

30 avril 2022

# Fondation de placement Swiss Life

## LPP-Mix 35 P

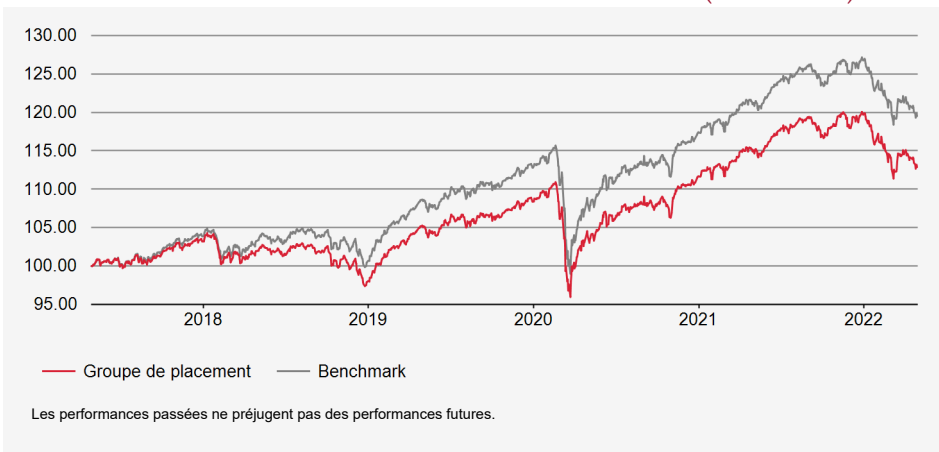


**Fortune nette (VNI) en mio. CHF : 315.02**  
**Valeur nette d'inventaire par droit en CHF : 180.51**

### 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.

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



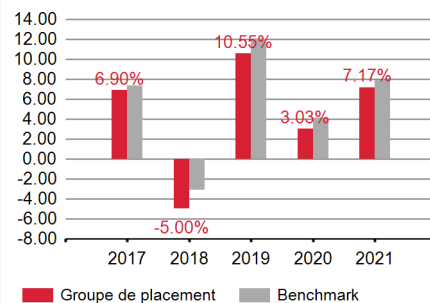
### Performances en devise de référence

|                            | PERFORMANCES CUMULÉES |        |        |        | PERFORMANCES ANNUALISÉES |       |        |         |
|----------------------------|-----------------------|--------|--------|--------|--------------------------|-------|--------|---------|
|                            | YTD                   | 1 MOIS | 3 MOIS | 1 AN   | 3 ANS                    | 5 ANS | 10 ANS | ORIGINE |
| <b>GROUPE DE PLACEMENT</b> | -5.70%                | -1.46% | -3.42% | -1.77% | 2.35%                    | 2.45% | 3.76%  | 3.06%   |
| <b>BENCHMARK</b>           | -5.72%                | -1.45% | -3.48% | -1.27% | 3.22%                    | 3.62% | 4.88%  | 4.47%   |

### Données statistiques (annualisées)

|  | 1 AN  | 3 ANS  | 5 ANS  | 10 ANS | ORIGINE |
|--|-------|--------|--------|--------|---------|
| Volatilité du groupe de placement (en %) | 5.03  | 6.01   | 5.27   | 4.75   | 5.08    |
| Volatilité du Benchmark (en %)           | 4.92  | 6.30   | 5.46   | 4.71   | 5.01    |
| Tracking Error ex post (en %)            | 0.38  | 0.59   | 0.55   | 0.54   | 0.66    |
| Information Ratio                        | -1.32 | -1.49  | -2.14  | -2.06  | -2.14   |
| Sharpe Ratio                             | -0.23 | 0.50   | 0.60   | 0.89   | 0.58    |
| Corrélation                              | 1.00  | 1.00   | 1.00   | 0.99   | 0.99    |
| Beta                                     | 1.02  | 0.95   | 0.96   | 1.00   | 1.01    |
| Jensen alpha                             | -0.49 | -0.68  | -1.01  | -1.14  | -1.44   |
| Maximum Drawdown (en %)                  | -7.24 | -13.47 | -13.47 | -13.47 | -22.51  |
| Recovery Period (ans)                    | -     | 0.74   | 0.74   | 0.74   | 3.44    |

### Performance



### Info. sur le produit

**Numéro de valeur:** 1436916  
**ISIN:** CH0014369166  
**LEI:**  
**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](http://www.swisslife.ch/fondationdeplacement)  
**Taux des charges d'exploitation TER KGAST**  
**au préalable:** 1.41%  
**a posteriori au:** 30/09/2021 1.43%

**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.

## Structure de portefeuille par groupes de placement

|  | Groupe de placement | Benchmark | max. OPP2 |
|--|---------------------|-----------|-----------|
| Liquidités                                     | 6.26%               | 2.00%     | -         |
| Hypothèques Suisse                             | 0.75%               | -         | -         |
| Obligations suisses en CHF                     | 8.88%               | 14.00%    | -         |
| Obligations étrangères en CHF                  | 4.39%               | 7.00%     | -         |
| Obl. en monnaies étrangères (couvertes en CHF) | 27.60%              | 24.00%    | -         |
| Actions Suisse                                 | 18.43%              | 18.00%    | -         |
| Actions Etranger                               | 15.85%              | 17.00%    | -         |
| Actions Etranger (couv. en CHF)                | 1.52%               | -         | -         |
| Immobilier Suisse                              | 11.49%              | 11.00%    | 30.00%    |
| Immobilier étranger (couvert en CHF)           | 2.74%               | 2.00%     | 10.00%    |
| Placements alternatifs (couverts en CHF)       | 2.09%               | 5.00%     | 15.00%    |
| Total actions (Suisse et Etranger)             | 35.80%              | 35.00%    | 50.00%    |
| Total monnaies étrangères                      | 15.85%              | 17.00%    | 30.00%    |

## Structure du portefeuille selon les monnaies

|        |        |
|--------|--------|
| CHF    | 84.15% |
| USD    | 11.00% |
| EUR    | 1.81%  |
| JPY    | 1.05%  |
| AUTRES | 1.99%  |

## Caractéristiques d'investissements sur instruments à taux fixe

|                   |      |
|-------------------|------|
| Modified Duration | 5.29 |
| Note moyenne      | A    |

## Les principales positions en actions

|                              | Groupe de placement |
|------------------------------|---------------------|
| NESTLE SA-REG                | 3.84%               |
| ROCHE HOLDING AG             | 2.75%               |
| NOVARTIS AG-REG              | 2.28%               |
| MICROSOFT CORP.              | 0.92%               |
| ZURICH INSURANCE GROUP AG    | 0.73%               |
| CIE FINANCIERE RICHEMONT-REG | 0.65%               |
| ALPHABET INC                 | 0.62%               |
| UBS GROUP AG-REG             | 0.61%               |
| ABB LTD-REG                  | 0.52%               |
| SIKA AG                      | 0.50%               |