



Swiss Life Funds (LUX) Equity ESG USA USD I Cap

Actif net du fonds : 617.84 M USD | Valeur liquidative : 387.40 USD

Morningstar® ★★★



Information SFDR: Article 8

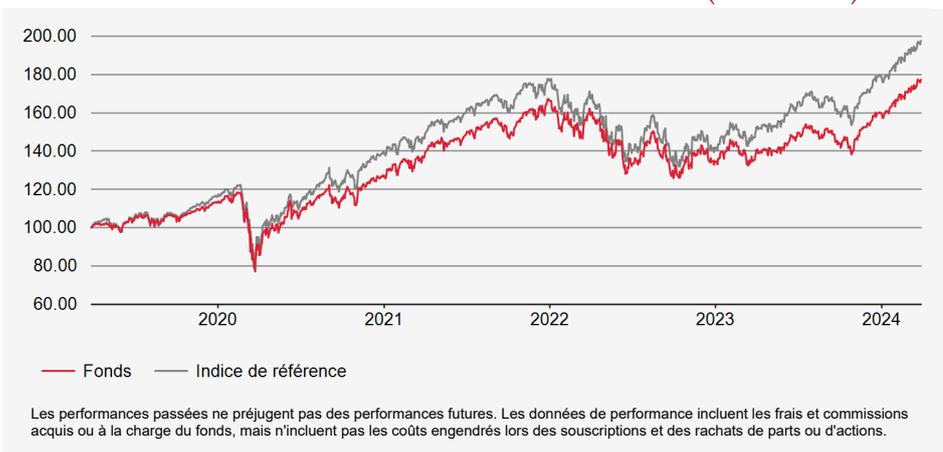
Commentaire de gestion

Le mois dernier, le fonds a surperformé son indice de référence de près de 0,5%. Surpondérer les titres à qualité, rendement du dividende et momentum élevés a profité, à l'inverse de la surpondération des titres de rentabilité. L'exposition à certains titres explique l'essentiel de la performance. Sous-pondérer Tesla et surpondérer Netapp et Target ont été favorables, alors que surpondérer Lululemon Athletica et sous-pondérer Exxon Mobile et Micron Technology ont pesé.

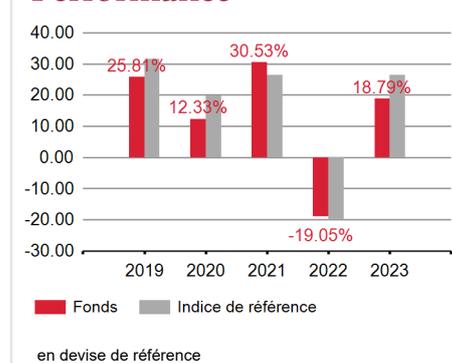
Stratégie d'investissement

Le compartiment utilise un processus d'investissement systématique, basé sur des facteurs, pour investir dans des actions de grandes sociétés cotées. La sélection des titres est effectuée sur une base mensuelle à l'aide d'un filtre quantitatif basé sur des facteurs de risque.

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	10.95%	3.51%	26.30%	29.10%	76.29%	287.31%	8.90%	12.00%	12.47%
Indice de réf.	10.30%	3.15%	29.67%	34.20%	96.24%	336.45%	10.32%	14.43%	13.64%

Caractéristiques du fonds

Date de création: 21/09/2012
ISIN: LU0832468986
Code Bloomberg: SWLEQUI LX
Catégorie Morningstar: Actions Etats-Unis Gdes Cap. Mixte
Devise de référence: USD
Domicile: Luxembourg
Indice de réf.: MSCI USA NET TR USD INDEX
Souscription minimale: 1000 parts
Commission de souscription (max.): 5.00%
Commission de rachat (max.): 0.00%
Frais de gestion: 0.60%
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

Max. Drawdown
-34.76%

Recouvrement
154 jours

Beta
0.95

Alpha
-0.03

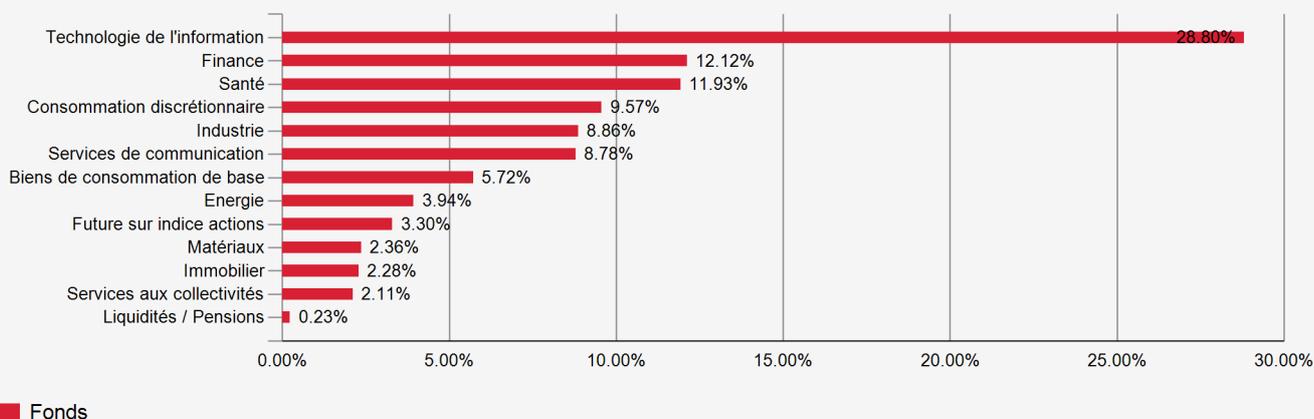
Risque Faible < 1 2 3 4 5 6 7 > Risque Élevé
Rendement potentiellement plus faible Rendement potentiellement plus fort

Indicateur	1 an	3 ans	Origine
Hebdo. annualisée			
Volatilité du portefeuille	11.32%	16.67%	16.46%
Volatilité de l'indice de réf.	11.69%	16.89%	16.25%
Tracking Error	2.39	2.63	2.92
Ratio d'information	-1.41	-0.54	-0.40
Ratio de Sharpe	1.61	0.35	0.64

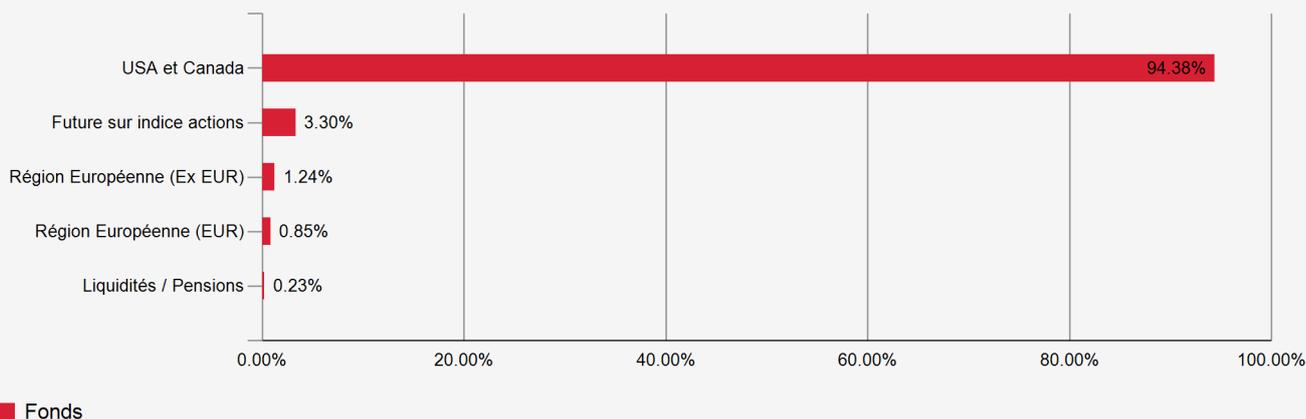
Swiss Life Funds (LUX) Equity ESG USA USD

I Cap

Répartition sectorielle



Répartition géographique



Principales positions

N°	Émission	Pays	Secteur	%
1	MICROSOFT CORP	États-Unis	Technologie de l'information	6.86%
2	NVIDIA CORP	États-Unis	Technologie de l'information	5.29%
3	APPLE INC	États-Unis	Technologie de l'information	4.65%
4	AMAZON.COM INC	États-Unis	Consommation discrétionnaire	2.85%
5	ALPHABET INC-CL A	États-Unis	Services de communication	2.18%
6	JPMORGAN CHASE & CO	États-Unis	Finance	1.79%
7	ALPHABET INC-CL C	États-Unis	Services de communication	1.67%
8	META PLATFORMS INC-CLASS A	États-Unis	Services de communication	1.58%
9	UNITEDHEALTH GROUP INC	États-Unis	Santé	1.52%
10	MASTERCARD INC - A	États-Unis	Finance	1.41%
Total des principales positions				29.80%
Nombre de lignes				120