



Fondation de placement Swiss Life

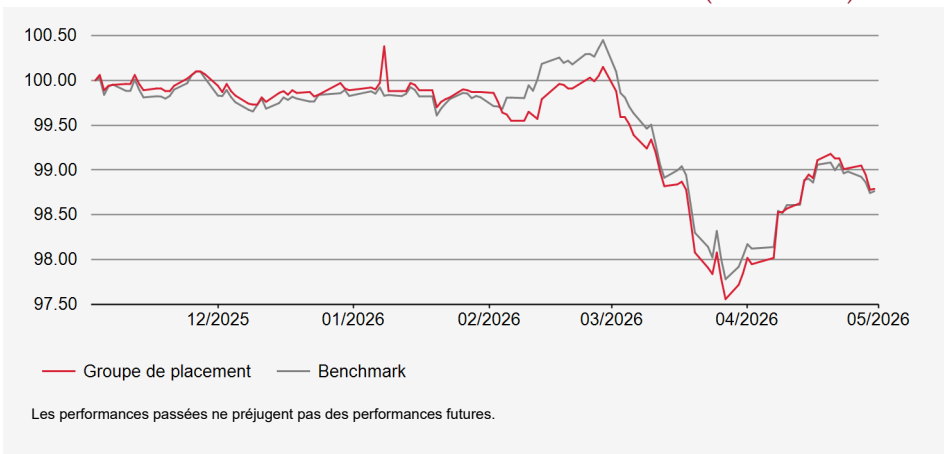
Obligations Marchés Emergents Entreprises SPM (couvertes en CHF)

Fortune nette (VNI) en mio. CHF : 360.40
Valeur nette d'inventaire par droit en CHF : 98.79

Stratégie d'investissement

Placements dans des titres de créance d'entreprises et d'Etats de pays émergents, y compris agences et organisations supranationales, libellés en dollars américains ou d'autres devises fortes. Sélection active de titres, gestion de la duration et positionnement sur la courbe des taux. Limitation des débiteurs: 10%. Titres de créance de débiteurs hors benchmark: max. 35%. Qualité moyenne de notation: BBB- minimum. Les risques de change sont couverts à au moins 90% par rapport au franc suisse. Mise en œuvre via l'utilisation du fonds Swiss Life Funds (LUX) Bond Emerging Markets Corporates CHF hedged AM Cap, un 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
Groupe de placement	-1.10%	0.96%	-1.08%	-	-	-	-	-
Benchmark	-1.06%	0.74%	-1.05%	-	-	-	-	-

Données statistiques (annualisées)

	1 an	3 ans	5 ans	10 ans	Origine
Volatilité du groupe de placement (en %)	-	-	-	-	3.85
Volatilité du Benchmark (en %)	-	-	-	-	3.98
Tracking Error ex post (en %)	-	-	-	-	0.67
Information Ratio	-	-	-	-	-0.03
Sharpe Ratio	-	-	-	-	-0.62
Corrélation	-	-	-	-	0.99
Beta	-	-	-	-	0.95
Jensen alpha	-	-	-	-	-0.06
Maximum Drawdown (en %)	-	-	-	-	-2.81
Recovery Period (ans)	-	-	-	-	-

Performance

Historique de données insuffisant

Info. sur le produit

Numéro de valeur: 148323397
ISIN: CH1483233974
LEI: 254900R4DORKK6JJUG51
Code Bloomberg: SLOEUCS SW
Benchmark: JP Morgan CEMBI Broad Diversified IG Index (CHF Hedged)
Monnaie: CHF
Pays d'origine: Suisse
Date de création: 03/11/2025
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.
Asset Management: Swiss Life Asset Management SA
Surveillance du gestionnaire de fortune: Surveillance par PPCmetrics des résultats de placement du gestionnaire de fortune engagé
Publication de cours: Bloomberg: ASSL
www.swisslife.ch/fondationdeplacement

SPM-Tranche: La tranche SPM est accessible aussi bien aux investisseurs ayant conclu une convention spéciale avec Swiss Life Asset Management SA (SLAM CH) qu'aux clients de gestion de fortune et à ceux des partenaires de coopération de SLAM CH (avec convention complémentaire).

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.

Fondation de placement Swiss Life

Obligations Marchés Emergents Entreprises SPM (couvertes en CHF)

Structure du portefeuille par branches

	Groupe de placement	Benchmark
Finance	34.16%	41.15%
Communications	14.39%	7.83%
Services aux collectivités	10.46%	9.56%
Energie	9.14%	9.69%
Consommation, non cyclique	8.17%	4.90%
Consommation, cyclique	6.00%	5.15%
Matériaux de base	5.34%	12.22%
Technologie	3.43%	4.06%
Supranational	1.19%	-
Autres	6.19%	5.44%
Liquidités	1.42%	-
Couverture de change	0.10%	-

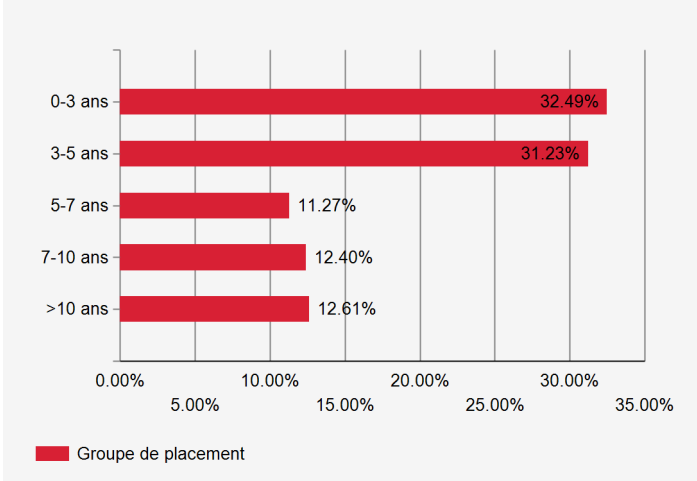
Débiteurs les plus importants et note

	Groupe de placement	
Erste Group Bank AG	BBB+	3.72%
Prosus NV	BBB	2.45%
Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd	AA-	2.09%
Genting Bhd	BBB-	2.06%
Petroliam Nasional Bhd	BBB+	1.70%

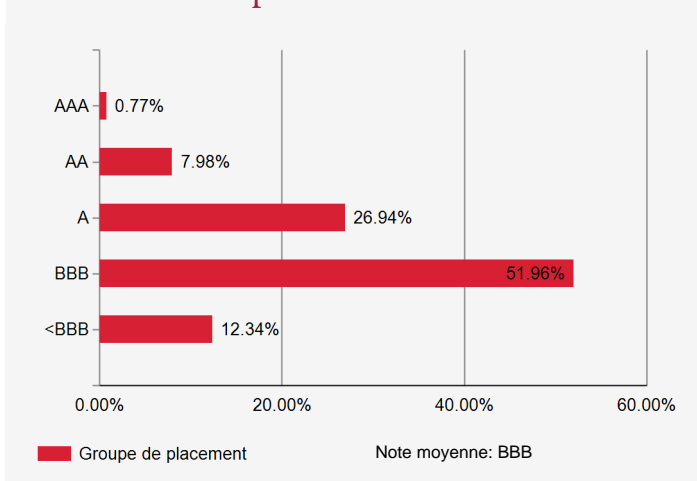
Indications supplémentaires sur les débiteurs

Nombre de débiteurs	148
Part de débiteurs hors du benchmark	30.64%

Structure de l'échéance des titres



Investissement par notes



Sensibilité et rendement à maturité

	Groupe de placement	Benchmark
Modified Duration	4.9	4.5
Rendement à l'échéance théorique*	5.40%	5.05%

* avant couverture de change

Structure du portefeuille selon les pays/régions

	Groupe de placement	Benchmark
Chine	7.89%	12.58%
Émirats arabes unis	7.32%	5.84%
Mexique	5.49%	4.20%
Singapour	5.46%	3.56%
Corée du Sud	5.16%	7.09%
Malaisie	4.65%	2.11%
Arabie saoudite	4.02%	6.45%
Marchés Émergents Asie-Pacifique	16.01%	19.43%
Marchés Émergents Amériques	12.78%	8.41%
Marchés Émergents Moyen-Orient	8.85%	11.35%
Autres	20.86%	18.99%
Liquidités, couverture	1.52%	-