

# Fondation de placement Swiss Life

## LPP-Mix 35 P



### Stratégie d'investissement

- Le groupe de placement LPP-Mix 35 P investit en moyenne environ 35% 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 45% de la fortune est investie dans des obligations.
- Les plafonds suivants s'appliquent: 45% d'actions, 30% de titres en monnaies étrangères.
- LPP-Mix 35 P convient aux investisseurs qui sont prêts à accepter des fluctuations de cours modérées. Nous conseillons un horizon de placement supérieur à sept ans.

### Informations sur le produit

Numéro de valeur	1436916
ISIN	CH0014369166
LEI	254900SR5GM6HP44F130
Bloomberg Ticker	SLVOR35 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](http://www.swisslife.ch/fondationdeplacement)

Taux des charges d'exploitation TER<sub>KGAST</sub> \*\*

- au préalable 1.42%

- a posteriori au 30.09.2019 1.43%

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

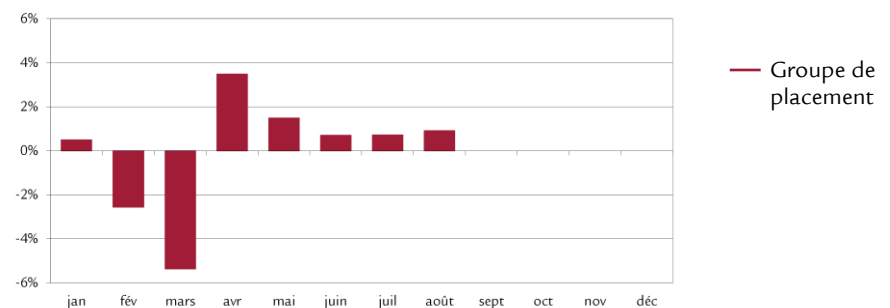
\*\* Le taux des charges d'exploitation TER<sub>KGAST</sub> couvre tous les coûts à l'exception des frais de transaction et des prélèvements fiscaux sur les transactions

### Evolution du cours indexée et performance



Performance	1M	3M	1A	3A	5A	10A	depuis 30.09.02
Groupe de placement (en %)	0.92	2.36	1.41	7.16	15.09	45.81	72.73
	YTD	2019	2018	2017	2016	2015	2014
Groupe de placement (en %)	-0.37	10.55	-5.00	6.90	2.04	0.09	8.11

### Performance mensuelle 2020



### Données statistiques (annualisées)

	1A	3A	5A	10A	depuis 30.09.02
Volatilité du groupe de placement (en %)	7.60	5.47	4.83	4.49	5.04
Volatilité Benchmark (en %)	8.39	5.81	4.99	4.42	4.97
Tracking Error ex post (en %)	0.89	0.63	0.58	0.55	0.66
Tracking Error ex ante (en %)	0.60				
Information Ratio	-1.09	-2.38	-2.23	-2.08	-2.23
Sharpe Ratio	0.28	0.55	0.73	0.93	0.55
Corrélation	1.00	1.00	0.99	0.99	0.99
Beta	0.91	0.94	0.96	1.01	1.01
Jensen-Alpha	-0.66	-1.18	-1.06	-1.14	-1.45
Maximum Drawdown (en %)	-13.47	-13.47	-13.47	-13.47	-22.51
Recovery Period (ans)	-	-	-	-	3.44

### Chiffres caractéristiques

	31.12.2019	31.08.2020
Fortune en mio. CHF	214.2	227.0
Valeur nette d'inventaire par part en CHF	173.37	172.73

31 août 2020

# Fondation de placement Swiss Life

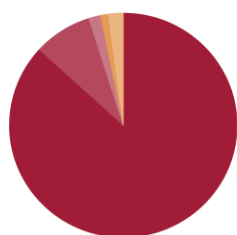
## LPP-Mix 35 P



### Structure de portefeuille par groupes de placement

	Groupe de placement	Benchmark	max. OPP2
Liquidités	1.8%	2%	
Obligations suisses en CHF	9.0%	14%	
Obligations étrangères en CHF	4.4%	7%	
Obl. en monnaies étrangères (couvertes en CHF)	30.2%	24%	
Actions Suisse	17.4%	18%	
Actions Etranger	13.2%	17%	
Actions Etranger (couv. en CHF)	7.9%	0%	
Immobilier Suisse	11.8%	11%	30%
Immobilier étranger (couvert en CHF)	2.1%	2%	10%
Placements alternatifs (couverts en CHF)	2.2%	5%	15%
<b>Total</b>	<b>100.0%</b>	<b>100%</b>	
<hr/>			
Total actions (Suisse et Etranger)	38.5%	35%	50%
Total monnaies étrangères	13.2%	17%	30%

### Structure du portefeuille selon les monnaies



CHF	86.8%
USD	8.3%
EUR	1.7%
JPY	1.1%
Autres	2.1%

### Les principales positions en actions

Nestlé	3.8%
Roche BJ	2.6%
Novartis	2.3%
Apple Inc.	0.7%
Zurich Insurance Group	0.6%
Microsoft Corp.	0.5%
Lonza Group AG	0.5%
ABB	0.5%
UBS	0.5%
Amazon.com, Inc.	0.5%

### Caractéristiques des placements à revenu fixe

Modified Duration	6.01
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.