

Fondation de placement Swiss Life

LPP-Mix 25 P



Stratégie d'investissement

- Le groupe de placement LPP-Mix 25 P investit en moyenne environ 25% 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 53% de la fortune est investie dans des obligations.
- Les plafonds suivants s'appliquent: 35% d'actions, 30% de titres en monnaies étrangères.
- LPP-Mix 25 P convient aux investisseurs qui sont prêts à accepter des fluctuations de cours. Nous conseillons un horizon de placement supérieur à cinq ans.

Informations sur le produit

Numéro de valeur	1436904
ISIN	CH0014369042
LEI	254900JNOBNDNHDGRO53
Bloomberg Ticker	SLVOR25 SW
Benchmark	customized
Monnaie	CHF
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

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 1.40%

- a posteriori au 30.09.2019 1.41%

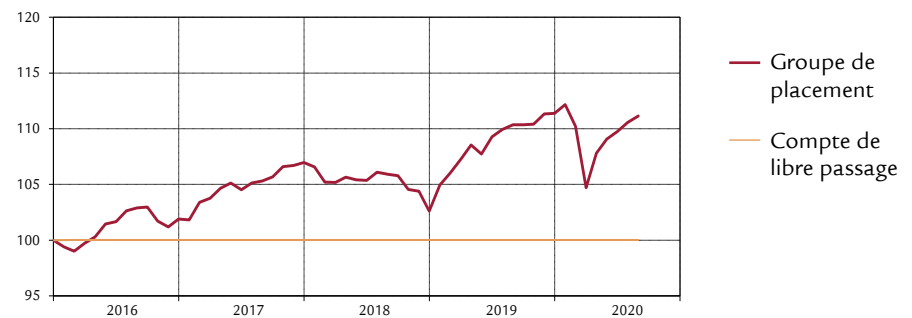
Commission de souscription/rachat aucune

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

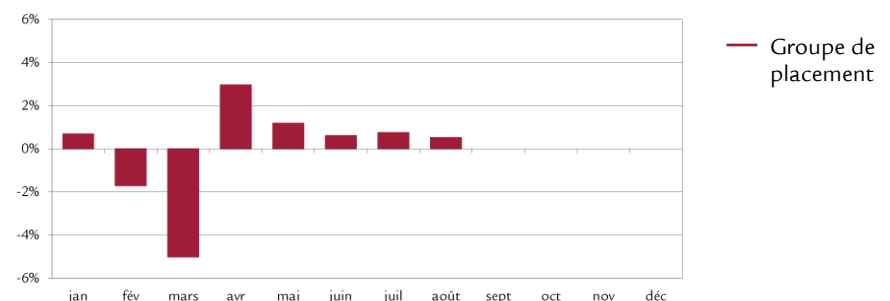
** Le taux des charges d'exploitation TER_{KGAST} couvre tous les coûts à l'exception des frais de transaction et des prélèvements fiscaux sur les transactions

Evolution du cours indexée et performance



Performance	1M	3M	1A	3A	5A	10A	depuis 30.09.02
Groupe de placement (en %)	0.52	1.90	0.71	5.53	11.83	37.42	62.92
	YTD	2019	2018	2017	2016	2015	2014
Groupe de placement (en %)	-0.21	8.56	-4.09	4.99	1.90	0.23	7.44

Performance mensuelle 2020



Données statistiques (annualisées)

	1A	3A	5A	10A	depuis 30.09.02
Volatilité du groupe de placement (en %)	6.66	4.53	3.96	3.59	3.95
Volatilité Benchmark (en %)	7.23	4.78	4.06	3.51	3.88
Tracking Error ex post (en %)	0.68	0.50	0.49	0.50	0.59
Tracking Error ex ante (en %)	0.50				
Information Ratio	-1.71	-3.03	-2.62	-2.27	-2.37
Sharpe Ratio	0.21	0.56	0.75	0.99	0.62
Corrélation	1.00	1.00	0.99	0.99	0.99
Beta	0.92	0.94	0.97	1.01	1.01
Jensen-Alpha	-0.94	-1.25	-1.12	-1.15	-1.38
Maximum Drawdown (en %)	-10.96	-10.96	-10.96	-10.96	-15.36
Recovery Period (ans)	-	-	-	-	1.66

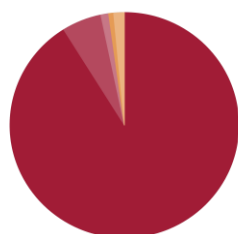
Chiffres caractéristiques

	31.12.2019	31.08.2020
Fortune en mio. CHF	655.3	674.1
Valeur nette d'inventaire par part en CHF	163.27	162.92

Structure de portefeuille par groupes de placement

	Groupe de placement	Benchmark	max. OPP2
Liquidités	1.6%	2%	
Obligations suisses en CHF	12.7%	16%	
Obligations étrangères en CHF	7.2%	9%	
Obl. en monnaies étrangères (couvertes en CHF)	31.9%	28%	
Actions Suisse	12.1%	13%	
Actions Etranger	8.9%	12%	
Actions Etranger (couv. en CHF)	7.1%	0%	
Immobilier Suisse	14.7%	13%	30%
Immobilier étranger (couvert en CHF)	1.7%	2%	10%
Placements alternatifs (couverts en CHF)	2.1%	5%	15%
Total	100.0%	100%	
<hr/>			
Total actions (Suisse et Etranger)	28.1%	25%	50%
Total monnaies étrangères	8.9%	12%	30%

Structure du portefeuille selon les monnaies



CHF	91.1%
USD	5.6%
EUR	1.1%
JPY	0.7%
Autres	1.5%

Les principales positions en actions

Nestlé	2.7%
Roche BJ	1.8%
Novartis	1.6%
Apple Inc.	0.5%
Zurich Insurance Group	0.4%
Microsoft Corp.	0.3%
Lonza Group AG	0.3%
ABB	0.3%
UBS	0.3%
Amazon.com, Inc.	0.3%

Caractéristiques des placements à revenu fixe

Modified Duration	6.08
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, de la Fondation de libre passage Swiss Life, p.A. Swiss Life SA, Service Center LPZ, Case postale, 8022 Zurich, tél. 0800 378 378 ou de la Fondation de prévoyance 3a Swiss Life, p.A. Swiss Life SA, Service Center LPZ, Case postale, 8022 Zurich, tél. 0800 378 378. Le cercle des investisseurs est limité aux institutions du 2e pilier et du pilier 3a, ainsi que les autres institutions de prévoyance professionnelle exonérées d'impôts avec siège en Suisse et aux personnes qui gèrent des placements collectifs pour ces institutions, qui sont soumises à la surveillance de l'Autorité fédérale de surveillance des marchés financiers et qui ne placent dans la fondation que des fonds destinés à ces institutions.

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.