

31 mars 2025

# Fondation de placement Swiss Life

## LPP-Mix 45

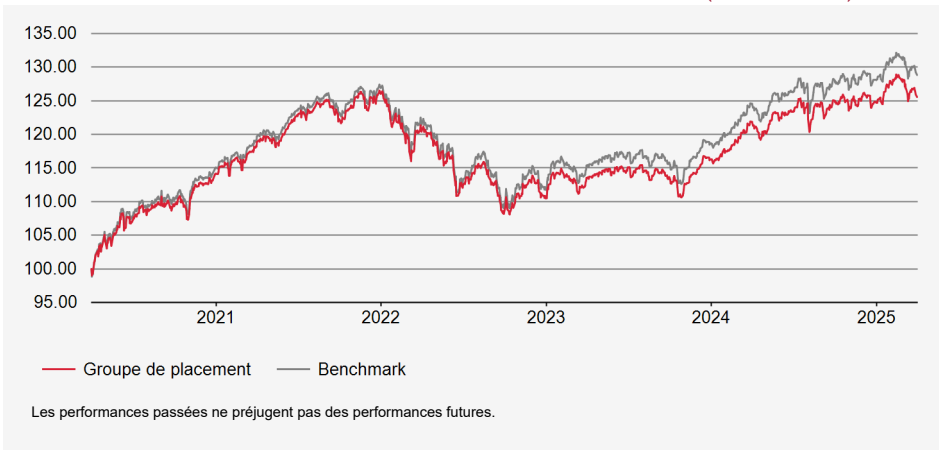


**Fortune nette (VNI) en mio. CHF : 804.21**  
**Valeur nette d'inventaire par droit en CHF : 224.25**

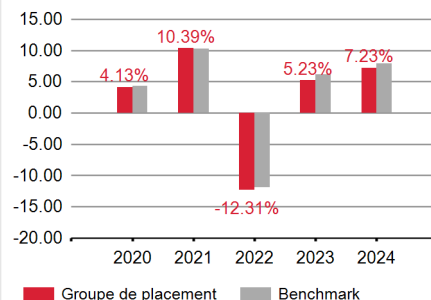
### Stratégie d'investissement

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)



### Performance



### Info. sur le produit

**Numéro de valeur:** 1245607  
**ISIN:** CH0012456072  
**LEI:** 2549001XL79VZWJO5Q69  
**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:** 12h00  
**Protection antidilution:**  
 Commission d'émission / de rachat en faveur du groupe de placement selon l'aperçu des conditions.

**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:** 0.56%

**a posteriori au:** 30/09/2024 0.59%

### 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	0.68%	-2.02%	0.68%	3.02%	1.40%	4.65%	3.23%	3.49%
Benchmark	0.59%	-2.03%	0.59%	3.42%	1.99%	5.19%	3.76%	4.14%

### Données statistiques (annualisées)

	1 an	3 ans	5 ans	10 ans	Origine
Volatilité du groupe de placement (en %)	4.87	6.61	6.59	6.32	6.42
Volatilité du Benchmark (en %)	4.77	6.98	6.80	6.42	6.40
Tracking Error ex post (en %)	0.25	0.55	0.49	0.56	0.66
Information Ratio	-1.61	-1.08	-1.10	-0.94	-0.97
Sharpe Ratio	0.41	0.07	0.65	0.54	0.50
Corrélation	1.00	1.00	1.00	1.00	0.99
Beta	1.02	0.95	0.97	0.98	1.00
Jensen alpha	-0.45	-0.53	-0.37	-0.45	-0.64
Maximum Drawdown (en %)	-3.98	-10.77	-14.55	-16.22	-28.27
Recovery Period (ans)	0.19	1.44	2.28	0.67	3.76

**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.

**Protection antidilution:** Aperçu des conditions disponible à l'adresse: [www.swisslife.ch/fondationdeplacement](http://www.swisslife.ch/fondationdeplacement), «Documents juridiques» (modifications possibles à tout moment sans préavis).

**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	4.19%	2.00%	-
Hypothèques Suisse	0.51%	-	-
Obligations suisses en CHF	10.66%	12.00%	-
Obligations étrangères en CHF	4.32%	5.00%	-
Obl. en monnaies étrangères (couvertes en CHF)	18.82%	20.00%	-
Actions Suisse	24.00%	23.00%	-
Actions Etranger	22.72%	22.00%	-
Actions Etranger (couv. en CHF)	0.98%	-	-
Immobilier Suisse	9.33%	9.00%	30.00%
Immobilier étranger (couvert en CHF)	1.44%	2.00%	10.00%
Placements alternatifs (couverts en CHF)	3.02%	5.00%	15.00%
Total actions (Suisse et Etranger)	47.71%	45.00%	50.00%
Total monnaies étrangères	22.72%	22.00%	30.00%

## Les principales positions en actions

NESTLE SA-REG	3.42%
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	2.98%
NOVARTIS AG-REG	2.82%
ZURICH INSURANCE GROUP AG	1.31%
NVIDIA CORP	1.25%
MICROSOFT CORP	1.25%
UBS GROUP AG-REG	1.25%
CIE FINANCIERE RICHEMO-A REG	1.20%
ABB LTD-REG	1.05%
HOLCIM LTD	0.75%

## Composition du benchmark

1M Saron	2.00%
SBI Domestic AAA-BBB	12.00%
SBI Foreign AAA-BBB	5.00%
Bloomberg Gl. Agg. Treas. ex CH TR (couv. en CHF)	2.50%
Bloomberg Gl. Agg. Corp. (couv. en CHF)	6.50%
Bloomberg Gl. Agg. Corp. Short Term (couv. en CHF)	7.00%
JP Morgan CEMBI Broad Div IG Index (couv. en CHF)	4.00%
SPI® Total Return	23.00%
MSCI World ex CH ESG Leaders, in 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%

## Structure du portefeuille selon les monnaies

CHF	76.33%
USD	15.29%
JPY	1.31%
EUR	0.27%
Autres	5.85%

## Caractéristiques d'investissements sur instruments à taux fixe

Modified Duration	5.44
Note moyenne	A