

31 juillet 2025

Fondation de placement Swiss Life

LPP-Mix 25

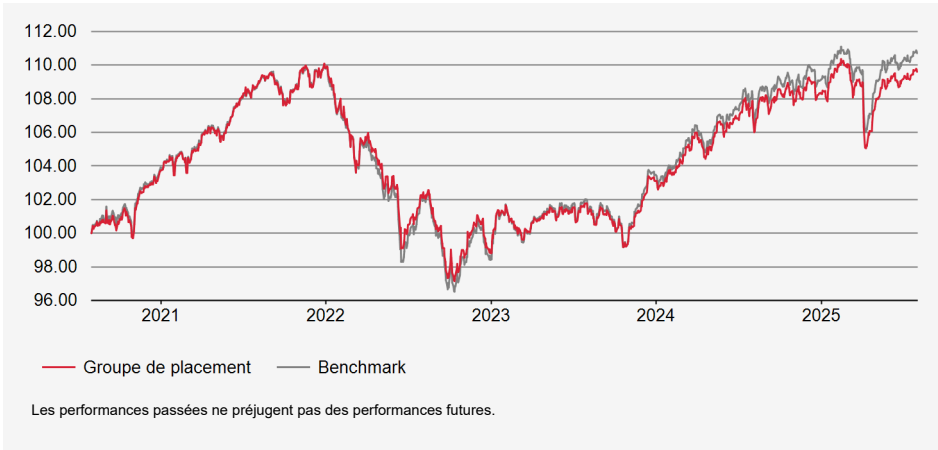


Fortune nette (VNI) en mio. CHF : 706.59
Valeur nette d'inventaire par droit en CHF : 202.20

Stratégie d'investissement

Placement dans toutes les catégories autorisées selon la LPP (part d'actions stratégique: 25%). Allocation active d'actifs. Limitation pour titres de participation: 35%. Limitation pour monnaies étrangères: 30%. Note moyenne des obligations: BBB+ au minimum. Réalisation au moyen de placements collectifs de même nature. Réserves de fluctuation recommandées: plus de 10%.

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	1.22%	0.40%	1.74%	1.62%	2.33%	1.85%	2.23%	3.00%
Benchmark	1.51%	0.41%	1.76%	2.15%	2.72%	2.05%	2.57%	3.48%

Données statistiques (annualisées)

	1 an	3 ans	5 ans	10 ans	Origine
Volatilité du groupe de placement (en %)	3.05	4.15	4.39	4.22	4.06
Volatilité du Benchmark (en %)	2.95	4.43	4.64	4.39	4.06
Tracking Error ex post (en %)	0.36	0.44	0.50	0.51	0.57
Information Ratio	-1.47	-0.88	-0.41	-0.67	-0.84
Sharpe Ratio	0.34	0.32	0.34	0.58	0.67
Corrélation	0.99	1.00	1.00	0.99	0.99
Beta	1.02	0.93	0.94	0.96	0.99
Jensen alpha	-0.57	-0.28	-0.11	-0.22	-0.46
Maximum Drawdown (en %)	-4.81	-5.28	-11.75	-11.75	-14.16
Recovery Period (ans)	-	1.17	2.34	2.34	0.98

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.

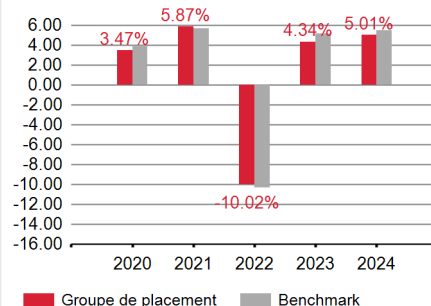
Protection antidilution: Aperçu des conditions disponible à l'adresse: www.swisslife.ch/fondationdeplacement, «Documents juridiques» (modifications possibles à tout moment sans préavis).

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.

Performance



Info. sur le produit

Numéro de valeur: 1245601
ISIN: CH0012456015
LEI: 5493000KUC3Z24U77V93
Code Bloomberg: SWABM25 SW
Benchmark: Customized
Monnaie: CHF
Pays d'origine: Suisse
Date de création: 30/09/2001
Valeur de lancement: 100.00
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.

Asset Management:
Allocation tactique et stratégique des actifs par Swiss Life Asset Management SA
Groupes de placement de même nature utilisés:
Divers selon l'approche Swiss Life Best Select Invest Plus @

Conseil externe:
Surveillance par PPCmetrics des résultats de placement des groupes de placement utilisés et conseil sur la structure de mandat adaptée ainsi que pour la sélection du gestionnaire d'actifs adapté

Publication de cours: Bloomberg: ASSL
www.swisslife.ch/fondationdeplacement

Taux des charges d'exploitation TER KGAST

au préalable: 0.50%

a posteriori au: 30/09/2024 0.59%

Structure de portefeuille par groupes de placement

	Groupe de placement	Benchmark	max. OPP2
Liquidités	2.72%	4.00%	-
Hypothèques Suisse	6.13%	6.00%	-
Obligations suisses en CHF	22.58%	23.00%	-
Obl. en monnaies étrangères (couvertes en CHF)	20.77%	23.00%	-
Actions Suisse	12.02%	11.00%	-
Actions Etranger	6.65%	6.00%	-
Actions Etranger (couv. en CHF)	9.02%	8.00%	-
Immobilier Suisse	16.35%	14.00%	30.00%
Immobilier étranger (couvert en CHF)	2.18%	2.00%	10.00%
Placements alternatifs (couverts en CHF)	1.58%	3.00%	15.00%
Infrastructure	-	-	-
Total actions (Suisse et Etranger)	27.69%	25.00%	50.00%
Total monnaies étrangères	6.65%	12.00%	30.00%

Les principales positions en actions

NOVARTIS AG-REG	1.41%
NESTLE SA-REG	1.40%
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	1.38%
NVIDIA CORP	0.72%
UBS GROUP AG-REG	0.70%
ABB LTD-REG	0.64%
MICROSOFT CORP	0.63%
ZURICH INSURANCE GROUP AG	0.62%
CIE FINANCIERE RICHEMO-A REG	0.55%
APPLE INC	0.52%

Composition du benchmark

1M Saron	4.00%
SBI Domestic AAA-A 1-3Y Total Return	6.00%
SBI AAA-BBB Total Return	23.00%
Bloomberg Gl. Agg. Treas. ex CH (couv. en CHF)	11.00%
Bloomberg Gl. Agg. Corp. (couv. en CHF)	4.00%
Bloomberg Gl. Agg. Corp. Short Term (couv. en CHF)	3.00%
JP Morgan CEMBI Broad Diversifiés IG Index (couv. en CHF)	5.00%
SP1® Total Return	11.00%
MSCI World ex Switzerland Net Return	6.00%
MSCI World ex Switzerland Net Return (CHF hedged)	8.00%
KGAST Immo-Index	14.00%
SL REF (LUX) ESG German Core Real Estate (couv. en CHF)	1.40%
Fondazione d'investimento Swiss Life Immobilier Europe Industrie et Logistique ESG (EUR), CHF hedged	0.60%
HFRX Global Hedge Funds (couv. en CHF)	3.00%
Fondazione d'investimento Swiss Life Infrastructure Globale ESG (EUR)	-

Structure du portefeuille selon les monnaies

CHF	93.35%
USD	3.67%
EUR	0.95%
JPY	0.18%
Autres	1.85%

Caractéristiques d'investissements sur instruments à taux fixe

Modified Duration	5.80
Note moyenne	AA-