

# FWI LPP 35 allegro

## Rapport trimestriel au 30. juin 2024

### 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 |

### Données de référence

|                     |                 |
|---------------------|-----------------|
| NAV (par 28.6.2024) | CHF 2'458.94    |
| Fortune             | CHF 156'825'724 |
| Nombre de droits    | 63'777.73       |
| Distribution        | capitalisation  |

### 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.

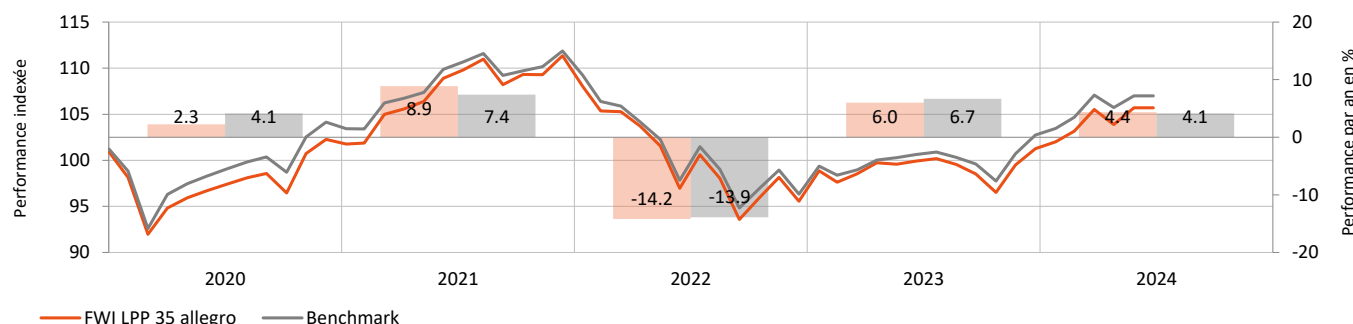
Les investissements de ce portefeuille sont ventilés comme suit:

- 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.

### Tarif

|                              |       |       |        |       |
|------------------------------|-------|-------|--------|-------|
| Fortune totale (en mio. CHF) | < 20  | 20-30 | 30-100 | > 100 |
| TER KGAST 2023               | 0.52% | 0.49% | 0.46%  | 0.43% |
| Frais de gestion p.a.        | 0.41% | 0.38% | 0.35%  | 0.32% |

### Performance nette (en CHF)



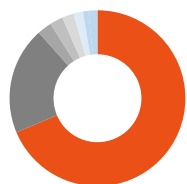
### Performance

| en %                | 1 mois | 3 mois | YTD  | 1 an | 3 ans p.a. | 5 ans p.a. | création p.a. |
|---------------------|--------|--------|------|------|------------|------------|---------------|
| Portefeuille        | 0.00   | 0.18   | 4.37 | 5.80 | -0.99      | 1.75       | 4.88          |
| Indice de référence | 0.00   | -0.06  | 4.14 | 6.34 | -0.88      | 2.04       | 5.02          |

### Nombres statistique en %

|   | Portefeuille | Indice de référence |
|---|--------------|---------------------|
| Volatilité 1 an                         | 5.54         | 5.17                |
| Volatilité 3 ans                        | 7.43         | 6.93                |
| Tracking Error 1 Jahr                   | 0.75         |                     |
| Tracking Error 3 Jahre                  | 0.97         |                     |
| Value at Risk (niveau de confiance 95%) | 2.58         |                     |
| Sharpe Ratio (1 an/ base 0%)            | 1.05         | 1.23                |
| Corrélation 1 an                        | 0.99         | 1.00                |

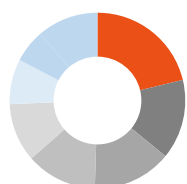
### Répartition par région



|       |                      |
|-------|----------------------|
| 69.3% | Suisse               |
| 19.9% | Amérique du Nord     |
| 2.7%  | Pacifique sans Japon |
| 2.4%  | Zone euro            |
| 2.2%  | Marces Emergents     |
| 1.7%  | Japon                |
| 1.0%  | Autres               |
| 1.7%  | Autres               |

|                      | in %  |
|----------------------|-------|
| Suisse               | 69.34 |
| Amérique du Nord     | 19.94 |
| Pacifique sans Japon | 2.68  |
| Zone euro            | 2.45  |
| Marces Emergents     | 2.17  |
| Japon                | 1.74  |
| Autres               | 1.67  |

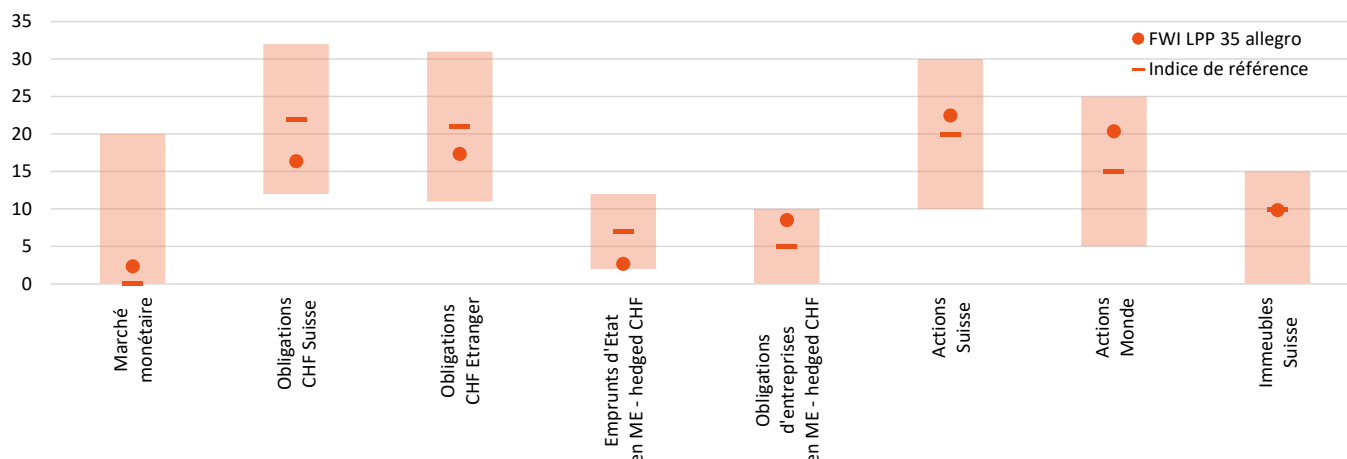
### Répartition par secteur



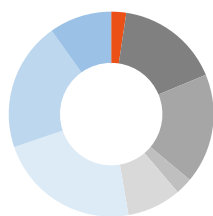
|       |                          |
|-------|--------------------------|
| 21.2% | Santé                    |
| 14.7% | Immeubles                |
| 14.6% | Secteur financier        |
| 13.1% | Biens de cons. non cycl. |
| 10.8% | Industrie                |
| 8.3%  | Techno. de l'inform.     |
| 6.1%  | Matières premières       |
| 11.3% | Autres                   |

|                          | in %  |
|--------------------------|-------|
| Santé                    | 21.22 |
| Immeubles                | 14.68 |
| Secteur financier        | 14.57 |
| Biens de cons. non cycl. | 13.08 |
| Industrie                | 10.78 |
| Techno. de l'inform.     | 8.30  |
| Autres                   | 11.28 |

### Allocation des actifs

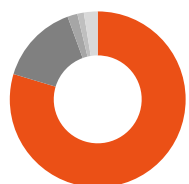


### Allocation des actifs



|  | Portefeuille | Indice de référence | en % Limite |
|--|--------------|---------------------|-------------|
| Marché monétaire                             | 2.37         | 0.00                | 0-20%       |
| Obligations CHF Suisse                       | 16.37        | 22.00               | 12-32%      |
| Obligations CHF Etranger                     | 17.35        | 21.00               | 11-31%      |
| Emprunts d'Etat en ME - hedged CHF           | 2.67         | 7.00                | 2-12%       |
| Obligations d'entreprises en ME - hedged CHF | 8.53         | 5.00                | 0-10%       |
| Actions Suisse                               | 22.49        | 20.00               | 10-30%      |
| Actions Monde                                | 20.35        | 15.00               | 5-25%       |
| Immeubles Suisse                             | 9.86         | 10.00               | 0-15%       |

### Répartition par devise (après hedging)



|       |        |
|-------|--------|
| 79.6% | CHF    |
| 14.8% | USD    |
| 1.8%  | EUR    |
| 1.2%  | JPY    |
| 2.5%  | Autres |

### 5 principales participations

|   | en % |
|---|------|
| Nestle                                  | 3.54 |
| Novartis                                | 2.62 |
| Roche Holdings                          | 2.22 |
| CSIF (I) MSCI USA ESG LEADERS ETF b usd | 1.87 |
| UBS Group                               | 1.12 |

### Répartition par rating



|       |     |
|-------|-----|
| 36.3% | AAA |
| 36.1% | AA  |
| 27.7% | A   |
| 0.0%  | BBB |

### 5 principaux débiteurs

|   | en % |
|---|------|
| AXA WF - Global Buy and Maintain Credit       | 8.61 |
| Pfandbriefbank CH                             | 4.44 |
| Pfandbriefzentrale CH                         | 3.24 |
| Schweizerische Eidgenossenschaft              | 2.83 |
| CANTON OF GENEVA SR UNSECURED REGS 03/33 1.75 | 0.82 |

### 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 égale 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.