

Fondation de placement Swiss Life

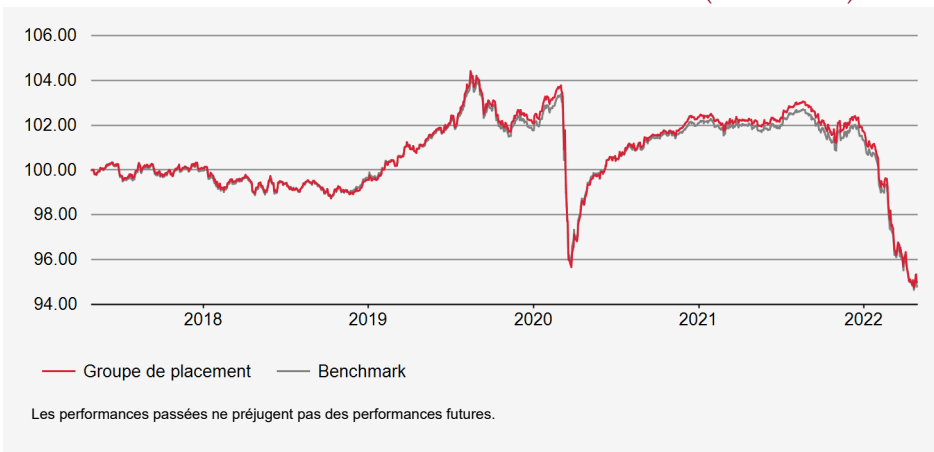
Obligations étrangères en CHF PM

Fortune nette (VNI) en mio. CHF : 333.63
Valeur nette d'inventaire par droit en CHF : 128.52

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 durée et positionnement sur la courbe des taux. Limite par débiteur: 10%. 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)



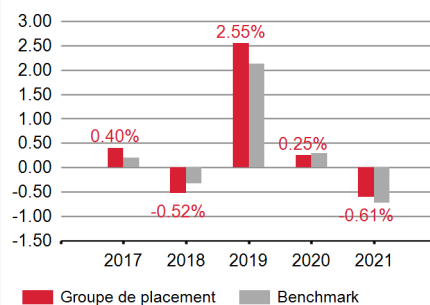
Performances en devise de référence

	PERFORMANCES CUMULÉES				PERFORMANCES ANNUELISÉES			
	YTD	1 MOIS	3 MOIS	1 AN	3 ANS	5 ANS	10 ANS	ORIGINE
GROUPE DE PLACEMENT	-6.62%	-1.11%	-5.58%	-6.94%	-2.05%	-1.02%	0.76%	1.70%
BENCHMARK	-6.47%	-1.15%	-5.50%	-6.95%	-2.11%	-1.06%	0.55%	1.59%

Données statistiques (annualisées)

	1 AN	3 ANS	5 ANS	10 ANS	ORIGINE
Volatilité du groupe de placement (en %)	3.60	4.95	3.91	3.09	3.46
Volatilité du Benchmark (en %)	3.58	4.64	3.69	2.93	3.21
Tracking Error ex post (en %)	0.32	0.42	0.34	0.37	1.02
Information Ratio	0.01	0.13	0.13	0.55	0.10
Sharpe Ratio	-1.82	-0.28	-0.07	0.42	0.53
Corrélation	1.00	1.00	1.00	0.99	0.96
Beta	1.00	1.06	1.06	1.05	1.04
Jensen alpha	0.01	0.15	0.06	0.15	0.04
Maximum Drawdown (en %)	-8.06	-9.25	-9.25	-9.25	-9.25
Recovery Period (ans)	-	-	-	-	-

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: 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/fondationdeplacement
Taux des charges d'exploitation TER KGAST au préalable: 0.08%
a posteriori au: 30/09/2021 0.08%

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.

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.

Structure du portefeuille par branches

	Groupe de placement	Benchmark
FINANCE	54.79%	48.77%
CENTRALES DE LETTRES DE GAGE	11.98%	9.10%
ENERGIE	4.86%	4.36%
CONSOMMATION, NON CYCLIQUE	3.90%	5.11%
COMMUNICATIONS	3.29%	3.33%
INDUSTRIE	3.05%	5.23%
ÉTAT ET ASSIMILÉ	2.92%	17.42%
SERVICES AUX COLLECTIVITÉS	2.61%	2.42%
SUPRANATIONAL	7.01%	-
AUTRES	3.74%	4.25%
LIQUIDITÉS	1.85%	-

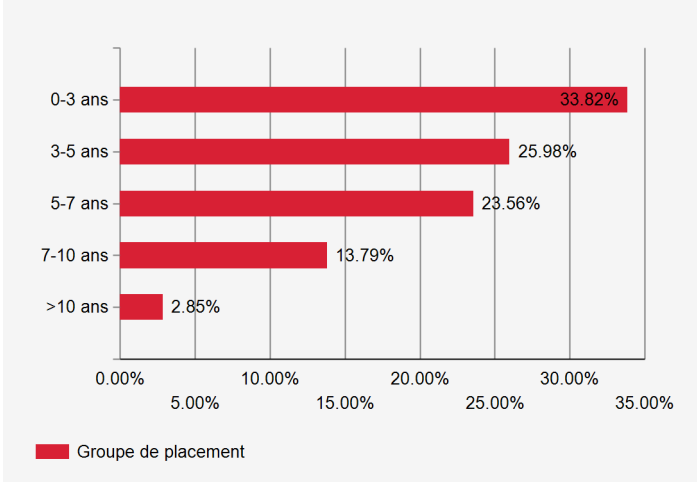
Débiteurs les plus importants et note

	Groupe de placement	
Banque de lettres de gage	AAA	4.28%
Müchener Hypothekenbank	AA	3.91%
Credit Agricole Group	AA-	3.35%
Bank of Nova Scotia/The	AA-	3.02%
Canadian Imperial Bank of Commerce	AA-	2.22%

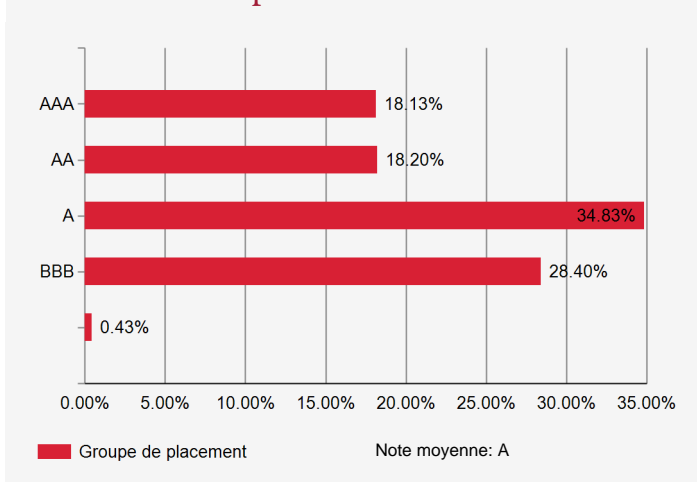
Indications supplémentaires sur les débiteurs

Nombre de débiteurs	129
Part de débiteurs hors du benchmark	10.73%

Structure de l'échéance des titres



Investissement par notes



Sensibilité et rendement à maturité

	Groupe de placement	Benchmark
Modified Duration	4.6	4.5
Rendement à l'échéance théorique*	1.59%	1.31%

* avant couverture de change, en tenant compte des dérivés

Structure du portefeuille selon les pays/régions

	Groupe de placement	Benchmark
ÉTATS-UNIS	17.95%	15.72%
FRANCE	13.44%	14.17%
SUISSE	10.25%	1.18%
AUSTRALIE	8.50%	8.25%
CANADA	8.41%	8.35%
ALLEMAGNE	8.09%	11.16%
ROYAUME-UNI	4.22%	4.02%
RÉGION EUROPÉENNE (EUR)	8.05%	18.80%
MARCHÉS ÉMERGENTS AMÉRIQUES	6.85%	5.61%
MARCHÉS ÉMERGENTS MOYEN-ORIENT	4.87%	2.02%
AUTRES	7.52%	10.74%
LIQUIDITÉS, COUVERTURE	1.85%	-