

# Fondation de placement Swiss Life

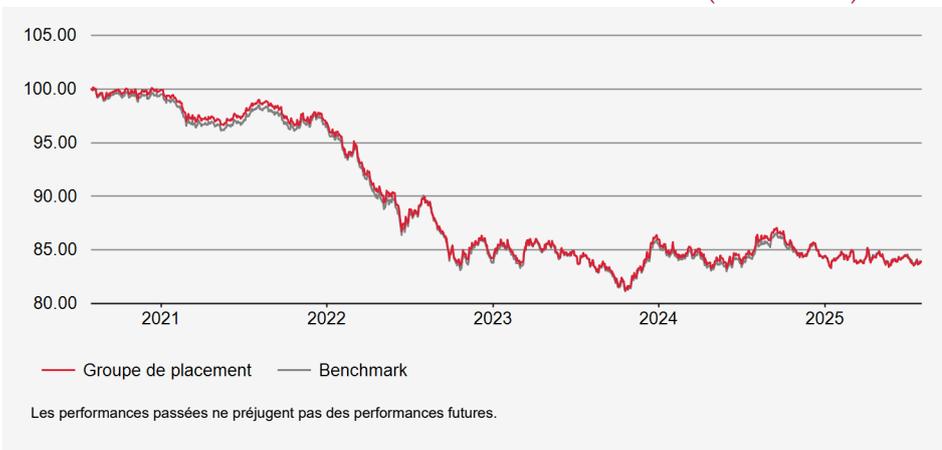
## Obligations Global Etats+ PM (couvertes en CHF)

**Fortune nette (VNI) en mio. CHF : 657.06**  
**Valeur nette d'inventaire par droit en CHF : 108.77**

### Stratégie d'investissement

Placement dans titres de créance d'Etats et d'institutions gouvernementales. 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 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	-0.63%	-0.67%	-1.12%	-1.65%	-2.23%	-3.44%	-0.83%	0.58%
Benchmark	-0.53%	-0.67%	-1.13%	-1.11%	-2.20%	-3.44%	-0.88%	0.38%

### Données statistiques (annualisées)

	1 an	3 ans	5 ans	10 ans	Origine
Volatilité du groupe de placement (en %)	3.36	4.74	4.31	3.65	3.57
Volatilité du Benchmark (en %)	3.09	4.73	4.36	3.75	3.51
Tracking Error ex post (en %)	0.37	0.50	0.50	0.57	0.68
Information Ratio	-1.47	-0.07	-0.02	0.09	0.29
Sharpe Ratio	-0.66	-0.69	-0.89	-0.17	0.21
Corrélation	1.00	0.99	0.99	0.99	0.98
Beta	1.09	1.00	0.98	0.96	1.00
Jensen alpha	-0.39	-0.05	-0.07	0.03	0.20
Maximum Drawdown (en %)	-4.31	-9.73	-18.93	-19.23	-19.23
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.

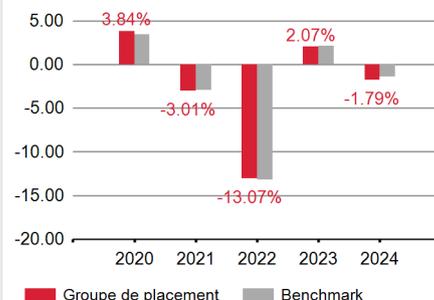
**Taux des charges d'exploitation TER KGAST:** Le taux des charges d'exploitation TER KGAST couvre tous les coûts à l'exception des frais de transaction et des prélèvements fiscaux sur les transactions.

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

### Performance



### Info. sur le produit

**Numéro de valeur:** 11956107

**ISIN:** CH0119561071

**LEI:** 254900H7WEVS3K9ANR90

**Code Bloomberg:** SWLGS PM 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.

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

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

**au préalable:** 0.15%

**a posteriori au:** 30/09/2024 0.15%

### Structure du portefeuille par branches

	Groupe de placement	Benchmark
État et Assimilé	79.65%	100.00%
Finance	8.71%	-
Centrales de lettres de gage	2.81%	-
Supranational	7.02%	-
Liquidités	0.57%	-
Couverture de change	1.24%	-

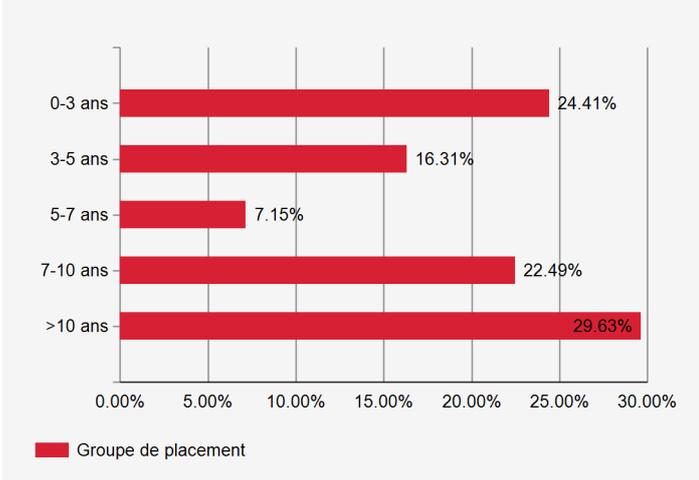
### Débiteurs les plus importants et note

	Groupe de placement	
Japon	A+	20.37%
US Treasury N/B	AA+	9.82%
People's Republic of China	A+	7.80%
Italie	BBB	5.67%
Royaume-Uni	AA-	4.68%

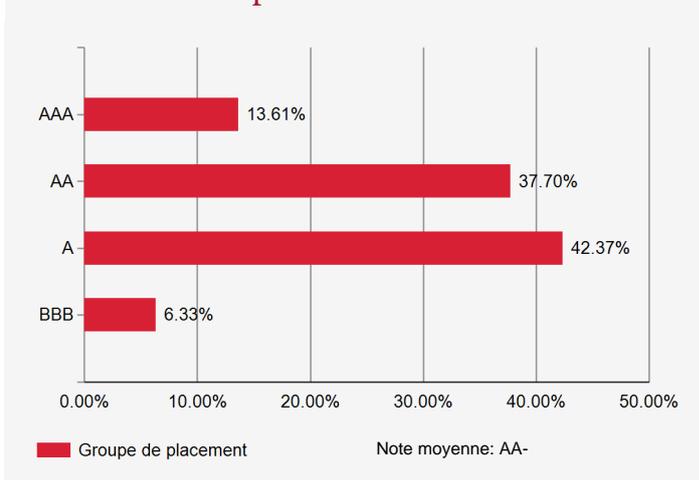
### Indications supplémentaires sur les débiteurs

Nombre de débiteurs	60
Part de débiteurs hors du benchmark	2.56%

### Structure de l'échéance des titres



### Investissement par notes



### Sensibilité et rendement à maturité

	Groupe de placement	Benchmark
Modified Duration	7.4	7.0
Rendement à l'échéance théorique*	3.11%	3.16%

\* avant couverture de change

### Structure du portefeuille par monnaies et durations

	Groupe de placement		Benchmark	
	Poids	Duration	Poids	Duration
EUR	34.22%	5.49	23.72%	6.95
JPY	25.24%	6.02	15.81%	8.51
USD	23.48%	10.04	34.92%	5.67
GBP	11.03%	5.97	5.60%	8.27
Autres	6.02%	25.06	20.58%	7.23

### Structure du portefeuille selon les pays/régions

	Groupe de placement	Benchmark
Japon	22.71%	15.84%
États-Unis	10.86%	34.61%
Canada	9.30%	1.66%
Chine	8.60%	10.11%
Italie	6.25%	5.26%
Royaume-Uni	5.16%	5.56%
Pays-Bas	4.60%	1.00%
Région Européenne (EUR)	19.48%	16.49%
Marchés Émergents Amériques	5.83%	0.12%
Région Européenne (Ex EUR)	3.78%	0.46%
Autres	1.63%	8.90%
Liquidités, couverture	1.81%	-