

# Fondation de placement Swiss Life

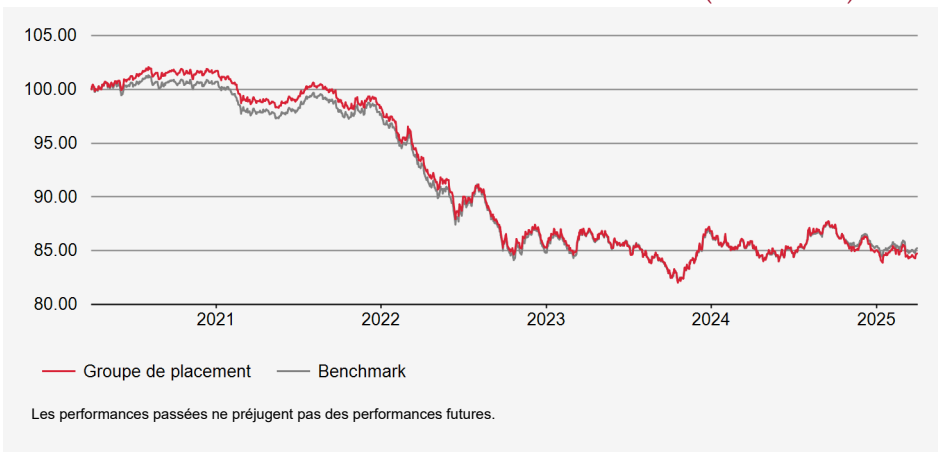
## Obligations Global Etats+ (couvertes en CHF)

**Fortune nette (VNI) en mio. CHF : 787.23**  
**Valeur nette d'inventaire par droit en CHF : 104.85**

### 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".

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



### Performances en devise de référence

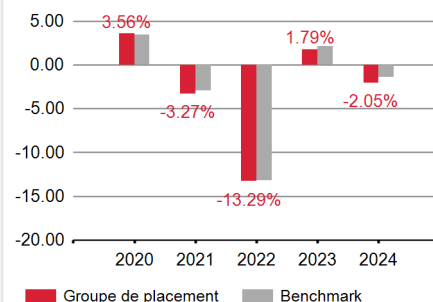
	Performances cumulées				Performances annualisées			
	YTD	1 mois	3 mois	1 an	3 ans	5 ans	10 ans	Origine
Groupe de placement	-0.35%	-0.95%	-0.35%	-1.33%	-3.30%	-3.25%	-1.32%	0.33%
Benchmark	-0.21%	-0.82%	-0.21%	-0.66%	-2.90%	-3.14%	-1.02%	0.41%

### Données statistiques (annualisées)

	1 an	3 ans	5 ans	10 ans	Origine
Volatilité du groupe de placement (en %)	4.04	5.02	4.32	3.69	3.59
Volatilité du Benchmark (en %)	3.68	5.05	4.35	3.77	3.53
Tracking Error ex post (en %)	0.44	0.57	0.54	0.59	0.69
Information Ratio	-1.53	-0.70	-0.21	-0.50	-0.12
Sharpe Ratio	-0.57	-0.85	-0.83	-0.29	0.14
Corrélation	1.00	0.99	0.99	0.99	0.98
Beta	1.10	0.99	0.99	0.97	1.00
Jensen alpha	-0.51	-0.45	-0.16	-0.32	-0.08
Maximum Drawdown (en %)	-4.39	-12.48	-19.62	-20.00	-20.00
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:** 11955694  
**ISIN:** CH0119556949  
**LEI:** 254900H7WEVS3K9ANR90  
**Code Bloomberg:** SWLGSTP SW  
**Benchmark:** BLOOMBERG GLOBAL AGG TREAS EX CHF TR HEDGED CHF  
**Monnaie:** CHF  
**Pays d'origine:** Suisse  
**Date de création:** 14/12/2010  
**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:** 0.40%

**a posteriori au:** 30/09/2024 0.42%

# Fondation de placement Swiss Life

## Obligations Global Etats+ (couvertes en CHF)

### Structure du portefeuille par branches

	Groupe de placement	Benchmark
État et Assimilé	77.06%	100.00%
Finance	6.57%	-
Centrales de lettres de gage	2.75%	-
Supranational	4.29%	-
Liquidités	9.89%	-
Couverture de change	-0.55%	-

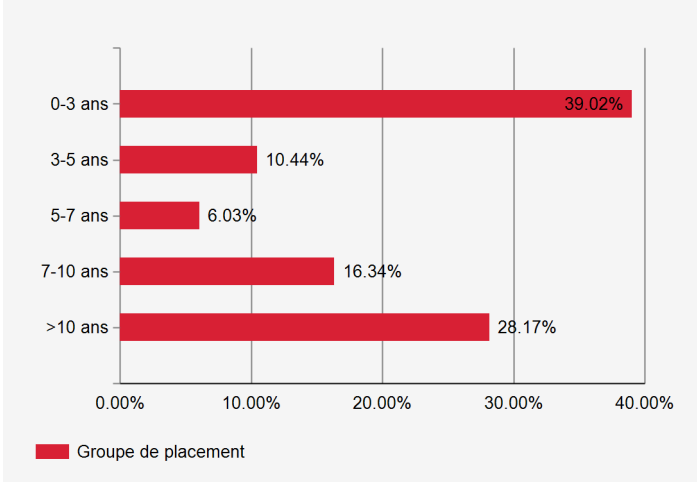
### Débiteurs les plus importants et note

	Groupe de placement	
Japon	A+	20.13%
US Treasury N/B	AAA	14.82%
Royaume-Uni	AA-	6.17%
People's Republic of China	A+	6.13%
Italie	BBB-	5.27%

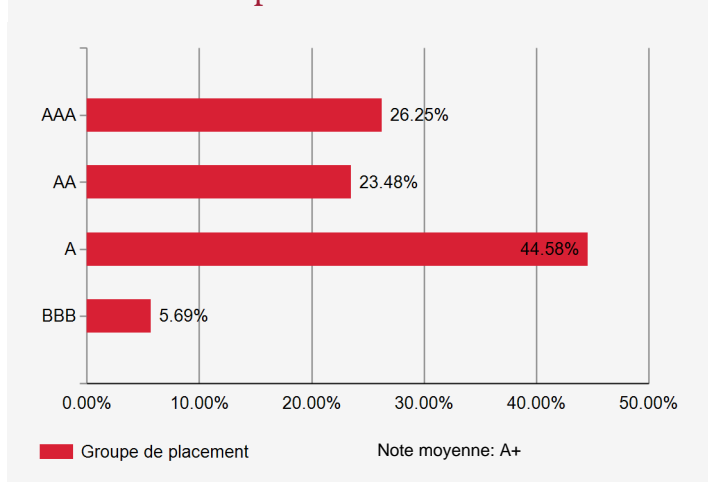
### Indications supplémentaires sur les débiteurs

Nombre de débiteurs	61
Part de débiteurs hors du benchmark	2.53%

### Structure de l'échéance des titres



### Investissement par notes



### Sensibilité et rendement à maturité

	Groupe de placement	Benchmark
Modified Duration	7.2	7.1
Rendement à l'échéance théorique*	3.30%	3.30%

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

### Structure du portefeuille par monnaies et durations

	Groupe de placement		Benchmark	
	Poids	Duration	Poids	Duration
JPY	25.64%	8.17	16.87%	8.68
EUR	23.11%	11.40	22.61%	6.92
USD	23.04%	13.71	35.18%	5.80
Autres	28.21%	8.36	25.33%	7.46

### Structure du portefeuille selon les pays/régions

	Groupe de placement	Benchmark
Japon	22.10%	16.87%
États-Unis	16.13%	35.18%
Royaume-Uni	6.70%	5.23%
Chine	6.66%	9.88%
Italie	5.72%	5.01%
France	5.54%	5.34%
Espagne	3.84%	3.26%
Région Européenne (EUR)	11.22%	7.87%
Marchés Émergents Amériques	3.85%	0.12%
Région Européenne (Ex EUR)	3.61%	0.43%
Autres	5.30%	10.81%
Liquidités, couverture	9.33%	-