31 mars 2026

Fondation de placement Swiss Life
Obligations Global Etats+ SPM (couvertes en CHF)

Fortune nette (VNI) en mio. CHF : 610.37
Valeur nette d'inventaire par droit en CHF : 97.78

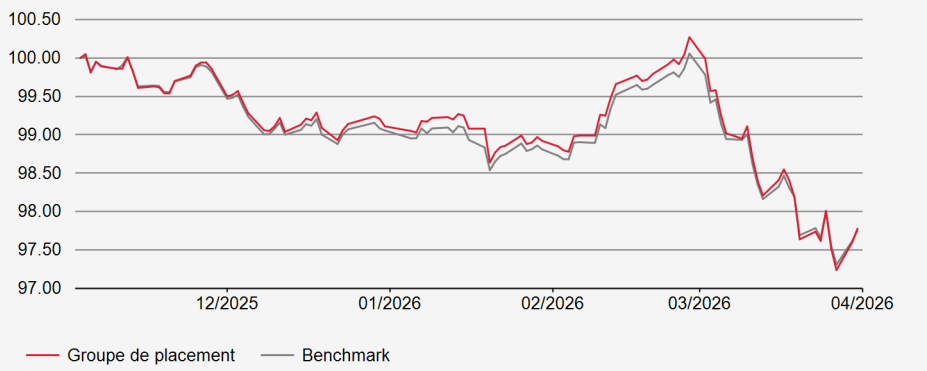
Stratégie d'investissement

Placement dans titres de créance d'Etats et d'institutions gouvernementales. Sélection active des titres, contrôle de la duration 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). Titres de créance de 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".

Performance

Historique de données insuffisant

Évolution de la valeur en devise de référence (base 100)



Les performances passées ne préjugent pas des performances futures.

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	-1.34%	-2.48%	-1.34%	-	-	-	-	-
Benchmark	-1.32%	-2.30%	-1.32%	-	-	-	-	-

Données statistiques (annualisées)

	1 an	3 ans	5 ans	10 ans	Origine
Volatilité du groupe de placement (en %)	-	-	-	-	4.83
Volatilité du Benchmark (en %)	-	-	-	-	4.47
Tracking Error ex post (en %)	-	-	-	-	0.38
Information Ratio	-	-	-	-	-0.02
Sharpe Ratio	-	-	-	-	-1.11
Corrélation	-	-	-	-	1.00
Beta	-	-	-	-	1.08
Jensen alpha	-	-	-	-	0.48
Maximum Drawdown (en %)	-	-	-	-	-3.02
Recovery Period (ans)	-	-	-	-	-

Info. sur le produit

Numéro de valeur: 148323395
ISIN: CH1483233958
LEI: 254900H7WEVS3K9ANR90
Code Bloomberg: SLOGSPM SW
Benchmark: BLOOMBERG GLOBAL AGG TREAS EX CHF TR HEDGED CHF
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).
Benchmark: Le benchmark a été modifié au 1er juillet 2012. Pour obtenir des informations sur l'ancien benchmark, veuillez vous adresser à la Fondation de placement Swiss Life
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.

31 mars 2026

Fondation de placement Swiss Life Obligations Global Etats+ SPM (couvertes en CHF)

Structure du portefeuille par branches

	Groupe de placement	Benchmark
État et Assimilé	85.73%	100.00%
Finance	5.16%	-
Centrales de lettres de gage	3.58%	-
Supranational	5.59%	-
Liquidités	2.21%	-
Couverture de change	-2.27%	-

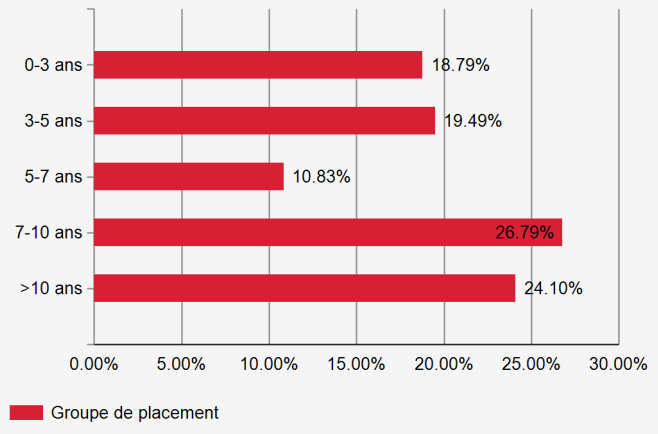
Débiteurs les plus importants et note

		Groupe de placement
Japon	A+	10.46%
US Treasury N/B	AA+	10.33%
Royaume-Uni	AA-	9.14%
People's Republic of China	A+	8.01%
Italie	BBB	6.22%

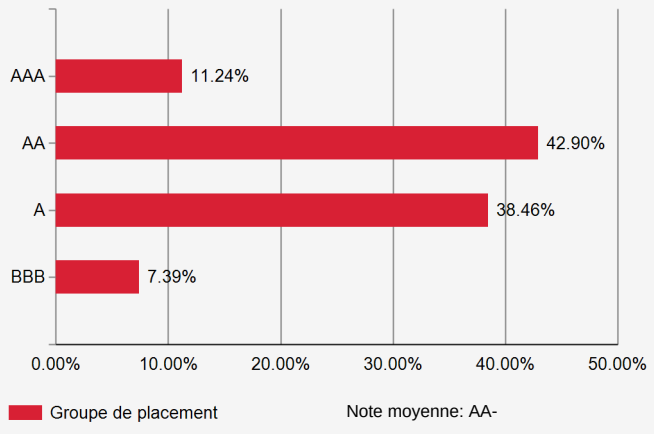
Indications supplémentaires sur les débiteurs

Nombre de débiteurs	61
Part de débiteurs hors du benchmark	0.00%

Structure de l'échéance des titres



Investissement par notes



Sensibilité et rendement à maturité

	Groupe de placement	Benchmark
Modified Duration	7.4	6.7
Rendement à l'échéance théorique*	3.29%	3.43%

* avant couverture de change

Structure du portefeuille selon les pays/régions

	Groupe de placement	Benchmark
Canada	14.60%	1.82%
Japon	11.68%	13.93%
États-Unis	11.45%	35.83%
Royaume-Uni	10.10%	5.48%
Chine	8.84%	11.13%
Italie	6.87%	4.99%
Espagne	5.26%	3.31%
Région Européenne (EUR)	16.70%	14.03%
Marchés Émergents Amériques	6.97%	0.84%
Région Européenne (Ex EUR)	3.95%	0.28%
Autres	3.64%	8.36%
Liquidités, couverture	-0.06%	-

Avertissement: La présente publication ne constitue ni une incitation ni une recommandation pour la vente ou l'achat d'instruments de placement, et son but est uniquement d'informer. Tous les documents constituant la base légale dans le cadre d'un éventuel placement peuvent être obtenus gratuitement auprès de la Fondation de placement Swiss Life, c/o Swiss Life SA, case postale, 8022 Zurich, tél. 043 547 71 11 et sur www.swisslife.ch/anlagestiftung. Le cercle des investisseurs est limité aux institutions du 2e pilier et du pilier 3a, ainsi que les autres institutions de prévoyance professionnelle exonérées d'impôts avec siège en Suisse et aux personnes qui gèrent des placements collectifs pour les institutions, qui sont soumises à la surveillance de l'Autorité fédérale de surveillance des marchés financiers FINMA et qui ne placent dans la fondation que des fonds destinés à ces institutions. La performance passée ne saurait présumer de l'évolution en cours ou à venir. Leur utilisation n'implique aucune adhésion ni affiliation de leur part. Ce document peut-être été créé à l'aide de intelligence artificielle. **Source:** Swiss Life Asset Managers. Tous droits réservés.