



# 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

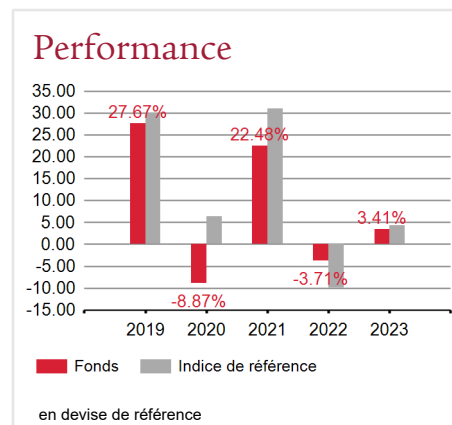
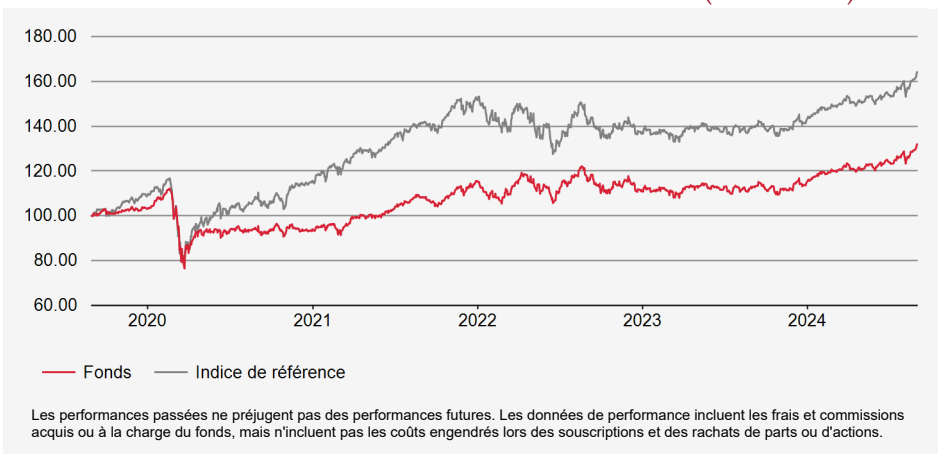
## Commentaire de gestion

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

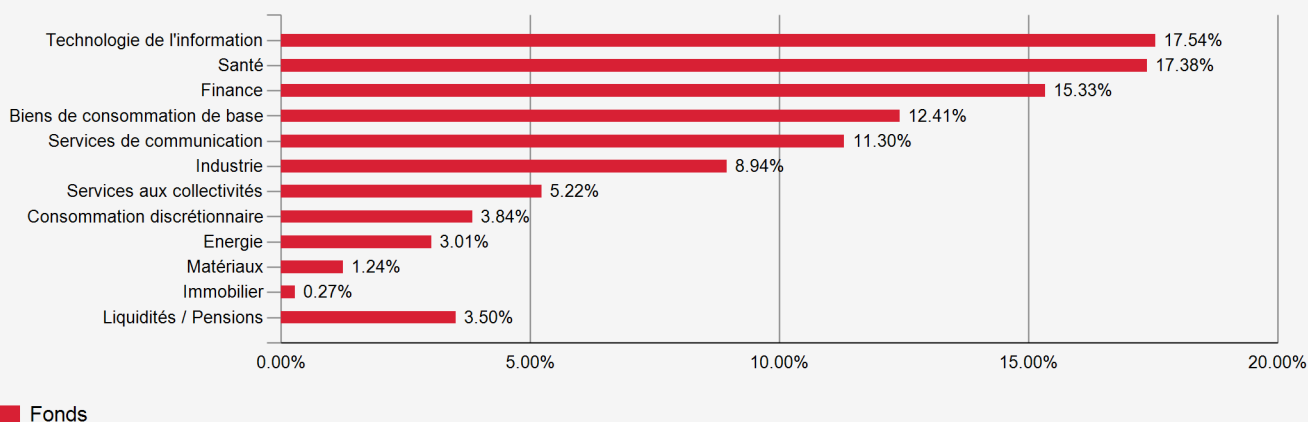
Risque Faible < 1 2 **3** 4 5 6 7 > Risque Élevé

Rendement potentiellement plus faible Rendement potentiellement plus fort

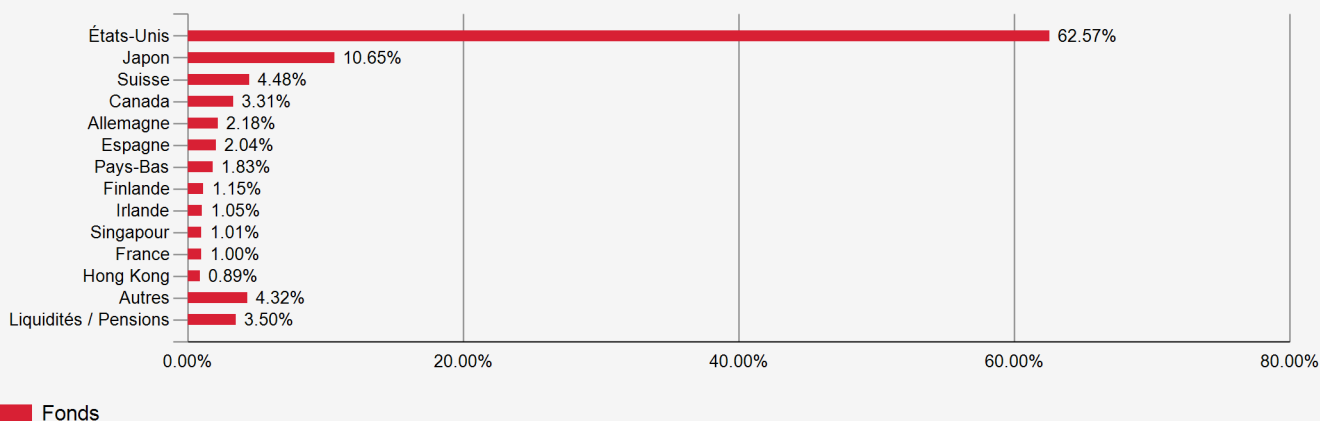
Hebdo. annualisée	1 an	3 ans	Origine
Volatilité du portefeuille	7.16%	10.61%	13.33%
Volatilité de l'indice de réf.	7.00%	11.62%	15.29%
Tracking Error	0.89	4.88	7.28
Ratio d'information	-0.74	0.35	-0.20
Ratio de Sharpe	1.65	0.45	0.54

# 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>

**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)