



Swiss Life Funds (LUX) Equity ESG Global Minimum Volatility EUR R Dis

Actif net du fonds : 133.47 M USD | Valeur liquidative : 127.38 EUR

Morningstar® **



Information SFDR: Article 8

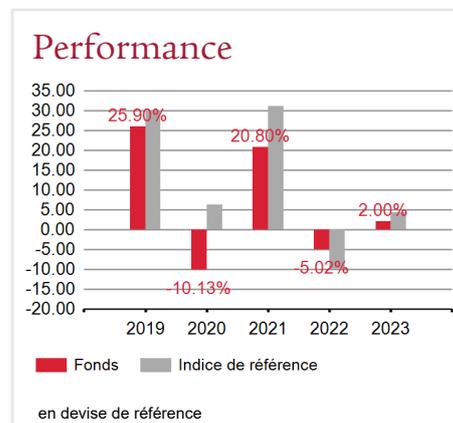
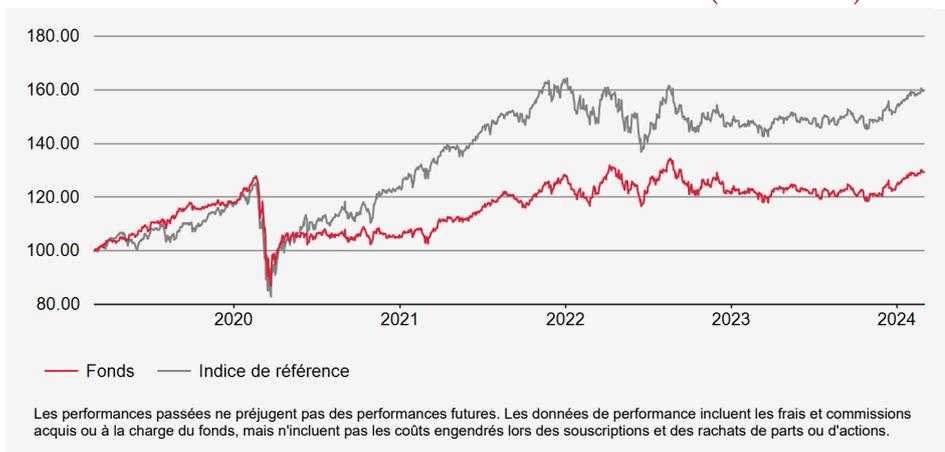
Commentaire de gestion

Le mois de février s'est inscrit dans la continuité des mois précédents avec les acteurs du marché espérant une baisse prochaine des taux directeur et l'atterrissage en douceur de l'économie. La sous-performance observée provient en grande partie de la sélection des titres en Asie et plus particulièrement au Japon alors que l'Amérique du Nord a permis d'atténuer cet effet. Par ailleurs, le biais de durabilité du fonds a été fortement négatif.

Stratégie d'investissement

Le compartiment investit en actions des pays développés, 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 composant l'indice MSCI World. 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					Performances annualisées			
	YTD	1 mois	1 an	3 ans	5 ans	Origine	3 ans	5 ans	Origine
Fonds	4.52%	1.02%	7.53%	25.74%	29.45%	45.32%	7.91%	5.29%	5.31%
Indice de réf.	4.55%	1.19%	9.91%	25.89%	59.84%	83.92%	7.95%	9.82%	8.80%

Caractéristiques du fonds

Date de création: 09/12/2016
ISIN: LU1531540661
Code Bloomberg: SLEGMRD LX
Devise de référence: EUR
Domicile: Luxembourg
Indice de réf.: MSCI World Min. Vol. Opt. In EUR Net TR USD IX
Souscription minimale: 1 Part
Commission de souscription (max.): 5.00%
Commission de rachat (max.): 0.00%
Frais de gestion: 1.50%
Commission de performance: Néant
Frais courants au 28/02/2023: 1.64%
Souscriptions / Rachats: Ordre J avant 15:00 Règlement J+2
Distribution des revenus: Distribution
Swing Pricing: Oui

Le produit présente un risque de perte en capital.

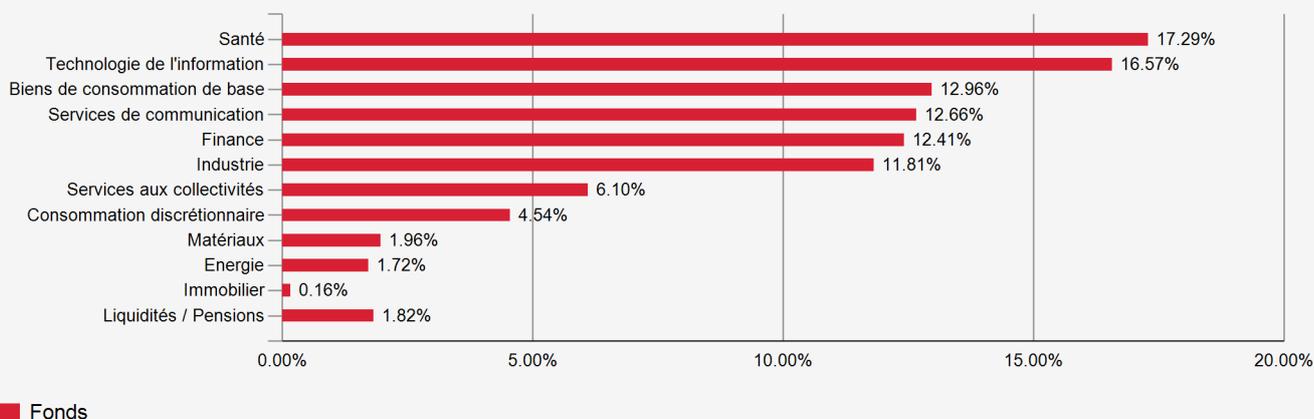
Indicateurs de risque

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

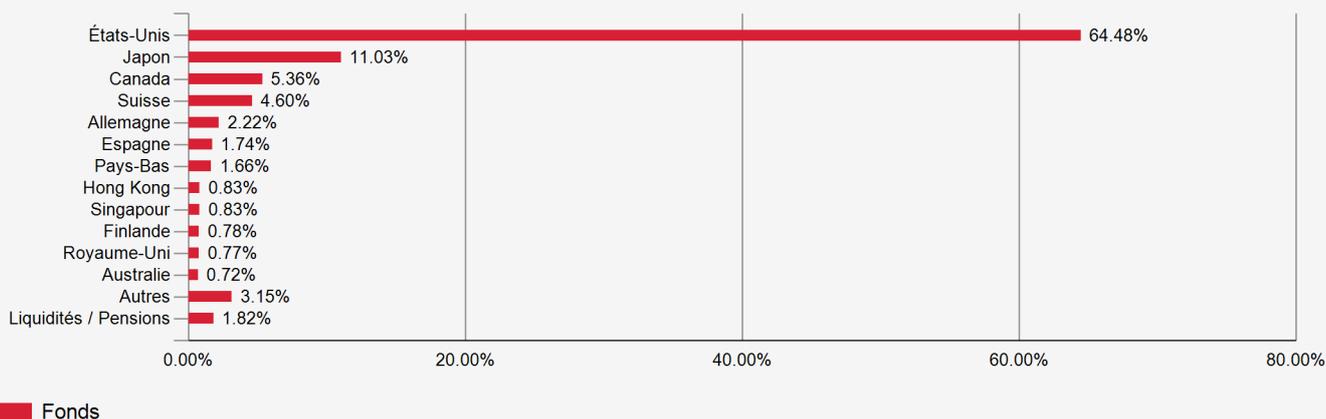
Max. Drawdown -31.87%	Hebdo. annualisée	1 an	3 ans	Origine
Recouvrement 645 jours	Volatilité du portefeuille	8.34%	10.89%	12.92%
Beta 1.01	Volatilité de l'indice de réf.	8.17%	11.92%	14.87%
Alpha -0.04	Tracking Error	1.08	5.50	7.21
	Ratio d'information	-2.09	-0.04	-0.48
	Ratio de Sharpe	0.41	0.51	0.39

Swiss Life Funds (LUX) Equity ESG Global Minimum Volatility EUR R Dis

Répartition sectorielle



Répartition géographique



Principales positions

N°	Émission	Pays	Secteur	%
1	SOFTBANK CORP	Japon	Services de communication	1.98%
2	MERCK & CO. INC.	États-Unis	Santé	1.71%
3	INTL BUSINESS MACHINES CORP	États-Unis	Technologie de l'information	1.58%
4	CISCO SYSTEMS INC	États-Unis	Technologie de l'information	1.54%
5	WASTE MANAGEMENT INC	États-Unis	Industrie	1.39%
6	NOVARTIS AG-REG	Suisse	Santé	1.32%
7	MOTOROLA SOLUTIONS INC	États-Unis	Technologie de l'information	1.32%
8	GILEAD SCIENCES INC	États-Unis	Santé	1.26%
9	CENCORA INC	États-Unis	Santé	1.25%
10	GENERAL MILLS INC	États-Unis	Biens de consommation de base	1.24%
Total des principales positions				14.59%
Nombre de lignes				209

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. 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. **Source:** Swiss Life Asset Managers / ©2024, Morningstar. Tous droits réservés. **Service client:** info@swisslife-am.com