

# FWI LPP 35 allegro

factsheet 08|23

## Caractéristique

Devise	CHF
ISIN	CH0002875646
Numéro de valeur	287564
Bloomberg-ID	AWIBVGL
Intervalle d'évaluation	quotidienne
Emission/Rachat	quotidienne jusqu'à 12h
Date de lancement	01.01.1984
Indice de référence	Customized Index, Total Return
Gestion	(depuis le 01.10.2020) Fundo SA
Banque de dépôt	Bank Julius Bär & Co. AG
Auditeur	PricewaterhouseCoopers AG

## Données de référence

NAV (par 31.08.2023)	CHF 2'289.36
Fortune	CHF 152'301'412
Nombre de droits	66'525.64
Distribution	capitalisation

## Composition indice de référence

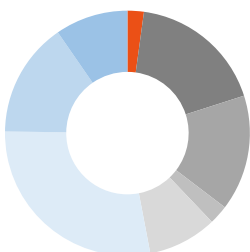
	en %
FTSE 3m Eurodeposit CHF	0.00
Swiss Bond Index Domestic AAA-BBB	22.00
Swiss Bond Index Foreign AAA-BBB	21.00
JPM GBI Curr-Hedged CHF	7.00
ICE BofAML Corporate Index hedged CHF	5.00
SPI Total Return	20.00
MSCI AC World ex CH net	15.00
SXI Real Estate Funds Broad	10.00

## 5 principales participations

	en %
Nestle	9.37
Roche Holdings	6.41
Novartis	5.50
CSIF (I) MSCI USA ESG LEADERS ETF b usd	1.91
Zurich Insurance	1.89

	Portefeuille	Indice de référence
<b>Duration modifiée</b>		
Obligations CHF Suisse	7.63	7.71
Obligations CHF Etranger	4.20	4.19
Emprunts d'Etat en ME - hedged CHF	7.46	6.94
Titres de crédit en ME - hedged CHF	5.97	5.85
Total obligations	6.11	6.10

## Allocation des actifs



	Portefeuille	Indice de référence	en %	Limite
Marché monétaire	2.16	0.00	0-20%	
Obligations CHF Suisse	17.89	22.00	12-32%	
Obligations CHF Etranger	15.30	21.00	11-31%	
Emprunts d'Etat en ME - hedged CHF	2.54	7.00	2-12%	
Obligations d'entreprises en ME - hedged CHF	9.11	5.00	0-10%	
Actions Suisse	28.21	20.00	10-30%	
Actions Monde	15.17	15.00	5-25%	
Immeubles Suisse	9.62	10.00	0-15%	

## Tarif

	TER KGAST
<b>Fortune totale</b>	<b>2022</b>
Catégorie A: < 20 (Mio. CHF)	0.55%
Catégorie B: 20-30 (Mio. CHF)	0.52%
Catégorie C: 30-100 (Mio. CHF)	0.49%
Catégorie D: > 100 (Mio. CHF)	0.46%

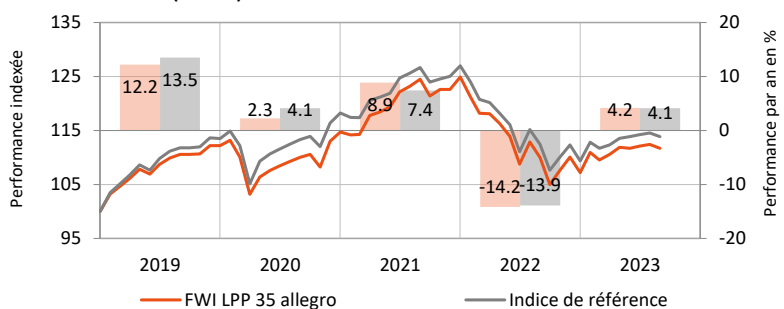
## Politique de placement

L'exposition à un risque défini comme moyen pendant toute la durée doit, à long terme, permettre de réaliser un rendement sensiblement supérieur au taux d'intérêt minimal LPP. Aussi la pondération en actions se situe-t-elle entre 25% au minimum et 45% au maximum.

Les investissements de ce portefeuille sont ventilés comme suit:

- 25% au min. et 45% au max. d'actions en Suisse et à l'étranger.
- 35% au min. et 75% au max. d'obligations en CHF ou en devises.
- 30% au max. de devises étrangères (sans couverture des risques de change).
- 15% au max. de valeurs immobilières.

## Performance nette (en CHF)



## Nombres statistique en %

	Portefeuille	Indice de référence
Volatilité 1 an	7.79	7.19
Volatilité 3 ans	7.72	7.11
Tracking Error 1 an	0.87	
Tracking Error 3 ans	1.00	
Value at Risk (niveau de confiance 95%)	3.63	
Sharpe Ratio (1 an/ base 0%)	0.20	0.18
Corrélation 1 an	1.00	1.00

## 5 principaux débiteurs

	en %
AXA WF - Global Buy and Maintain Credit	18.31
Bq de lettres gage suisses de crédit hypo.	8.46
Centrale de lettres gage des bq cant. suisses	7.26
Confédération suisse	6.20
États-Unis d'Amérique	1.60

## Répartition par devise (après hedging)



## Performance nette (en CHF)

	en %	1 mois	3 mois	YTD	1 an	3 ans p.a.	5 ans p.a.	création p.a.
Portefeuille (Cat. A)	-0.64	-0.01	4.19	1.54	0.50	1.40	4.83	
Portefeuille (Cat. B)	-0.64	0.00	4.21	1.57	0.53	1.43	4.86	
Portefeuille (Cat. C)	-0.63	0.01	4.23	1.60	0.56	1.46	4.89	
Portefeuille (Cat. D)	-0.63	0.01	4.25	1.63	0.59	1.49	4.92	
Indice de référence	-0.58	0.01	4.14	1.29	0.16	1.91	4.96	

---

Informations générales: la vente de parts du groupe de placement repose sur les documents d'émission déterminants dans leur version en vigueur, en association avec le dernier rapport annuel ou, s'il est disponible, le dernier rapport semestriel du groupe de placement. Clause de non-responsabilité: le présent document a été établi par 1741 Fund Solutions AG (ci-après: «1741»). 1741 n'accorde aucune garantie quant à son contenu et à son exhaustivité et décline toute responsabilité en cas de perte ou de dommages de quelque nature que ce soit, découlant directement ou indirectement de l'utilisation du présent document ou des informations qu'il contient. Les opinions exprimées dans le présent document sont celles de 1741 au moment de sa rédaction et peuvent être modifiées à tout moment sans préavis. Sauf mention contraire, l'ensemble des chiffres n'a pas été vérifié. Finalité informative uniquement: le présent document vise uniquement à informer son destinataire et ne constitue ni un conseil en placement, ni une offre ou une recommandation d'acheter des instruments financiers. Il ne dispense pas le destinataire de procéder à sa propre évaluation. Groupe cible: le présent document et les informations qu'il contient s'adressent exclusivement aux caisses de pension suisses. Par conséquent, ni le présent document, ni des copies de celui-ci ne peuvent être envoyés ou emportés aux États-Unis ou remis à des ressortissants américains, conformément à la Regulation S du US Securities Act de 1933. Restriction d'utilisation: ce document s'adresse expressément aux personnes dont la nationalité, le domicile ou d'autres motifs leur permettent d'accéder à de telles informations en vertu des lois en vigueur. En cas de doute, nous vous recommandons de contacter un point de vente ou un établissement bancaire local. Performance: chaque placement comporte des risques et en particulier des risques de fluctuations de la valeur et du rendement. Les placements sont volatils et un investissement peut également entraîner la perte totale des capitaux investis et d'éventuels rendements. De plus, les données de performance ne tiennent pas compte des commissions et frais prélevés lors des émissions et/ou rachats. En outre, il est impossible de garantir que la performance de l'indice de référence sera atteinte, voire dépassée. Une évolution positive de la valeur par le passé ou l'indication d'une telle évolution ne saurait garantir l'évolution positive de la valeur à l'avenir. Les investissements dans des devises étrangères peuvent pâtir de fluctuations monétaires. Il existe également un risque que la devise étrangère perde de la valeur par rapport à la devise de référence de l'investisseur. Distribution en Suisse: en Suisse, ce groupe de placement ne peut être distribué qu'aux caisses de pension. Il s'agit d'un document de marketing.

**Fondation de placement Winterthur FWI, Bahnhofplatz 8, CH-8400 Winterthur, T +41 (0)52 202 02 30, F +41 (0)52 202 02 40, [fwi-fondation.ch](http://fwi-fondation.ch)**