

### Stratégie d'investissement

- Placement dans toutes les catégories autorisées selon la LPP (part d'actions stratégique: 35%)
- Allocation active d'actifs
- Limitation pour titres de participation: 45%, limitation pour monnaies étrangères: 30%
- Note moyenne des obligations: A au minimum
- Réalisation au moyen de placements collectifs de même nature
- Réserves de fluctuation recommandées: plus de 15%

### Informations sur le produit

Numéro de valeur	1245606
ISIN	CH0012456064
LEI	254900SR5GM6HP44F130
Bloomberg Ticker	SWABM35 SW
Benchmark	customized
Monnaie	CHF
Date de création	30.09.2001
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)

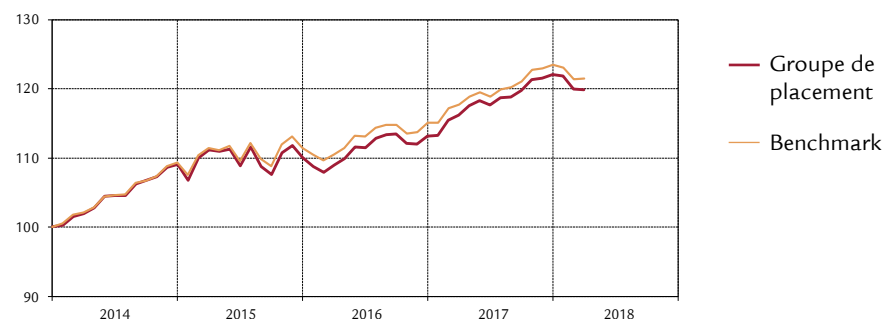
Taux des charges d'exploitation TER<sub>KGAST</sub> \*\*  
- au préalable 0.53%  
- a posteriori au 30.09.2017 0.56%

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

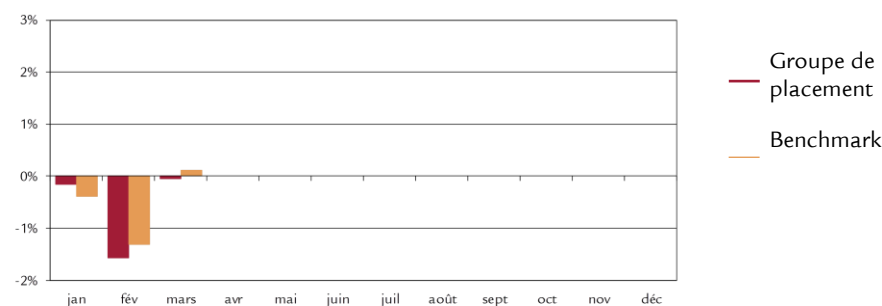
\*\* Le taux des charges d'exploitation TER<sub>KGAST</sub> couvre tous les coûts à l'exception des frais de transaction et des prélèvements fiscaux sur les transactions

### Evolution du cours indexée et performance



Performance	1M	3M	1A	3A	5A	10Ap.a. depuis	
				p.a.	p.a.	p.a.	30.09.01
Groupe de placement (en %)	-0.06	-1.78	3.11	2.54	4.27	4.26	3.49
Benchmark (en %)	0.11	-1.60	3.21	2.94	4.62	4.59	4.08
	YTD	2017	2016	2015	2014	2013	2012
Groupe de placement (en %)	-1.78	7.79	2.89	0.92	9.01	7.87	9.58
Benchmark (en %)	-1.60	7.29	3.32	1.86	9.36	7.99	8.72

### Performance mensuelle



### Données statistiques (annualisées)

	1A	3A	5A	10A	depuis	
					30.09.01	
Volatilité du groupe de placement (en %)	2.76	4.18	4.11	5.13	4.98	
Volatilité Benchmark (en %)	2.56	3.88	3.77	4.90	4.83	
Tracking Error ex post (en %)	0.50	0.56	0.55	0.61	0.64	
Tracking Error ex ante (en %)	0.60					
Information Ratio	-0.19	-0.73	-0.65	-0.53	-0.92	
Sharpe Ratio	1.38	0.78	1.13	0.81	0.59	
Corrélation	0.98	0.99	0.99	0.99	0.99	
Beta	1.06	1.07	1.08	1.04	1.02	
Jensen-Alpha	-0.33	-0.65	-0.75	-0.49	-0.65	
Maximum Drawdown (en %)	-3.81	-6.84	-6.84	-16.90	-21.36	
Recovery Period (ans)	-	0.44	0.44	0.94	3.00	

### Chiffres caractéristiques

	31.12.2017	31.03.2018
Fortune en mio. CHF	163.6	186.5
Valeur nette d'inventaire par part en CHF	179.40	176.20

31 mars 2018

# Fondation de placement Swiss Life

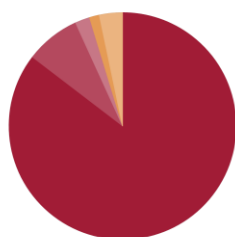
## LPP-Mix 35



### Structure de portefeuille par groupes de placement

	Groupe de placement	Benchmark	OPP2
Liquidités	1.1%	2%	
Obligations suisses en CHF	13.3%	20%	
Obligations étrangères en CHF	9.4%	12%	
Obligations Global (couvertes en CHF)	25.8%	18%	
Actions Suisse	14.8%	18%	
Actions Etranger	14.6%	17%	
Actions Etranger (couv. en CHF)	8.8%	0%	
Immobilier Suisse	10.7%	13%	30%
Immobilier étranger (couvert en CHF)	1.5%	0%	10%
Total	100.0%	100%	
.....			
Total actions (Suisse et Etranger)	38.2%	35%	50%
Total monnaies étrangères	14.6%	17%	30%

### Structure du portefeuille selon les monnaies



■	CHF	85.4%
■	USD	7.8%
■	EUR	2.1%
■	JPY	1.4%
■	Autres	3.3%

### Composition du benchmark

Citigroup CHF 1 M Euro Depo	2.00%
SBI Domestic AAA-BBB	20.00%
SBI Foreign AAA-BBB	12.00%
Bloomberg Barclays Gl. Agg Treas ex CH TR (couv. en CHF)	10.80%
Bloomberg Barclays Gl. Agg. Corp. (couv. en CHF)	7.20%
Swiss Performance Index	18.00%
MSCI World, ex CH, en CHF	13.60%
MSCI AC World Small Cap, en CHF	2.55%
MSCI World Emerging Markets, en CHF	0.85%
KGAST Immo-Index	13.00%

### Caractéristiques des placements à revenu fixe

Modified Duration	6.79
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 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 les institutions selon l'al. 1, let. a, 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.