

# Fondation de placement Swiss Life

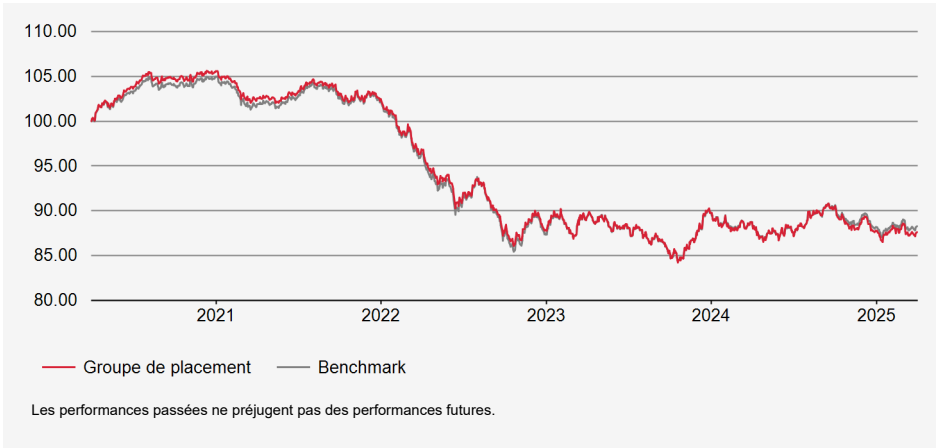
## Obligations Global Aggregate (couvertes en CHF)

**Fortune nette (VNI) en mio. CHF : 67.25**  
**Valeur nette d'inventaire par droit en CHF : 116.78**

### Stratégie d'investissement

Placement dans des titres de créance émis par des débiteurs domiciliés en Suisse ou à l'étranger (dès le 1.1.2011 couvertes en CHF). 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 Aggregate (CHF hedged); 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

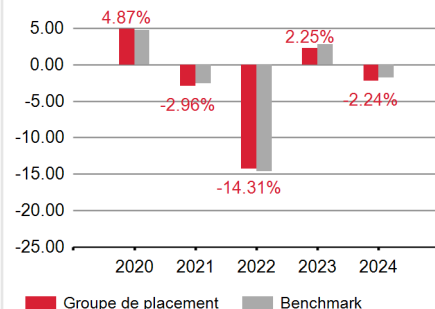
	Performances cumulées				Performances annualisées			
	YTD	1 mois	3 mois	1 an	3 ans	5 ans	10 ans	Origine
Groupe de placement	-0.15%	-1.08%	-0.15%	-1.24%	-3.28%	-2.60%	-1.00%	0.66%
Benchmark	0.12%	-0.84%	0.12%	-0.53%	-2.92%	-2.46%	-0.78%	0.78%

### Données statistiques (annualisées)

	1 an	3 ans	5 ans	10 ans	Origine
Volatilité du groupe de placement (en %)	4.54	5.88	5.14	4.30	5.38
Volatilité du Benchmark (en %)	4.24	6.06	5.26	4.36	5.53
Tracking Error ex post (en %)	0.46	0.58	0.52	0.57	1.39
Information Ratio	-1.56	-0.62	-0.28	-0.40	-0.07
Sharpe Ratio	-0.49	-0.72	-0.57	-0.17	0.08
Corrélation	1.00	1.00	1.00	0.99	0.97
Beta	1.07	0.97	0.97	0.98	0.94
Jensen alpha	-0.61	-0.49	-0.22	-0.24	-0.08
Maximum Drawdown (en %)	-4.73	-13.03	-20.24	-20.24	-20.24
Recovery Period (ans)	-	-	-	-	-

**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  
**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.  
**Protection antidilution:** Aperçu des conditions disponible à l'adresse: [www.swisslife.ch/fondationdeplacement](http://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.

### Performance



### Info. sur le produit

**Numéro de valeur:** 1245479  
**ISIN:** CH0012454796  
**LEI:** 254900F82G5L48XPDV74  
**Code Bloomberg:** SWAOBFG SW  
**Benchmark:** BLOOMBERG GLO AGG EX SEC EX CNY HEDGED CHF  
**Monnaie:** CHF  
**Pays d'origine:** Suisse  
**Date de création:** 30/09/2001  
**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.

**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](http://www.swisslife.ch/fondationdeplacement)

**Taux des charges d'exploitation TER KGAST**

**au préalable:** 0.44%

**a posteriori au:** 30/09/2024 0.46%

# Fondation de placement Swiss Life

## Obligations Global Aggregate (couvertes en CHF)

### Structure du portefeuille par branches

	Groupe de placement	Benchmark
État et Assimilé	45.93%	72.41%
Finance	21.57%	11.67%
Consommation, non cyclique	6.54%	3.97%
Consommation, cyclique	3.13%	1.76%
Communications	2.84%	1.89%
Services aux collectivités	2.84%	2.74%
Technologie	2.61%	1.15%
Energie	1.58%	1.69%
Supranational	7.18%	-
Autres	1.50%	2.71%
Liquidités	4.55%	-
Couverture de change	-0.26%	-

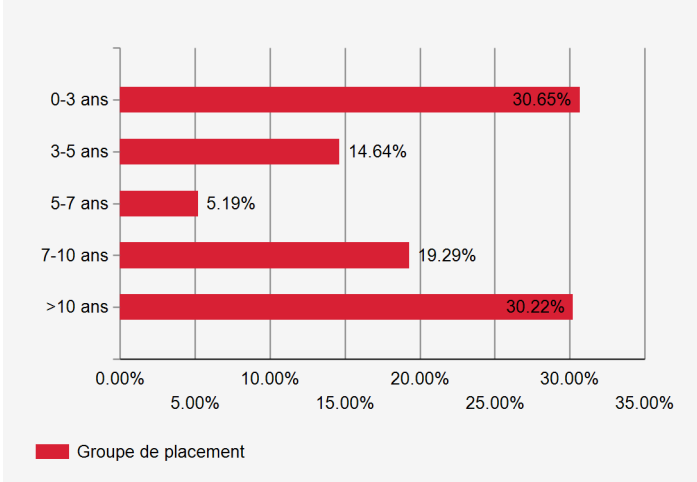
### Débiteurs les plus importants et note

	Groupe de placement	
Japon	A+	16.64%
US Treasury N/B	AAA	7.73%
Italie	BBB	3.62%
European Union	AA+	3.39%
Corp Andina de Fomento	AA-	2.39%

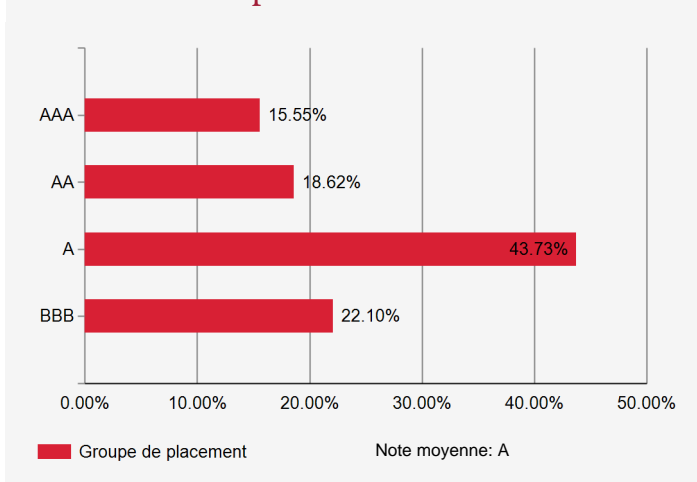
### Indications supplémentaires sur les débiteurs

Nombre de débiteurs	122
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	7.0	6.6
Rendement à l'échéance théorique*	3.91%	3.85%

\* avant couverture de change, en tenant compte des dérivés

### Structure du portefeuille selon les pays/régions

	Groupe de placement	Benchmark
États-Unis	25.61%	38.52%
Japon	19.62%	12.87%
Canada	7.63%	4.36%
France	6.59%	6.03%
Allemagne	5.12%	5.78%
Italie	5.05%	4.00%
Royaume-Uni	4.99%	5.26%
Région Européenne (EUR)	10.99%	8.86%
Marchés Émergents Amériques	3.94%	0.04%
Région Européenne (Ex EUR)	3.11%	1.27%
Autres	3.08%	13.02%
Liquidités, couverture	4.29%	-