

# Fondation de placement Swiss Life

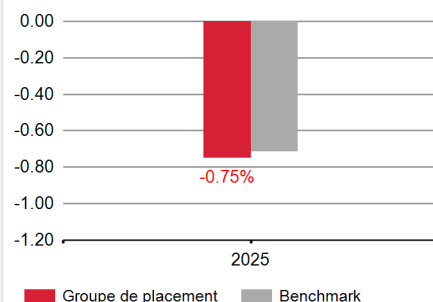
## Obligations Global Etats ex CHF Indexées SPM (couvertes en CHF)

**Fortune nette (VNI) en mio. CHF : 32.59**  
**Valeur nette d'inventaire par droit en CHF : 972.27**

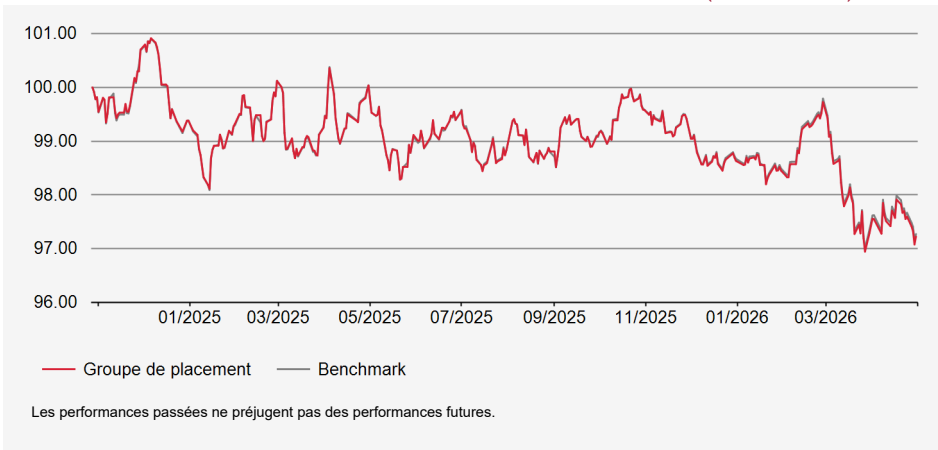
### Stratégie d'investissement

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 FTSE Non-CHF World Government Bond Index Total Return (CHF hedged). Réalisation au moyen du Swiss Life Index Funds (CH) Bond Global Government 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).

### Performance



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



### Info. sur le produit

**Numéro de valeur:** 137660509  
**ISIN:** CH1376605098  
**LEI:** 254900WRQBH1EKTFLX93  
**Code Bloomberg:** SLAIGSP SW  
**Benchmark:** FTSE Non-CHF World Government Bond Index Total Return (hdg)  
**Monnaie:** CHF  
**Pays d'origine:** Suisse  
**Date de création:** 28/10/2024  
**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 Manager selon Swiss Life Best Select Invest Plus@:** 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](http://www.swisslife.ch/fondationdeplacement)  
**Taux des charges d'exploitation TER KGAST**  
**au préalable:** 0.01%  
**a posteriori au:** 30/09/2025 0.01%

### 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	-1.42%	-0.21%	-1.25%	-2.81%	-	-	-	-1.85%
Benchmark	-1.42%	-0.22%	-1.24%	-2.76%	-	-	-	-1.82%

### Données statistiques (annualisées)

	1 an	3 ans	5 ans	10 ans	Origine
Volatilité du groupe de placement (en %)	3.13	-	-	-	3.04
Volatilité du Benchmark (en %)	3.15	-	-	-	3.05
Tracking Error ex post (en %)	0.08	-	-	-	0.08
Information Ratio	-0.53	-	-	-	-0.38
Sharpe Ratio	-0.91	-	-	-	-0.64
Corrélation	1.00	-	-	-	1.00
Beta	0.99	-	-	-	1.00
Jensen alpha	-0.06	-	-	-	-0.04
Maximum Drawdown (en %)	-3.09	-	-	-	-3.93
Recovery Period (ans)	-	-	-	-	-

**SPM-Tranche:** La tranche SPM est accessible aussi bien aux investisseurs ayant conclu une convention spéciale avec Swiss Life Asset Management SA (SLAM CH) qu'aux clients de gestion de fortune et à ceux des partenaires de coopération de SLAM CH (avec convention complémentaire).

**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.

# Fondation de placement Swiss Life

## Obligations Global Etats ex CHF Indexées SPM (couvertes en CHF)

### Structure du portefeuille par branches

	Groupe de placement	Benchmark
Treasury	99.30%	100.00%
Liquidités	0.70%	-

### Structure du portefeuille par maturité

	Groupe de placement	Benchmark
0-3 ans	28.95%	28.92%
3-5 ans	19.48%	20.06%
5-7 ans	12.57%	12.47%
7-10 ans	14.84%	14.33%
> 10 ans	24.16%	24.22%

### Sensibilité et rendement à maturité

	Groupe de placement	Benchmark
Modified Duration	6.6	6.5
Rendement à l'échéance théorique*	3.59%	3.54%

\* avant couverture de change

### Structure du portefeuille selon les pays/régions

	Groupe de placement	Benchmark
États-Unis	40.96%	41.55%
Chine	11.42%	11.35%
Japon	8.43%	8.45%
France	6.50%	6.56%
Italie	5.89%	5.99%
Allemagne	5.19%	5.19%
Royaume-Uni	5.14%	5.12%
Espagne	3.85%	3.95%
Canada	1.96%	1.94%
Autres	9.95%	9.89%
Liquidités	0.70%	-

### Débiteurs les plus importants et note

	Groupe de placement	Benchmark	
United States of America	AA+	41.24%	41.55%
People's Republic of China	A+	11.50%	11.35%
Japan	A+	8.49%	8.45%
French Republic	A+	6.55%	6.56%
Republic of Italy	BBB+	5.93%	5.99%
Federal Republic of Germany	AAA	5.22%	5.19%
United Kingdom of Great Britain and Northern Ireland	AA	5.18%	5.12%
Kingdom of Spain	A+	3.88%	3.95%
Canada	AAA	1.98%	1.94%
Kingdom of Belgium	AA	1.37%	1.39%

### Structure du portefeuille par notation

	Groupe de placement	Benchmark	
AAA		10.52%	10.59%
AA		49.84%	50.18%
A		32.26%	32.43%
BBB		6.68%	6.80%
Liquidités		0.70%	-