



Swiss Life Funds (LUX) Multi Asset Moderate EUR M Cap

Actif net du fonds : 1,462.65 M EUR | Valeur liquidative : 110.59 EUR

Morningstar® ★★★



Information SFDR: Article 8

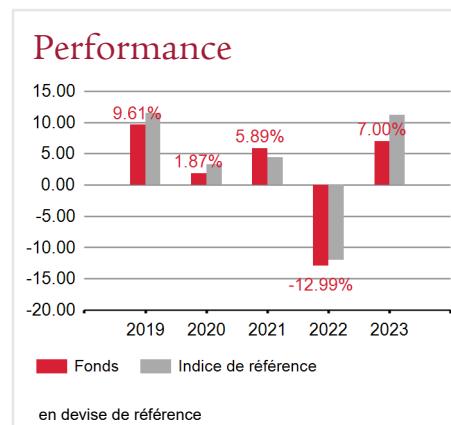
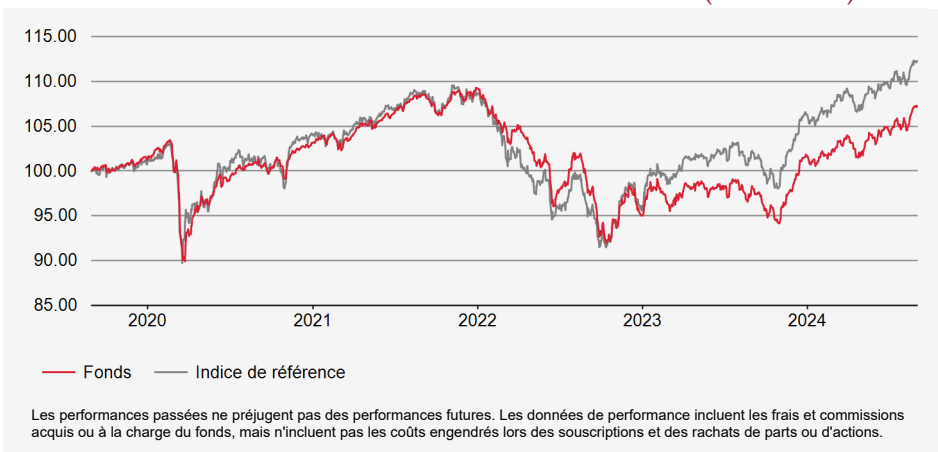
Commentaire de gestion

Sur le mois d'août, le fonds affiche une performance positive. Il est en ligne avec son indice de référence. L'allocation par rapport à cet indice a contribué négativement via une sous-exposition aux obligations, qui terminent le mois en territoire positif. La sélection a, pour sa part, apporté de la surperformance sur les actions et les obligations, en particulier concernant les expositions aux taux d'intérêt.

Stratégie d'investissement

Le compartiment 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.

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	5.50%	1.64%	9.12%	-1.11%	7.28%	10.59%	-0.37%	1.41%	1.53%
Indice de réf.	5.65%	1.17%	9.82%	3.40%	12.28%	19.04%	1.12%	2.34%	2.66%

Caractéristiques du fonds

Date de création: 15/01/2018
ISIN: LU1749126378
Code Bloomberg: SLPFEUM LX
Catégorie Morningstar: Allocation EUR Prudente - International
Devise de référence: EUR
Domicile: Luxembourg
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: 1 part
Commission de souscription (max.): 5.00%
Commission de rachat (max.): 0.00%
Frais de gestion: 0.30%
Commission de performance: Néant
Frais courants au 29/12/2023: 0.78%
Souscriptions / Rachats: Ordre J avant 15:00 Règlement 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

-15.83%

Recouvrement

-

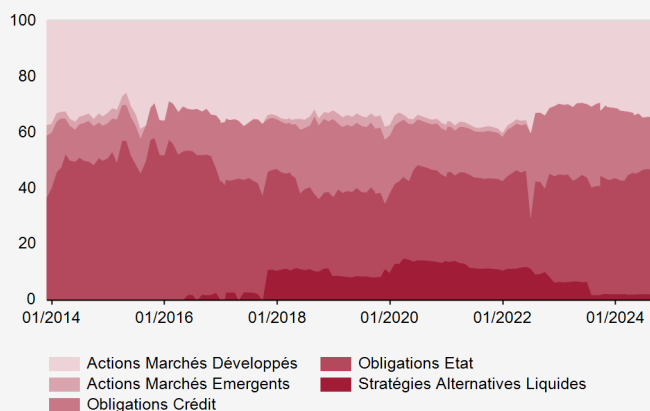
Duration effective

Fonds 3.89
 Indice de réf. 4.59

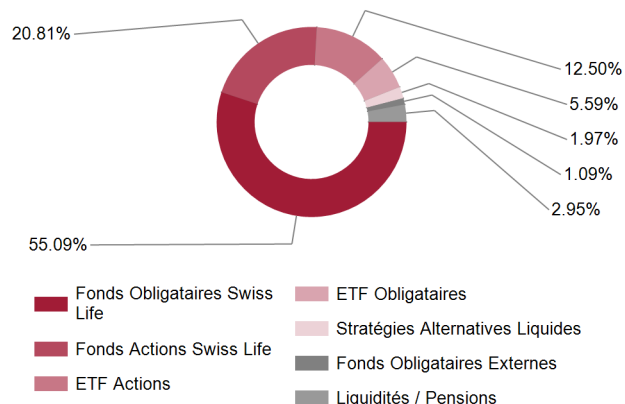
Hebdo. annualisée	1 an	3 ans	Origine
Volatilité du portefeuille	5.39%	6.38%	6.26%
Volatilité de l'indice de réf.	5.46%	6.57%	6.62%
Tracking Error	2.31	3.67	3.38
Ratio d'information	-0.28	-0.39	-0.33
Ratio de Sharpe	0.97	-0.33	0.15

Swiss Life Funds (LUX) Multi Asset Moderate EUR M Cap

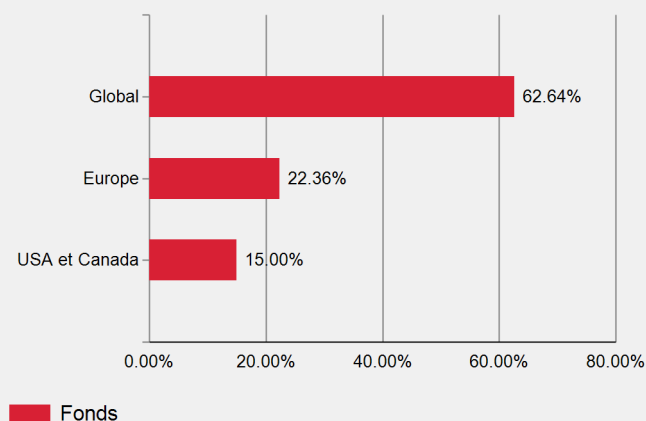
Evolution de l'allocation d'actifs



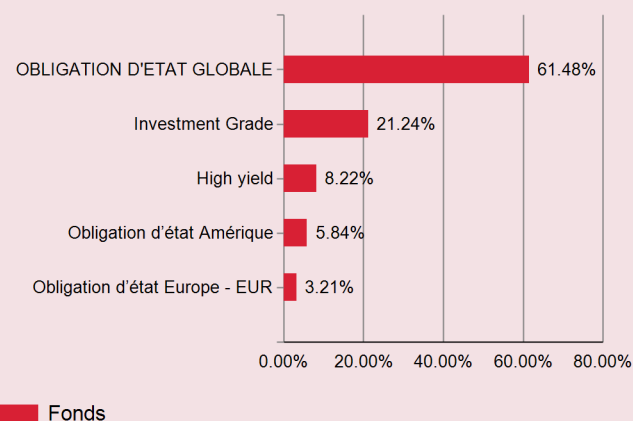
Structure du portefeuille



Répartition géographique actions



Répartition poche taux



Principales positions actions

N°	Émission	Pays	%
1	AM MSCI EU ESG LEAD-ETF A		6.28%
2	SWIS LI EQ ESG EUR ZONE-SEUR		5.05%
3	S L LX-EQ ESG GL-S EURCAP		5.03%
4	S LIFE LX-EQUITY ESG USA-S A		5.00%
5	AMUNDI MSCI USA ESG LEADERS		4.65%

Principales positions taux

N°	Émission	Pays	%
1	SWISS LF BN ESG GBL SVR-SCAP		18.99%
2	SWISS LF BN ESG GBL AGG-SCAP		18.99%
3	S L LX-BD ESG GB CP-S		12.02%
4	S LIFE LX-BD ESG EU HY-S		3.99%
5	ISHARES USD TRES 20+ EUR-H D		3.61%