

Fondation de placement Swiss Life

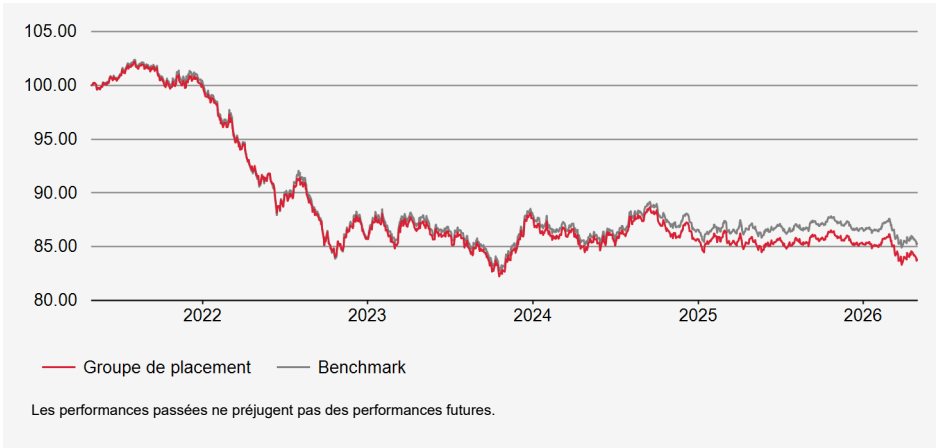
Obligations Global Aggregate (couvertes en CHF)

Fortune nette (VNI) en mio. CHF : 65.45
Valeur nette d'inventaire par droit en CHF : 114.40

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 durée 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)



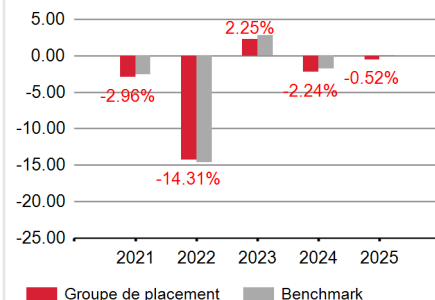
Performances en devise de référence

	Performances cumulées				Performances annualisées			
	YTD	1 mois	3 mois	1 an	3 ans	5 ans	10 ans	Origine
Groupe de placement	-1.67%	-0.05%	-1.52%	-2.42%	-1.31%	-3.47%	-1.22%	0.55%
Benchmark	-1.55%	-0.09%	-1.42%	-2.14%	-0.93%	-3.13%	-1.04%	0.68%

Données statistiques (annualisées)

	1 an	3 ans	5 ans	10 ans	Origine
Volatilité du groupe de placement (en %)	3.39	4.40	5.03	4.31	5.31
Volatilité du Benchmark (en %)	3.23	4.27	5.17	4.38	5.45
Tracking Error ex post (en %)	0.21	0.35	0.50	0.48	1.36
Information Ratio	-1.33	-1.09	-0.68	-0.38	-0.09
Sharpe Ratio	-0.72	-0.49	-0.79	-0.24	0.07
Corrélation	1.00	1.00	1.00	0.99	0.97
Beta	1.05	1.03	0.97	0.98	0.94
Jensen alpha	-0.18	-0.33	-0.46	-0.20	-0.10
Maximum Drawdown (en %)	-3.69	-6.03	-19.51	-20.24	-20.24
Recovery Period (ans)	-	-	-	-	-

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.
Asset Management: Swiss Life Asset Management SA
Surveillance du gestionnaire de fortune: Surveillance par PPCmetrics des résultats de placement du gestionnaire de fortune engagé
Publication de cours: Bloomberg: ASSL
www.swisslife.ch/fondationdeplacement
Taux des charges d'exploitation TER KGAST
au préalable: 0.44%
a posteriori au: 30/09/2025 0.44%

Structure du portefeuille par branches

	Groupe de placement	Benchmark
État et Assimilé	43.93%	72.49%
Finance	24.72%	11.42%
Consommation, non cyclique	7.37%	3.92%
Communications	5.89%	2.08%
Technologie	2.69%	1.18%
Consommation, cyclique	2.57%	1.69%
Services aux collectivités	2.27%	2.87%
Energie	1.70%	1.70%
Supranational	6.10%	-
Autres	1.57%	2.65%
Liquidités	1.78%	-
Couverture de change	-0.58%	-

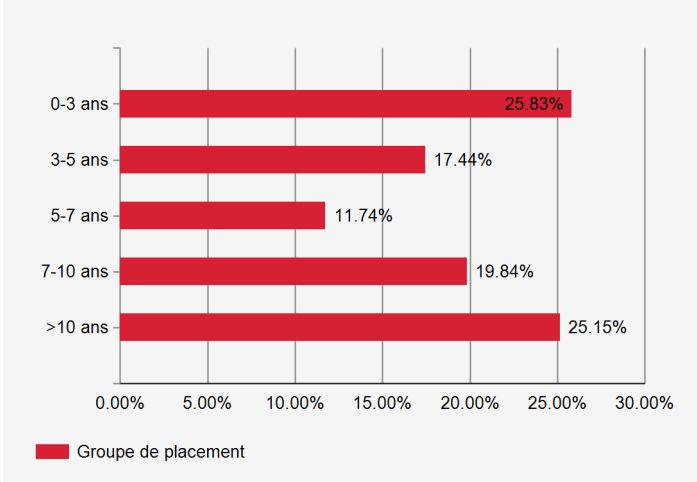
Débiteurs les plus importants et note

	Groupe de placement	
Japon	A+	8.55%
Italie	BBB+	5.61%
US Treasury N/B	AA+	4.78%
France	A+	3.40%
European Union	AA+	3.20%

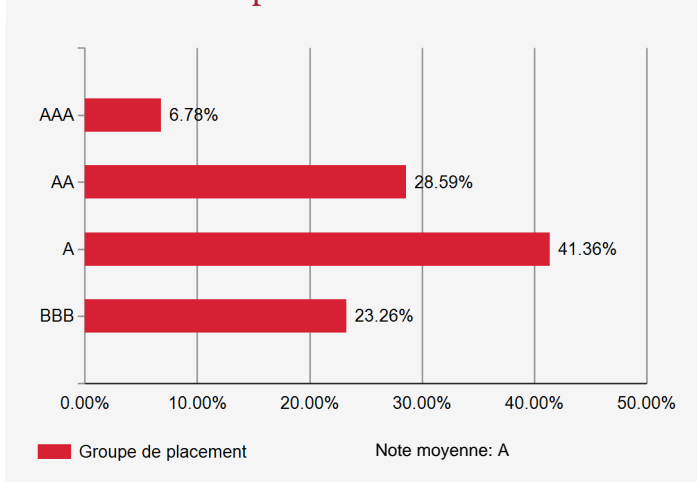
Indications supplémentaires sur les débiteurs

Nombre de débiteurs	119
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	6.6	6.4
Rendement à l'échéance théorique*	3.69%	3.97%

* avant couverture de change

Structure du portefeuille selon les pays/régions

	Groupe de placement	Benchmark
États-Unis	27.02%	38.78%
Japon	11.73%	10.73%
Canada	11.13%	4.59%
Italie	7.37%	4.10%
Royaume-Uni	7.32%	5.48%
France	5.83%	6.23%
Allemagne	4.67%	5.96%
Région Européenne (EUR)	10.79%	9.44%
Région Européenne (Ex EUR)	4.45%	1.28%
Marchés Émergents Amériques	4.31%	0.86%
Autres	4.18%	12.54%
Liquidités, couverture	1.19%	-