

# Fondation de placement Swiss Life

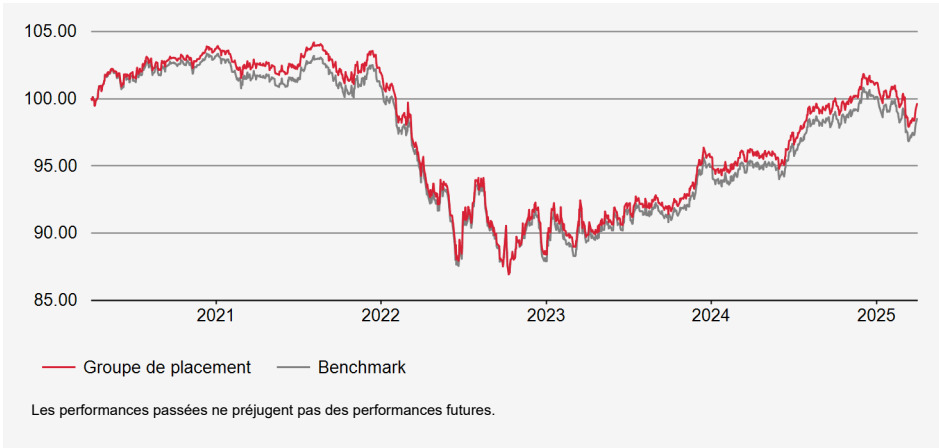
## Obligations suisses en CHF PM

**Fortune nette (VNI) en mio. CHF : 831.91**  
**Valeur nette d'inventaire par droit en CHF : 147.20**

### 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 durée 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	-1.55%	-0.75%	-1.55%	3.54%	1.55%	-0.08%	0.24%	2.19%
Benchmark	-1.63%	-0.78%	-1.63%	3.33%	1.36%	-0.30%	0.12%	2.02%

### Données statistiques (annualisées)

	1 an	3 ans	5 ans	10 ans	Origine
Volatilité du groupe de placement (en %)	3.81	5.50	5.01	4.68	4.03
Volatilité du Benchmark (en %)	3.78	5.37	4.88	4.53	3.98
Tracking Error ex post (en %)	0.14	0.40	0.35	0.37	0.43
Information Ratio	1.51	0.48	0.63	0.31	0.40
Sharpe Ratio	0.66	0.11	-0.07	0.11	0.53
Corrélation	1.00	1.00	1.00	1.00	0.99
Beta	1.01	1.02	1.03	1.03	1.01
Jensen alpha	0.19	0.18	0.24	0.10	0.16
Maximum Drawdown (en %)	-3.84	-9.13	-16.56	-19.21	-19.21
Recovery Period (ans)	-	1.17	-	-	-

**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.

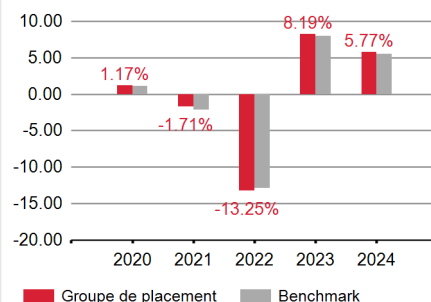
**Protection antilution:** Aperçu des conditions disponible à l'adresse: [www.swisslife.ch/fondationdeplacement](http://www.swisslife.ch/fondationdeplacement), «Documents juridiques» (modifications possibles à tout moment sans préavis).

**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:** 3026053

**ISIN:** CH0030260530

**LEI:** 254900M0YGKYAE29FA28

**Code Bloomberg:** SLOCIPM SW

**Benchmark:** SBI Domestic AAA - BBB TR

**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 antilution:**

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:** 0.08%

**a posteriori au:** 30/09/2024 0.08%

### Structure du portefeuille par branches

	Groupe de placement	Benchmark
Centrales de lettres de gage	32.97%	78.59%
Finance	27.44%	32.29%
État et Assimilé	21.76%	58.97%
Consommation, non cyclique	7.19%	14.62%
Services aux collectivités	4.72%	4.87%
Industrial	2.71%	5.62%
Consommation, cyclique	1.20%	0.86%
OPCVM	-	0.62%
Autres	0.72%	3.57%
Liquidités	1.29%	-

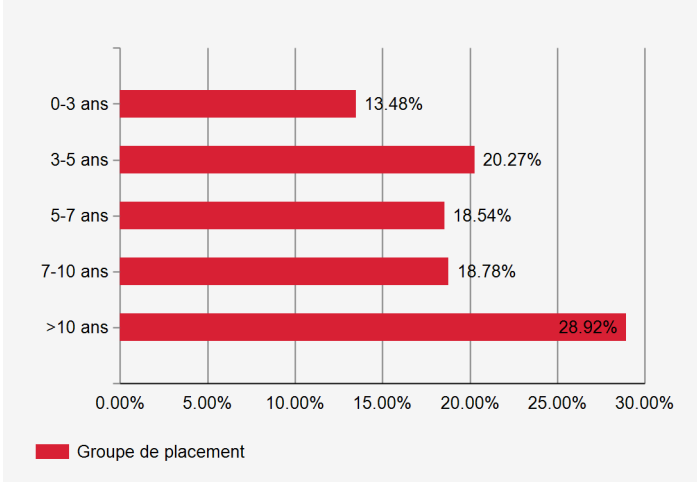
### Débiteurs les plus importants et note

	Groupe de placement	
Banque de lettres de gage	AAA	18.35%
Centrale de lettres de gage	AAA	14.43%
Confédération	AAA	14.28%
UBS Group AG	AA-	2.42%
Banque cantonale de Zurich	AA+	2.36%

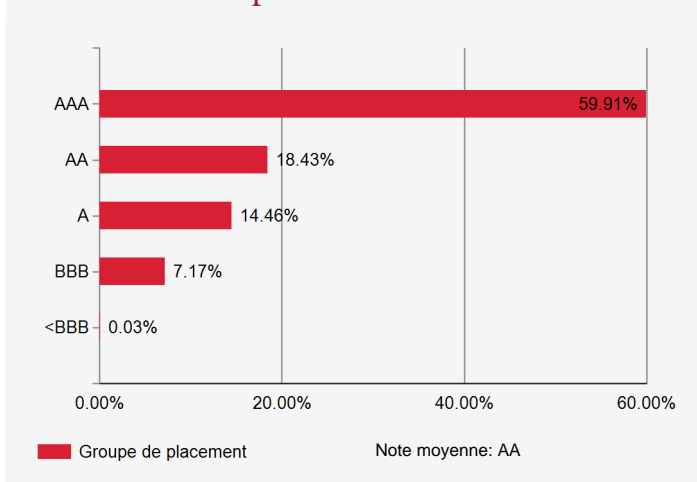
### Indications supplémentaires sur les débiteurs

Nombre de débiteurs	120
Part de débiteurs hors du benchmark	0.16%

### Structure de l'échéance des titres



### Investissement par notes



### Sensibilité et rendement à maturité

	Groupe de placement	Benchmark
Modified Duration	7.8	7.7
Rendement à l'échéance théorique*	0.97%	0.90%

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