

31 juillet 2025

Fondation de placement Swiss Life

Obligations Marchés Emergents Entreprises PM (couvertes en CHF)



SwissLife

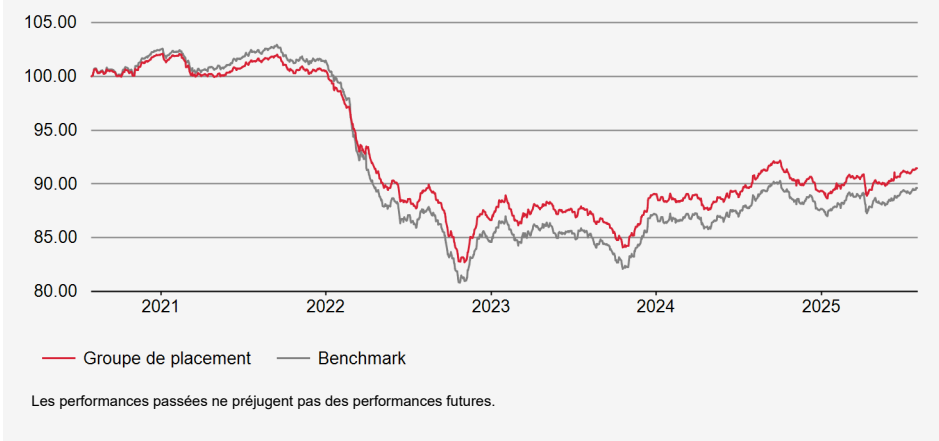
Fortune nette (VNI) en mio. CHF : 354.14

Valeur nette d'inventaire par droit en CHF : 97.60

Stratégie d'investissement

Placements dans des titres de créance d'entreprises et d'Etats de pays émergents, y compris agences et organisations supranationales, libellés en dollars américains ou d'autres devises fortes. Sélection active de titres, gestion de la duration et positionnement sur la courbe des taux. Limitation des débiteurs: 10%. Titres de créance de débiteurs hors benchmark: max. 35%. Qualité moyenne de notation: BBB- minimum. Les risques de change sont couverts à au moins 90% par rapport au franc suisse. Mise en œuvre via l'utilisation du fonds Swiss Life Funds (LUX) Bond Emerging Markets Corporates CHF hedged AM Cap, un fonds de placement de droit luxembourgeois

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	2.36%	0.31%	1.22%	1.49%	0.85%	-1.77%	-	-0.31%
Benchmark	2.25%	0.29%	1.07%	1.60%	0.82%	-2.16%	-	-0.45%

Données statistiques (annualisées)

	1 an	3 ans	5 ans	10 ans	Origine
Volatilité du groupe de placement (en %)	3.25	5.38	5.00	-	5.38
Volatilité du Benchmark (en %)	3.31	5.47	5.41	-	5.89
Tracking Error ex post (en %)	0.43	0.48	1.04	-	1.02
Information Ratio	-0.27	0.07	0.38	-	0.14
Sharpe Ratio	0.28	-0.03	-0.43	-	-0.04
Corrélation	0.99	1.00	0.98	-	0.99
Beta	0.98	0.98	0.91	-	0.90
Jensen alpha	-0.09	0.03	0.16	-	0.10
Maximum Drawdown (en %)	-3.82	-8.02	-18.98	-	-18.98
Recovery Period (ans)	-	1.74	-	-	-

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

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.

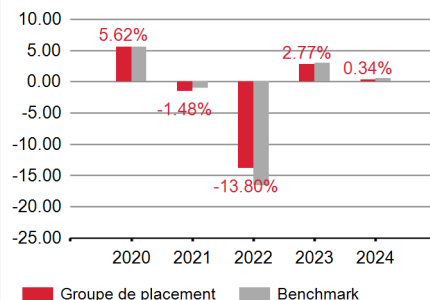
Protection antidilution: Aperçu des conditions disponible à l'adresse: www.swisslife.ch/fondationdeplacement, «Documents juridiques» (modifications possibles à tout moment sans préavis).

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.

Performance



Info. sur le produit

Numéro de valeur: 36974878

ISIN: CH0369748782

LEI: 254900R4DORKK6JJUG51

Code Bloomberg: SLOEMPM SW

Benchmark: JP Morgan CEMBI Broad Diversified IG Index (CHF Hedged)

Monnaie: CHF

Pays d'origine: Suisse

Date de création: 29/09/2017

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: 0.28%

a posteriori au: 30/09/2024 0.28%

Fondation de placement Swiss Life

Obligations Marchés Emergents Entreprises PM (couvertes en CHF)

Structure du portefeuille par branches

	Groupe de placement	Benchmark
Finance	32.47%	37.97%
Communications	12.48%	8.53%
Services aux collectivités	11.33%	10.82%
Consommation, non cyclique	10.49%	4.73%
Energie	9.46%	11.39%
Consommation, cyclique	4.95%	5.77%
Matériaux de base	4.86%	10.49%
Technologie	4.58%	4.86%
Supranational	1.25%	-
Autres	9.43%	5.43%
Liquidités	0.78%	-
Couverture de change	-2.06%	-

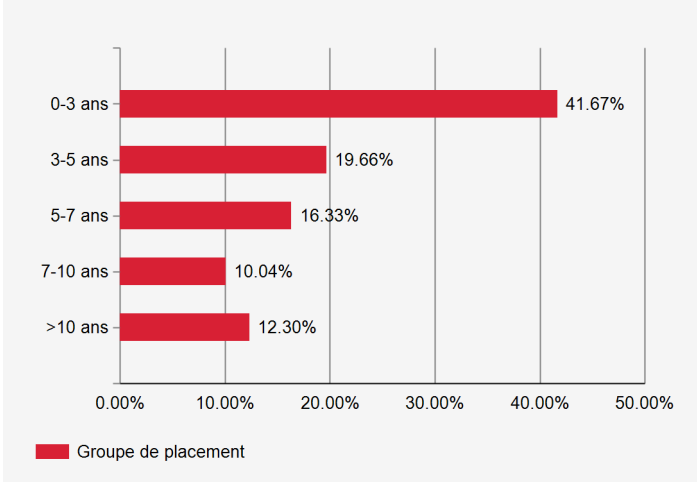
Débiteurs les plus importants et note

	Groupe de placement	
Taiwan Semiconductor Manufacturing Co Ltd	AA-	3.30%
US Treasury N/B	AA+	3.13%
Prosus NV	BBB	2.43%
OTP Bank Nyrt	BBB-	1.95%
Erste Group Bank AG	BBB+	1.87%

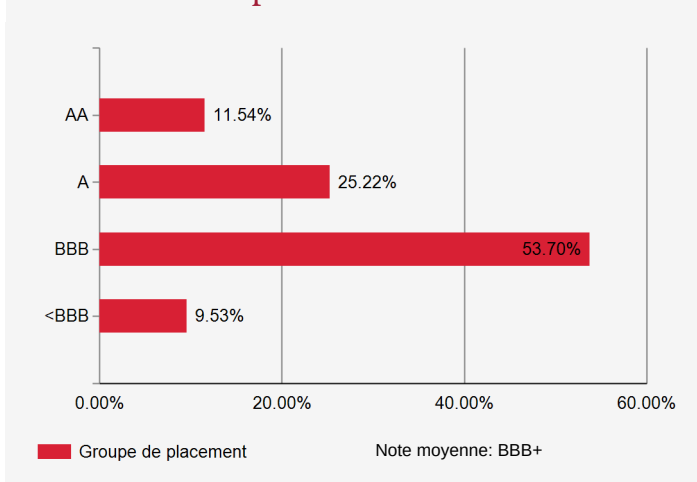
Indications supplémentaires sur les débiteurs

Nombre de débiteurs	144
Part de débiteurs hors du benchmark	28.03%

Structure de l'échéance des titres



Investissement par notes



Sensibilité et rendement à maturité

	Groupe de placement	Benchmark
Modified Duration	4.7	4.6
Rendement à l'échéance théorique*	5.18%	5.11%

* avant couverture de change

Structure du portefeuille selon les pays/régions

	Groupe de placement	Benchmark
Chine	7.79%	12.86%
Émirats arabes unis	7.28%	5.94%
Corée du Sud	5.61%	7.52%
Inde	5.15%	3.98%
Singapour	4.98%	4.02%
Mexique	4.95%	4.71%
Indonésie	4.49%	3.74%
Marchés Émergents Asie-Pacifique	13.79%	15.98%
Marchés Émergents Amériques	11.92%	8.45%
Marchés Émergents Moyen-Orient	10.80%	15.78%
Autres	24.53%	17.02%
Liquidités, couverture	-1.28%	-