

Fondation de placement Swiss Life

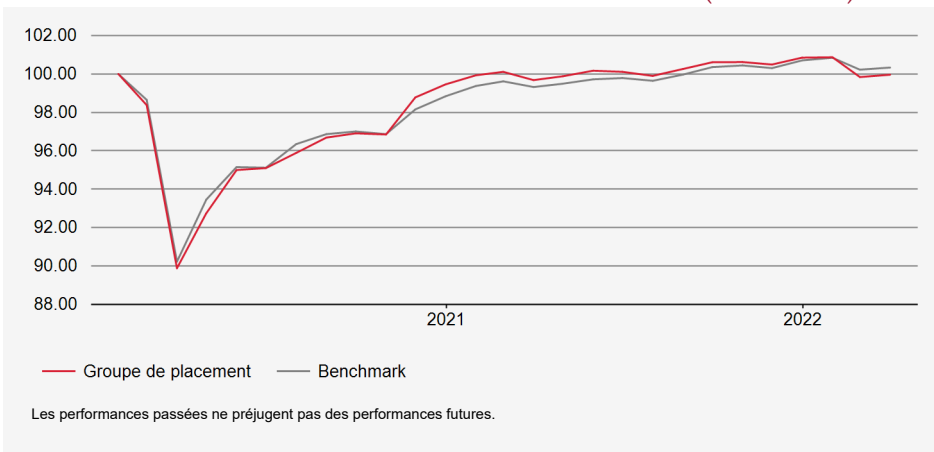
Senior Secured Loans PM (couvertes en CHF)

Fortune nette (VNI) en mio. CHF : 95.77
Valeur nette d'inventaire par droit en CHF : 99.76

Stratégie d'investissement

Le groupe de placement vise des rendements stables et élevés avec une volatilité des prix minimale et une durée de maturité courte. Le groupe de placement investit principalement dans des prêts privilégiés de premier rang garantis par des sociétés de pays développés. Au moins 85% seront investis dans des prêts garantis de premier rang. Limitation des débiteurs par entreprise: 5%. Au plus 25% sont investis dans le même groupe industriel. Risques de change par rapport au franc suisse sont couverts à au moins 90%. Réalisation au moyen du Swiss Life Loan Fund (LUX) S.A., SICAV-SIF Senior Secured Loans V AM-Shares (couvertes en CHF); fonds de placement de droit luxembourgeois.

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	-1.08%	-0.20%	-1.10%	-0.12%	-	-	-	-0.11%
BENCHMARK	-0.19%	0.18%	-0.32%	1.03%	-	-	-	0.23%

Données statistiques (annualisées)

	1 AN	3 ANS	5 ANS	10 ANS	ORIGINE
Volatilité du groupe de placement (en %)	1.34	-	-	-	6.92
Volatilité du Benchmark (en %)	0.98	-	-	-	6.75
Tracking Error ex post (en %)	0.53	-	-	-	0.87
Information Ratio	-2.18	-	-	-	-0.37
Sharpe Ratio	0.39	-	-	-	0.08
Corrélation	0.94	-	-	-	0.99
Beta	1.29	-	-	-	1.02
Jensen alpha	-1.63	-	-	-	-0.35
Maximum Drawdown (en %)	-1.10	-	-	-	-10.11
Recovery Period (ans)	-	-	-	-	0.91

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.

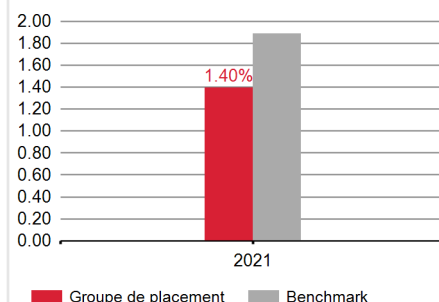
Délai final d'acceptation: Ultimo = dernier jour ouvrable bancaire du mois

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.

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: 51215723

ISIN: CH0512157238

LEI: 254900TFN2RL5B1QJ986

Code Bloomberg: SWSSLPM SW

Benchmark: 80% JPM US LL UT (CHFh)

20% JPM EU LL UT (CHFh)

Monnaie: CHF

Pays d'origine: Suisse

Date de création: 31/01/2020

Valeur de lancement: 100.00

Clôture de l'exercice: 30.09

Souscription/Rachat: mensuelle

Délai final d'acceptation: 14h30

Souscriptions: Ultimo -2

Rachats: Ultimo -5

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: 0.50%

a posteriori au: 30/09/2021 0.50%

Structure du portefeuille par branches

	Groupe de placement	Benchmark
SERVICES	12.61%	5.72%
SANTÉ	12.09%	13.04%
TECHNOLOGIE	9.56%	10.65%
CÂBLE ET SATELLITE	6.95%	8.45%
CHIMIE	6.83%	7.83%
ALIMENTATION ET BOISSONS	5.66%	2.88%
HOUSING	4.99%	3.00%
FINANCE	4.77%	5.03%
JEUX/LOISIRS	4.45%	9.17%
RADIODIFFUSION	4.22%	2.64%
AUTRES	25.41%	31.36%
LIQUIDITÉS	2.46%	-

Débiteurs les plus importants et note

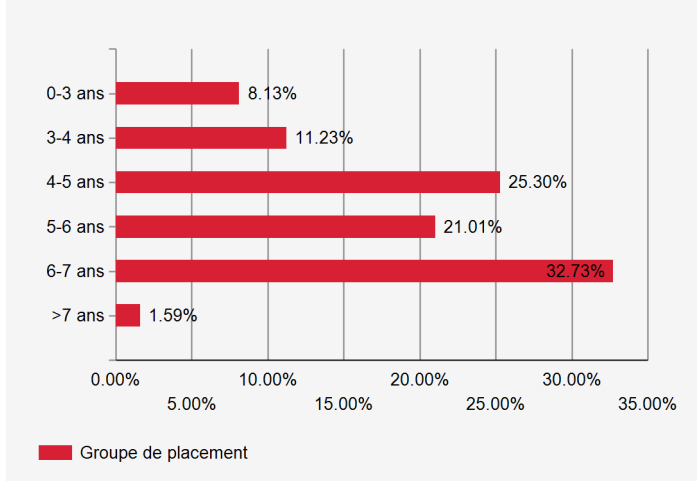
	Groupe de placement	
Altice USA	BB	1.85%
CenturyLink	BBB-	1.67%
Virgin/O2	BB-	1.47%
Belron	BB+	1.47%
Avantor	BB+	1.39%

Indications supplémentaires sur les débiteurs

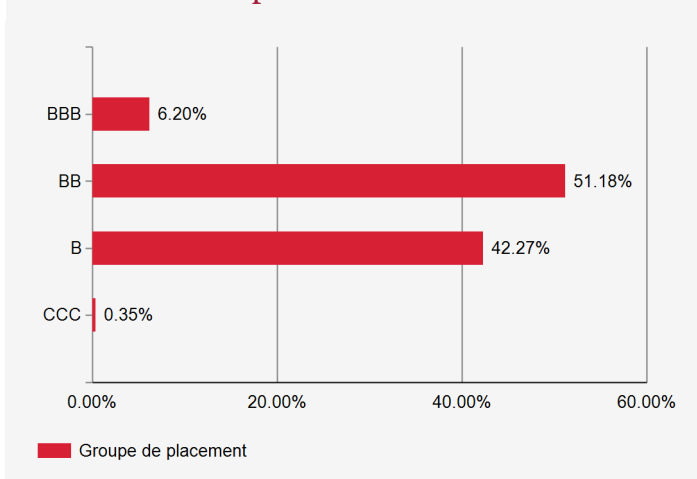
Nombre de débiteurs

249

Structure de l'échéance des titres



Investissement par notes



Structure du portefeuille par monnaies/rendements (sans liquidités)

	Groupe de placement		Benchmark	
	Poids	Rendements	Poids	Rendements
USD	61.56%	4.52%	80.00%	4.28%
EUR	38.44%	4.34%	20.00%	3.51%
Moyenne	-	4.45%	-	4.13%

Structure du portefeuille selon les pays/régions

	Groupe de placement	Benchmark
ÉTATS-UNIS	59.57%	81.46%
ROYAUME-UNI	10.16%	4.69%
PAYS-BAS	7.72%	1.87%
LUXEMBOURG	6.54%	0.54%
ALLEMAGNE	3.27%	1.01%
ESPAGNE	2.64%	1.07%
FRANCE	2.30%	0.31%
IRLANDE	1.90%	3.77%
BELGIQUE	1.51%	0.72%
SUÈDE	1.38%	-
AUTRES	0.56%	4.56%
LIQUIDITÉS	2.46%	-