

31 mars 2025

Fondation de placement Swiss Life

LPP-Mix Index 45

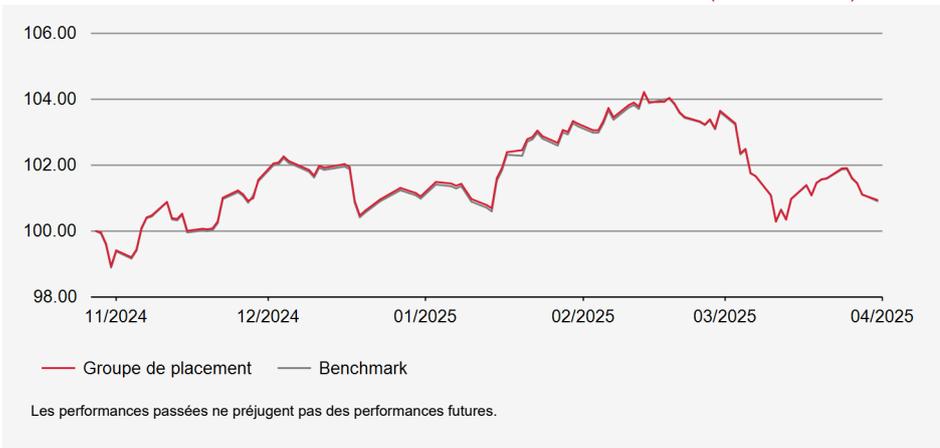


Fortune nette (VNI) en mio. CHF : 19.32
Valeur nette d'inventaire par droit en CHF : 1,009.42

Stratégie d'investissement

Le groupe de placement est géré selon une approche indexée, avec une part stratégique d'actions de 45%. Le groupe de placement investit indirectement dans des actions, des obligations d'entreprises et d'Etat à l'échelle mondiale par le biais d'investissements collectifs indexés ainsi que dans l'immobilier suisse, et se distingue par une large diversification.

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
Groupe de placement	-0.11%	-2.61%	-0.11%	-	-	-	-	-
Benchmark	-0.07%	-2.60%	-0.07%	-	-	-	-	-

Données statistiques (annualisées)

	1 an	3 ans	5 ans	10 ans	Origine
Volatilité du groupe de placement (en %)	-	-	-	-	6.91
Volatilité du Benchmark (en %)	-	-	-	-	6.92
Tracking Error ex post (en %)	-	-	-	-	0.09
Information Ratio	-	-	-	-	0.76
Sharpe Ratio	-	-	-	-	0.19
Corrélation	-	-	-	-	1.00
Beta	-	-	-	-	1.00
Jensen alpha	-	-	-	-	0.08
Maximum Drawdown (en %)	-	-	-	-	-3.77
Recovery Period (ans)	-	-	-	-	-

Performance

Historique de données insuffisant

Info. sur le produit

Numéro de valeur: 137661035
ISIN: CH1376610353
LEI: 2549004PTRK412MK4644
Code Bloomberg: SLAI45S SW
Benchmark: Customized
Monnaie: CHF
Pays d'origine: Suisse
Date de création: 28/10/2024
Valeur de lancement: 1000.00
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

Taux des charges d'exploitation TER KGAST
au préalable: 0.35%

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, «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	0.01%	-	-
Obligations en CHF	19.44%	19.00%	-
Obl. en monnaies étrangères (couvertes en CHF)	29.11%	29.00%	-
Actions Suisse	15.79%	16.00%	-
Actions Etranger	12.59%	13.00%	-
Actions Etranger (couv. en CHF)	15.89%	16.00%	-
Immobilier Suisse	7.16%	7.00%	30.00%
Total actions (Suisse et Etranger)	44.27%	-	50.00%
Total monnaies étrangères	12.59%	-	30.00%

Les principales positions

NESTLE SA-REG	2.25%
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	1.96%
NOVARTIS AG-REG	1.85%
APPLE INC	1.14%
NVIDIA CORP	0.90%
MICROSOFT CORP	0.90%
ZURICH INSURANCE GROUP AG	0.87%
UBS GROUP AG-REG	0.82%
CIE FINANCIERE RICHEMO-A REG	0.79%
ABB LTD-REG	0.69%

Composition du benchmark

SBI® AAA-BBB Total Return	19.00%
FTSE Non-CHF World Government Bond Index TR (CHF hedged)	14.50%
Bloomberg Global Aggregate Corporate ex CHF TR (CHF hedged)	14.50%
SPI® Total Return	16.00%
MSCI World ex Switzerland Net Return	7.00%
MSCI World ex Switzerland Net Return (CHF hedged)	16.00%
MSCI World ex Switzerland Small Cap Net Return	3.00%
MSCI Emerging Markets Net Return	3.00%
SXI Real Estate® Funds Broad Total Return	7.00%

Structure du portefeuille selon les monnaies

CHF	87.41%
USD	6.83%
JPY	0.77%
EUR	0.76%
Autres	4.23%

Caractéristiques d'investissements sur instruments à taux fixe

Modified Duration	6.69
Note moyenne	A+