



# Swiss Life Funds (LUX) Equity ESG Euro Zone EUR I Cap

Actif net du fonds : 485.40 M EUR | Valeur liquidative : 167.06 EUR

Morningstar® ★★★★★



Information SFDR: Article 8

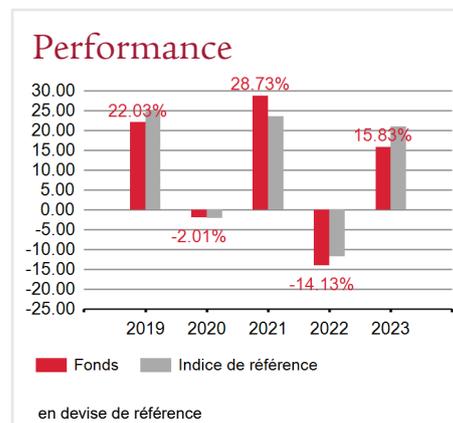
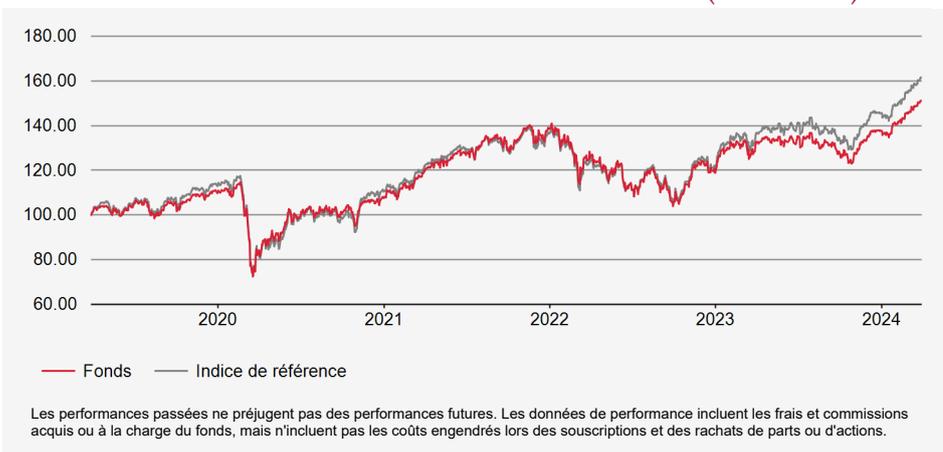
## Commentaire de gestion

Performance positive mais en retrait par rapport à son indice de référence. Les secteurs de la finance, des services aux collectivités et de l'industrie ont contribué négativement ce mois-ci et n'ont pas été compensés entièrement par la bonne performance des secteurs des technologies de l'information, de l'énergie et des matériaux. La sélection a été négative contrairement à l'allocation qui a été positive. A l'exception du facteur sentiment, toutes les primes de risque ont été négatives et plus particulièrement, les facteurs beta et qualité.

## Stratégie d'investissement

Le fonds utilise un processus de placement systématique, fondé sur l'analyse de facteur de risque afin d'investir dans les actions de grandes sociétés cotées de l'union monétaire européenne. Les critères environnementaux, sociaux et de gouvernance (« critères ESG ») sont systématiquement pris en compte dans le processus de placement et dans la sélection des sociétés.

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



## 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	9.72%	3.92%	13.86%	26.38%	50.13%	67.06%	8.13%	8.46%	6.02%
Indice de réf.	10.91%	4.31%	18.13%	32.93%	60.10%	66.86%	9.97%	9.86%	6.01%

## Caractéristiques du fonds

**Date de création:** 22/06/2015  
**ISIN:** LU1247740126  
**Code Bloomberg:** SWIEQIE LX  
**Catégorie Morningstar:** Actions Zone Euro Flex Cap  
**Devise de référence:** EUR  
**Domicile:** Luxembourg  
**Indice de réf.:** MSCI Euro TR Net Index (EUR)  
**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:** 0.71%  
**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**  
-36.60%

**Recouvrement**  
356 jours

**Beta**  
0.96

**Alpha**  
-0.06

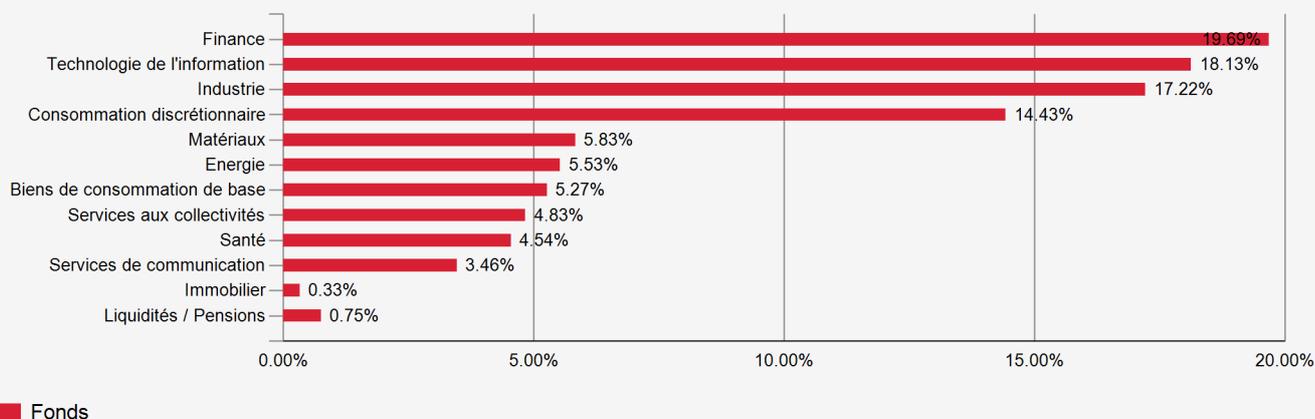
Risque Faible < 1 2 3 4 5 6 7 > Risque Élevé  
 Rendement potentiellement plus faible Rendement potentiellement plus fort

Hebdo. annualisée	1 an	3 ans	Origine
Volatilité du portefeuille	11.35%	15.14%	17.36%
Volatilité de l'indice de réf.	11.72%	15.88%	19.03%
Tracking Error	1.72	2.14	4.06
Ratio d'information	-2.49	-0.90	0.00
Ratio de Sharpe	0.83	0.45	0.33

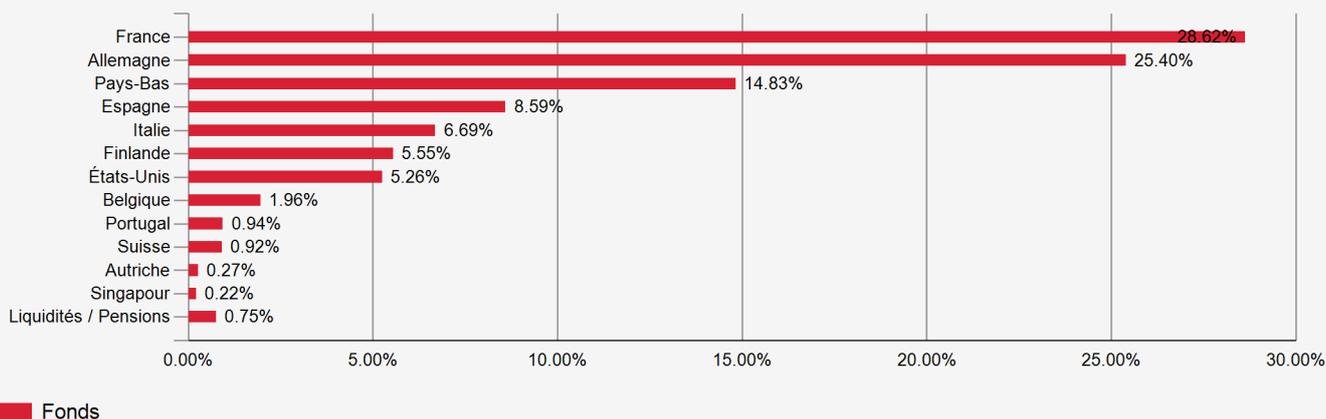
# Swiss Life Funds (LUX) Equity ESG Euro Zone EUR

## I Cap

### Répartition sectorielle



### Répartition géographique



### Principales positions

N°	Émission	Pays	Secteur	%
1	ASML HOLDING NV	Pays-Bas	Technologie de l'information	8.81%
2	SAP SE	Allemagne	Technologie de l'information	4.87%
3	LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI	France	Consommation discrétionnaire	4.51%
4	TOTALENERGIES SE	France	Energie	3.68%
5	SIEMENS AG-REG	Allemagne	Industrie	3.58%
6	SCHNEIDER ELECTRIC SE	États-Unis	Industrie	3.10%
7	ALLIANZ SE-REG	Allemagne	Finance	2.99%
8	AXA SA	France	Finance	1.94%
9	MUENCHENER RUECKVER AG-REG	Allemagne	Finance	1.91%
10	ESSILORLUXOTTICA	France	Santé	1.90%
<b>Total des principales positions</b>				<b>37.28%</b>
<b>Nombre de lignes</b>				<b>108</b>

**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 Asset Managers Luxembourg, Niederlassung Deutschland, Hochstrasse 53, 60313 Frankfurt am Main, Deutschland | France : Swiss Life Asset Managers France, 153, rue Saint Honoré, 75001 Paris | ou sur [www.swisslife-am.com](http://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 engendrés au niveau du fonds (par exemple la commission de gestion). La performance n'inclut pas les coûts engendrés au niveau du client (coûts et commissions d'émission et de rachat, droits de garde, etc.). Les fonds Swiss Life Asset Managers ne doivent ni être offerts, vendus ou transférés aux États-Unis, ni bénéficier directement ou indirectement à un citoyen américain ou US Person résidant aux États-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](http://www.swisslife-am.com). **Source:** Swiss Life Asset Managers / ©2024, Morningstar. Tous droits réservés. **Service client:** [info@swisslife-am.com](mailto:info@swisslife-am.com)