



# Swiss Life Funds (LUX) Equity ESG Global Minimum Volatility EUR AM Cap

Actif net du fonds : 111.27 M USD | Valeur liquidative : 16,837.33 EUR

Morningstar® ★★★



Information SFDR: Article 8

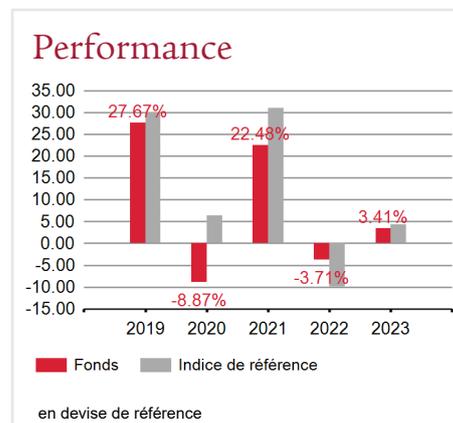
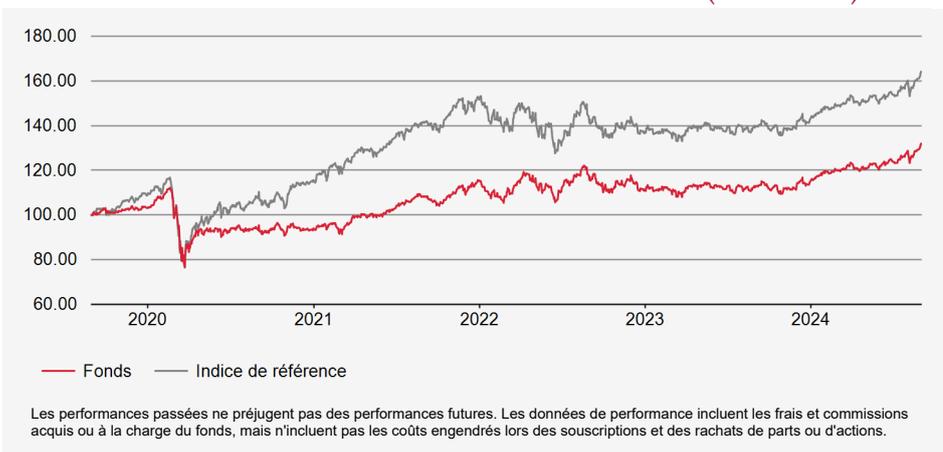
## Commentaire de gestion

Le mois d'août a été positif sur l'ensemble des marchés, avec des anticipations de baisses de taux à la suite des publications économiques. La surperformance observée provient de la sélection de titres au sein de la consommation durable, particulièrement en Amérique du Nord. Par ailleurs, le biais de durabilité du fonds a été positif au cours du mois, avec la surpondération des valeurs notées AAA selon MSCI ESG.

## 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	15.13%	2.73%	17.33%	22.09%	32.02%	68.37%	6.88%	5.71%	8.18%
Indice de réf.	15.21%	2.62%	17.83%	16.17%	64.23%	84.42%	5.12%	10.42%	9.67%

## Caractéristiques du fonds

**Date de création:** 15/01/2018  
**ISIN:** LU1681197981  
**Code Bloomberg:** SLEGMAM LX  
**Devise de référence:** EUR  
**Domicile:** Luxembourg  
**Indice de réf.:** MSCI World Min. Vol. Opt. In EUR Net TR USD IX  
**Souscription minimale:** 10 Parts  
**Commission de souscription (max.):** 5.00%  
**Commission de rachat (max.):** 0.00%  
**Frais de gestion:** 0.15%  
**Commission de performance:** Néant  
**Frais courants au 29/12/2023:** 0.31%  
**Souscriptions / Rachats:** Ordre J avant 15:00 Règlement J+2  
**Distribution des revenus:** Capitalisation  
**Swinging Single Pricing:** Oui  
 Le produit présente un risque de perte en capital.

### Indicateurs de risque

**Max. Drawdown**  
-31.79%

**Recouvrement**  
603 jours

**Beta**  
1.01

**Alpha**  
-0.01

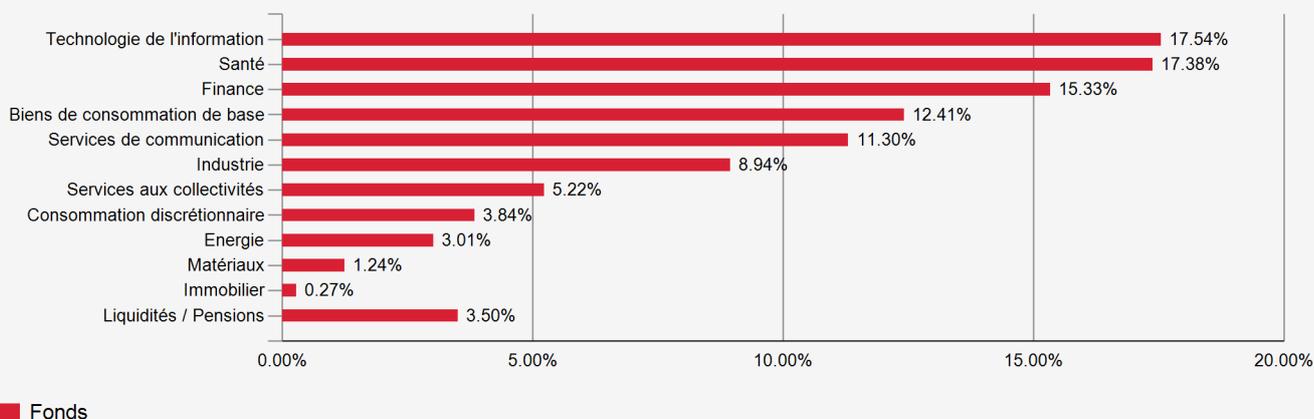
Risque Faible < 1 2 **3** 4 5 6 7 > Risque Élevé

Rendement potentiellement plus faible Rendement potentiellement plus fort

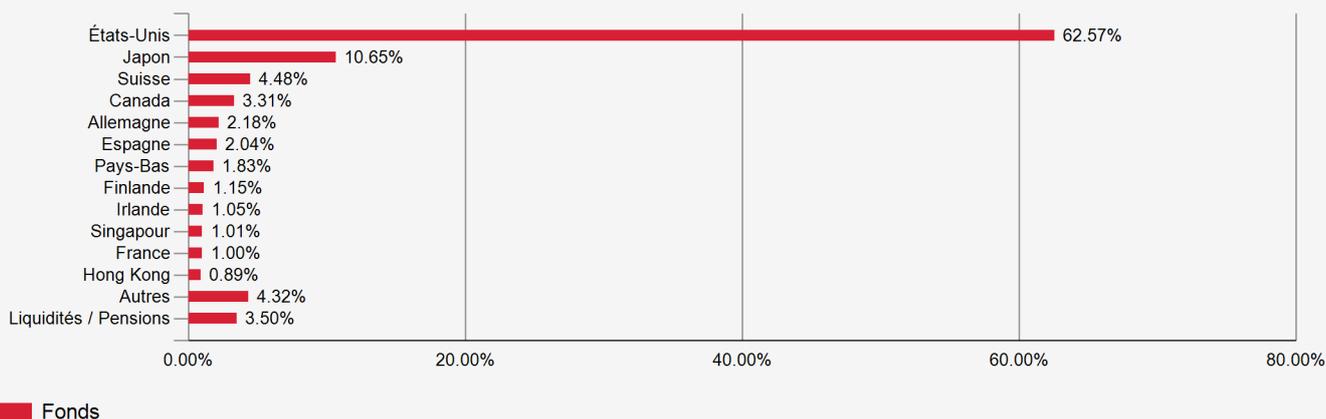
Hebdo. annualisée	1 an	3 ans	Origine
Volatilité du portefeuille	7.16%	10.61%	13.33%
Volatilité de l'indice de réf.	7.00%	11.62%	15.29%
Tracking Error	0.89	4.88	7.28
Ratio d'information	-0.74	0.35	-0.20
Ratio de Sharpe	1.65	0.45	0.54

# Swiss Life Funds (LUX) Equity ESG Global Minimum Volatility EUR AM Cap

## Répartition sectorielle



## Répartition géographique



## Principales positions

N°	Émission	Pays	Secteur	%
1	MOTOROLA SOLUTIONS INC	États-Unis	Technologie de l'information	1.53%
2	NOVARTIS AG-REG	Suisse	Santé	1.53%
3	CISCO SYSTEMS INC	États-Unis	Technologie de l'information	1.52%
4	SOFTBANK CORP	Japon	Services de communication	1.51%
5	KELLANOVA	États-Unis	Biens de consommation de base	1.44%
6	GENERAL MILLS INC	États-Unis	Biens de consommation de base	1.42%
7	KDDI CORP	Japon	Services de communication	1.37%
8	MERCK & CO. INC.	États-Unis	Santé	1.32%
9	INTL BUSINESS MACHINES CORP	États-Unis	Technologie de l'information	1.26%
10	MCKESSON CORP	États-Unis	Santé	1.21%
<b>Total des principales positions</b>				<b>14.12%</b>
<b>Nombre de lignes</b>				<b>203</b>