

# Fondation de placement Swiss Life

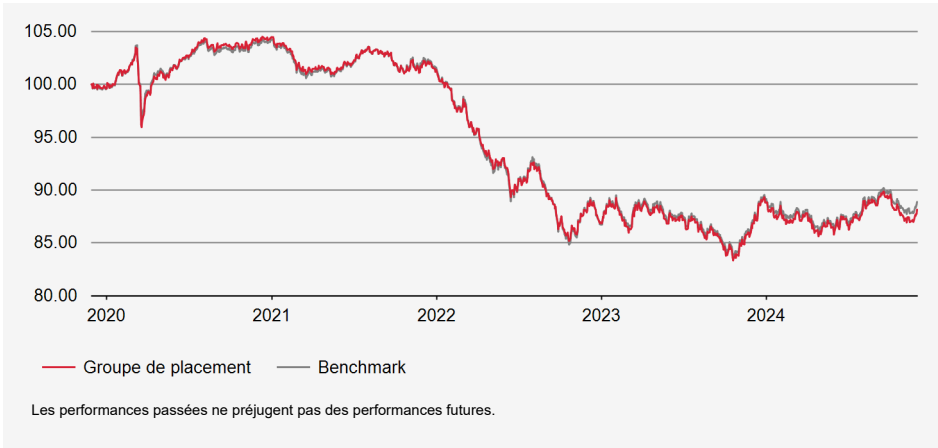
## Obligations Global (couvertes en CHF)

**Fortune nette (VNI) en mio. CHF : 140.62**  
**Valeur nette d'inventaire par droit en CHF : 118.73**

### Stratégie d'investissement

Placement dans des titres de créance émis par des débiteurs domiciliés en Suisse ou à l'étranger (dès le 1.1.2011 couvertes en CHF). Sélection active des titres, contrôle de la duration et positionnement sur la courbe des taux. Limite par débiteur: 10% (exception: à condition que les débiteurs soient dans le benchmark, et position au max. 5% points de plus que pondération dans le benchmark). Titres de créance de débiteurs hors benchmark: max. 10%. Note moyenne: A- au minimum. Risques de change par rapport au franc suisse sont couverts à au moins 90%. Réalisation au moyen du Swiss Life iFunds (CH) Bond Global Aggregate (CHF hedged); fonds de placement de droit suisse de la catégorie "Autres fonds en placements traditionnels".

### Évolution de la valeur en devise de référence (base 100)



### Performances en devise de référence

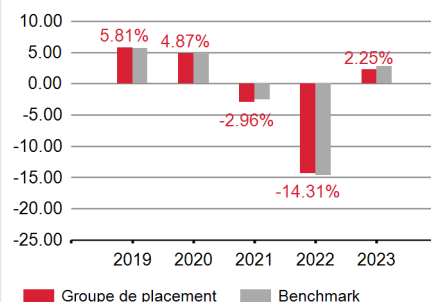
	Performances cumulées				Performances annualisées			
	YTD	1 mois	3 mois	1 an	3 ans	5 ans	10 ans	Origine
Groupe de placement	-0.75%	0.93%	-0.45%	2.04%	-4.72%	-2.49%	-0.62%	0.74%
Benchmark	-0.31%	0.88%	-0.09%	2.52%	-4.54%	-2.33%	-0.44%	0.85%

### Données statistiques (annualisées)

	1 an	3 ans	5 ans	10 ans	Origine
Volatilité du groupe de placement (en %)	5.18	5.99	5.34	4.32	5.40
Volatilité du Benchmark (en %)	4.92	6.20	5.45	4.38	5.56
Tracking Error ex post (en %)	0.44	0.60	0.53	0.57	1.40
Information Ratio	-1.11	-0.29	-0.30	-0.32	-0.07
Sharpe Ratio	0.13	-0.94	-0.51	-0.08	0.10
Corrélation	1.00	1.00	1.00	0.99	0.97
Beta	1.05	0.96	0.98	0.98	0.94
Jensen alpha	-0.54	-0.39	-0.22	-0.18	-0.07
Maximum Drawdown (en %)	-4.13	-18.46	-20.24	-20.24	-20.24
Recovery Period (ans)	0.37	-	-	-	-

**Benchmark:** Le benchmark a été modifié au 1er juillet 2012. Pour obtenir des informations sur l'ancien benchmark, veuillez vous adresser à la Fondation de placement Swiss Life  
**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.  
**Protection antidilution:** Aperçu des conditions disponible à l'adresse: [www.swisslife.ch/fondationdeplacement](http://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:** 1245479  
**ISIN:** CH0012454796  
**LEI:** 254900F82G5L48XPDV74  
**Code Bloomberg:** SWAOBFG SW  
**Benchmark:** BLOOMBERG GLO AGG EX SEC EX CNY HEDGED CHF  
**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:** 13h00  
**Protection antidilution:** Commission d'émission / de rachat en faveur du groupe de placement selon l'aperçu des conditions.  
**Pratique de distribution:** Capitalisation  
**Asset Manager selon Swiss Life Best Select Invest Plus®:** Swiss Life Asset Management SA  
**Surveillance du gestionnaire de fortune:** PPCmetrics apporte un soutien dans le cadre de la surveillance continue du gestionnaire de fortune et de l'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 KGAST**  
**au préalable:** 0.46%  
**a posteriori au:** 30/09/2024 0.46%

### Structure du portefeuille par branches

	Groupe de placement	Benchmark
État et Assimilé	49.94%	72.25%
Finance	20.38%	11.56%
Consommation, non cyclique	6.87%	4.03%
Communications	2.73%	1.96%
Consommation, cyclique	2.55%	1.80%
Services aux collectivités	2.10%	2.74%
Technologie	1.60%	1.15%
Energie	1.47%	1.71%
Supranational	5.26%	-
Autres	2.10%	2.80%
Liquidités	5.33%	-
Couverture de change	-0.34%	-

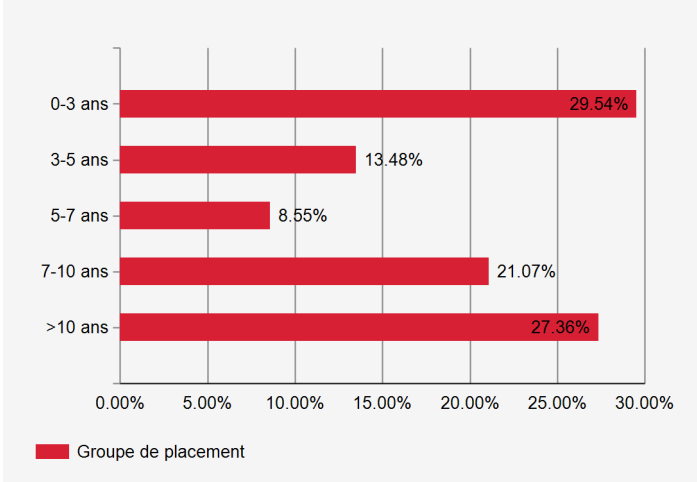
### Débiteurs les plus importants et note

	Groupe de placement	
Japon	A+	16.98%
US Treasury N/B	AAA	7.27%
Italie	BBB	5.73%
Royaume d'Espagne	A	2.66%
BNG Bank NV	AAA	2.00%

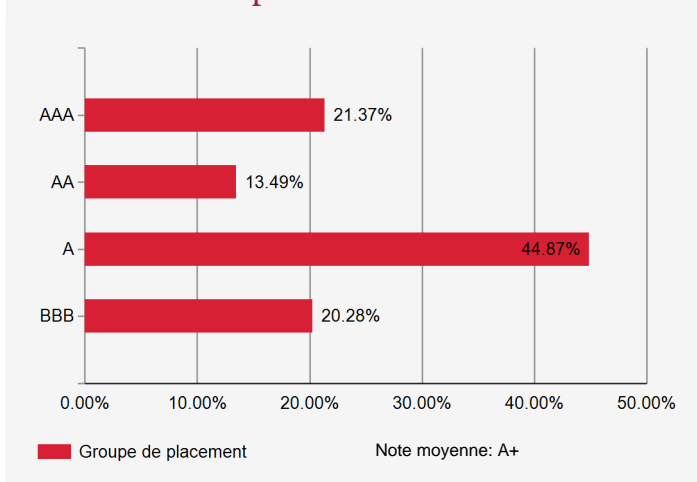
### Indications supplémentaires sur les débiteurs

Nombre de débiteurs	129
Part de débiteurs hors du benchmark	0.00%

### Structure de l'échéance des titres



### Investissement par notes



### Sensibilité et rendement à maturité

	Groupe de placement	Benchmark
Modified Duration	7.1	6.8
Rendement à l'échéance théorique*	3.63%	3.64%

\* avant couverture de change, en tenant compte des dérivés

### Structure du portefeuille selon les pays/régions

	Groupe de placement	Benchmark
États-Unis	24.77%	38.08%
Japon	19.86%	13.24%
Canada	8.57%	4.36%
Italie	7.21%	4.04%
Allemagne	5.73%	5.78%
France	5.62%	6.11%
Royaume-Uni	3.94%	5.30%
Région Européenne (EUR)	10.58%	8.78%
Région Européenne (Ex EUR)	3.26%	1.60%
Marchés Émergents Amériques	1.73%	0.04%
Autres	3.74%	12.67%
Liquidités, couverture	4.99%	-