

Fondation de placement Swiss Life

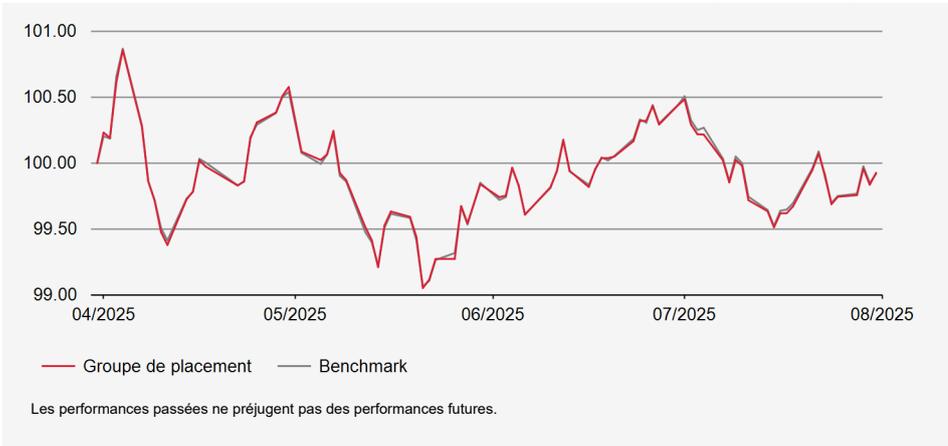
Obligations Global Aggregate ex CHF Indexées PM (couvertes en CHF)

Fortune nette (VNI) en mio. CHF : 13.17
Valeur nette d'inventaire par droit en CHF : 999.27

Stratégie d'investissement

Le groupe de placement est géré selon une approche indexée et se distingue par une large diversification et une faible erreur de suivi. L'objectif de placement consiste à reproduire au mieux le benchmark Bloomberg Global Aggregate ex CHF Total Return (CHF hedged). Réalisation au moyen du Swiss Life Index Funds (CH) Bond Global Aggregate ex CHF (CHF hedged); fonds de placement contractuel de droit suisse du type "Autres fonds en placements traditionnels". Aucun securities lending (prêt de valeurs mobilières) n'est pratiqué et aucun investissement n'est effectué dans des titres dont l'exclusion est recommandée par l'Association suisse pour des investissements responsables (www.svvk-asir.ch).

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	-	-0.51%	-0.65%	-	-	-	-	-
Benchmark	-	-0.52%	-0.62%	-	-	-	-	-

Données statistiques (annualisées)

	1 an	3 ans	5 ans	10 ans	Origine
Volatilité du groupe de placement (en %)	-	-	-	-	2.12
Volatilité du Benchmark (en %)	-	-	-	-	2.04
Tracking Error ex post (en %)	-	-	-	-	0.11
Information Ratio	-	-	-	-	0.20
Sharpe Ratio	-	-	-	-	-0.14
Corrélation	-	-	-	-	1.00
Beta	-	-	-	-	1.04
Jensen alpha	-	-	-	-	0.04
Maximum Drawdown (en %)	-	-	-	-	-1.79
Recovery Period (ans)	-	-	-	-	-

PM tranche: L'acquisition de cette tranche n'est possible que dans le cadre d'une convention spéciale avec Swiss Life Asset Management SA.

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.

Performance

Historique de données insuffisant

Info. sur le produit

Numéro de valeur: 142759586

ISIN: CH1427595868

LEI: 2549009Q08QLB0BEL51

Code Bloomberg: SLAIGAP SW

Benchmark: BLOOMBERG GLO AGG EX CHF TR IND HEDGED CHF

Monnaie: CHF

Pays d'origine: Suisse

Date de création: 31/03/2025

Valeur de lancement: 1000.00

Clôture de l'exercice: 30.09

Souscription/Rachat: journalier

Délai final d'acceptation: 14h00 (J-1)

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

Conseil externe:

PPCmetrics fournit les prestations suivantes: conseil concernant la bonne structure de mandat, aide à la sélection de gestionnaires de fortune adéquats et soutien dans le cadre de la surveillance continue du gestionnaire de fortune, ainsi qu'évaluation des résultats des placements.

Publication de cours: Bloomberg: ASSL
www.swisslife.ch/fondationdeplacement

Taux des charges d'exploitation TER KGAST

au préalable: 0.02%

Fondation de placement Swiss Life

Obligations Global Aggregate ex CHF Indexées PM (couvertes en CHF)

Structure du portefeuille par branches

	Groupe de placement	Benchmark
Treasury	54.59%	53.74%
MBS Pass-Through	10.70%	10.10%
Industrial	9.17%	9.46%
Financial Institutions	7.73%	7.23%
Agency	7.47%	8.13%
Local Authority	2.81%	3.00%
Supranational	2.29%	2.66%
Utilities	1.94%	1.69%
Covered	1.63%	1.92%
Sovereign	1.34%	1.23%
ABS	-	0.20%
CMBS	-	0.63%
Liquidités	0.33%	-

Débiteurs les plus importants et note

	Groupe de placement	Benchmark	
United States of America	AA+	29.47%	28.84%
Japan	A+	8.87%	8.52%
People's Republic of China	A+	6.88%	6.83%
United Kingdom of Great Britain and Northern Ireland	AA-	2.90%	2.99%
Republic of Italy	BBB	2.82%	2.86%
French Republic	AA-	2.79%	2.97%
Federal Republic of Germany	AAA	2.41%	2.36%
China Development Bank	A+	2.33%	2.30%
Kingdom of Spain	A-	1.89%	1.84%
Republic of Korea	AA	1.12%	1.15%

Structure du portefeuille par maturité

	Groupe de placement	Benchmark
0-3 ans	22.90%	23.72%
3-5 ans	18.42%	18.77%
5-7 ans	13.00%	12.28%
7-10 ans	14.14%	13.98%
> 10 ans	31.53%	31.25%

Sensibilité et rendement à maturité

	Groupe de placement	Benchmark
Modified Duration	6.4	6.4
Rendement à l'échéance théorique*	3.33%	3.58%

* avant couverture de change

Structure du portefeuille selon les pays/régions

	Groupe de placement	Benchmark
États-Unis	41.73%	40.89%
Chine	9.94%	9.93%
Japon	9.10%	9.20%
France	5.22%	5.30%
Allemagne	4.63%	4.44%
Canada	4.01%	3.49%
Royaume-Uni	3.99%	4.29%
Italie	3.13%	3.25%
Pays-Bas	2.22%	1.87%
Autres	15.71%	17.34%
Liquidités	0.33%	-

Structure du portefeuille par notation

	Groupe de placement	Benchmark
AAA	10.87%	11.71%
AA	43.09%	42.84%
A	31.46%	31.10%
BBB	14.25%	14.34%
BB	-	0.00%
NR	-	0.00%
Liquidités	0.33%	-