

Fondation de placement Swiss Life

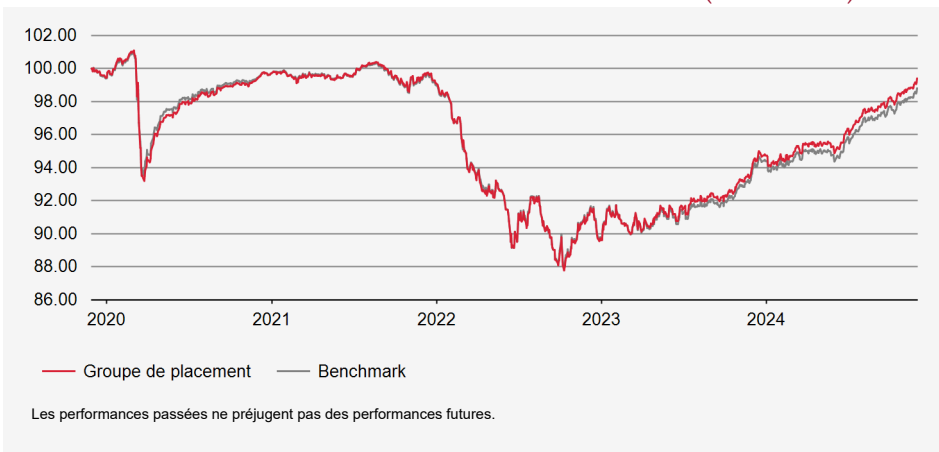
Obligations étrangères en CHF PM

Fortune nette (VNI) en mio. CHF : 345.67
Valeur nette d'inventaire par droit en CHF : 138.06

Stratégie d'investissement

Placement dans des titres de créance libellés en francs suisses et émis par des débiteurs essentiellement domiciliés à l'étranger. Sélection active des titres, contrôle de la duration et positionnement sur la courbe des taux. Limite par débiteur: 10%. Titres de créance de débiteurs hors benchmark: max. 20%. Note moyenne: A au minimum. Réalisation au moyen du Swiss Life iFunds (CH) Bond Swiss Francs Foreign (CHF); 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

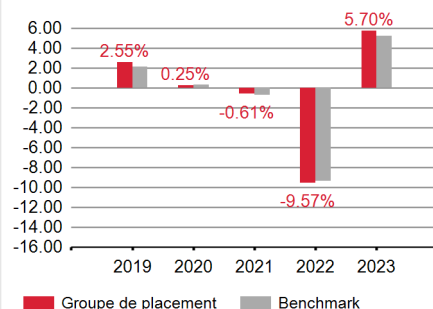
| | Performances cumulées | | | | Performances annualisées | | | |
|---------------------|-----------------------|--------|--------|-------|--------------------------|--------|--------|---------|
| | YTD | 1 mois | 3 mois | 1 an | 3 ans | 5 ans | 10 ans | Origine |
| Groupe de placement | 4.94% | 0.91% | 1.94% | 5.81% | -0.03% | -0.12% | 0.54% | 1.86% |
| Benchmark | 4.67% | 0.88% | 1.84% | 5.54% | -0.20% | -0.24% | 0.41% | 1.73% |

Données statistiques (annualisées)

| | 1 an | 3 ans | 5 ans | 10 ans | Origine |
|--|-------|--------|--------|--------|---------|
| Volatilité du groupe de placement (en %) | 1.94 | 3.90 | 4.47 | 3.41 | 3.46 |
| Volatilité du Benchmark (en %) | 1.97 | 3.87 | 4.26 | 3.27 | 3.24 |
| Tracking Error ex post (en %) | 0.11 | 0.25 | 0.34 | 0.32 | 0.95 |
| Information Ratio | 2.51 | 0.69 | 0.35 | 0.41 | 0.14 |
| Sharpe Ratio | 2.20 | -0.21 | -0.07 | 0.24 | 0.53 |
| Corrélation | 1.00 | 1.00 | 1.00 | 1.00 | 0.96 |
| Beta | 0.98 | 1.01 | 1.05 | 1.04 | 1.03 |
| Jensen alpha | 0.34 | 0.18 | 0.14 | 0.10 | 0.08 |
| Maximum Drawdown (en %) | -0.97 | -12.02 | -13.18 | -13.71 | -13.71 |
| Recovery Period (ans) | 0.15 | - | - | - | - |

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

Performance



Info. sur le produit

Numéro de valeur: 3026054
ISIN: CH0030260548
LEI: 2549002XPEQH1AZYBW05
Code Bloomberg: SLOCAPM SW
Benchmark: SBI Foreign AAA - BBB TR
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: 13h00
Protection antidilution:
 Commission d'émission / de rachat en faveur du groupe de placement selon l'aperçu des conditions.

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/fondationdeplacement

Taux des charges d'exploitation TER KGAST

au préalable: 0.08%

a posteriori au: 30/09/2024 0.08%

Fondation de placement Swiss Life

Obligations étrangères en CHF PM

Structure du portefeuille par branches

| | Groupe de placement | Benchmark |
|------------------------------|---------------------|-----------|
| Finance | 64.55% | 47.79% |
| État et Assimilé | 7.40% | 15.51% |
| Centrales de lettres de gage | 6.36% | 16.06% |
| Consommation, cyclique | 4.84% | 3.95% |
| Industrie | 3.81% | 5.36% |
| Services aux collectivités | 3.36% | 2.96% |
| Consommation, non cyclique | 3.22% | 4.17% |
| Energie | 0.98% | 1.46% |
| Supranational | 4.30% | - |
| Autres | 1.40% | 2.74% |
| Liquidités | -0.24% | - |

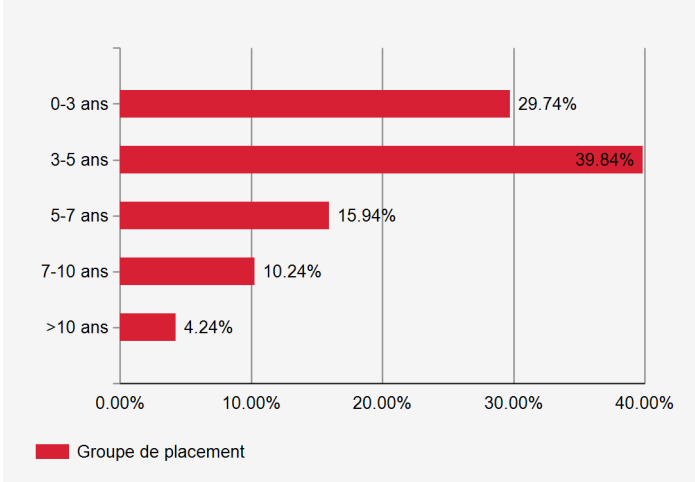
Débiteurs les plus importants et note

| | | Groupe de placement |
|----------------------------|-----|---------------------|
| Banco Santander SA, Madrid | A+ | 4.35% |
| Müchener Hypothekenbank | AA | 3.86% |
| Bank of Nova Scotia/The | AA | 3.61% |
| Groupe BPCE | AA- | 3.49% |
| Credit Agricole Group | AA- | 3.07% |

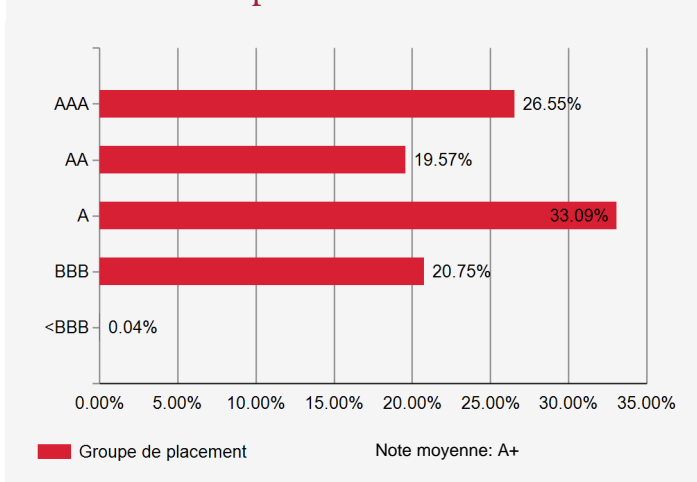
Indications supplémentaires sur les débiteurs

| | |
|-------------------------------------|-------|
| Nombre de débiteurs | 124 |
| Part de débiteurs hors du benchmark | 2.43% |

Structure de l'échéance des titres



Investissement par notes



Sensibilité et rendement à maturité

| | Groupe de placement | Benchmark |
|-----------------------------------|---------------------|-----------|
| Modified Duration | 4.2 | 4.2 |
| Rendement à l'échéance théorique* | 0.95% | 0.82% |

* avant couverture de change, en tenant compte des dérivés

Structure du portefeuille selon les pays/régions

| | Groupe de placement | Benchmark |
|-----------------------------|---------------------|-----------|
| France | 15.58% | 16.79% |
| Allemagne | 15.18% | 14.17% |
| Canada | 11.65% | 11.88% |
| États-Unis | 11.34% | 12.24% |
| Australie | 6.41% | 6.07% |
| Espagne | 5.81% | 4.57% |
| Royaume-Uni | 5.65% | 4.38% |
| Région Européenne (Ex EUR) | 7.71% | 6.56% |
| Marchés Émergents Amériques | 5.93% | 3.85% |
| Région Européenne (EUR) | 5.41% | 9.29% |
| Autres | 9.58% | 10.20% |
| Liquidités, couverture | -0.24% | - |