



SwissLife
Asset Managers

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

Actif net du fonds : 473.27 M EUR | Valeur liquidative : 129.21 EUR

Morningstar® ★★★



Information SFDR: Article 8

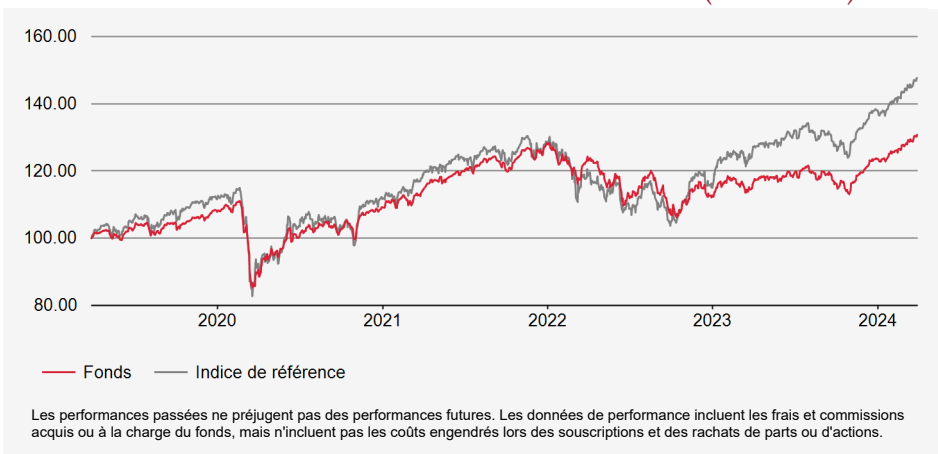
Commentaire de gestion

Le fonds affiche une performance positive en mars. Il sous-performe son indice de référence. L'effet allocation est négatif à cause de notre positionnement prudent sur les actions. Toutefois, la sélection est positive. En effet, au sein de la poche action, nous sous-jacents ont, pour la plupart, surperformé. De même, au sein de la poche Obligataire, où notre ajustement en durée a été bénéfique, tout comme notre exposition au High Yield.

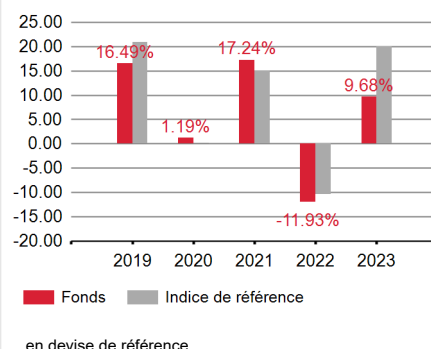
Stratégie d'investissement

Le compartiment met en œuvre une gestion multi-actifs sur l'ensemble des zones géographiques avec un profil de type dynamique. 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)



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	5.81%	2.71%	12.47%	14.41%	30.46%	29.21%	4.60%	5.46%	4.22%
Indice de réf.	6.93%	2.75%	16.13%	24.35%	46.64%	43.58%	7.55%	7.95%	6.00%

Caractéristiques du fonds

Date de création: 15/01/2018

ISIN: LU1749126535

Code Bloomberg: SLPFVM LX

Catégorie Morningstar: EUR Aggressive
Allocation - Global

Devise de référence: EUR

Domicile: Luxembourg

Indice de réf.: 50% MSCI World 100% Hedged to EUR Net Total Return Ind + 30% BLOOMBERG GLO AGG IND HEDGED EUR + 20% 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: 0.40%

Commission de performance: Néant

Frais courants au 29/12/2023: 0.97%

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

Max.Drawdown
-23.10%

Recouvrement
301 jours

Duration effective

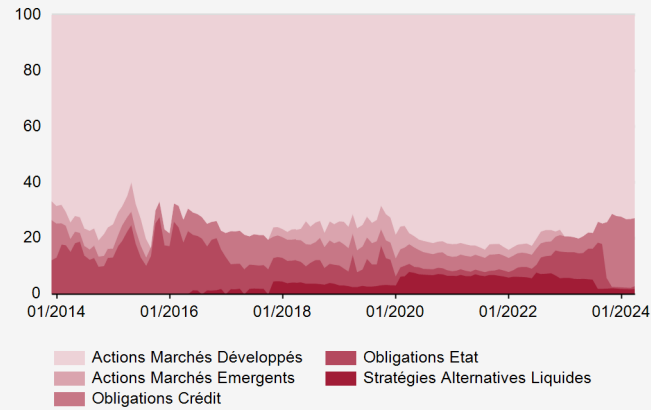
Fonds 1.42
Indice de réf. 1.95

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

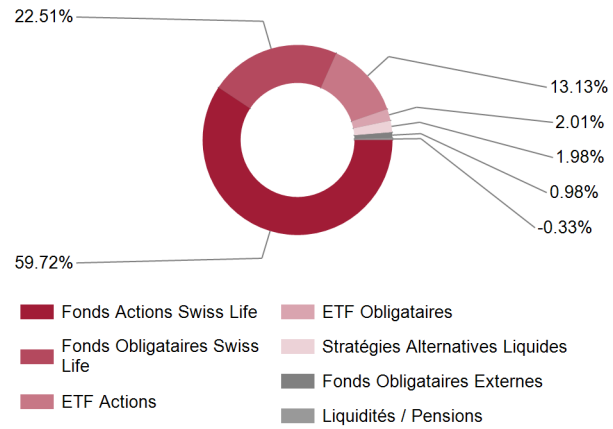
Hebdo. annualisée	1 an	3 ans	Origine
Volatilité du portefeuille	7.02%	9.13%	11.49%
Volatilité de l'indice de réf.	8.17%	11.51%	14.24%
Tracking Error	3.33	7.58	6.76
Ratio d'information	-1.10	-0.39	-0.26
Ratio de Sharpe	1.17	0.38	0.32

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

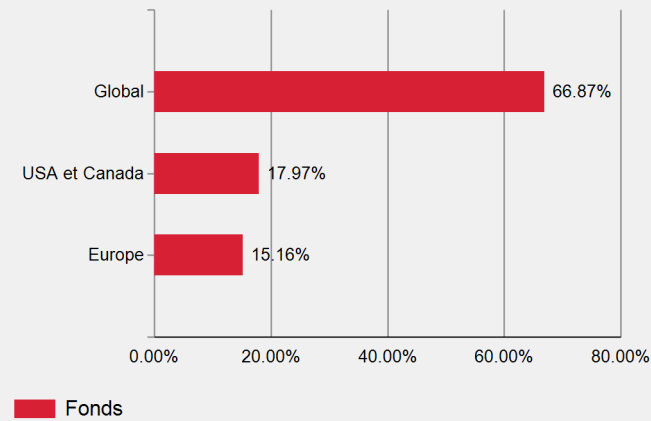
Evolution de l'allocation d'actifs



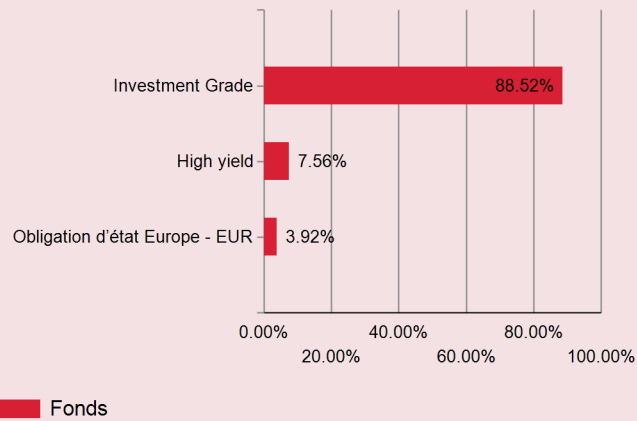
Structure du portefeuille



Répartition géographique actions



Répartition poche taux



Principales positions actions

N°	Émission	Pays	%
1	S LIFE LX-EQUITY ESG USA-S A		13.09%
2	S L LX-EQ ESG GL-S EURCAP		11.10%
3	SWIS LI EQ ESG EUR ZONE-SEUR		10.99%
4	SL LX EQ ESG GLBL PRTCT EUSC		9.97%
5	AMUNDI MSCI USA ESG LEADERS		7.08%

Principales positions taux

N°	Émission	Pays	%
1	SWISS LF BN ESG GBL SVR-SCAP		14.32%
2	S L LX-BD ESG GB CP-S		3.95%
3	SLF (F) BOND 6M I CAP		3.00%
4	ISHARES USD TRES 20+ EUR-H D		1.01%
5	ISHARES EURO GOV 20Y TGT DUR		1.00%