

Fondation de placement Swiss Life

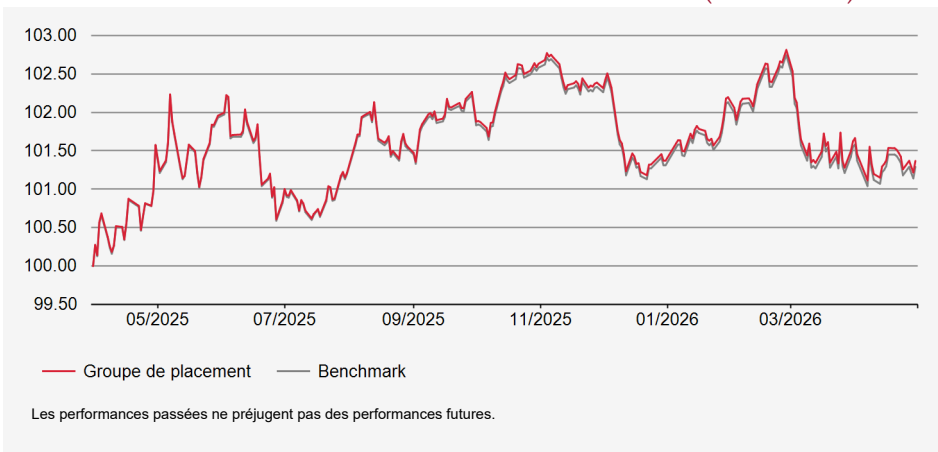
Obligations en CHF AAA-BBB ESG Indexées SPM

Fortune nette (VNI) en mio. CHF : 2.99
Valeur nette d'inventaire par droit en CHF : 1,013.69

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 SBI® ESG AAA-BBB Total Return. Réalisation au moyen du Swiss Life Index Funds (CH) Bond Responsible Swiss Francs AAA-BBB; 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	0.00%	-0.25%	-0.81%	-0.20%	-	-	-	1.26%
Benchmark	-0.02%	-0.26%	-0.82%	-0.28%	-	-	-	1.19%

Données statistiques (annualisées)

	1 an	3 ans	5 ans	10 ans	Origine
Volatilité du groupe de placement (en %)	2.48	-	-	-	2.71
Volatilité du Benchmark (en %)	2.47	-	-	-	2.81
Tracking Error ex post (en %)	0.03	-	-	-	0.03
Information Ratio	2.67	-	-	-	2.76
Sharpe Ratio	-0.08	-	-	-	0.43
Corrélation	1.00	-	-	-	1.00
Beta	1.00	-	-	-	1.00
Jensen alpha	0.07	-	-	-	0.07
Maximum Drawdown (en %)	-1.65	-	-	-	-1.65
Recovery Period (ans)	-	-	-	-	-

Performance

Historique de données insuffisant

Info. sur le produit

Numéro de valeur: 142759585
ISIN: CH1427595850
LEI: 2549007FEM7DLVNXSM63
Code Bloomberg: SLAICRP SW
Benchmark: SBI® ESG AAA-BBB Total Return
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: 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
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: 0.01%
a posteriori au: 30/09/2025 0.01%

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, «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 en CHF AAA-BBB ESG Indexées SPM

Structure du portefeuille par branches

	Groupe de placement	Benchmark
Covered	35.97%	36.19%
Local Authority	19.43%	19.30%
Treasury	15.40%	15.38%
Financial Institutions	11.34%	11.14%
Industrial	9.02%	9.19%
Agency	4.61%	5.02%
Supranational	2.07%	2.09%
Utilities	1.25%	1.18%
Sovereign	0.61%	0.52%
Liquidités	0.29%	-

Débiteurs les plus importants et note

	Groupe de placement	Benchmark	
Pfandbriefbank schweizerischer Hypothekarinstitute AG	AAA	16.35%	16.70%
Swiss Confederation	AAA	15.45%	15.38%
Pfandbriefzentrale der schweizerischen Kantonalbanken AG	AAA	15.41%	15.31%
Canton of Geneva Switzerland	AA	1.43%	1.40%
Credit Agricole Group	AA-	1.31%	1.14%
Zürcher Kantonalbank	AA+	1.28%	1.29%
Luzerner Kantonalbank AG	AA-	1.25%	1.27%
City of Zurich Switzerland	AAA	1.14%	1.23%
UBS Group AG	AA	0.82%	0.87%
Canton of Zurich	AAA	0.73%	0.78%

Structure du portefeuille par maturité

	Groupe de placement	Benchmark
0-3 ans	21.05%	22.46%
3-5 ans	20.02%	20.34%
5-7 ans	17.94%	16.92%
7-10 ans	17.29%	17.06%
> 10 ans	23.69%	23.22%

Sensibilité et rendement à maturité

	Groupe de placement	Benchmark
Modified Duration	7.3	7.2
Rendement à l'échéance théorique*	0.78%	0.77%

* avant couverture de change

Structure du portefeuille par notation

	Groupe de placement	Benchmark
AAA	60.51%	60.98%
AA	18.71%	18.49%
A	14.31%	14.52%
BBB	6.11%	6.00%
NR	0.08%	-
Liquidités	0.29%	-

Structure du portefeuille selon les pays/régions

	Groupe de placement	Benchmark
Suisse	77.79%	77.99%
France	3.39%	3.50%
États-Unis	3.11%	3.21%
Allemagne	2.88%	2.82%
Canada	2.34%	2.50%
Supranational	1.89%	1.92%
Australie	1.24%	1.17%
Autriche	1.23%	0.99%
Royaume-Uni	0.91%	0.73%
Autres	4.94%	5.16%
Liquidités	0.29%	-