

30 avril 2026

Fondation de placement Swiss Life

Obligations étrangères en CHF SPM

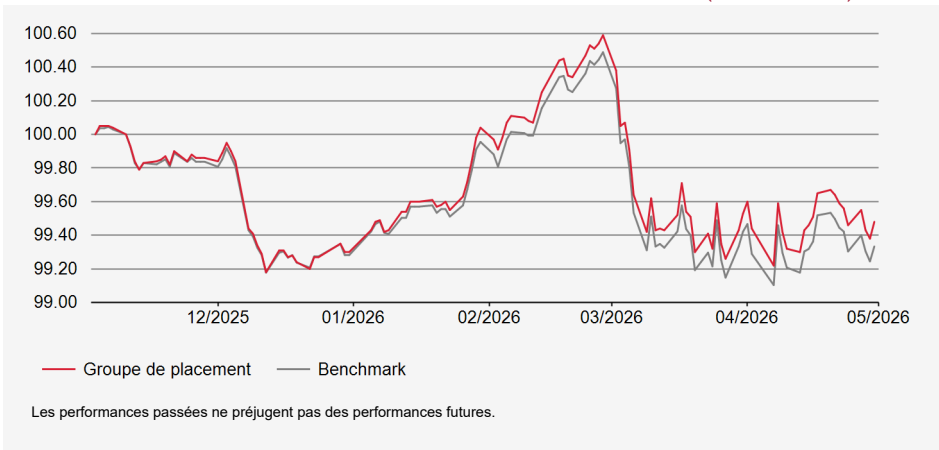


Fortune nette (VNI) en mio. CHF : 464.87
Valeur nette d'inventaire par droit en CHF : 99.48

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	0.18%	-0.05%	-0.56%	-	-	-	-	-
Benchmark	0.05%	-0.09%	-0.62%	-	-	-	-	-

Données statistiques (annualisées)

	1 an	3 ans	5 ans	10 ans	Origine
Volatilité du groupe de placement (en %)	-	-	-	-	2.33
Volatilité du Benchmark (en %)	-	-	-	-	2.27
Tracking Error ex post (en %)	-	-	-	-	0.09
Information Ratio	-	-	-	-	2.97
Sharpe Ratio	-	-	-	-	-0.43
Corrélation	-	-	-	-	1.00
Beta	-	-	-	-	1.03
Jensen alpha	-	-	-	-	0.33
Maximum Drawdown (en %)	-	-	-	-	-1.36
Recovery Period (ans)	-	-	-	-	-

Performance

Historique de données insuffisant

Info. sur le produit

Numéro de valeur: 148323392
ISIN: CH1483233925
LEI: 2549002XPEQH1AZYBW05
Code Bloomberg: SWILOSP SW
Benchmark: SBI Foreign AAA - BBB TR
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.

Structure du portefeuille par branches

	Groupe de placement	Benchmark
Finance	58.58%	44.17%
État et Assimilé	9.16%	20.29%
Consommation, non cyclique	5.97%	5.62%
Consommation, cyclique	5.62%	4.13%
Services aux collectivités	3.90%	3.53%
Centrales de lettres de gage	3.57%	10.75%
Industrial	3.22%	4.64%
Communications	2.66%	4.25%
Supranational	4.28%	-
Autres	3.04%	2.61%
Liquidités	-0.01%	-

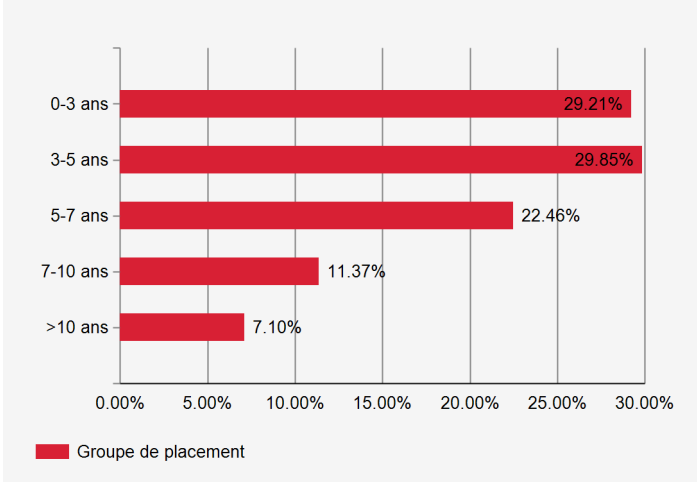
Débiteurs les plus importants et note

	Groupe de placement	
Credit Agricole Group	A+	4.04%
Groupe BPCE	AA	3.94%
Banco Santander SA, Madrid	A	3.51%
Müchener Hypothekenbank	AA-	2.68%
BNP Paribas SA, Paris	A-	2.11%

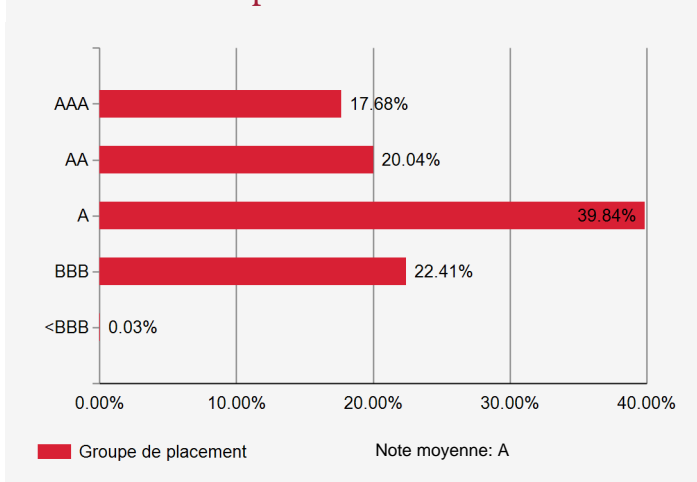
Indications supplémentaires sur les débiteurs

Nombre de débiteurs	138
Part de débiteurs hors du benchmark	1.24%

Structure de l'échéance des titres



Investissement par notes



Sensibilité et rendement à maturité

	Groupe de placement	Benchmark
Modified Duration	4.9	4.8
Rendement à l'échéance théorique*	1.07%	0.90%

* avant couverture de change

Structure du portefeuille selon les pays/régions

	Groupe de placement	Benchmark
France	17.06%	15.38%
Allemagne	16.80%	14.73%
États-Unis	15.98%	15.81%
Canada	10.57%	11.69%
Australie	5.96%	5.26%
Espagne	5.15%	3.81%
Royaume-Uni	3.82%	3.12%
Marchés Émergents Amériques	6.73%	3.18%
Région Européenne (EUR)	5.86%	11.69%
Région Européenne (Ex EUR)	4.11%	5.51%
Autres	7.98%	9.82%
Liquidités, couverture	-0.01%	-