

# Swiss Franc Bonds Optimized

autrefois Obligations Suisse

30.09.2020



## Politique de placement

Le véhicule de placement "Swiss Franc Bonds Optimized" investit dans les obligations libellées en CHF du monde entier bénéficiant d'une notation minimum "investment grade" (au moment de la décision d'achat) et ayant une bonne liquidité de marché. Lors du choix des débiteurs, nous appliquons le principe de la répartition optimale des risques pour le portefeuille. La répartition des échéances du portefeuille résulte d'une optimisation des bénéfices des rolls, bien que la composition et la durée moyenne du portefeuille reste généralement assez proches de celles du benchmark.

## Gestion

**Julian Wiedmer**  
Gestionnaire  
"Swiss Franc Bonds Optimized"



## Performance / Indices de risque

### Aperçu des performances (p.a.)

	Groupe de placement	Benchmark (frais excl.)
Année en cours (YTD)	0.18%	0.38%
12 derniers mois	-1.57%	-1.37%
3 dernières années	1.11%	1.43%
5 dernières années	0.70%	1.02%
10 dernières années	1.75%	2.08%

### Indices de risque, basés sur les 3 dernières années

	Groupe de placement	Benchmark
Rendement à l'échéance	-0.05%	-0.12%
Duration (modifiée)	7.56	7.60
Dérive	0.53%	

### Valorisation actuelle, en CHF

Prix d'émission par part	1'514.32
--------------------------	----------

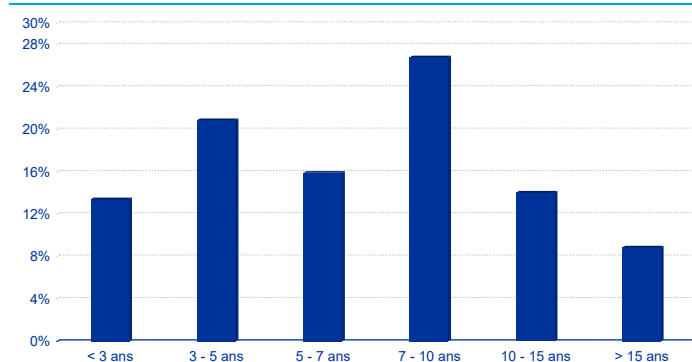
### Benchmark

Swiss Bond Index Total AAA-BBB

### Structure des notations

AAA	47.4%
AA	18.5%
A	19.5%
BBB	13.7%
BB	0.6%
not rated	0.2%

### Structure des échéances

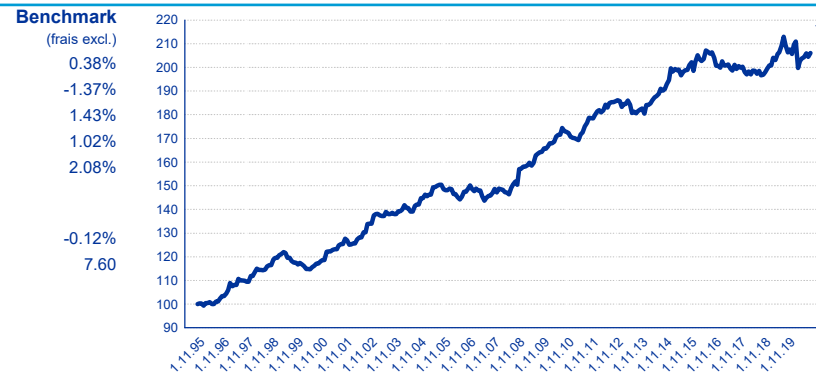


### Dix principales positions en %

Swiss Confederation Government Bond, 0.00%, 22/06/29	CHF	2.2%
Swiss Confederation Government Bond, 4.00%, 06/01/49	CHF	1.2%
Swiss Confederation Government Bond, 2.25%, 22/06/31	CHF	1.1%
Bank of Nova Scotia/The, 0.30%, 03/04/28	CHF	1.1%
Province of New Brunswick Canada, 0.13%, 06/12/32	CHF	1.1%
Pfandbriefbank schweizerischer Hypothekarinstitute, 1.88%, 15/09/31	CHF	1.0%
Swiss Confederation Government Bond, 1.25%, 27/06/37	CHF	0.9%
Luzerner Kantonalbank AG, 0.00%, 07/08/28	CHF	0.9%
Walliser Kantonalbank, 0.00%, 14/02/29	CHF	0.9%
Baloise Holding AG, 0.00%, 25/09/26	CHF	0.8%

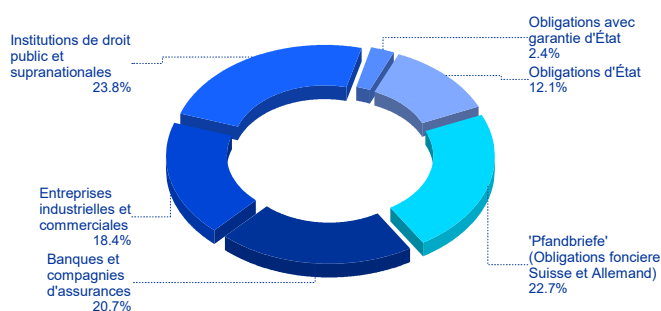
### Informations complémentaires sur le groupe de placement

Actifs immobilisés:	CHF 347'129'319
Gérant de fortune:	Baloise Asset Management AG
Organe de révision:	Ernst & Young AG, Basel
Domicile:	Suisse
Date de lancement: <sup>2</sup>	01.11.1995
Banque depositaire:	Credit Suisse (Schweiz) AG, Zürich



<sup>1</sup> Au 17 mai 2019, l'absorption du groupe de placement BAP «Obligations étrangères CHF» par le groupe de placement BAP «Obligations Suisse» s'est achevée. En parallèle, le groupe de placement «Obligations Suisse» résultant a vu sa stratégie de placement adaptée ainsi que son nom changé en «Swiss Franc Bonds Optimized».

### Structure des débiteurs



### Prenez contact avec nous

Site Internet:	www.baloise-fondation.ch
E-mail:	anlagestiftung@baloise.ch
Tél:	+41 58 285 80 72
Publications du cours:	Telekurs, KGAST, NZZ, Bloomberg: BAPOBLS SW

<sup>2</sup> Informations sur le lancement: au 17 mai 2019, l'absorption du groupe de placement BAP «Obligations étrangères CHF» par le groupe de placement BAP «Obligations Suisse» s'est achevée. En parallèle, le groupe de placement «Obligations Suisse» résultant a vu sa stratégie de placement adaptée ainsi que son nom changé en «Swiss Franc Bonds Optimized».

# Swiss Franc Bonds Optimized

autrefois Obligations Suisse

30.09.2020



## Responsible Investment Policy

Le fonds est soumis à la Responsible Investment (RI) Policy conformément aux directives de Baloise Group. La politique RI peut être consultée via le lien suivant:

<https://www.baloise-asset-management.com/fr/ch/a-propos-de-nous/investir-de-facon-responsable.html>

Ce fonds appartient à la catégorie «Pure Responsible», ce qui veut dire que le respect de la politique RI est garanti pour 100% des placements. Pour les fonds déclarés comme «Classic Responsible», le respect de la politique RI n'est que partiellement garanti, car ces fonds contiennent des produits tiers, passifs ou white label.

### Stratégies d'investissement responsable

Exclusion	✓
Intégration ESG	✓
Exercice des droits de vote	
Engagement (en évolution)	

### Critères d'exclusion

Producteurs d'armes controversées	✓
Liste selon l'ASIR	✓
Émetteurs avec chiffre d'affaires issu du charbon > 30%	✓
Notation ESG < B (selon MSCI Inc.)	✓

### Portefeuille



Signatory of:



### Avis juridique important

Ce document publicitaire a pour seul but d'informer. Il ne constitue ni une offre, ni une incitation à acheter ou à vendre des parts de fonds et ne doit pas non plus être considéré comme une incitation à soumettre une offre de conclusion d'un contrat portant sur un service de titres ou un service complémentaire. Les chiffres de performance sont des valeurs qui se réfèrent au passé et ne constituent pas d'indicateur fiable de l'évolution de la valeur future. La performance ne tient pas compte des éventuels commissions et coûts prélevés lors de la souscription et de la reprise de parts. Les commissions et les coûts ont un effet négatif sur la performance. Tout placement implique des risques, notamment des fluctuations de la valeur et du rendement. Malgré tout le soin apporté dans l'élaboration de ce document, des données peuvent être représentées de façon incomplète ou incorrecte. Nous déclinons toute responsabilité concernant l'exactitude, l'exhaustivité ou l'actualité des informations contenues dans ce document. Le cercle des investisseurs est limité aux seules institutions de prévoyance du 2e pilier et du pilier 3a exonérées de l'impôt et domiciliées en Suisse. Il est interdit de proposer et de vendre hors de Suisse des droits à des groupes de placement de la Fondation de la Bâloise pour le placement des capitaux d'institutions de prévoyance. Les statuts et le règlement, les directives de placement, le règlement des frais ainsi que les comptes rendus annuels et semestriels peuvent être demandés gratuitement auprès de la Fondation de la Bâloise pour le placement des capitaux d'institutions de prévoyance, Aeschengraben 21, CH-4002 Bâle. Ce document est une traduction à titre d'information. Seul le texte allemand est contraignant.

"SIX Swiss Exchange AG ("SIX Swiss Exchange") is the source of Swiss Bond Index Total AAA-BBB and the data comprised therein. SIX Swiss Exchange has not been involved in any way in the creation of any reported information and does not give any warranty and excludes any liability whatsoever (whether in negligence or otherwise) - including without limitation for the accuracy, adequateness, correctness, completeness, timeliness, and fitness for any purpose - with respect to any reported information or in relation to any errors, omissions or interruptions in the Swiss Performance Index or its data. Any dissemination or further distribution of any such information pertaining to SIX Swiss Exchange is prohibited."