

Fondation de placement Swiss Life

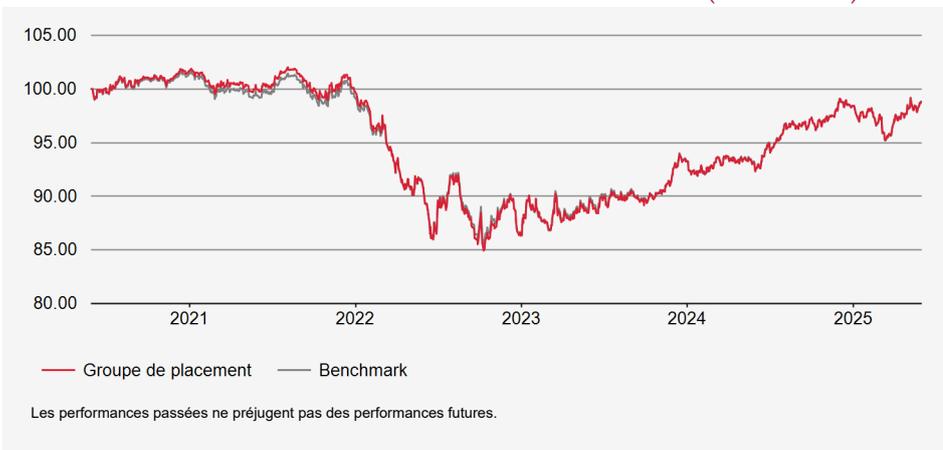
Obligations suisses en CHF

Fortune nette (VNI) en mio. CHF : 1,009.57
Valeur nette d'inventaire par droit en CHF : 170.37

Stratégie d'investissement

Placements dans des titres de créance libellés en francs suisses, émis par des débiteurs principalement domiciliés en Suisse. Sélection active des titres, contrôle de la duration et positionnement sur la courbe des taux. Limitation des débiteurs: 10% (exceptions: jusqu'au 25% dans chaque centrale d'émission des lettres de gages, Confédération Suisse sans limitation). Débiteurs hors de l'indice de réf.: max. 10%. Note moyenne: A+ au minimum. Réalisation au moyen du Swiss Life iFunds (CH) Bond Swiss Francs Domestic (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)



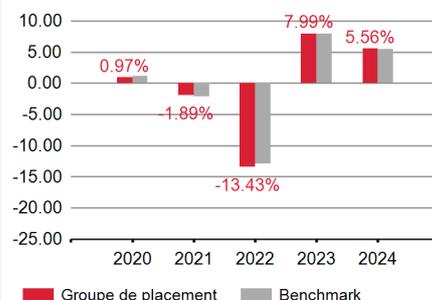
Performances en devise de référence

	Performances cumulées				Performances annualisées			
	YTD	1 mois	3 mois	1 an	3 ans	5 ans	10 ans	Origine
Groupe de placement	0.38%	0.33%	1.22%	6.86%	3.04%	-0.24%	0.25%	2.28%
Benchmark	0.41%	0.33%	1.28%	6.79%	3.03%	-0.23%	0.33%	2.36%

Données statistiques (annualisées)

	1 an	3 ans	5 ans	10 ans	Origine
Volatilité du groupe de placement (en %)	3.64	5.35	5.00	4.71	3.79
Volatilité du Benchmark (en %)	3.67	5.23	4.88	4.56	3.77
Tracking Error ex post (en %)	0.11	0.39	0.35	0.36	0.44
Information Ratio	0.56	0.02	-0.02	-0.23	-0.17
Sharpe Ratio	1.61	0.38	-0.11	0.10	0.54
Corrélation	1.00	1.00	1.00	1.00	0.99
Beta	0.99	1.02	1.02	1.03	1.00
Jensen alpha	0.12	-0.03	0.01	-0.10	-0.08
Maximum Drawdown (en %)	-3.88	-7.65	-16.75	-19.71	-19.71
Recovery Period (ans)	0.15	1.14	-	-	-

Performance



Info. sur le produit

Numéro de valeur: 1239071
ISIN: CH0012390719
LEI: 254900M0YGKYAE29FA28
Code Bloomberg: SWAOBIN SW
Benchmark: SBI Domestic AAA - BBB TR
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.

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
Taux des charges d'exploitation TER KGAST
au préalable: 0.26%
a posteriori au: 30/09/2024 0.27%

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, «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
Centrales de lettres de gage	35.06%	39.23%
Finance	27.46%	16.41%
État et Assimilé	20.26%	29.34%
Consommation, non cyclique	6.66%	7.32%
Services aux collectivités	3.77%	2.34%
Industrial	3.47%	2.85%
Consommation, cyclique	1.09%	0.40%
Communications	0.40%	0.91%
Autres	0.30%	1.22%
Liquidités	1.52%	-

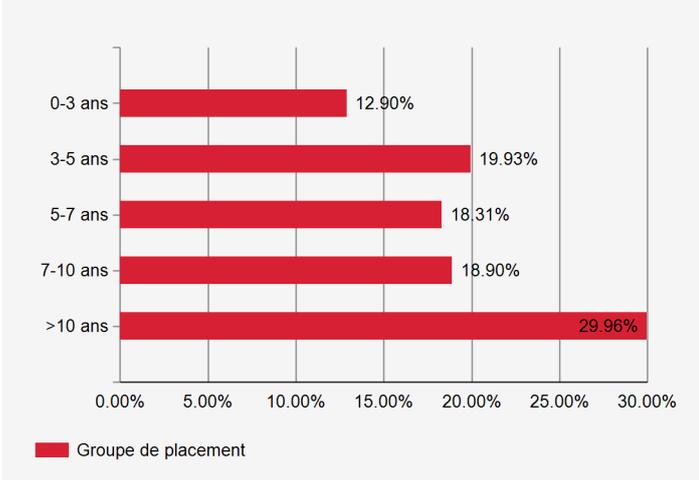
Débiteurs les plus importants et note

	Groupe de placement	
Banque de lettres de gage	AAA	19.25%
Centrale de lettres de gage	AAA	15.63%
Confédération	AAA	13.44%
Banque cantonale de Zurich	AA+	2.49%
UBS Group AG	AA-	2.05%

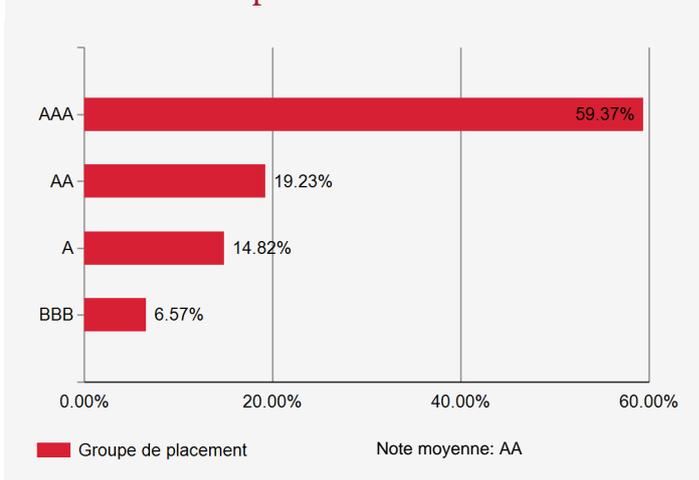
Indications supplémentaires sur les débiteurs

Nombre de débiteurs	125
Part de débiteurs hors du benchmark	0.12%

Structure de l'échéance des titres



Investissement par notes



Sensibilité et rendement à maturité

	Groupe de placement	Benchmark
Modified Duration	8.1	7.9
Rendement à l'échéance théorique*	0.73%	0.64%

* avant couverture de change, en tenant compte des dérivés