Fondation de placement Swiss Life Obligations Marchés Emergents Entreprises (couvertes en CHF)

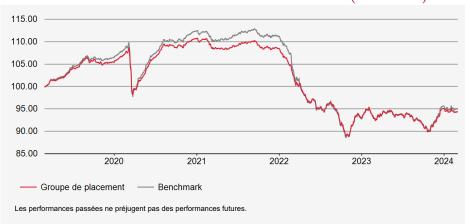


Fortune nette (VNI) en mio. CHF: 336.10 Valeur nette d'inventaire par droit en CHF: 91.19

Stratégie d'investissement

Placement dans titres de créance libellés en dollars US ou d'autres devises fortes émis par des entreprises de pays émergents (y compris ceux des agences et des entités supranationales). Sélection active des titres, contrôle de la duration et positionnement sur la courbe des taux. Limite par débiteur: 10%. Titres de créance de débiteurs hors benchmark: max. 20%. Note moyenne: BBB au minimum. Risques de change par rapport au franc suisse sont couverts à au moins 90%. Réalisation au moyen du Swiss Life Funds (LUX) Bond Emerging Markets Corporates CHF AM Cap; fonds de placement de droit luxembourgeois.

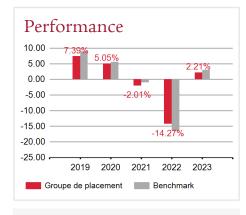
Évolution de la valeur en devise de référence (base 100)



Performances en devise de référence

Performances cumulées				Perfor	mances ar	nnualisées		
	YTD	1 mois	3 mois	1 an	3 ans	5 ans	10 ans	Origine
Groupe de placement	-0.75%	-0.53%	1.62%	1.67%	-4.79%	-1.16%	-	-1.43%
Benchmark	-0.52%	-0.25%	2.18%	2.34%	-5.03%	-1.00%	-	-1.06%

Données statistiques (annualisées)	1 an	3 ans	5 ans	10 ans	Origine
Volatilité du groupe de placement (en %)	5.02	5.88	6.41	-	5.73
Volatilité du Benchmark (en %)	5.18	6.40	7.07	-	6.30
Tracking Error ex post (en %)	0.54	1.31	1.23	-	1.11
Information Ratio	-1.24	0.19	-0.13	-	-0.33
Sharpe Ratio	0.02	-0.89	-0.16	-	-0.20
Corrélation	0.99	0.98	0.99	-	0.99
Beta	0.96	0.90	0.90	-	0.90
Jensen alpha	-0.64	-0.29	-0.25	-	-0.45
Maximum Drawdown (en %)	-5.04	-19.41	-19.77	-	-19.77
Recovery Period (ans)	0.16	-	-	-	-



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: 14h30 Commission de souscription/rachat:

aucune

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: 0.77%

a posteriori au: 30/09/2023 0.77%

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

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 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.

Fondation de placement Swiss Life Obligations Marchés Emergents Entreprises (couvertes en CHF)



Structure du portefeuille par branches

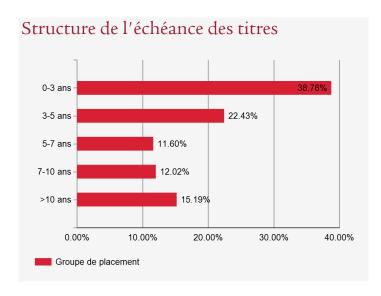
	Groupe de placement	Benchmark
Finance	35.71%	36.10%
Services aux collectivités	11.91%	11.42%
Communications	9.58%	9.22%
Energie	8.60%	11.07%
Matériaux de base	7.21%	11.10%
Consommation, non cyclique	7.08%	4.97%
Industrie	5.66%	3.90%
Technologie	5.24%	5.50%
Supranational	3.12%	-
Autres	7.43%	6.72%
Liquidités	1.04%	-
Couverture de change	-2.60%	-

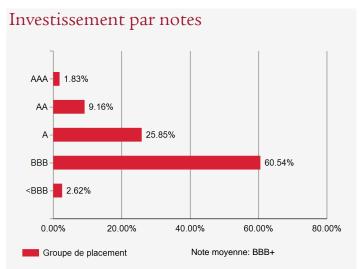
Débiteurs les plus importants et note

		Groupe de placement
Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd	AA-	3.68%
Prosus NV	BBB-	1.99%
OTP Bank Nyrt	BBB-	1.95%
HDFC Bank Ltd	BBB-	1.91%
US Treasury N/B	AAA	1.88%

Indications supplémentaires sur les débiteurs

Nombre de débiteurs	161
Part de débiteurs hors du benchmark	16 28%





Sensibilité et rendement à maturité

	Groupe de placement	Benchmark
Modified Duration	4.9	4.7
Rendement à l'échéance théorique*	6.16%	5.81%

Structure du portefeuille par monnaies et durations

	Groupe de pia	cement	Benchmark		
	Poids	Duration	Poids	Duration	
USD	100.00%	-2015.36	100.00%	4.88	

Structure du portefeuille selon les pays/régions

	Groupe de placement	Benchmark
Chine	8.85%	13.97%
Émirats arabes unis	8.85%	5.62%
Corée du Sud	6.98%	7.53%
Inde	6.64%	4.19%
Qatar	5.93%	5.12%
Mexique	4.87%	4.70%
Chili	4.45%	3.46%
Marchés Émergents Asie-Pacifique	24.37%	24.17%
Marchés Émergents Amériques	8.70%	5.30%
Marchés Émergents Moyen-Orient	7.08%	10.53%
Autres	14.83%	15.42%
Liquidités, couverture	-1.55%	-