



SwissLife

Swiss Life
Best Select
Invest Plus®

Fondation de placement Swiss Life

Bénéficiaire de l'expérience des grandes caisses de pensions et profiter de leurs principes de placement modernes.

Caractéristiques de la Fondation de placement Swiss Life

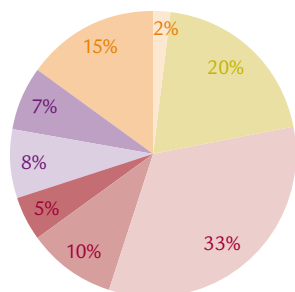
- Fondation exemptée d'impôts (fondée en 2001; patrimoine de 1,9 milliard de francs sous gestion)
- Objectif: placement collectif et gestion de capitaux de prévoyance
- Processus fiscalement optimisés via des fonds institutionnels
- Cercle d'investisseurs exclusif (institutions de prévoyance exonérées d'impôts)
- Conseil de fondation composé majoritairement de représentants des investisseurs
- Fondation soumise à la surveillance de l'Office fédéral des assurances sociales
- Membre de la CAFP (Conférence des administrateurs de fondations de placement) soumise à leurs directives de qualité

Gamme de produits ciblée

Obligations Suisse en CHF Indice de référence: SBI Domestic AAA-BBB	Obligations Etranger en CHF Indice de référence: SBI Foreign AAA-BBB	Obligations Global Etats+ (couvertes en CHF) Indice de référence: Citigroup WGBI ex CH (couvertes en CHF)	Obligations Global Entreprises (couvertes en CHF) Indice de référence: Barclays Global Aggregate Corporates (couvertes en CHF)	Obligations Global (couvertes en CHF) Indice de référence: 60% Citigroup WGBI ex CH 40% Barclays Global Aggregate Corporates (Indices couvertes en CHF)
Actions Suisse Indice de référence: Swiss Performance Index	Actions Suisse Protect Avec stratégie de couverture intégrée («Put Spread Collar»)	Actions Etranger Indice de référence: 80% MSCI World ex CH 15% MSCI World Small Cap 5% MSCI Marchés émergents	Actions Etranger Protect Avec stratégie de couverture intégrée («Put Spread Collar»)	Immobilier Suisse Indice de référence: KGAST Immo-Index Fonds immobiliers Suisse Indice de référence: SXI Swiss Real Estate® Funds

LPP-Mix 15

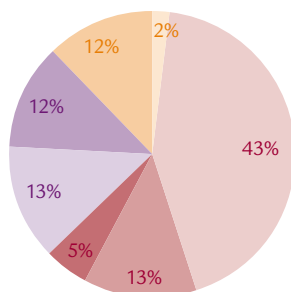
stratégie de placement:



■ Liquidités
■ Hypothèques Suisse

LPP-Mix 25

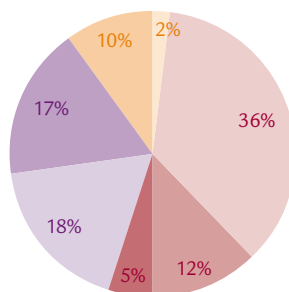
stratégie de placement:



■ Obligations CHF Suisse
■ Obligations CHF Etranger

LPP-Mix 35

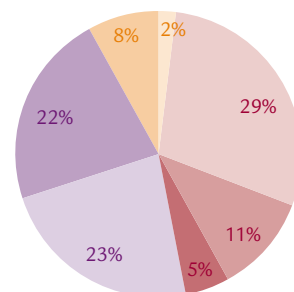
stratégie de placement:



■ Obl. Global (couvertes en CHF)
■ Actions Suisse

LPP-Mix 45

stratégie de placement:



■ Actions Etranger
■ Immobilier Suisse

Investment Controlling indépendant assuré par PPCmetrics

PPCmetrics SA est une société de conseil indépendante leader pour les investisseurs institutionnels. Elle agit en tant qu'Investment Controller de la Fondation de placement Swiss Life et propose les prestations suivantes pour les groupes de placement de titres (Actions Protect excl.):

- conseil sur les structures de mandats appropriées dans les catégories de placement Obligations Global, Actions Suisse et Actions Etranger (nombre de mandats, segmentation, style de placement, définition des directives de placement);

- soutien à la sélection du gérant de fortune externe le plus compétent dans ces catégories de placement;
- soutien au suivi permanent des gérants de fortune et à l'évaluation des résultats des placements.

Swiss Life Asset Management SA sélectionne les gérants, assure une surveillance continue ainsi qu'un suivi complet du processus selon des critères objectifs, conformément à la meilleure pratique institutionnelle.

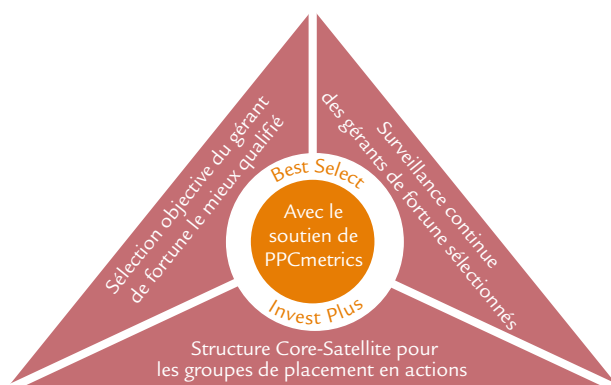
Une philosophie de placement des plus modernes

Sélection des gérants de fortune

Les gérants de fortune les plus compétents sont sélectionnés en fonction de critères objectifs et des exigences particulières des groupes de placement. Cela signifie que, selon la structure d'un groupe de placement, la gestion de fortune peut être confiée à un ou plusieurs gérants.

Surveillance indépendante et continue

L'Investment Controller indépendant surveille les activités de placement des gérants sélectionnés de manière systématique et régulière, en se fondant sur des critères objectifs tant qualitatifs que quantitatifs.



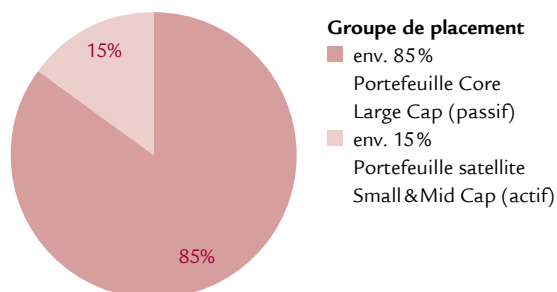
Structure au sein des groupes de placement

Les portefeuilles au sein des groupes de placement ont une structure moderne. Dans cette optique, les groupes de placement en actions appliquent une stratégie Core-Satellite fondée sur les éléments suivants: les marchés principaux ou certains segments de marché comme les sociétés fortement capitalisées sont considérés comme «efficients»; il est pratiquement impossible de réaliser une performance au-dessus du marché en pratiquant une gestion active. C'est pourquoi la fondation de placement suit une stratégie de placement passive pour ces thèmes appelés Core, avec pour objectif d'obtenir une réplique de l'indice de marché à moindres coûts et avec un tracking error faible.

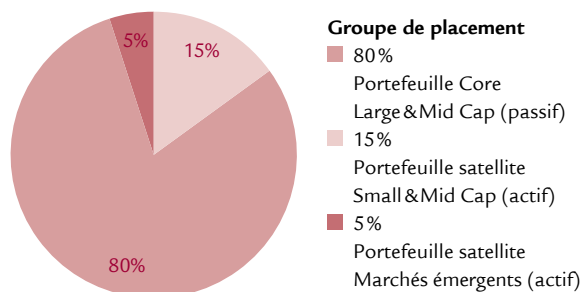
En revanche, s'agissant des small caps et des marchés émergents (thèmes satellites), la fondation de placement opère une gestion active. Les évaluations erronées de titres, secteurs ou marchés peuvent ainsi être décelées et mises à profit grâce à un timing judicieux.

Un alpha positif peut ainsi être obtenu à moyen et à long terme.

Actions Suisse (structure)



Actions Etranger (structure)



Gérants de fortune sélectionnés

Groupe de placement	Structure du portefeuille (active/passive)	Gérant de fortune
Obligations CHF Suisse	Portefeuille global, actif	Swiss Life Asset Management SA
Obligations CHF Etranger	Portefeuille global, actif	Swiss Life Asset Management SA
Obligations Global (couvertes en CHF)	Portefeuille global, actif	Swiss Life Asset Management SA
Obligations Global Etats+ (couvertes en CHF)	Portefeuille global, actif	Swiss Life Asset Management SA
Obligations Global Entreprises (couvertes en CHF)	Portefeuille global, actif	Swiss Life Asset Management SA
Actions Suisse	Large Caps, passif Small&Mid Caps, actif	Pictet Asset Management SA Mirabaud & Cie
Actions Suisse Protect	Large Caps, approche réglementée, «Put Spread Collar»	Swiss Life Asset Management SA
Actions Etranger	Large & Mid Cap, passif Small Caps, actif Marchés émergents, actif	UBS SA Invesco Divers (Swiss Life Fund of Funds)
Actions Etranger Protect	Large & Mid Caps, approche réglementée, «Put Spread Collar»	Swiss Life Asset Management SA
Immobilier Suisse	Portefeuille global, actif	Swiss Life Property Management SA
Fonds immobiliers Suisse	Portefeuille global, actif	Divers (Swiss Life Fund of Funds)
LPP Mix 15/25/35/45	Portefeuille global composé des groupes de placement susmentionnés, actif	Swiss Life Asset Management SA

Swiss Life Best Select Invest Plus®

- Sélection objective des gérants de fortune les mieux qualifiés et soutien apporté par un Investment Consultant de renom
- Groupes de placement structurés dans un portefeuille moderne (Core-Satellite) selon une pratique institutionnelle optimale
- Expertise reconnue de Swiss Life Asset Management dans le domaine des obligations et des portefeuilles mixtes
- Transparence et sécurité accrues grâce à une surveillance permanente des gérants de fortune effectuée par un Investment Controller indépendant

Fondation de placement Swiss Life
Case postale, 8022 Zurich
Téléphone +41 (0)43 284 79 79
fondationdeplacement@swisslife.ch
www.swisslife.ch/fondationdeplacement

