

Fondation de placement Swiss Life

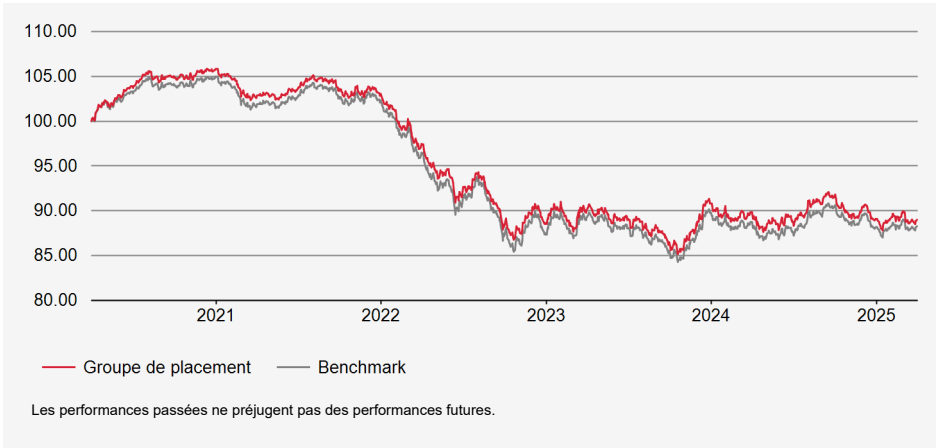
Obligations Global Aggregate PM (couvertes en CHF)

Fortune nette (VNI) en mio. CHF : 67.25
Valeur nette d'inventaire par droit en CHF : 117.70

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 durée 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 | -0.08% | -1.06% | -0.08% | -0.93% | -2.98% | -2.30% | -0.69% | 0.92% |
| Benchmark | 0.12% | -0.84% | 0.12% | -0.53% | -2.92% | -2.46% | -0.78% | 0.68% |

Données statistiques (annualisées)

| | 1 an | 3 ans | 5 ans | 10 ans | Origine |
|--|-------|--------|--------|--------|---------|
| Volatilité du groupe de placement (en %) | 4.53 | 5.88 | 5.13 | 4.30 | 5.59 |
| Volatilité du Benchmark (en %) | 4.24 | 6.06 | 5.26 | 4.36 | 5.58 |
| Tracking Error ex post (en %) | 0.45 | 0.58 | 0.52 | 0.56 | 1.36 |
| Information Ratio | -0.89 | -0.11 | 0.30 | 0.14 | 0.17 |
| Sharpe Ratio | -0.42 | -0.67 | -0.51 | -0.10 | 0.16 |
| Corrélation | 1.00 | 1.00 | 1.00 | 0.99 | 0.97 |
| Beta | 1.07 | 0.97 | 0.97 | 0.98 | 0.97 |
| Jensen alpha | -0.30 | -0.19 | 0.08 | 0.07 | 0.25 |
| Maximum Drawdown (en %) | -4.63 | -12.61 | -19.52 | -19.52 | -19.52 |
| Recovery Period (ans) | - | - | - | - | - |

PM tranche: L'acquisition de cette tranche n'est possible que dans le cadre d'une convention spéciale avec Swiss Life Asset Management SA.

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.

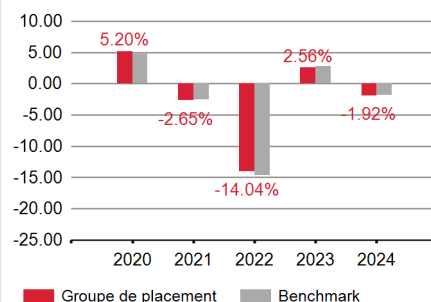
Taux des charges d'exploitation TER KGAST: Le taux des charges d'exploitation TER KGAST couvre tous les coûts à l'exception des frais de transaction et des prélèvements fiscaux sur les transactions.

Protection antidilution: Aperçu des conditions disponible à l'adresse: www.swisslife.ch/fondationdeplacement, «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.

Performance



Info. sur le produit

Numéro de valeur: 3026055

ISIN: CH0030260555

LEI: 254900F82G5L48XPDV74

Code Bloomberg: SLOFGPM SW

Benchmark: BLOOMBERG GLO AGG EX SEC EX CNY HEDGED CHF

Monnaie: CHF

Pays d'origine: Suisse

Date de création: 31/05/2007

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

Taux des charges d'exploitation TER KGAST

au préalable: 0.15%

a posteriori au: 30/09/2024 0.15%

Fondation de placement Swiss Life

Obligations Global Aggregate PM (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% | - |

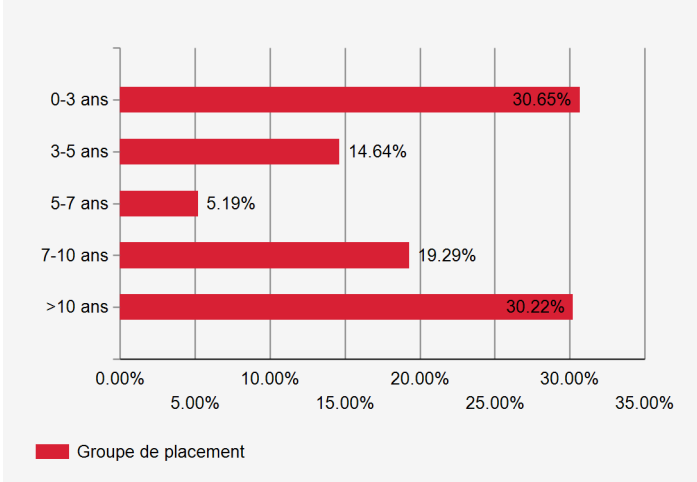
Débiteurs les plus importants et note

| | 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% |

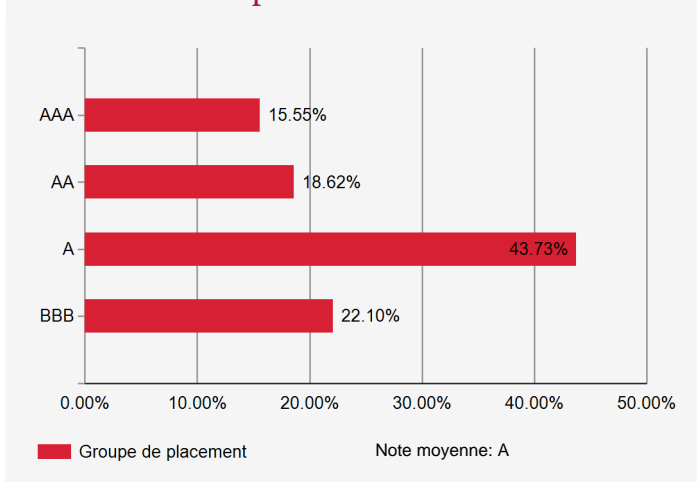
Indications supplémentaires sur les débiteurs

| | |
|-------------------------------------|-------|
| 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% | - |