI) en mio. CHF : 382.91
Valeur nette d'inventaire par droit en CHF : 181.83

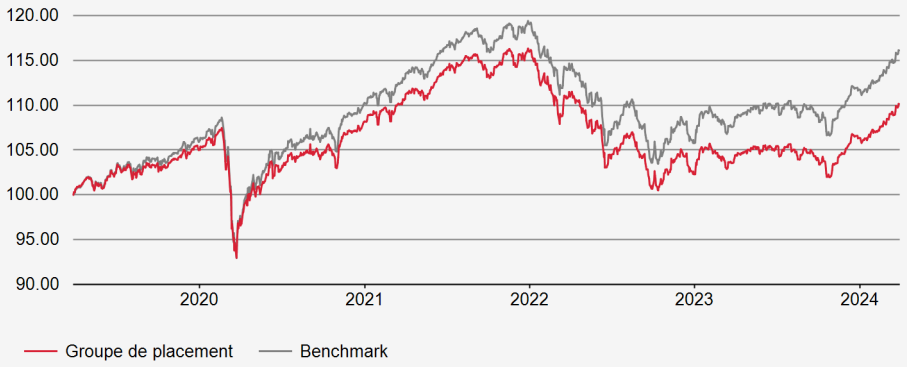
Stratégie d'investissement

Le groupe de placement LPP-Mix 35 P investit en moyenne environ 35% des avoirs dans des actions. Un peu plus de la moitié de cette part d'actions est placée dans des titres suisses générant un dividende, et le reste dans des sociétés étrangères. En moyenne, environ 45% de la fortune est investie dans des obligations. Les plafonds suivants s'appliquent: 45% d'actions, 30% de titres en monnaies étrangères. LPP-Mix 35 P convient aux investisseurs qui sont prêts à accepter des fluctuations de cours modérées. Nous conseillons un horizon de placement supérieur à sept ans.

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	3.57%	1.96%	3.57%	5.48%	-0.17%	1.89%	2.48%	2.82%
Benchmark	3.90%	2.05%	3.90%	6.84%	0.90%	2.98%	3.71%	4.23%

Données statistiques (annualisées)

	1 an	3 ans	5 ans	10 ans	Origine
Volatilité du groupe de placement (en %)	4.07	5.82	6.10	5.27	5.20
Volatilité du Benchmark (en %)	4.34	6.18	6.49	5.39	5.20
Tracking Error ex post (en %)	0.35	0.58	0.61	0.58	0.66
Information Ratio	-3.88	-1.84	-1.79	-2.11	-2.14
Sharpe Ratio	0.91	-0.09	0.32	0.53	0.51
Corrélation	1.00	1.00	1.00	0.99	0.99
Beta	0.94	0.94	0.94	0.97	0.99
Jensen alpha	-1.03	-1.04	-0.90	-1.11	-1.38
Maximum Drawdown (en %)	-3.49	-13.60	-13.60	-13.60	-22.51
Recovery Period (ans)	0.12	-	-	-	3.44

Info. sur le produit

Numéro de valeur: 1436916
ISIN: CH0014369166
LEI: 254900SR5GM6HP44F130
Code Bloomberg: SLVOR35 SW
Benchmark: Customized
Monnaie: CHF
Pays d'origine: Suisse
Date de création: 30/09/2002
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: 1.41%
a posteriori au: 30/09/2023 1.41%

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.
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 mars 2024

Fondation de placement Swiss Life
LPP-Mix 35 P

Structure de portefeuille par groupes de placement

	Groupe de placement	Benchmark	max. OPP2
Liquidités	3.09%	2.00%	-
Hypothèques Suisse	0.62%	-	-
Obligations suisses en CHF	14.16%	14.00%	-
Obligations étrangères en CHF	7.01%	7.00%	-
Obl. en monnaies étrangères (couvertes en CHF)	22.68%	24.00%	-
Actions Suisse	18.32%	18.00%	-
Actions Etranger	17.06%	17.00%	-
Actions Etranger (couv. en CHF)	0.56%	-	-
Immobilier Suisse	11.96%	11.00%	30.00%
Immobilier étranger (couvert en CHF)	2.24%	2.00%	10.00%
Placements alternatifs (couverts en CHF)	2.30%	5.00%	15.00%
Total actions (Suisse et Etranger)	35.94%	35.00%	50.00%
Total monnaies étrangères	17.06%	17.00%	30.00%

Les principales positions en actions

NESTLE SA-REG	2.96%
NOVARTIS AG-REG	2.07%
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	1.87%
MICROSOFT CORP.	1.23%
UBS GROUP AG-REG	1.04%
NVIDIA CORP	0.93%
CIE FINANCIERE RICHEMONT-REG	0.86%
ZURICH INSURANCE GROUP AG	0.83%
ABB LTD-REG	0.79%
ALPHABET INC	0.70%

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	81.55%
USD	11.63%
EUR	1.34%
JPY	1.14%
Autres	4.33%

Caractéristiques d'investissements sur instruments à taux fixe

Modified Duration	5.60
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, de la Fondation de libre passage Swiss Life ou de la Fondation de prévoyance 3a Swiss Life, les deux c/o Swiss Life SA, Service Center LPZ, Case postale, 8022 Zurich, tél. 0800 378 378. 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 ces 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.