

Fondation de placement Swiss Life

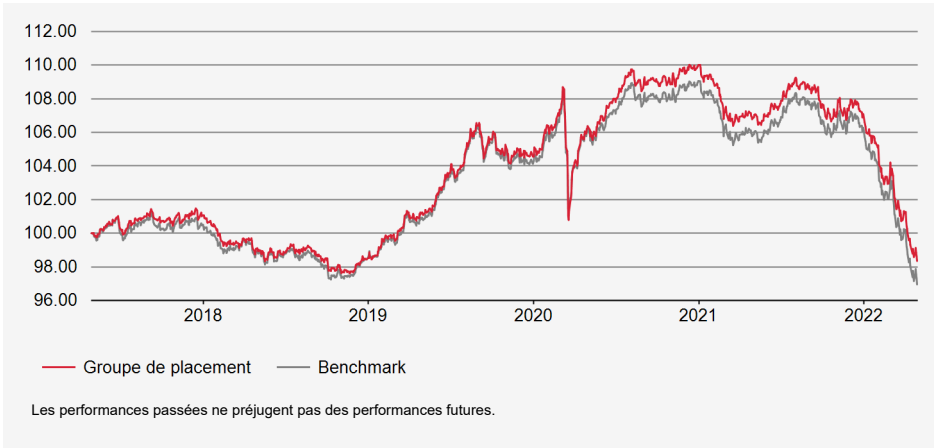
Obligations Global PM (couvertes en CHF)

Fortune nette (VNI) en mio. CHF : 50.92
Valeur nette d'inventaire par droit en CHF : 125.11

Stratégie d'investissement

Placement dans des titres de créance libellés en monnaies étrangères, émis par des débiteurs domiciliés en Suisse ou à l'étranger (dès le 1.1.2011 couvertes en CHF). Sélection active des titres, contrôle de la duration et positionnement sur la courbe des taux. Limite par débiteur: 10% (exception: à condition que les débiteurs soient dans le benchmark, et position au max. 5% points de plus que pondération dans le benchmark). Débiteurs hors benchmark: max. 10%. Note moyenne: A- au minimum. Risques de change par rapport au franc suisse sont couverts à au moins 90%. Réalisation au moyen du Swiss Life iFunds (CH) Bond Global Government+ (CHF hedged) et Swiss Life iFunds (CH) Bond Global Corporates (CHF hedged); fonds de placement de droit suisse de la catégorie "Autres fonds en placements traditionnels".

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



Performances en devise de référence

	PERFORMANCES CUMULÉES				PERFORMANCES ANNUELISÉES			
	YTD	1 MOIS	3 MOIS	1 AN	3 ANS	5 ANS	10 ANS	ORIGINE
GROUPE DE PLACEMENT	-8.16%	-2.93%	-6.51%	-7.94%	-0.96%	-0.33%	1.37%	1.51%
BENCHMARK	-8.77%	-3.29%	-6.92%	-8.38%	-1.33%	-0.62%	1.04%	1.19%

Données statistiques (annualisées)

	1 AN	3 ANS	5 ANS	10 ANS	ORIGINE
Volatilité du groupe de placement (en %)	4.36	4.53	3.72	3.52	5.54
Volatilité du Benchmark (en %)	4.75	4.63	3.81	3.44	5.51
Tracking Error ex post (en %)	0.58	0.45	0.48	0.65	1.46
Information Ratio	0.76	0.82	0.59	0.51	0.22
Sharpe Ratio	-1.75	-0.06	0.11	0.54	0.30
Corrélation	1.00	1.00	0.99	0.98	0.96
Beta	0.91	0.97	0.97	1.01	0.97
Jensen alpha	-0.24	0.35	0.29	0.32	0.36
Maximum Drawdown (en %)	-9.98	-10.61	-10.61	-10.61	-14.13
Recovery Period (ans)	-	-	-	-	1.89

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

Benchmark: Jusqu'au 30.06.12 60% Citigroup WGBI, ex CH (couvertes en CHF)

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.

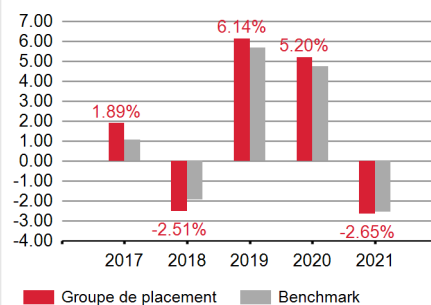
Taux des charges d'exploitation TER KGAST: Le taux des charges d'exploitation TER KGAST couvre tous les coûts à l'exception des frais de transaction et des prélèvements fiscaux sur les transactions.

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



Info. sur le produit

Numéro de valeur: 3026055

ISIN: CH0030260555

LEI: 254900F82G5L48XPDV74

Code Bloomberg: SLOFGPM SW

Benchmark: BD GL BB Blend 40 Corp 60 TRCRST IX

Monnaie: CHF

Pays d'origine: Suisse

Date de création: 31/05/2007

Valeur de lancement: 100.00

Clôture de l'exercice: 30.09

Souscription/Rachat: journalier

Délai final d'acceptation: 14h30

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/fondationplacement

Taux des charges d'exploitation TER KGAST

au préalable: 0.15%

a posteriori au: 30/09/2021 0.15%

Structure du portefeuille par branches

	Groupe de placement	Benchmark
ÉTAT ET ASSIMILÉ	50.17%	60.00%
FINANCE	21.58%	15.46%
CONSOMMATION, NON CYCLIQUE	7.90%	6.02%
SERVICES AUX COLLECTIVITÉS	3.87%	3.25%
CONSOMMATION, CYCLIQUE	3.02%	2.92%
ENERGIE	2.98%	2.51%
COMMUNICATIONS	1.86%	3.37%
TECHNOLOGIE	1.53%	2.14%
INDUSTRIE	1.25%	3.07%
SUPRANATIONAL	2.17%	-
OTHER	0.63%	1.27%
LIQUIDITÉS	3.26%	-
COUVERTURE DE CHANGE	-0.22%	-

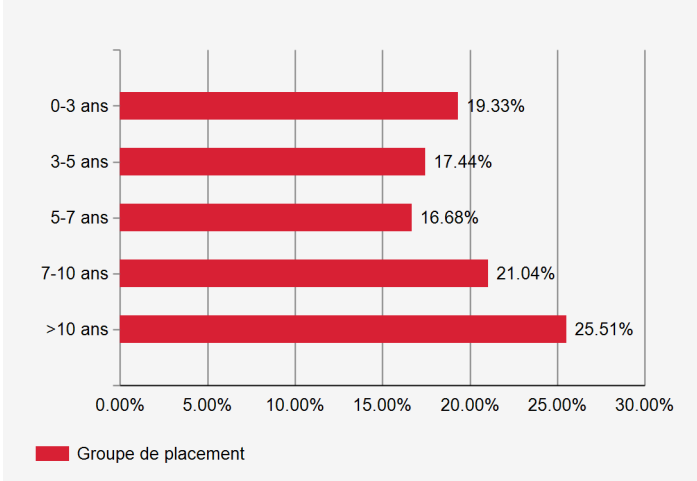
Débiteurs les plus importants et note

	Groupe de placement	
US Treasury N/B	AA+	17.60%
Japon	A+	10.57%
Italie	BBB-	3.68%
PEOPLE REP OF CN	A+	3.17%
Royaume-Uni	AA-	2.67%

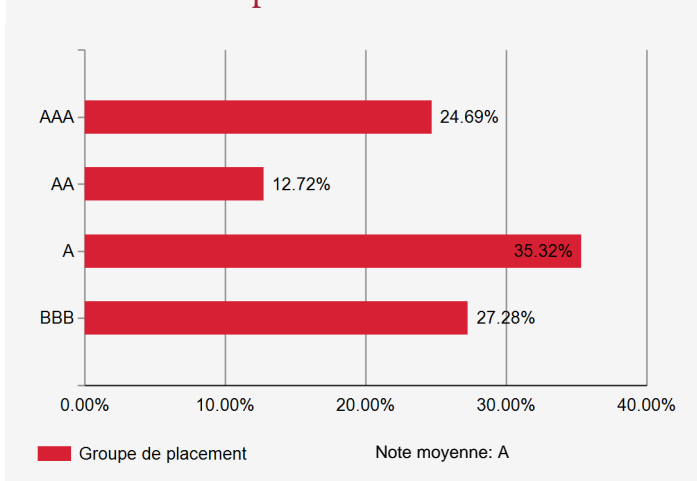
Indications supplémentaires sur les débiteurs

Nombre de débiteurs	286
Part de débiteurs hors du benchmark	1.67%

Structure de l'échéance des titres



Investissement par notes



Sensibilité et rendement à maturité

	Groupe de placement	Benchmark
Modified Duration	6.7	7.4
Rendement à l'échéance théorique*	2.57%	2.84%

* avant couverture de change, en tenant compte des dérivés

Structure du portefeuille par monnaies et durations

	Groupe de placement		Benchmark	
	Poids	Duration	Poids	Duration
USD	44.05%	6.26	45.15%	6.76
EUR	29.90%	4.49	23.15%	6.74
JPY	10.95%	8.17	13.72%	7.50
Autres	15.10%	12.18	18.00%	16.48

Structure du portefeuille selon les pays/régions

	Groupe de placement	Benchmark
ÉTATS-UNIS	33.28%	39.61%
JAPON	12.87%	14.56%
ALLEMAGNE	5.95%	4.59%
ROYAUME-UNI	5.84%	6.69%
CANADA	4.78%	2.74%
ITALIE	3.68%	3.02%
CHINE	3.35%	4.69%
RÉGION EUROPÉENNE (EUR)	15.12%	11.94%
MARCHÉS ÉMERGENTS ASIE-PACIFIQUE	2.59%	2.68%
RÉGION EUROPÉENNE (EX EUR)	1.24%	0.59%
AUTRES	8.27%	8.89%
LIQUIDITÉS, COUVERTURE	3.04%	-