

Fondation de placement Swiss Life

Obligations Marchés Emergents Short Term (couvertes en CHF)

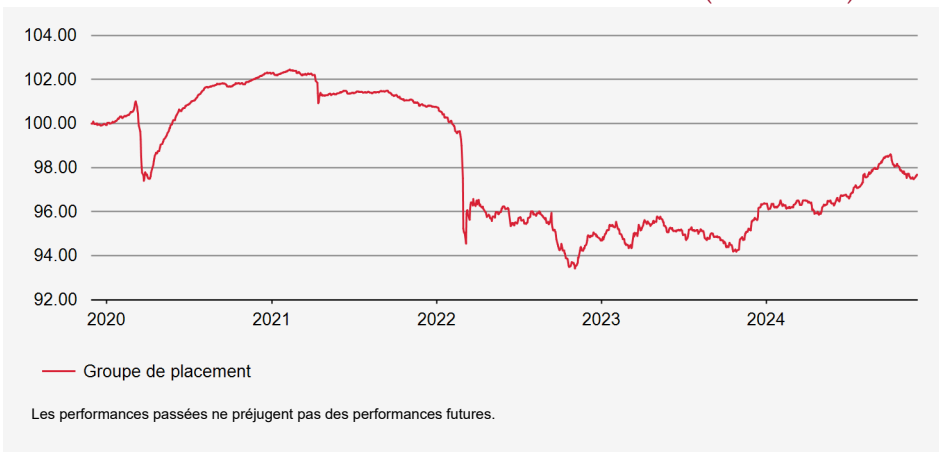


Fortune nette (VNI) en mio. CHF : 122.96
Valeur nette d'inventaire par droit en CHF : 95.92

Stratégie d'investissement

Placement dans titres de créance libellés en dollars US ou d'autres devises fortes émis par des entreprises et états de pays émergents (y compris ceux des agences et des entités supranationales) dont la durée résiduelle est courte (moins de trois ans en général). Sélection active des titres, contrôle de la durée et positionnement sur la courbe des taux. Limite par débiteur: 10%. 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 Short Term CHF AM Cap; fonds de placement de droit luxembourgeois.

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



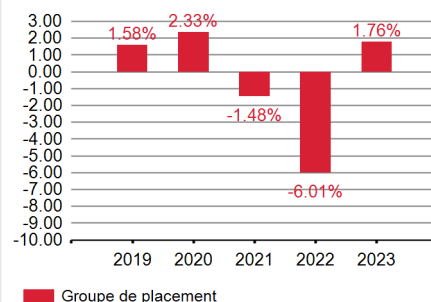
Performances en devise de référence

	Performances cumulées				Performances annualisées			
	YTD	1 mois	3 mois	1 an	3 ans	5 ans	10 ans	Origine
Groupe de placement	1.37%	-0.15%	-0.26%	2.24%	-1.06%	-0.47%	-	-0.58%

Données statistiques (annualisées)

	1 an	3 ans	5 ans	10 ans	Origine
Volatilité du groupe de placement (en %)	1.81	2.69	2.67	-	2.28
Sharpe Ratio	0.47	-0.69	-0.25	-	-0.20
Maximum Drawdown (en %)	-1.14	-7.39	-8.82	-	-8.82
Recovery Period (ans)	-	-	-	-	-

Performance



Info. sur le produit

Numéro de valeur: 38013680
ISIN: CH0380136801
LEI: 254900EGYJLGZXIT6O90
Code Bloomberg: SLOSTCH SW
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: 0.57%

a posteriori au: 30/09/2024 0.57%

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.

Fondation de placement Swiss Life

Obligations Marchés Emergents Short Term (couvertes en CHF)

Structure du portefeuille par branches

	Groupe de placement
Finance	32.74%
État et Assimilé	16.93%
Communications	8.82%
Energie	7.67%
Consommation, cyclique	6.09%
Consommation, non cyclique	6.01%
Matériaux de base	5.93%
Services aux collectivités	4.55%
Autres	6.52%
Liquidités	6.91%
Couverture de change	-2.17%

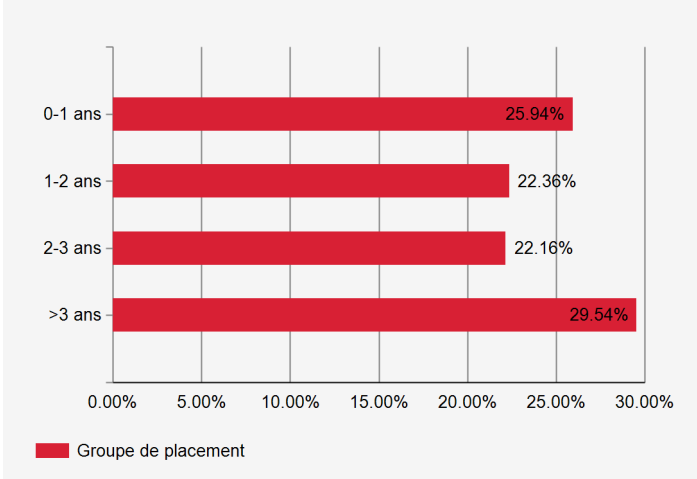
Débiteurs les plus importants et note

	Groupe de placement	
HDFC Bank Ltd	BBB-	3.34%
United Mexican States	BBB	2.61%
First Abu Dhabi Bank PJSC	AA-	2.59%
OTP Bank Nyrt	BBB-	2.20%
Reliance Industries Ltd	BBB	1.96%

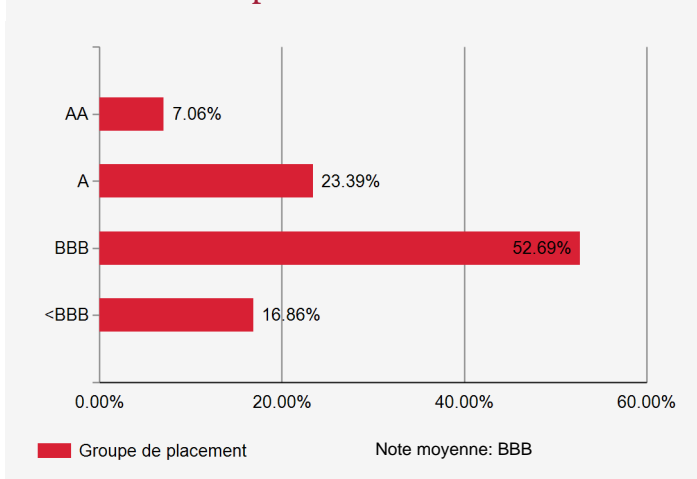
Indications supplémentaires sur les débiteurs

Nombre de débiteurs 92

Structure de l'échéance des titres



Investissement par notes



Sensibilité et rendement à maturité

	Groupe de placement
Modified Duration	2.0
Rendement à l'échéance théorique*	5.41%

* avant couverture de change, en tenant compte des dérivés

Structure du portefeuille par monnaies et durations

	Groupe de placement	
	Poids	Duration
CHF	99.79%	0.02

Structure du portefeuille selon les pays/régions

	Groupe de placement
Inde	10.31%
Chine	9.76%
Émirats arabes unis	7.70%
Indonésie	6.57%
Mexique	5.22%
Hongrie	4.28%
Chili	3.93%
Marchés Émergents Asie-Pacifique	15.55%
Marchés Émergents Amériques	9.07%
Marchés Émergents Moyen-Orient	6.69%
Autres	16.18%
Liquidités, couverture	4.74%