



Swiss Life Funds (F) Multi Asset Moderate P

Actif net du fonds : 180.57 M EUR | Valeur liquidative : 160.85 EUR



Information SFDR: Article 8

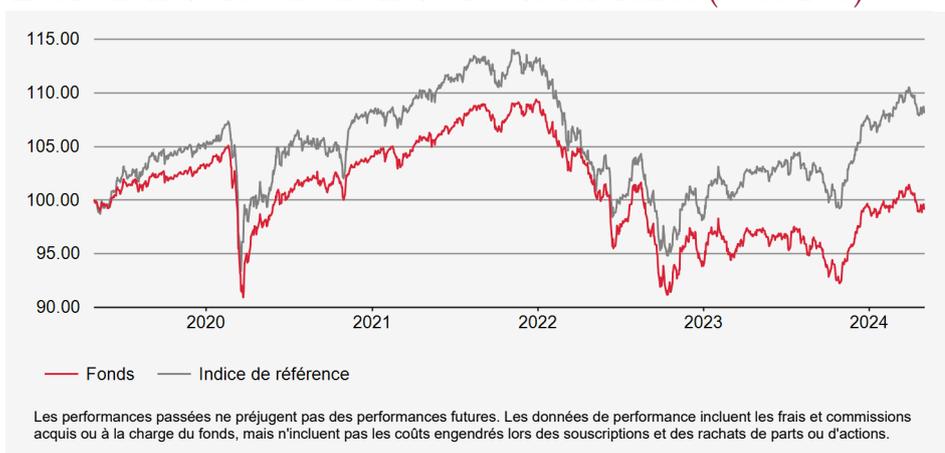
Commentaire de gestion

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.

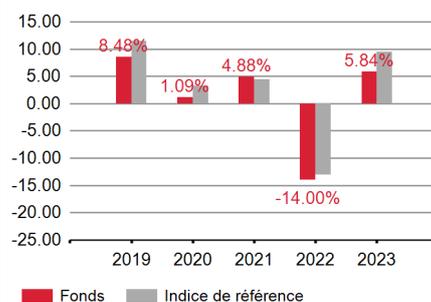
Stratégie d'investissement

Le fonds 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. Chaque classe d'actifs fait l'objet d'une gestion active spécifique centrée sur la volatilité.

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



Performance



en devise de référence

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	-0.19%	-	1.99%	-6.07%	-0.82%	60.85%	-2.06%	-0.17%	2.67%
Indice de réf.	0.57%	-	4.89%	-1.30%	8.17%	32.49%	-0.44%	1.58%	1.57%

Caractéristiques du fonds

Date de création: 10/04/2006

ISIN: FR0010308825

Code Bloomberg: SLFDEFE FP

Catégorie Morningstar: Allocation EUR Prudente - International

Classification AMF: not applicable

Devise de référence: EUR

Domicile: France

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: 0.001 part(s)

Commission de souscription (max.): 2.00%

Commission de rachat (max.): 0.00%

Frais de gestion: 1.20%

Commission de performance: Néant

Frais courants au 29/12/2023: 1.69%

Souscriptions / Rachats: Ordre J avant 11:00 Règlementation J+2

Distribution des revenus: Capitalisation

Le produit présente un risque de perte en capital.

Indicateurs de risque

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

Max. Drawdown

-16.63%

Recouvrement

-

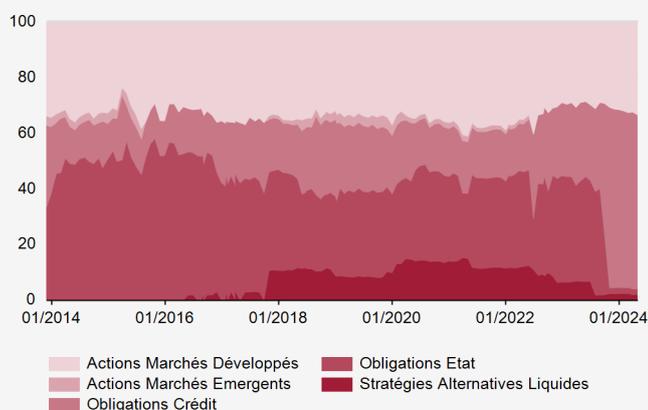
Duration effective

Fonds 4.02
Indice de réf. 4.57

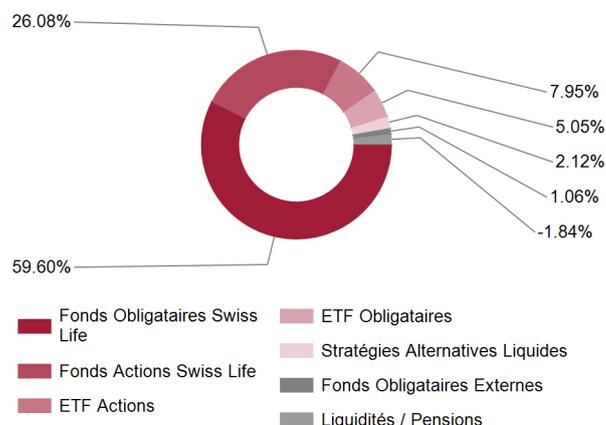
Hebdo. annualisée	1 an	3 ans	Origine
Volatilité du portefeuille	5.90%	6.50%	5.35%
Volatilité de l'indice de réf.	5.96%	6.52%	4.13%
Tracking Error	1.03	2.48	4.13
Ratio d'information	-2.92	-0.63	0.26
Ratio de Sharpe	-0.25	-0.53	0.35

Swiss Life Funds (F) Multi Asset Moderate P

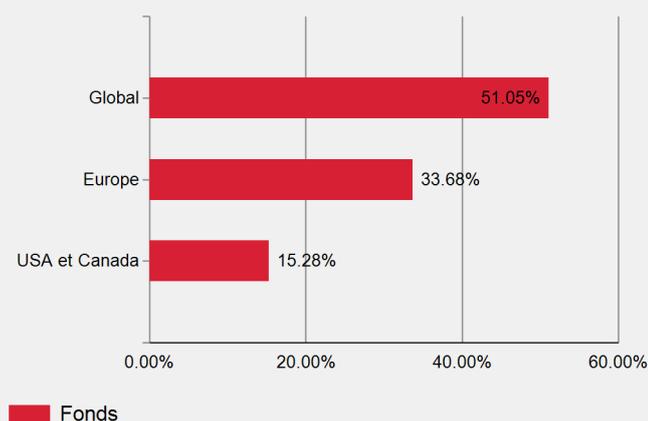
Evolution de l'allocation d'actifs



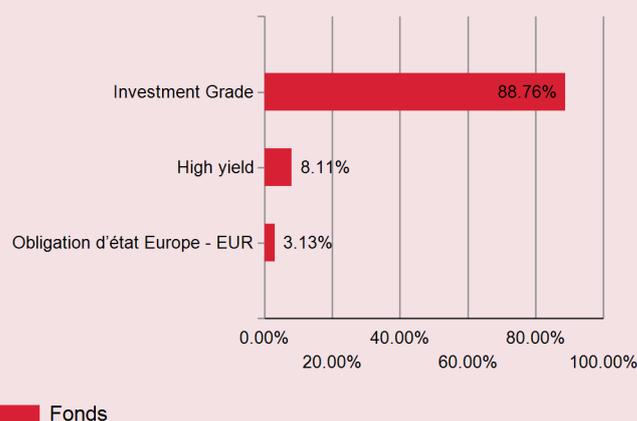
Structure du portefeuille



Répartition géographique actions



Répartition poche taux



Principales positions actions

N°	Émission	Pays	%
1	SWIS LI EQ ESG EUR ZONE-AM		5.20%
2	S LIFE LX-EQUITY ESG USA-AM		5.20%
3	S L LX-EQ ESG GLOBAL-AM		5.19%
4	AMUNDI MSCI USA ESG LEADERS		4.30%
5	SL LX EQ ESG GLBL PCT-EU I C		4.11%

Principales positions taux

N°	Émission	Pays	%
1	SWISS LF BN ESG GBL SVR-AMCP		19.54%
2	SWISS LF BN ESG GBL AGG-AMCP		19.51%
3	S L LX-BD ESG GB CP-AM		14.45%
4	S LIFE LX-BD ESG EU HY-AM		4.21%
5	ISHARES USD TRES 20+ EUR-H D		2.99%