FWI LPP 35 allegro

Rapport trimestriel au 31. décembre 2023

FWI Fondation de placement

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

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

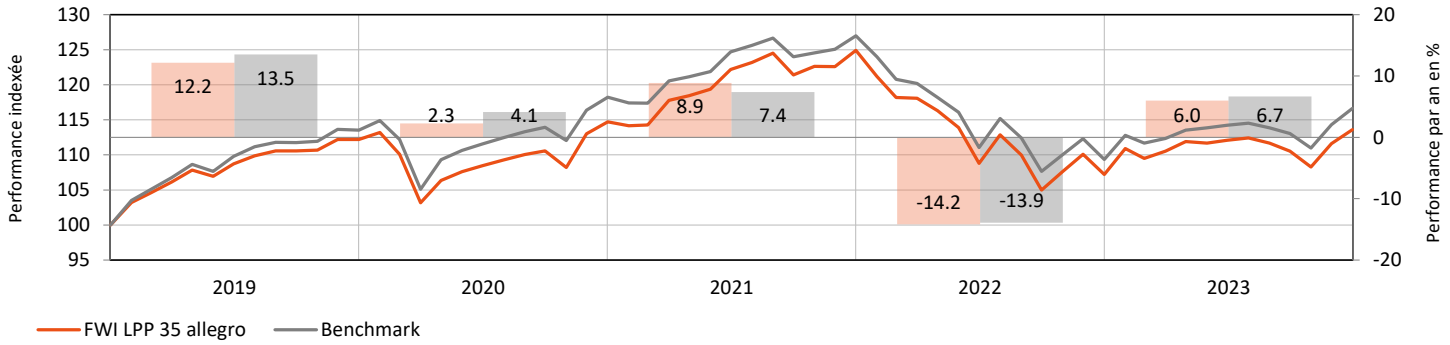
Données de référence

NAV (par 31.12.2023)	CHF 2'328.93
Fortune	CHF 148'673'826
Nombre de droits	63'837.93
Distribution	capitalisation

Tarif

Fortune totale (en mio. CHF)	< 20	20-30	30-100	> 100
TER KGAST 2022	0.55%	0.52%	0.49%	0.46%
Frais de gestion p.a.	0.41%	0.38%	0.35%	0.32%

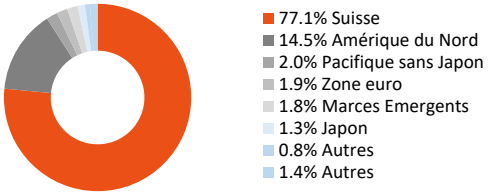
Performance nette (en CHF)



Performance en %	1 mois	3 mois	YTD	1 an	3 ans p.a.	5 ans p.a.	création p.a.
Portefeuille	1.80	2.80	5.99	5.99	-0.32	2.58	4.83
Indice de référence	2.03	3.17	6.68	6.68	-0.45	3.12	4.98

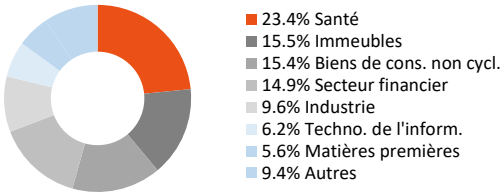
Nombres statistique en %	Portefeuille	Indice de référence
Volatilité 1 an	5.87	5.40
Volatilité 3 ans	7.52	7.02
Tracking Error 1 Jahr	0.82	
Tracking Error 3 Jahre	0.94	
Value at Risk (niveau de confiance 95%)	2.73	
Sharpe Ratio (1 an/ base 0%)	1.02	1.24
Corrélation 1 an	0.99	1.00

Répartition par région



	in %
Suisse	77.14
Amérique du Nord	14.53
Pacifique sans Japon	1.96
Zone euro	1.87
Marces Emergents	1.84
Japon	1.30
Autres	1.35

Répartition par secteur



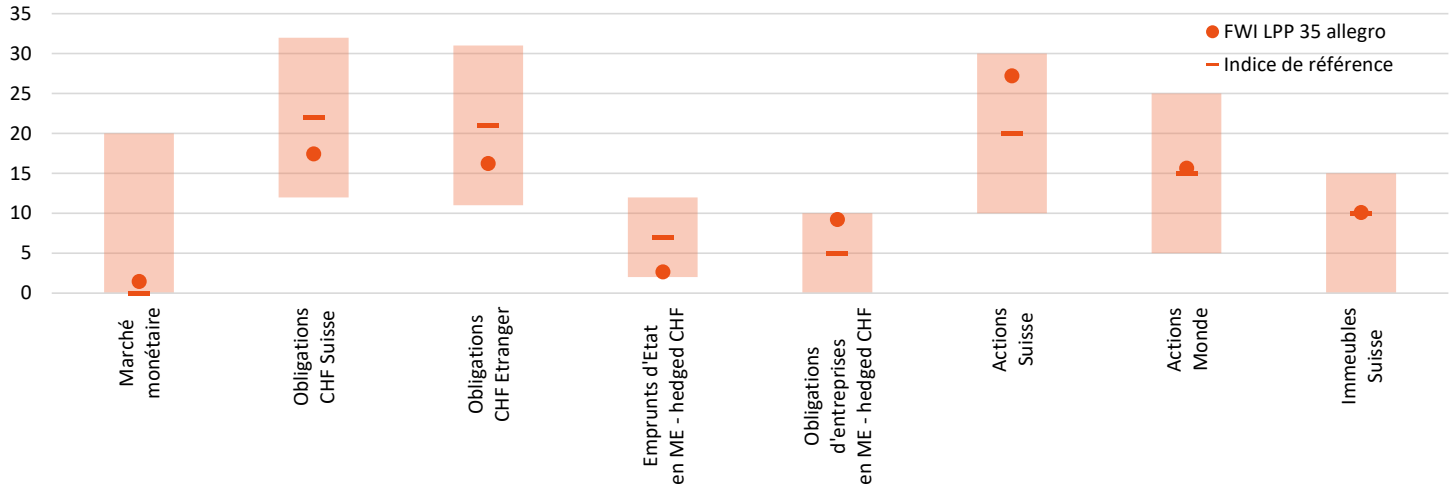
	in %
Santé	23.41
Immeubles	15.52
Biens de cons. non cycl.	15.42
Secteur financier	14.85
Industrie	9.60
Techno. de l'inform.	6.23
Autres	9.40

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

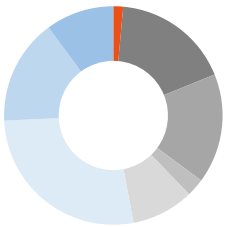
FWI LPP 35 allegro

Rapport trimestriel au 31. décembre 2023

Allocation des actifs

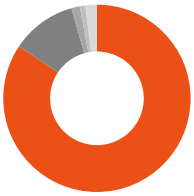


Allocation des actifs



	Portefeuille	Indice de référence	en % Limite
Marché monétaire	1.45	0.00	0-20%
Obligations CHF Suisse	17.43	22.00	12-32%
Obligations CHF Etranger	16.25	21.00	11-31%
Emprunts d'Etat en ME - hedged CHF	2.68	7.00	2-12%
Obligations d'entreprises en ME - hedged CHF	9.23	5.00	0-10%
Actions Suisse	27.22	20.00	10-30%
Actions Monde	15.66	15.00	5-25%
Immeubles Suisse	10.09	10.00	0-15%

Répartition par devise (après hedging)



- 84.3% CHF
- 11.3% USD
- 1.4% EUR
- 1.0% JPY
- 2.0% Autres

5 principales participations	en %
Nestle	4.82
Novartis	3.27
Roche Holdings	3.01
CSIF (I) MSCI USA ESG LEADERS ETF b usd	1.56
UBS Group	1.19

Répartition par rating

- 35.5% AAA
- 36.0% AA
- 28.5% A
- 0.0% BBB

5 principaux débiteurs	en %
AXA WF - Global Buy and Maintain Credit	9.23
Pfandbriefbank CH	4.62
Pfandbriefzentrale CH	3.80
Schweizerische Eidgenossenschaft	2.79
USA	0.94

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

A des fins d'information et de publicité uniquement - Veuillez lire les documents légaux du fonds avant de prendre une décision finale d'investissement. Ce document a été préparé avec le plus grand soin par 1741 Fund Solutions AG en tant que société de gestion (ci-après "1741"). Toutefois, 1741 ne fournit aucune garantie quant à son contenu et à son exhaustivité et décline toute responsabilité pour les pertes résultant de son utilisation. Les opinions exprimées dans le présent document sont celles de 1741 au moment de la préparation et peuvent être modifiées sans préavis. Sauf indication contraire, tous les chiffres ne sont pas audités. Ce document doit être lu conjointement avec les documents légaux du fonds (contrat de fonds et rapport annuel et, le cas échéant, prospectus, document d'information clé et rapport semestriel) (ci-après "documents du fonds"), qui peuvent être obtenus gratuitement auprès de la direction du fonds et de la banque dépositaire du fonds. Les souscriptions de parts ne sont acceptées que sur la base des documents du fonds. Cette communication marketing se rapporte aux parts du fonds concerné et non à un actif sous-jacent acquis par le fonds. Les informations contenues dans ce document sont données à titre indicatif et ne doivent pas être interprétées comme une offre, une recommandation ou un conseil en investissement. Elles ne tiennent pas compte de besoins spécifiques et ne dispensent pas le destinataire d'évaluer lui-même, le cas échéant avec l'aide d'un conseiller, la compatibilité des informations avec sa propre situation et les conséquences juridiques, réglementaires, fiscales et autres qui en découlent. La politique d'investissement ne peut être reproduite que dans une version abrégée. La politique d'investissement complète, y compris toutes les restrictions d'investissement, peut être consultée dans les documents du fonds. Le fonds est géré activement. Tout investissement comporte des risques, en particulier des fluctuations de valeur et de revenu. Dans le cas des devises étrangères, il existe un risque supplémentaire que la devise étrangère perde de la valeur par rapport à la devise de référence de l'investisseur. Une perte totale du montant investi est possible. Une description détaillée des risques figure dans les documents du fonds. La performance indiquée ne tient pas compte des commissions et des frais encourus lors de la souscription, de la conversion, du rachat ou de la détention de parts de fonds, qui peuvent réduire

le rendement de l'investisseur. Les informations sur la valeur nette d'inventaire (VNI) s'entendent hors commissions. Il n'y a aucune garantie que la performance d'un indice de référence soit égalée ou dépassée. Ce fonds est domicilié en Suisse. La distribution n'est expressément pas destinée aux personnes dont la nationalité ou la résidence interdit l'accès à ces informations en vertu du droit applicable. Ce fonds n'est pas enregistré en vertu de la loi américaine sur les valeurs mobilières de 1933. De plus amples informations à ce sujet et sur la distribution publique dans les différents pays sont disponibles dans les documents du fonds. Tous droits réservés.

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