



SwissLife
Asset Managers

Swiss Life Funds (LUX) Multi Asset Moderate EUR SF Cap

Actif net du fonds : 1,463.89 M EUR | Valeur liquidative : 92.68 EUR



Information SFDR: Article 8

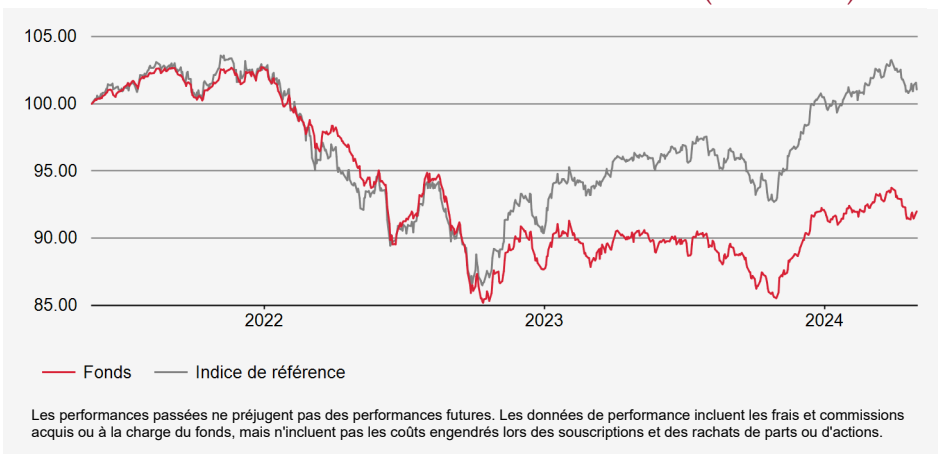
Commentaire de gestion

Le fonds affiche une performance négative en avril. Il est en ligne avec son indice de référence. L'effet allocation est positif grâce à notre positionnement prudent sur les actions et nos investissements en stratégies alternatives. La sélection est neutre sur la partie obligataire mais positive sur les actions grâce aux stratégies défensives qui font mieux que les indices.

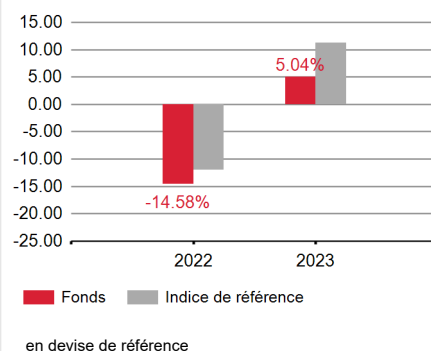
Stratégie d'investissement

Le compartiment met en œuvre une gestion multi-actifs sur l'ensemble des zones géographiques avec un profil de type défensif. L'allocation entre classes d'actifs (produits de taux, actions, ...) et régions est redéfinie tous les mois en utilisant des modèles quantitatifs.

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



Performance



Performances en devise de référence

	Performances cumulées						Performances annualisées		
	YTD	1 mois	1 an	3 ans	5 ans	Origine	3 ans	5 ans	Origine
Fonds	-0.12%	-1.87%	1.88%	-	-	-8.00%	-	-	-2.67%
Indice de réf.	0.57%	-2.12%	4.89%	-	-	1.06%	-	-	0.34%

Caractéristiques du fonds

Date de création: 01/04/2021

ISIN: LU2083923446

Code Bloomberg: SLMAMSF LX

Catégorie Morningstar: Allocation EUR Prudente - International

Devise de référence: EUR

Domicile: Luxembourg

Indice de réf.: 70% BLOOMBERG GLO AGG IND HEDGED EUR + 20% MSCI World 100% Hedged to EUR Net Total Return Ind + 10% MSCI Euro TR Net Index (EUR)

Souscription minimale: 1 part

Commission de souscription (max.): 5.00%

Commission de rachat (max.): 0.00%

Frais de gestion: 2.16%

Commission de performance: Néant

Frais courants au 29/12/2023: 2.64%

Souscriptions / Rachats: Ordre J avant 15:00 Réglement J+2

Distribution des revenus: Capitalisation

Le produit présente un risque de perte en capital.

Indicateurs de risque

Max. Drawdown

-17.05%

Recouvrement

-

Duration effective

Fonds Indice de réf.

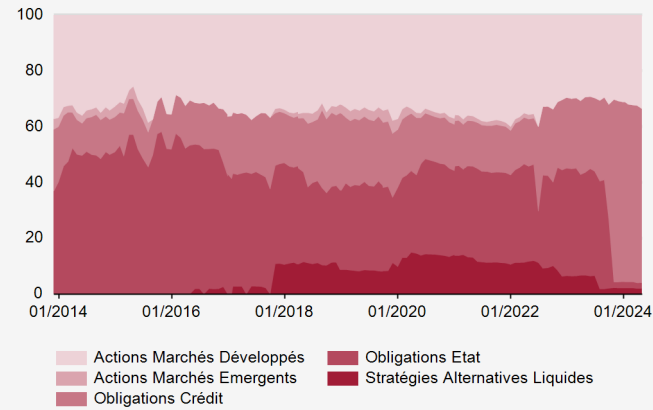
4.01 4.57

Risque Faible < 1 2 3 4 5 6 7 > Risque Élevé
Rendement potentiellement plus faible Rendement potentiellement plus fort

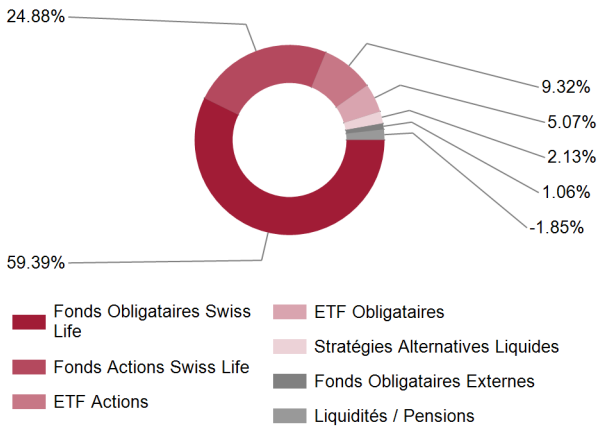
Hebdo. annualisée	1 an	3 ans	Origine
Volatilité du portefeuille	5.57%	-	6.24%
Volatilité de l'indice de réf.	5.94%	-	6.54%
Tracking Error	1.94	-	3.62
Ratio d'information	-2.03	-	-0.95
Ratio de Sharpe	-0.42	-	-0.70

Swiss Life Funds (LUX) Multi Asset Moderate EUR SF Cap

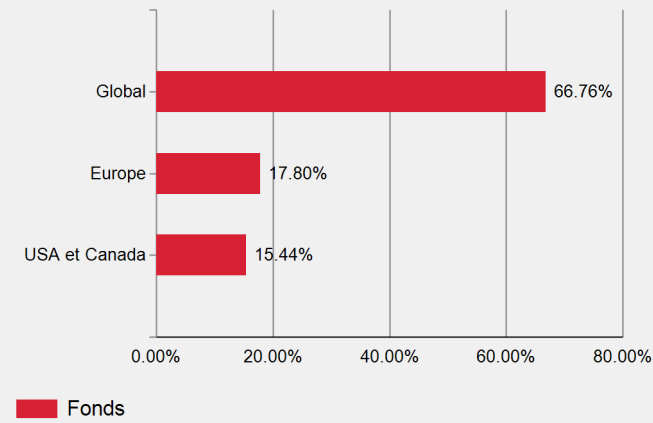
Evolution de l'allocation d'actifs



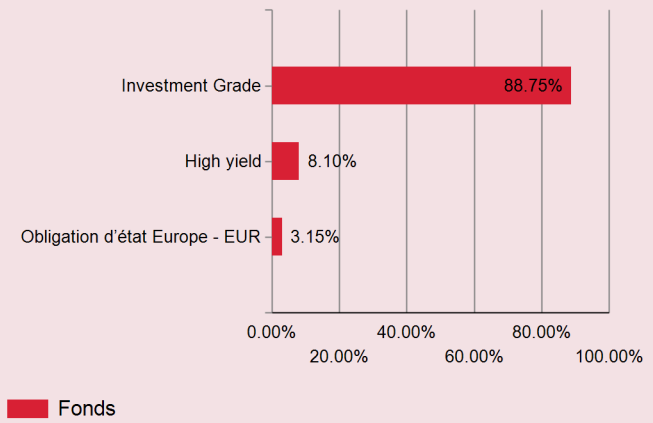
Structure du portefeuille



Répartition géographique actions



Répartition poche taux



Principales positions actions

N°	Émission	Pays	%
1	SWIS LI EQ ESG EUR ZONE-SEUR		5.30%
2	S L LX-EQ ESG GL-S EURCAP		5.30%
3	S LIFE LX-EQUITY ESG USA-S A		5.28%
4	AM MSCI EU ESG LEAD-ETF A		5.02%
5	AMUNDI MSCI USA ESG LEADERS		4.30%

Principales positions taux

N°	Émission	Pays	%
1	SWISS LF BN ESG GBL SVR-SCAP		19.54%
2	SWISS LF BN ESG GBL AGG-SCAP		19.50%
3	S L LX-BD ESG GB CP-S		14.53%
4	S LIFE LX-BD ESG EU HY-S		4.25%
5	ISHARES USD TRES 20+ EUR-H D		3.01%