

Fondation de placement Swiss Life

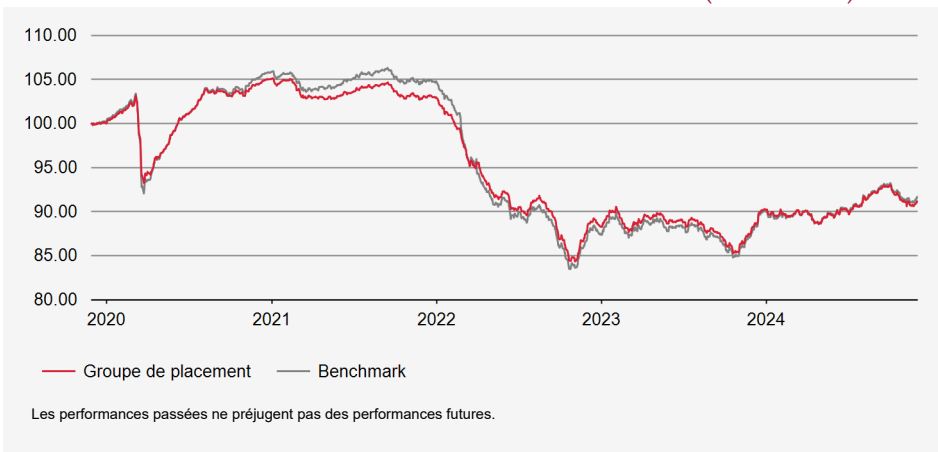
Obligations Marchés Emergents Entreprises (couvertes en CHF)

Fortune nette (VNI) en mio. CHF : 343.14
Valeur nette d'inventaire par droit en CHF : 92.85

Stratégie d'investissement

Placements dans des titres de créance d'entreprises et d'Etats de pays émergents, y compris agences et organisations supranationales, libellés en dollars américains ou d'autres devises fortes. Sélection active de titres, gestion de la duration et positionnement sur la courbe des taux. Limitation des débiteurs: 10%. Titres de créance de débiteurs hors benchmark: max. 35%. Qualité moyenne de notation: BBB- minimum. Les risques de change sont couverts à au moins 90% par rapport au franc suisse. Mise en œuvre via l'utilisation du fonds Swiss Life Funds (LUX) Bond Emerging Markets Corporates CHF hedged AM Cap, un fonds de placement de droit luxembourgeois

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



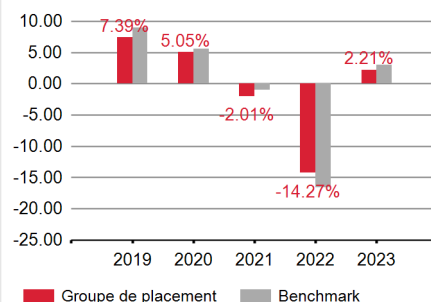
Performances en devise de référence

	Performances cumulées				Performances annualisées			
	YTD	1 mois	3 mois	1 an	3 ans	5 ans	10 ans	Origine
Groupe de placement	1.06%	-0.05%	-1.02%	3.47%	-3.96%	-1.83%	-	-1.03%
Benchmark	1.83%	0.29%	-0.62%	4.59%	-4.35%	-1.72%	-	-0.63%

Données statistiques (annualisées)

	1 an	3 ans	5 ans	10 ans	Origine
Volatilité du groupe de placement (en %)	4.13	6.18	6.44	-	5.57
Volatilité du Benchmark (en %)	4.31	6.68	7.10	-	6.10
Tracking Error ex post (en %)	0.51	1.29	1.21	-	1.06
Information Ratio	-2.18	0.31	-0.09	-	-0.38
Sharpe Ratio	0.50	-0.78	-0.32	-	-0.16
Corrélation	0.99	0.98	0.99	-	0.99
Beta	0.95	0.91	0.90	-	0.90
Jensen alpha	-0.97	-0.07	-0.31	-	-0.45
Maximum Drawdown (en %)	-2.59	-18.28	-19.77	-	-19.77
Recovery Period (ans)	-	-	-	-	-

Performance



Info. sur le produit

Numéro de valeur: 36974875
ISIN: CH0369748758
LEI: 254900R4DORKK6JJUG51
Code Bloomberg: SLOEMCH SW
Benchmark: JP Morgan CEMBI Broad Diversified IG Index (CHF Hedged)
Monnaie: CHF
Pays d'origine: Suisse
Date de création: 29/09/2017
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
Taux des charges d'exploitation TER KGAST au préalable: 0.82%
a posteriori au: 30/09/2024 0.82%

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, «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.

Structure du portefeuille par branches

	Groupe de placement	Benchmark
Finance	32.89%	37.30%
Communications	12.98%	9.23%
Services aux collectivités	11.09%	10.92%
Consommation, non cyclique	10.10%	4.64%
Energie	9.52%	11.08%
Industrie	6.15%	3.40%
Technologie	5.76%	5.31%
Matériaux de base	3.72%	10.62%
Supranational	1.77%	-
Autres	6.85%	7.50%
Liquidités	1.28%	-
Couverture de change	-2.11%	-

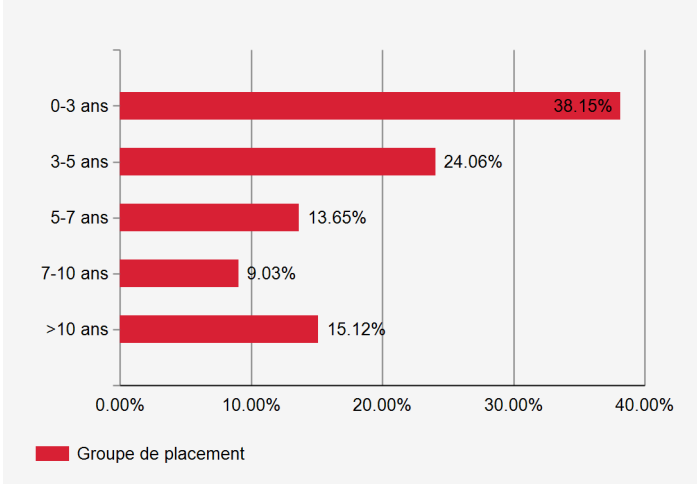
Débiteurs les plus importants et note

	Note	Groupe de placement
Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd	AA-	3.71%
Prosus NV	BBB	2.41%
US Treasury N/B	AAA	2.25%
HDFC Bank Ltd	BBB-	1.89%
Grupo Bimbo SAB de CV	BBB+	1.87%

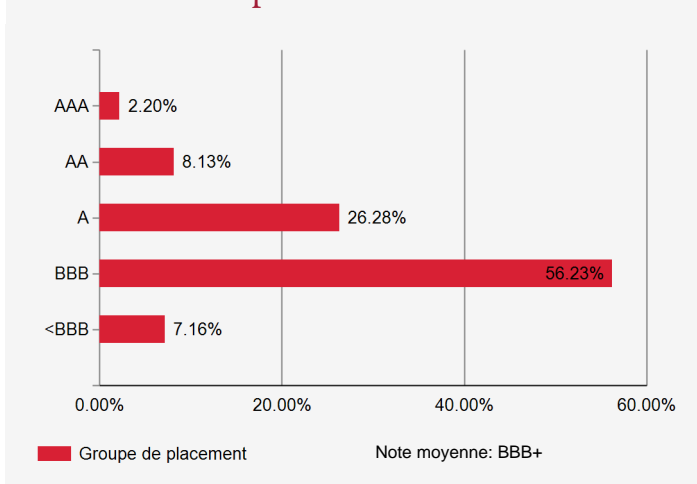
Indications supplémentaires sur les débiteurs

Nombre de débiteurs	143
Part de débiteurs hors du benchmark	21.05%

Structure de l'échéance des titres



Investissement par notes



Sensibilité et rendement à maturité

	Groupe de placement	Benchmark
Modified Duration	5.0	4.7
Rendement à l'échéance théorique*	5.53%	5.49%

* avant couverture de change, en tenant compte des dérivés

Structure du portefeuille selon les pays/régions

	Groupe de placement	Benchmark
Chine	9.69%	13.54%
Émirats arabes unis	6.96%	5.80%
Corée du Sud	6.59%	7.59%
Inde	6.40%	3.92%
Mexique	5.25%	4.80%
Qatar	4.81%	5.75%
Brésil	4.19%	1.93%
Marchés Émergents Asie-Pacifique	23.46%	23.60%
Marchés Émergents Amériques	9.06%	6.87%
Marchés Émergents Moyen-Orient	6.06%	10.13%
Autres	18.38%	16.07%
Liquidités, couverture	-0.84%	-