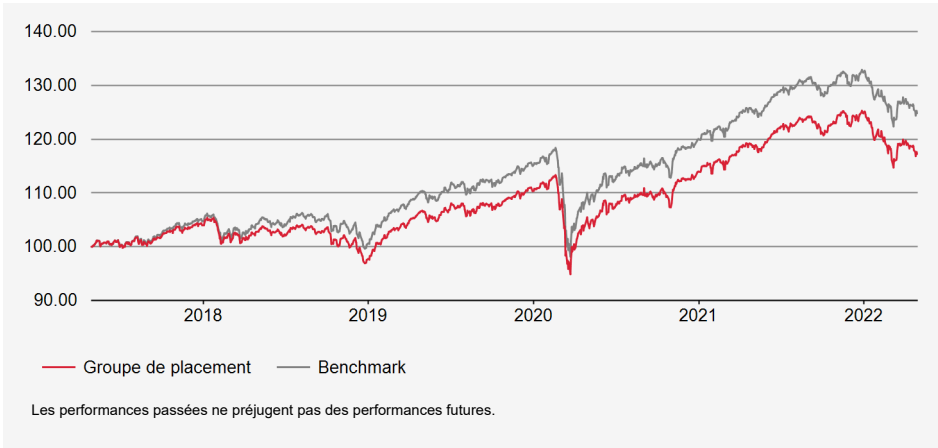


**Fortune nette (VNI) en mio. CHF : 540.53**  
**Valeur nette d'inventaire par droit en CHF : 194.52**

## Stratégie d'investissement

Le groupe de placement LPP-Mix 45 P investit en moyenne environ 45% 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 37% de la fortune est investie dans des obligations. Les plafonds suivants s'appliquent: 50% d'actions, 30% de titres en monnaies étrangères. LPP-Mix 45 P convient aux investisseurs qui sont prêts à accepter des fluctuations de cours importantes. Nous conseillons un horizon de placement supérieur à dix ans.

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



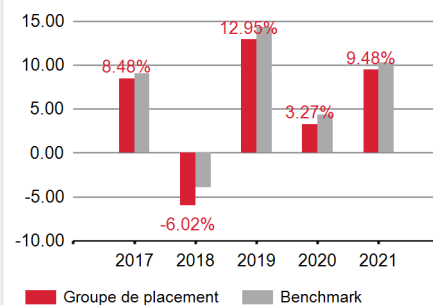
## Performances en devise de référence

	PERFORMANCES CUMULÉES				PERFORMANCES ANNUALISÉES			
	YTD	1 MOIS	3 MOIS	1 AN	3 ANS	5 ANS	10 ANS	ORIGINE
<b>GROUPE DE PLACEMENT</b>	-6.05%	-1.46%	-3.36%	-1.09%	3.19%	3.23%	4.57%	3.45%
<b>BENCHMARK</b>	-5.71%	-1.40%	-3.14%	-0.19%	4.18%	4.53%	5.78%	4.97%

## Données statistiques (annualisées)

	1 AN	3 ANS	5 ANS	10 ANS	ORIGINE
Volatilité du groupe de placement (en %)	5.99	7.23	6.41	5.82	6.29
Volatilité du Benchmark (en %)	5.76	7.42	6.53	5.72	6.21
Tracking Error ex post (en %)	0.33	0.53	0.52	0.54	0.68
Information Ratio	-2.72	-1.88	-2.48	-2.23	-2.22
Sharpe Ratio	-0.08	0.53	0.61	0.86	0.53
Corrélation	1.00	1.00	1.00	1.00	0.99
Beta	1.04	0.97	0.98	1.01	1.01
Jensen alpha	-0.92	-0.86	-1.19	-1.30	-1.56
Maximum Drawdown (en %)	-8.44	-16.28	-16.28	-16.28	-29.17
Recovery Period (ans)	-	0.74	0.74	0.74	3.98

## Performance



## Info. sur le produit

**Numéro de valeur:** 1436925

**ISIN:** CH0014369257

**LEI:** 2549001XL79VZWJO5Q69

**Code Bloomberg:** SLVOR45 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:** 1.42%

**a posteriori au:** 30/09/2021 1.45%

**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	6.13%	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%

## Caractéristiques d'investissements sur instruments à taux fixe

Modified Duration	5.16
Note moyenne	A

## Les principales positions en actions

	Groupe de placement
NESTLE SA-REG	4.91%
ROCHE HOLDING AG	3.52%
NOVARTIS AG-REG	2.91%
MICROSOFT CORP.	1.23%
ZURICH INSURANCE GROUP AG	0.93%
CIE FINANCIERE RICHEMONT-REG	0.83%
ALPHABET INC	0.83%
UBS GROUP AG-REG	0.78%
ABB LTD-REG	0.66%
SIKA AG	0.64%