31 juillet 2025

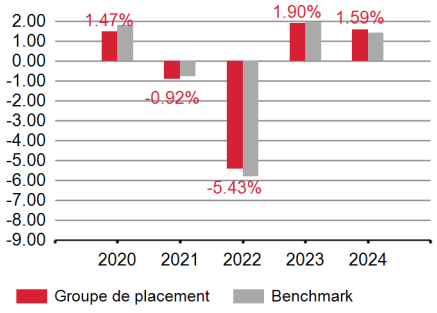
Fondation de placement Swiss Life Obligations Global Entreprises Short Term PM (couvertes en CHF)

Fortune nette (VNI) en mio. CHF : 1,713.31
Valeur nette d'inventaire par droit en CHF : 102.06

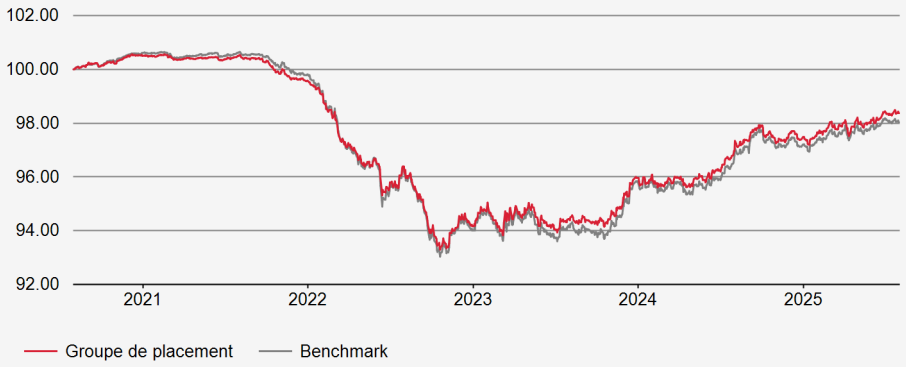
Stratégie d'investissement

Placement dans titres de créance d'entreprises (y compris ceux d'agences et d'entreprises supranationales) dont la durée résiduelle est courte (moins de trois ans en général). Sélection active des titres, contrôle de la duration et positionnement sur la courbe des taux. Limite par débiteur: 10%. Titres de créance de débiteurs hors benchmark: max. 10%. Note moyenne: BBB 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 Corporates Short Term (CHF hedged); Fonds de placement de droit suisse de la catégorie "Autres fonds en investissements traditionnels".

Performance



Évolution de la valeur en devise de référence (base 100)



Les performances passées ne préjugent pas des performances futures.

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	0.91%	-0.07%	0.17%	1.45%	0.68%	-0.33%	-0.04%	0.17%
Benchmark	0.85%	-0.15%	0.10%	1.42%	0.59%	-0.40%	-0.08%	0.09%

Données statistiques (annualisées)

	1 an	3 ans	5 ans	10 ans	Origine
Volatilité du groupe de placement (en %)	1.09	1.82	1.71	1.68	1.57
Volatilité du Benchmark (en %)	1.11	1.97	1.87	1.77	1.65
Tracking Error ex post (en %)	0.17	0.27	0.26	0.31	0.31
Information Ratio	0.16	0.32	0.27	0.13	0.25
Sharpe Ratio	0.81	-0.17	-0.39	0.11	0.25
Corrélation	0.99	0.99	0.99	0.98	0.98
Beta	0.97	0.91	0.91	0.93	0.94
Jensen alpha	0.05	0.05	0.00	0.05	0.10
Maximum Drawdown (en %)	-0.75	-3.20	-7.22	-7.22	-7.22
Recovery Period (ans)	0.12	1.71	-	-	-

Info. sur le produit

Numéro de valeur: 22073695
ISIN: CH0220736950
LEI: 2549003DSGO0RN37K507
Code Bloomberg: SWLOGPM SW
Benchmark: BLOOMBERG GLO AGG CORP 1-3 YR IND HEDGED CHF
Monnaie: CHF
Pays d'origine: Suisse
Date de création: 11/10/2013
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: 0.14%
a posteriori au: 30/09/2024 0.15%

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.

31 juillet 2025

Fondation de placement Swiss Life Obligations Global Entreprises Short Term PM (couvertes en CHF)

Structure du portefeuille par branches

	Groupe de placement	Benchmark
Finance	62.11%	51.28%
Consommation, cyclique	8.91%	9.57%
Consommation, non cyclique	8.33%	11.98%
Communications	6.41%	4.82%
Industrial	3.85%	6.22%
Services aux collectivités	3.66%	5.81%
Energie	3.11%	3.98%
Technologie	2.03%	4.14%
Autres	1.71%	2.20%
Liquidités	0.18%	-
Couverture de change	-0.31%	-

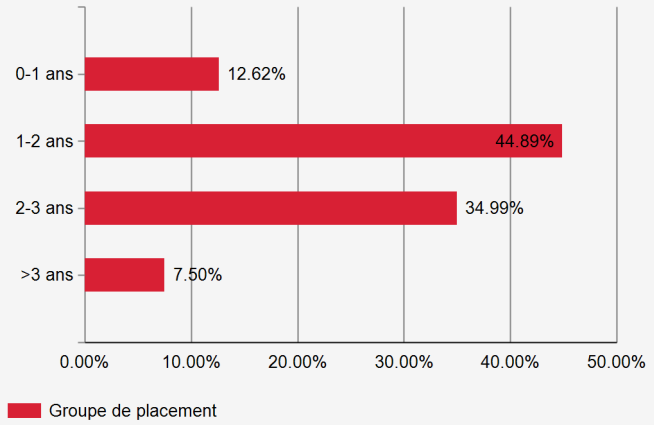
Débiteurs les plus importants et note

		Groupe de placement
Wells Fargo & Co	BBB+	3.96%
Citigroup Inc	BBB+	3.65%
Morgan Stanley NE US	A-	3.48%
Barclays Capital PLC, London	BBB	3.17%
Banco Santander SA, Madrid	BBB+	2.40%

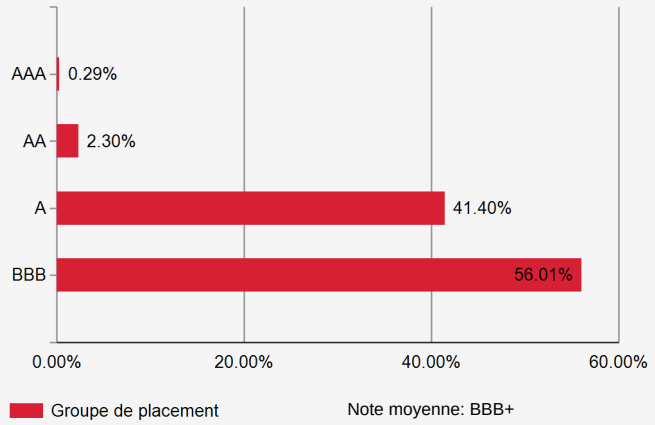
Indications supplémentaires sur les débiteurs

Nombre de débiteurs	136
Part de débiteurs hors du benchmark	2.73%

Structure de l'échéance des titres



Investissement par notes



Sensibilité et rendement à maturité

	Groupe de placement	Benchmark
Modified Duration	2.0	1.8
Rendement à l'échéance théorique*	3.77%	3.80%

* avant couverture de change

Structure du portefeuille par monnaies et durations

	Groupe de placement		Benchmark	
	Poids	Duration	Poids	Duration
USD	52.57%	2.24	59.43%	1.84
EUR	34.22%	1.79	29.85%	1.86
GBP	5.05%	1.77	3.70%	1.74
CHF	4.53%	1.61	0.55%	1.82
Autres	3.63%	1.77	6.44%	1.88

Structure du portefeuille selon les pays/régions

	Groupe de placement	Benchmark
États-Unis	36.60%	46.34%
Royaume-Uni	11.10%	6.82%
France	9.09%	7.19%
Allemagne	7.62%	6.33%
Japon	6.82%	4.39%
Canada	6.04%	6.37%
Suisse	5.40%	1.56%
Région Européenne (EUR)	9.13%	9.52%
Marchés Émergents Asie-Pacifique	4.74%	2.23%
Région Européenne (Ex EUR)	1.37%	0.70%
Autres	2.21%	8.55%
Liquidités, couverture	-0.12%	-

Avertissement: La présente publication ne constitue ni une incitation ni une recommandation pour la vente ou l'achat d'instruments de placement, et son but est uniquement d'informer. Tous les documents constituant la base légale dans le cadre d'un éventuel placement peuvent être obtenus gratuitement auprès de la Fondation de placement Swiss Life, c/o Swiss Life SA, case postale, 8022 Zurich, tél. 043 547 71 11 et sur www.swisslife.ch/anlagestiftung. Le cercle des investisseurs est limité aux institutions du 2e pilier et du pilier 3a, ainsi que les autres institutions de prévoyance professionnelle exonérées d'impôts avec siège en Suisse et aux personnes qui gèrent des placements collectifs pour ces institutions, qui sont soumises à la surveillance de l'Autorité fédérale de surveillance des marchés financiers FINMA et qui ne placent dans la fondation que des fonds destinés à ces institutions. En outre, les investisseurs mentionnés doivent avoir conclu une convention spéciale avec Swiss Life Asset Management SA. La performance passée ne saurait présumer de l'évolution en cours ou à venir. Leur utilisation n'implique aucune adhésion ni affiliation de leur part. Ce document peut-être été créé à l'aide de intelligence artificielle. **Source:** Swiss Life Asset Managers. Tous droits réservés.