

30 novembre 2024

Fondation de placement Swiss Life Senior Secured Loans (couvertes en CHF)

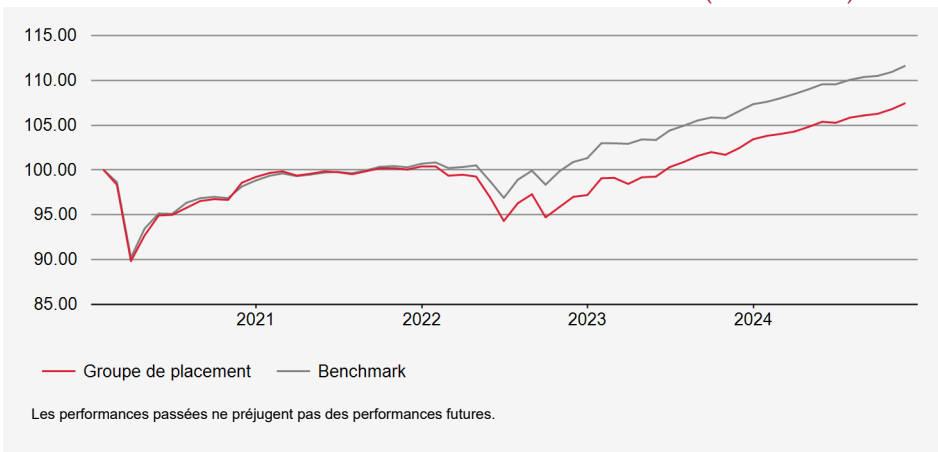


Fortune nette (VNI) en mio. CHF : 145.20
Valeur nette d'inventaire par droit en CHF : 107.43

Stratégie d'investissement

Le groupe de placement vise des rendements stables et élevés avec une volatilité des prix minimale et une durée de maturité courte. Le groupe de placement investit principalement dans des prêts privilégiés de premier rang garantis par des sociétés de pays développés. Au moins 85% seront investis dans des prêts garantis de premier rang. Limitation des débiteurs par entreprise: 5%. Au plus 25% sont investis dans le même groupe industriel. Risques de change par rapport au franc suisse sont couverts à au moins 90%. Réalisation au moyen du Swiss Life Loan Fund (LUX) S.A., SICAV-SIF Senior Secured Loans V AM-Shares (couvertes en CHF); fonds de placement de droit luxembourgeois.

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



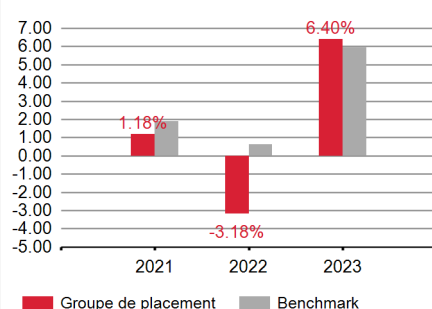
Performances en devise de référence

	Performances cumulées				Performances annualisées			
	YTD	1 mois	3 mois	1 an	3 ans	5 ans	10 ans	Origine
Groupe de placement	3.87%	0.61%	1.26%	4.87%	2.40%	-	-	1.49%
Benchmark	3.97%	0.60%	1.11%	4.73%	3.62%	-	-	2.30%

Données statistiques (annualisées)

	1 an	3 ans	5 ans	10 ans	Origine
Volatilité du groupe de placement (en %)	0.94	3.63	-	-	5.53
Volatilité du Benchmark (en %)	0.70	2.80	-	-	5.15
Tracking Error ex post (en %)	0.42	1.06	-	-	1.00
Information Ratio	0.34	-1.15	-	-	-0.80
Sharpe Ratio	3.60	0.44	-	-	0.22
Corrélation	0.91	0.98	-	-	0.98
Beta	1.23	1.26	-	-	1.06
Jensen alpha	-0.63	-1.97	-	-	-0.92
Maximum Drawdown (en %)	-0.10	-6.07	-	-	-10.15
Recovery Period (ans)	0.09	1.08	-	-	1.50

Performance



Info. sur le produit

Numéro de valeur: 51215713
ISIN: CH0512157139
LEI: 254900TFN2RL5B1QJ986
Code Bloomberg: SWSSLCH SW
Benchmark: JPM Lev Loans Upper Tier (80% US + 20% EU) CHFh
Monnaie: CHF
Pays d'origine: Suisse
Date de création: 31/01/2020
Valeur de lancement: 100.00
Clôture de l'exercice: 30.09
Souscription/Rachat: mensuelle
Délai final d'acceptation: 13h00
Souscriptions: Ultimo -2
Rachats: Ultimo -5
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: 0.61%

a posteriori au: 30/09/2024 0.61%

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.

Délai final d'acceptation: Ultimo = dernier jour ouvrable bancaire du mois

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
Services	16.31%	10.05%
Technologie	9.62%	8.20%
Santé	9.55%	8.41%
Jeux/Loisirs	7.96%	10.53%
Finance	7.45%	6.12%
Chimie	6.67%	5.22%
Câble et satellite	5.25%	2.84%
Automobile	4.79%	4.92%
Construction	3.88%	3.58%
Industrie	3.79%	7.89%
Autres	24.50%	32.24%
Liquidités	0.22%	-

Débiteurs les plus importants et note

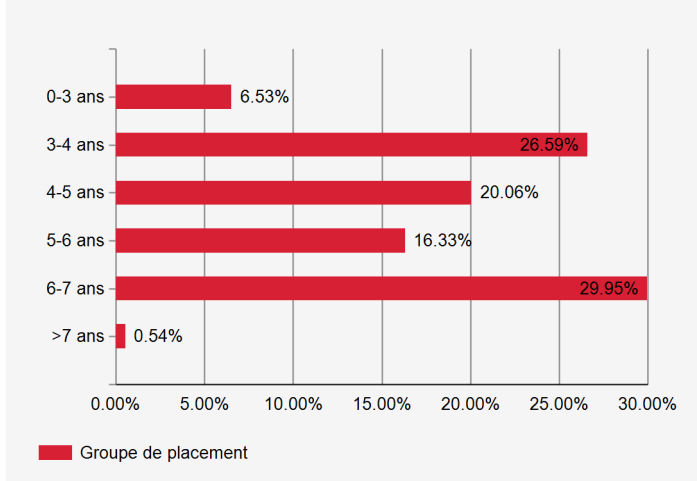
	Groupe de placement	
Belron	BB-	1.58%
Action	BB	1.57%
Asurion	B+	1.54%
Entain	BB-	1.49%
Cushman & Wakefield	BB-	1.38%

Indications supplémentaires sur les débiteurs

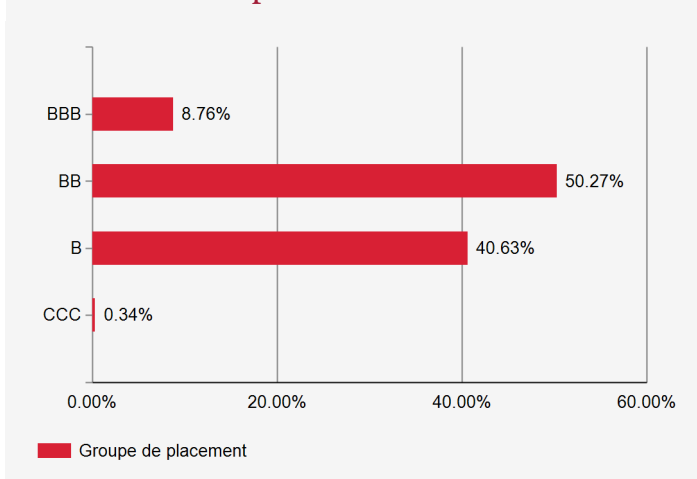
Nombre de débiteurs

237

Structure de l'échéance des titres



Investissement par notes



Structure du portefeuille par monnaies/rendements (sans liquidités)

	Groupe de placement		Benchmark	
	Poids	Rendements	Poids	Rendements
USD	68.76%	7.29%	80.00%	6.72%
EUR	31.24%	6.26%	20.00%	6.02%
Moyenne	-	6.97%	-	6.58%

Structure du portefeuille selon les pays/régions

	Groupe de placement	Benchmark
États-Unis	58.53%	82.89%
Royaume-Uni	9.95%	5.63%
Pays-Bas	6.60%	2.10%
Luxembourg	3.90%	0.59%
Allemagne	3.59%	0.40%
Belgique	2.91%	1.60%
France	2.27%	-
Espagne	1.67%	0.81%
Canada	1.52%	2.38%
Suisse	1.44%	0.17%
Autres	7.40%	3.44%
Liquidités	0.22%	-