

# Fondation de placement Swiss Life

## LPP-Mix 75 (Part d'actions dépassée selon OPP 2)

### Stratégie d'investissement

- Placement dans toutes les catégories autorisées selon la LPP (part d'actions stratégique: 75%)
- Allocation active d'actifs
- Limitation pour titres de participation: 85%, limitation pour monnaies étrangères: 30%
- Note moyenne des obligations: BBB au minimum
- Réalisation au moyen de placements collectifs de même nature
- Le cercle d'investisseurs se limite aux institutions de prévoyance de la prévoyance du pilier 3a ainsi qu'aux institutions de prévoyance pour leurs plans de prévoyance 1e
- Au vu de sa part élevée en actions, ce groupe de placement implique un risque plus élevé qu'un LPP-Mix dont la part en actions est de 50% au max.

### Informations sur le produit

Numéro de valeur	43583002
ISIN	CH0435830028
LEI	2549007M15RG5X8NMB06
Bloomberg Ticker	SWABM75 SW
Benchmark	customized
Monnaie	CHF
Date de création	31.10.2018
Valeur de lancement	100.00
Clôture de l'exercice	30.09.
Souscription/Rachat	journalier
Délai final d'acceptation	14h00

#### 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<sub>KGAST</sub> \*\*  
- au préalable 0.69%  
- a posteriori au n.a.

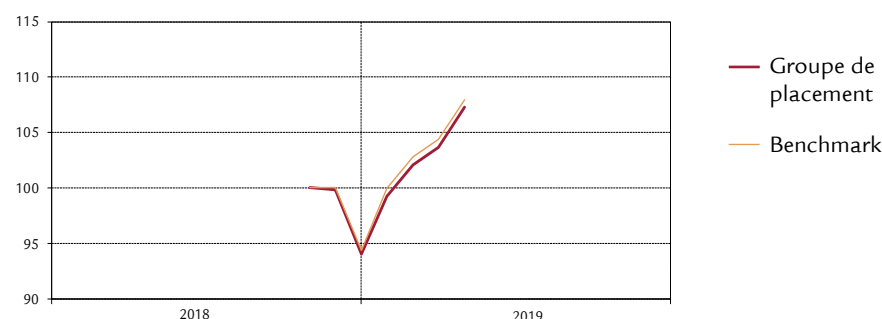
Comm. de souscription/rachat \*\*\* aucune  
Pratique de distribution Capitalisation

\* 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

\*\* Le taux des charges d'exploitation TER<sub>KGAST</sub> couvre tous les coûts à l'exception des frais de transaction et des prélèvements fiscaux sur les transactions

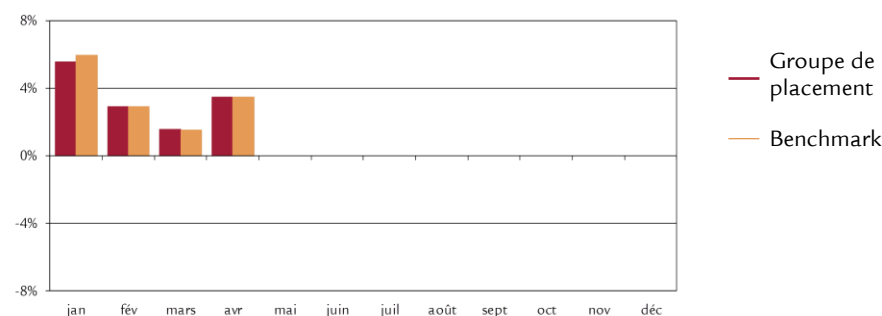
\*\*\* Toute disposition divergente dans les règlements relatifs aux émoluments des fondations de libre passage et des fondations de prévoyance 3a demeure réservée

### Evolution du cours indexée et performance



Performance	1M	3M	1A	3A p.a.	5Ap.a. depuis p.a. 31.10.18	
Groupe de placement (en %)	3.46	8.07			7.25	
Benchmark (en %)	3.46	8.04			7.97	
	YTD	2018	2017	2016	2015	2014
Groupe de placement (en %)	14.08					
Benchmark (en %)	14.45					

### Performance mensuelle



### Données statistiques (annualisées)

	1A	3A	5A	depuis 31.10.18
Volatilité du groupe de placement (en %)				13.70
Volatilité Benchmark (en %)				13.76
Tracking Error ex post (en %)				0.54
Tracking Error ex ante (en %)	0.60			
Information Ratio				-1.34
Sharpe Ratio				0.56
Corrélation				
Beta				0.99
Jensen-Alpha				-0.62
Maximum Drawdown (en %)				-8.35
Recovery Period (ans)				0.13

### Chiffres caractéristiques

	31.12.2018	30.04.2019
Fortune en mio. CHF	4.7	6.3
Valeur nette d'inventaire par part en CHF	94.01	107.25

30 avril 2019

# Fondation de placement Swiss Life

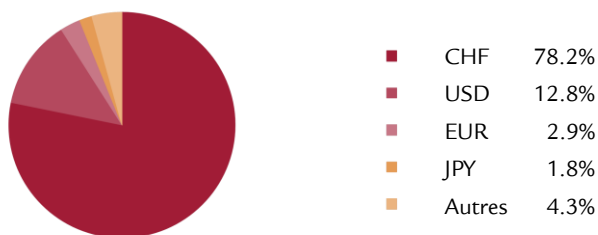
## LPP-Mix 75 (Part d'actions dépassée selon OPP 2)



### Structure de portefeuille par groupes de placement

	Groupe de placement	Benchmark	max. OPP2
Liquidités	0.1%	2%	
Obl. en monnaies étrangères (couvertes en CHF)	12.3%	13%	
Actions Suisse	39.2%	38%	
Actions Etranger	21.8%	20%	
Actions Etranger (couv. en CHF)	18.2%	17%	
Immobilier Suisse	6.1%	5%	30%
Placements alternatifs	2.3%	5%	15%
Total	100.0%	100%	
<hr/>			
Total actions (Suisse et Etranger)	79.2%	75%	50%
Total monnaies étrangères	21.8%	20%	30%

### Structure du portefeuille selon les monnaies



### Composition du benchmark

Citigroup CHF 1 M Euro Depo	2%
BB* Gl. Agg Treas ex CH TR (couv. en CHF)	2%
BB* Gl. Agg. Corp. (couv. en CHF)	4%
BB* Gl. Agg. Corp. Short Term (couv. en CHF)	4%
JP Morgan CEMBI Broad Diversified IG (CHF Hedged)	3%
Swiss Performance Index	38%
MSCI World ex CH, en CHF	16%
MSCI World ex CH, (couvertes en CHF)	17%
MSCI AC World Small Cap, en CHF	3%
MSCI Emerging Markets, en CHF	1%
KGAST Immo-Index	5%
HFRX Global Hedge Funds (couv. en CHF)	5%
Total	100%

\* Bloomberg Barclays

### Caractéristiques des placements à revenu fixe

Modified Duration	4.43
Rating moyenne	A-

### Disclaimer

La présente publication ne constitue ni une incitation ni une recommandation pour la vente ou l'achat d'instruments de placement, et son but est uniquement d'informer. Tous les documents constituant la base légale dans le cadre d'un éventuel placement peuvent être obtenus gratuitement auprès de la Fondation de placement Swiss Life, case postale, 8022 Zurich, tél. 043 284 79 79. Le cercle des investisseurs est limité aux institutions de prévoyance de la prévoyance liée domiciliées en Suisse ainsi qu'aux institutions de prévoyance domiciliées en Suisse pour leurs plans de prévoyance 1e.

La performance passée ne saurait présumer de l'évolution en cours ou à venir. Les données relatives aux performances ne tiennent pas compte des commissions et frais éventuellement prélevés au moment de l'émission ou du rachat des parts.