



Swiss Life Funds (F) Equity ESG Euro Zone Minimum Volatility I

Actif net du fonds : 147.17 M EUR | Valeur liquidative : 20,927.83 EUR

Morningstar® ★★★



Information SFDR: Article 8

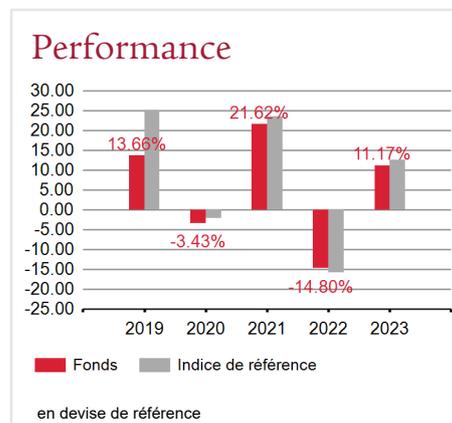
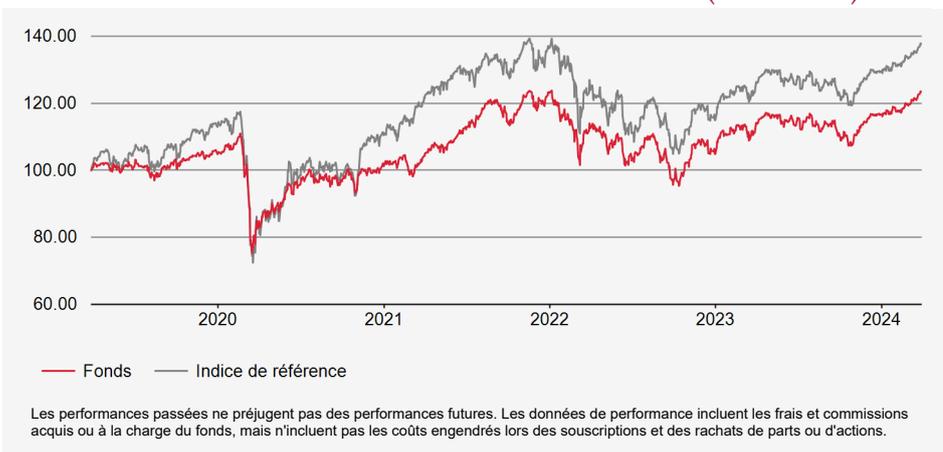
Commentaire de gestion

Le mois de mars est dans la continuité du début d'année avec une hausse du marché de la zone euro poussée par la réduction de l'inflation et les perspectives de baisses des taux. La surperformance observée provient de la sélection de titres au sein de la consommation discrétionnaire et des financières. Par ailleurs, le biais de durabilité du fonds a été fortement négatif au cours du mois.

Stratégie d'investissement

Le fonds investit en actions de la zone euro, principalement de grandes et moyennes entreprises, selon une stratégie quantitative de type Minimum Variance qui vise à définir chaque mois le portefeuille le moins volatil parmi les valeurs de son univers. Le portefeuille est construit grâce à un modèle d'optimisation propriétaire.

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



Performances en devise de référence

	Performances cumulées					Origine	Performances annualisées		
	YTD	1 mois	1 an	3 ans	5 ans		3 ans	5 ans	Origine
Fonds	5.84%	3.46%	8.13%	18.30%	23.02%	109.28%	5.77%	4.23%	4.83%
Indice de réf.	6.40%	3.31%	9.02%	13.31%	36.48%	100.14%	4.26%	6.41%	4.53%

Caractéristiques du fonds

Date de création: 08/08/2008
ISIN: FR0010654236
Code Bloomberg: SLFEUZM FP
Catégorie Morningstar: Actions Zone Euro Grandes Cap.
Classification AMF: Actions des pays de la zone euro
Devise de référence: EUR
Domicile: France
Indice de réf.: MSCI EMU Minimum Volatility Opt in Euro Net Local
Souscription minimale: 100 000 EUR
Commission de souscription (max.): 3.00%
Commission de rachat (max.): 0.00%
Frais de gestion: 0.70%
Commission de performance: Néant
Frais courants au 29/12/2023: 0.70%
Souscriptions / Rachats: Ordre J avant 15:00 Règlement J+2
Distribution des revenus: Capitalisation
Swing Pricing: Oui

Le produit présente un risque de perte en capital.

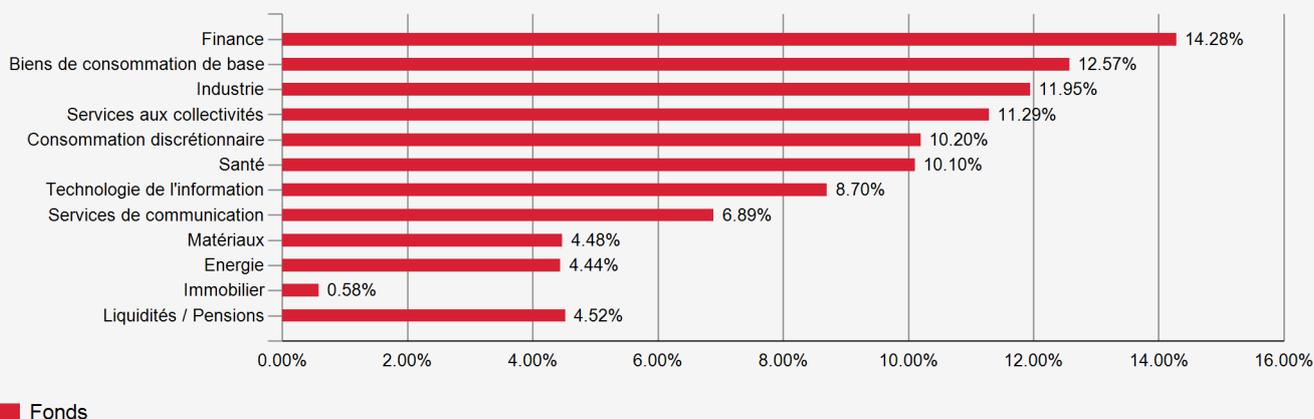
Indicateurs de risque

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

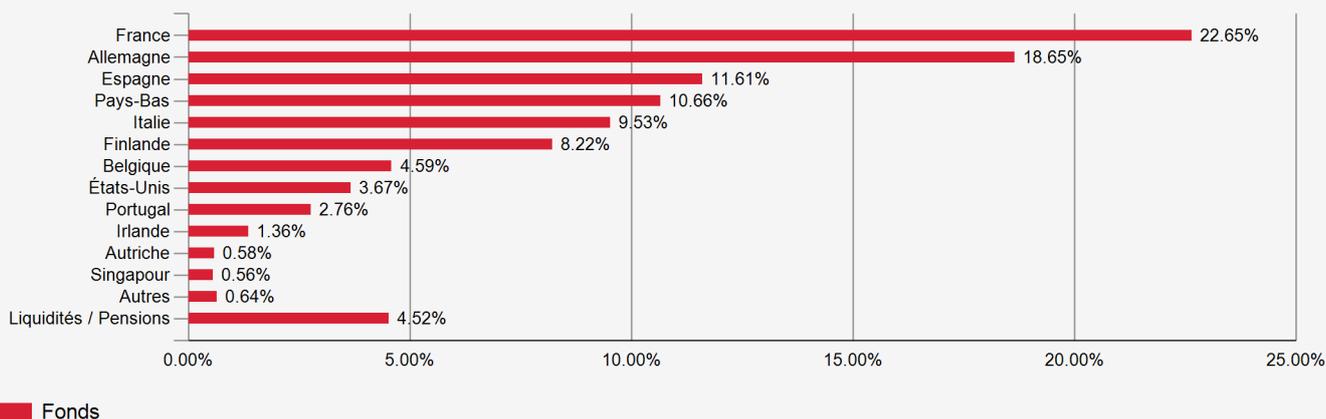
Max. Drawdown -32.12%	Hebdo. annualisée	1 an	3 ans	Origine
Recouvrement 456 jours	Volatilité du portefeuille	9.62%	12.58%	15.93%
Beta 0.98	Volatilité de l'indice de réf.	9.77%	14.66%	21.42%
Alpha -0.01	Tracking Error	1.05	4.89	8.93
	Ratio d'information	-0.84	0.28	0.03
	Ratio de Sharpe	0.44	0.36	0.27

Swiss Life Funds (F) Equity ESG Euro Zone Minimum Volatility I

Répartition sectorielle



Répartition géographique



Principales positions

N°	Émission	Pays	Secteur	%
1	SAP SE	Allemagne	Technologie de l'information	2.54%
2	ASSICURAZIONI GENERALI	Italie	Finance	2.47%
3	MUENCHENER RUECKVER AG-REG	Allemagne	Finance	2.36%
4	WOLTERS KLUWER	Pays-Bas	Industrie	2.32%
5	INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL	Espagne	Consommation discrétionnaire	2.20%
6	KONINKLIJKE KPN NV	Pays-Bas	Services de communication	2.19%
7	REDEIA CORP SA	Espagne	Services aux collectivités	2.08%
8	KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N	Pays-Bas	Biens de consommation de base	2.07%
9	IBERDROLA SA	Espagne	Services aux collectivités	2.03%
10	DEUTSCHE BOERSE AG	Allemagne	Finance	2.00%
Total des principales positions				22.25%
Nombre de lignes				121

Avertissement: Le présent document a été rédigé avec le plus grand soin, et en toute bonne foi. Les informations contenues dans le présent document sont exclusivement destinées à des fins informatives et ne doivent pas être considérées comme un document contractuel, un conseil en investissement, une recommandation d'investissement ou une sollicitation à acheter ou à vendre des parts de fonds de placement. Avant toute souscription, l'investisseur doit se procurer et lire attentivement les informations détaillées relatives aux fonds de placement contenues dans la documentation réglementaire de chaque fonds (prospectus, règlement/statuts du fonds, politique de placement, derniers rapports annuel/semestriel, document d'information clé pour l'investisseur (PRIIPs KID)), qui constitue la seule base réglementaire recevable pour l'acquisition de parts de fonds. Ces documents sont disponibles gratuitement, en format papier ou électronique auprès de la direction du fonds ou de son représentant : Suisse : Swiss Life Asset Management SA, General-Guisan-Quai 40, 8002 Zurich | Agents payeurs : UBS Switzerland AG, Bahnhofstrasse 45, 8001 Zurich | Allemagne : Swiss Life Invest GmbH, Zeppelinstrasse 1, 85784 Garching b. Munich | France : Swiss Life Asset Managers France, 153, rue Saint Honoré, 75001 Paris | ou sur www.swisslife-am.com. Les rendements et la valeur des parts de fonds peuvent baisser ou augmenter et une perte totale du capital investi dans les parts ne peut être exclue. La performance historique n'est pas une base suffisante pour établir des prévisions concernant l'évolution future de la performance ou des prix. Les performances passées ne présument en rien des performances actuelles ou futures. En aucune façon elles ne constituent une garantie de performance ou de capital futurs. La performance tient compte de tous les coûts et commissions acquis ou à la charge du fonds (par exemple la commission de gestion). La performance n'inclut pas les coûts engendrés au niveau du client (coûts et commissions de souscription et de rachat, droits de garde, etc.). Les fonds Swiss Life Asset Managers ne doivent ni être offerts, vendus ou transférés aux Etats-Unis, ni bénéficier directement ou indirectement à un citoyen américain ou US Person résidant aux Etats-Unis. « Swiss Life Asset Managers » est le nom de la marque des activités de gestion d'actifs du groupe Swiss Life. Vous trouverez de plus amples informations sur le site www.swisslife-am.com. **Source:** Swiss Life Asset Managers / ©2024, Morningstar. Tous droits réservés. **Service client:** service.client-securities@swisslife-am.com