

Fondation de placement Swiss Life

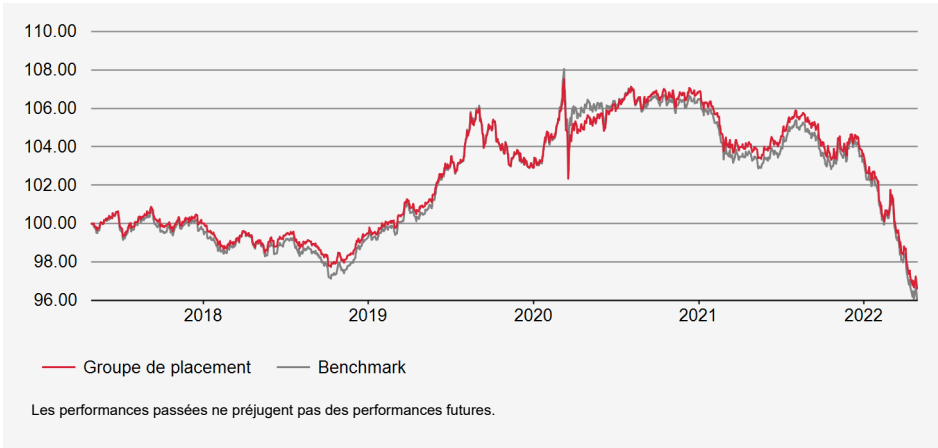
Obligations Global Etats+ PM (couvertes en CHF)

Fortune nette (VNI) en mio. CHF : 655.92
Valeur nette d'inventaire par droit en CHF : 117.09

Stratégie d'investissement

Placement dans titres de créance libellés en monnaies étrangères d'Etats et d'institutions gouvernementales. Sélection active des titres, contrôle de la durée 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); Fonds de placement de droit suisse de la catégorie "Autres fonds en investissements traditionnels"

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	-6.78%	-2.22%	-5.50%	-6.89%	-1.45%	-0.68%	0.93%	1.40%
BENCHMARK	-7.05%	-2.44%	-5.67%	-7.01%	-1.51%	-0.80%	0.76%	1.08%

Données statistiques (annualisées)

	1 AN	3 ANS	5 ANS	10 ANS	ORIGINE
Volatilité du groupe de placement (en %)	3.88	3.64	3.03	3.10	3.13
Volatilité du Benchmark (en %)	4.11	3.76	3.19	3.08	3.06
Tracking Error ex post (en %)	0.53	0.62	0.54	0.65	0.72
Information Ratio	0.24	0.10	0.21	0.25	0.43
Sharpe Ratio	-1.68	-0.21	0.02	0.48	0.59
Corrélation	0.99	0.99	0.99	0.98	0.97
Beta	0.94	0.95	0.94	0.98	1.00
Jensen alpha	-0.28	0.03	0.11	0.19	0.32
Maximum Drawdown (en %)	-8.74	-10.13	-10.13	-10.13	-10.13
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.

Benchmark: Jusqu'au 30.06.12 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.

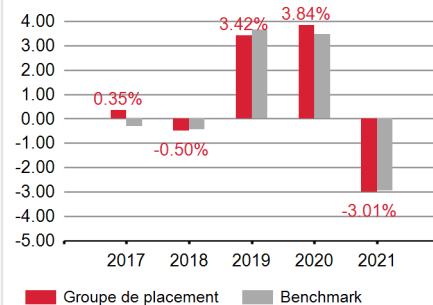
Taux des charges d'exploitation TER KGAST: Le taux des charges d'exploitation TER KGAST couvre tous les coûts à l'exception des frais de transaction et des prélèvements fiscaux sur les transactions.

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: 11956107

ISIN: CH0119561071

LEI: 254900H7WEVS3K9ANR90

Code Bloomberg: SWLGS PM SW

Benchmark: BLOOMBERG GLOBAL AGG TREAS EX CHF TR HEDGED CHF

Monnaie: CHF

Pays d'origine: Suisse

Date de création: 14/12/2010

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	83.34%	100.00%
FINANCE	9.07%	-
CONSOMMATION, CYCLIQUE	0.45%	-
MATÉRIAUX DE BASE	0.30%	-
INDUSTRIE	0.11%	-
SUPRANATIONAL	3.60%	-
LIQUIDITÉS	2.46%	-
COUVERTURE DE CHANGE	0.68%	-

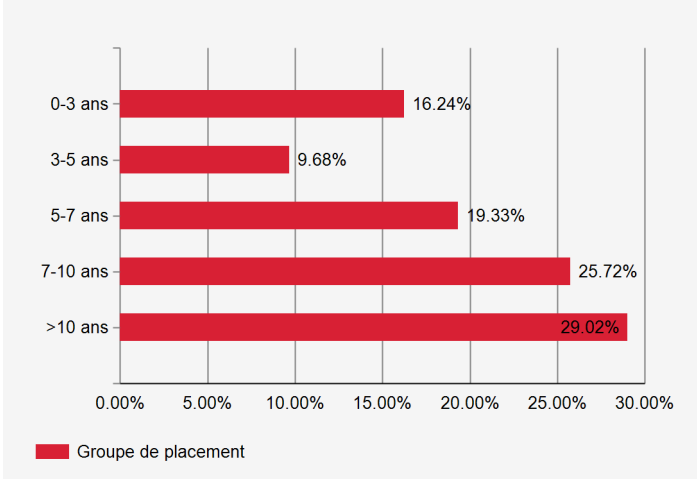
Débiteurs les plus importants et note

	Groupe de placement	
US Treasury N/B	AA+	29.23%
Japon	A+	17.56%
Italie	BBB-	6.11%
People's Republic of China	A+	5.27%
Royaume-Uni	AA-	4.44%

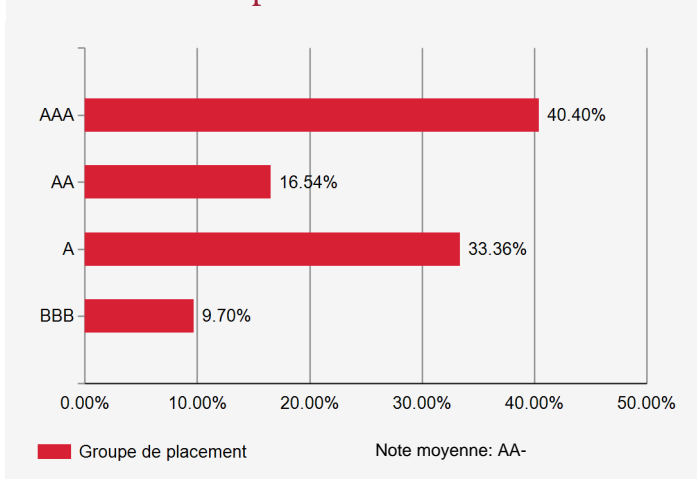
Indications supplémentaires sur les débiteurs

Nombre de débiteurs	77
Part de débiteurs hors du benchmark	0.92%

Structure de l'échéance des titres



Investissement par notes



Sensibilité et rendement à maturité

	Groupe de placement	Benchmark
Modified Duration	7.4	8.0
Rendement à l'échéance théorique*	1.71%	1.99%

* 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	32.26%	5.69	30.48%	6.38
EUR	30.21%	5.78	23.14%	7.83
JPY	18.01%	11.65	22.28%	9.59
GBP	7.79%	9.07	6.22%	11.71
Autres	11.74%	6.32	17.88%	6.95

Structure du portefeuille selon les pays/régions

	Groupe de placement	Benchmark
ÉTATS-UNIS	29.26%	30.48%
JAPON	18.46%	22.28%
ALLEMAGNE	6.72%	4.21%
ITALIE	6.10%	5.03%
CHINE	5.56%	7.81%
CANADA	4.91%	1.82%
ROYAUME-UNI	4.43%	6.22%
RÉGION EUROPÉENNE (EUR)	15.34%	13.52%
MARCHÉS ÉMERGENTS ASIE-PACIFIQUE	1.40%	2.91%
RÉGION ASIE ET PACIFIQUE	1.37%	1.58%
AUTRES	3.31%	4.13%
LIQUIDITÉS, COUVERTURE	3.14%	-