

31 octobre 2022

Fondation de placement Swiss Life Hypothèques Suisse ESG PM

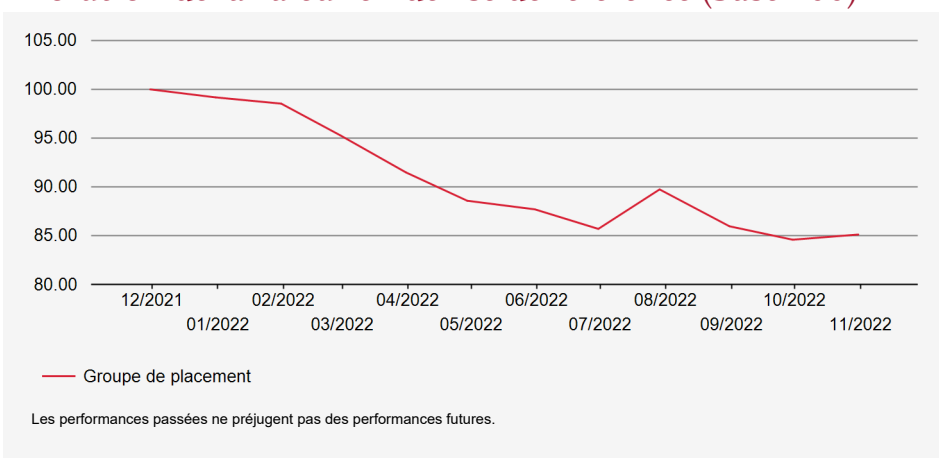


Fortune nette (VNI) en mio. CHF : 189.53
Valeur nette d'inventaire par droit en CHF : 85.14

Stratégie d'investissement

Investissements dans des hypothèques suisses durables: au moins 85% après déduction d'éventuelles liquidités. Duration cible de 8. Mise en œuvre via l'utilisation du compartiment «Swiss Life ESG Mortgage Fund» du fonds Swiss Life Mortgage Funds, un fonds ombrelle contractuel de droit suisse.

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
GRUPE DE PLACEMENT	-14.16%	0.63%	-5.15%	-	-	-	-	-

Données statistiques

Durée résiduelle moyenne (années)	9.22
Duration modifiée (hypothèques à terme exclues)*	7.44
Duration modifiée (hypothèques à terme incluses)*	8.06
Rendement brut à l'échéance	2.57%
Nantissement moyen	58%
Nombre d'hypothèques	378
Différence de rendement par rapport aux emprunts d'Etat suisses	1.50%

*liquidité comprise

Performance

Historique de données insuffisant

Info. sur le produit

Numéro de valeur: 112778775

ISIN: CH1127787757

LEI: 254900V4K2D79T13EF45

Code Bloomberg: SLHSEPM SW

Monnaie: CHF

Pays d'origine: Suisse

Date de création: 30/11/2021

Valeur de lancement: 100.00

Clôture de l'exercice: 30.9

Souscription/Rachat: mensuelle

Commission de souscription/rachat: aucune

Pratique de distribution: Capitalisation

Asset Manager:

Swiss Life Asset Management SA

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

Taux des charges d'exploitation TER KGAST

au préalable: 0.35%

à posteriori au: 30/09/2022 0.35%

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

Emission: Mensuel, moyennant un délai de souscription d'un mois.

Retrait: Mensuel, moyennant un préavis de six mois. Un rachat de droits sera possible pour la première fois au 30 janvier 2024, moyennant le respect du délai de résiliation de six 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.

Structure de la fortune

HYPOTHÈQUES	90.00%
OBLIGATIONS	5.30%
LIQUIDITÉS	4.70%
DÉRIVÉS	0.00%

Répartition en fonction du niveau de bail

<40%	10.01%
40 - 50%	14.31%
50 - 60%	11.26%
60 - 70%	55.92%
>70%	8.51%

Type de bien mis en gage

MAISON INDIVIDUELLES	28.82%
APPARTEMENTS EN PROPRIÉTÉ	51.11%
IMMEUBLE LOCATIFS	11.65%
LES IMMEUBLES À USAGE COMMERCIAL	8.43%

Part des types d'hypothèques

HYPOTHÈQUES À TAUX FIXE	98.50%
HYPOTHÈQUES SARON	1.42%
HYPOTHÈQUES À TAUX VARIABLE	0.08%

Répartition géographique des immeubles

ZURICH	25.22%
ESPACE MITTELLAND	11.65%
SUISSE CENTRALE	11.47%
SUISSE DU NORD-OUEST	6.06%
SUISSE ORIENTALE	1.98%
TESSIN	0.92%
RÉGION LÉMANIQUE	42.70%

Structure d'échéance des hypothèques

1-3 ANS	11.34%
3-5 ANS	11.41%
5-7 ANS	16.19%
7-10 ANS	27.97%
10-15 ANS	18.49%
>15 ANS	14.60%

Hypothèques avec des arriérés de paiement de plus de 90 jours

NOMBRE DE DÉBITEURS HYPOTHÉCAIRES	-
HYPOTHÈQUE À TAUX VARIABLE	-
NANTISSEMENT MOYEN	-