

# Fondation de placement Swiss Life

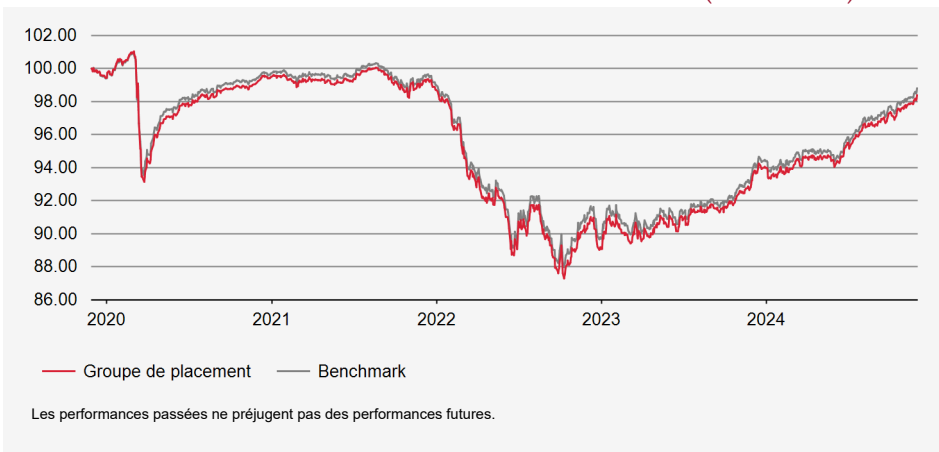
## Obligations étrangères en CHF

**Fortune nette (VNI) en mio. CHF : 345.67**  
**Valeur nette d'inventaire par droit en CHF : 152.10**

### Stratégie d'investissement

Placement dans des titres de créance libellés en francs suisses et émis par des débiteurs essentiellement domiciliés à l'étranger. 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: A au minimum. Réalisation au moyen du Swiss Life iFunds (CH) Bond Swiss Francs Foreign (CHF); fonds de placement de droit suisse de la catégorie "Autres fonds en placements traditionnels".

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



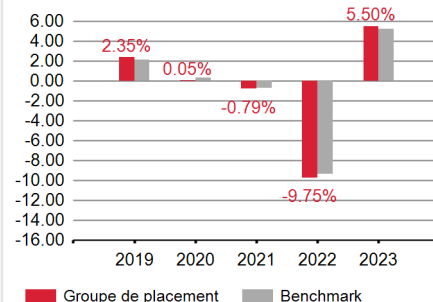
### Performances en devise de référence

	Performances cumulées				Performances annualisées			
	YTD	1 mois	3 mois	1 an	3 ans	5 ans	10 ans	Origine
Groupe de placement	4.69%	0.84%	1.83%	5.54%	-0.24%	-0.32%	0.34%	1.83%
Benchmark	4.67%	0.88%	1.84%	5.54%	-0.20%	-0.24%	0.41%	1.95%

### Données statistiques (annualisées)

	1 an	3 ans	5 ans	10 ans	Origine
Volatilité du groupe de placement (en %)	1.93	3.90	4.47	3.41	3.20
Volatilité du Benchmark (en %)	1.97	3.87	4.26	3.27	3.06
Tracking Error ex post (en %)	0.11	0.25	0.34	0.31	0.85
Information Ratio	0.06	-0.15	-0.25	-0.23	-0.14
Sharpe Ratio	2.09	-0.26	-0.12	0.18	0.50
Corrélation	1.00	1.00	1.00	1.00	0.96
Beta	0.98	1.00	1.05	1.04	1.01
Jensen alpha	0.11	-0.03	-0.06	-0.10	-0.15
Maximum Drawdown (en %)	-0.98	-12.15	-13.61	-14.23	-14.23
Recovery Period (ans)	0.15	-	-	-	-

### Performance



### Info. sur le produit

**Numéro de valeur:** 1245477  
**ISIN:** CH0012454770  
**LEI:** 2549002XPEQH1AZYBW05  
**Code Bloomberg:** SWAOBAU SW  
**Benchmark:** SBI Foreign AAA - BBB TR  
**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:** 0.27%

**a posteriori au:** 30/09/2024 0.27%

**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.

### Structure du portefeuille par branches

	Groupe de placement	Benchmark
Finance	64.55%	47.79%
État et Assimilé	7.40%	15.51%
Centrales de lettres de gage	6.36%	16.06%
Consommation, cyclique	4.84%	3.95%
Industrie	3.81%	5.36%
Services aux collectivités	3.36%	2.96%
Consommation, non cyclique	3.22%	4.17%
Energie	0.98%	1.46%
Supranational	4.30%	-
Autres	1.40%	2.74%
Liquidités	-0.24%	-

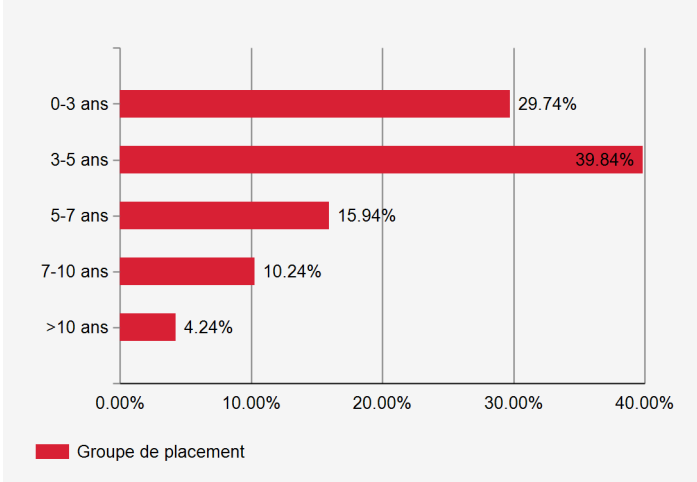
### Débiteurs les plus importants et note

		Groupe de placement
Banco Santander SA, Madrid	A+	4.35%
Müchener Hypothekenbank	AA	3.86%
Bank of Nova Scotia/The	AA	3.61%
Groupe BPCE	AA-	3.49%
Credit Agricole Group	AA-	3.07%

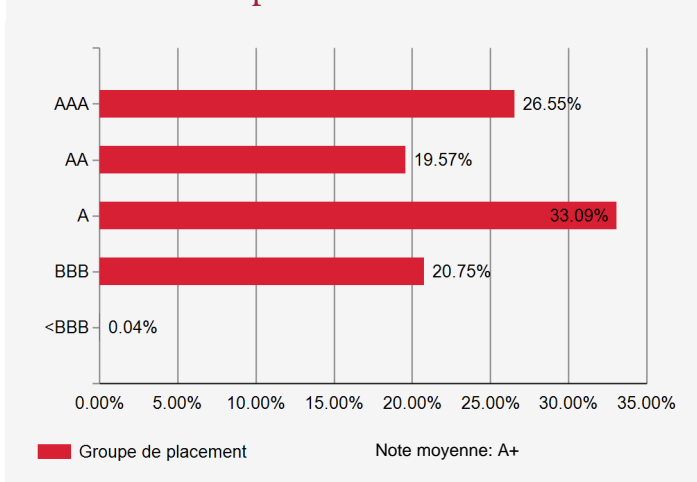
### Indications supplémentaires sur les débiteurs

Nombre de débiteurs	124
Part de débiteurs hors du benchmark	2.43%

### Structure de l'échéance des titres



### Investissement par notes



### Sensibilité et rendement à maturité

	Groupe de placement	Benchmark
Modified Duration	4.2	4.2
Rendement à l'échéance théorique*	0.95%	0.82%

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

### Structure du portefeuille selon les pays/régions

	Groupe de placement	Benchmark
France	15.58%	16.79%
Allemagne	15.18%	14.17%
Canada	11.65%	11.88%
États-Unis	11.34%	12.24%
Australie	6.41%	6.07%
Espagne	5.81%	4.57%
Royaume-Uni	5.65%	4.38%
Région Européenne (Ex EUR)	7.71%	6.56%
Marchés Émergents Amériques	5.93%	3.85%
Région Européenne (EUR)	5.41%	9.29%
Autres	9.58%	10.20%
Liquidités, couverture	-0.24%	-