



Swiss Life Funds (LUX) Equity ESG USA EUR SL Dis

Actif net du fonds : 605.48 M USD | Valeur liquidative : 17,064.33 EUR

Morningstar® ★★★



Information SFDR: Article 8

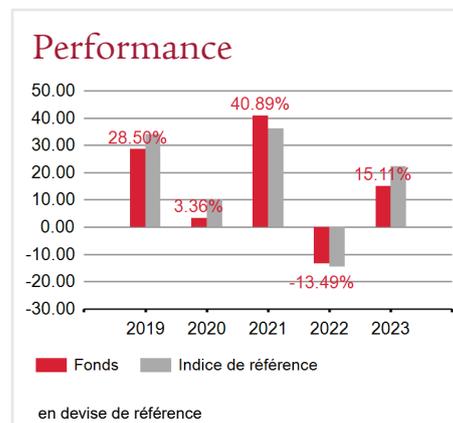
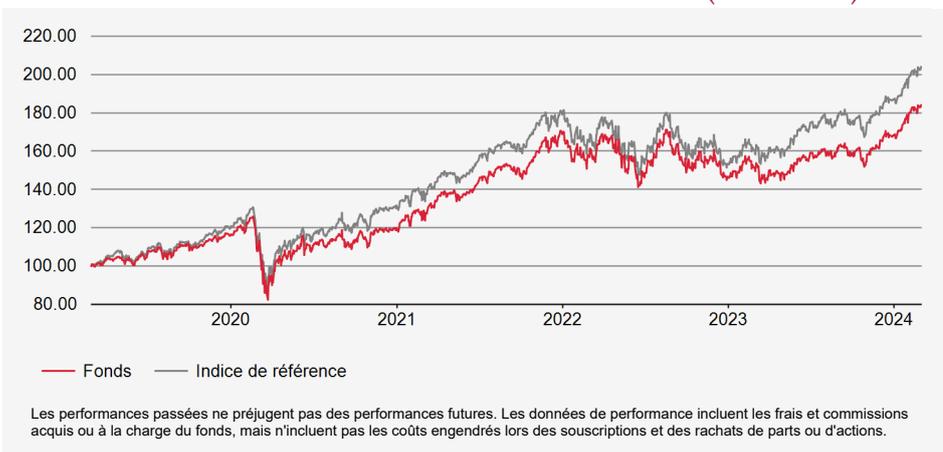
Commentaire de gestion

Le mois dernier, le fonds a sous-performé son indice de référence d'un peu moins de 0,5%. Surpondérer les actions à momentum élevé a été payant. L'exposition à certains titres explique l'essentiel de la performance. La surpondération d'Applied Materials, Deckers Outdoor et Dick's Sporting Goods a profité, la sous-pondération d'Eli Lilly, Amazon et AMD a pesé.

Stratégie d'investissement

Le compartiment utilise un processus d'investissement systématique, basé sur des facteurs, pour investir dans des actions de grandes sociétés cotées. La sélection des titres est effectuée sur une base mensuelle à l'aide d'un filtre quantitatif basé sur des facteurs de risque.

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	9.48%	5.32%	21.92%	47.84%	84.13%	81.76%	13.88%	12.97%	11.47%
Indice de réf.	9.15%	5.72%	27.51%	51.37%	104.09%	102.19%	14.78%	15.32%	13.65%

Caractéristiques du fonds

Date de création: 31/08/2018
ISIN: LU1860185088
Code Bloomberg: SWLEQSL LX
Catégorie Morningstar: Actions Etats-Unis Gdes Cap. Mixte
Devise de référence: EUR
Domicile: Luxembourg
Indice de réf.: MSCI USA NET TR USD INDEX
Souscription minimale: 10 parts
Commission de souscription (max.): 5.00%
Commission de rachat (max.): 0.00%
Frais de gestion: 0.30%
Commission de performance: Néant
Frais courants au 28/02/2023: 0.38%
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

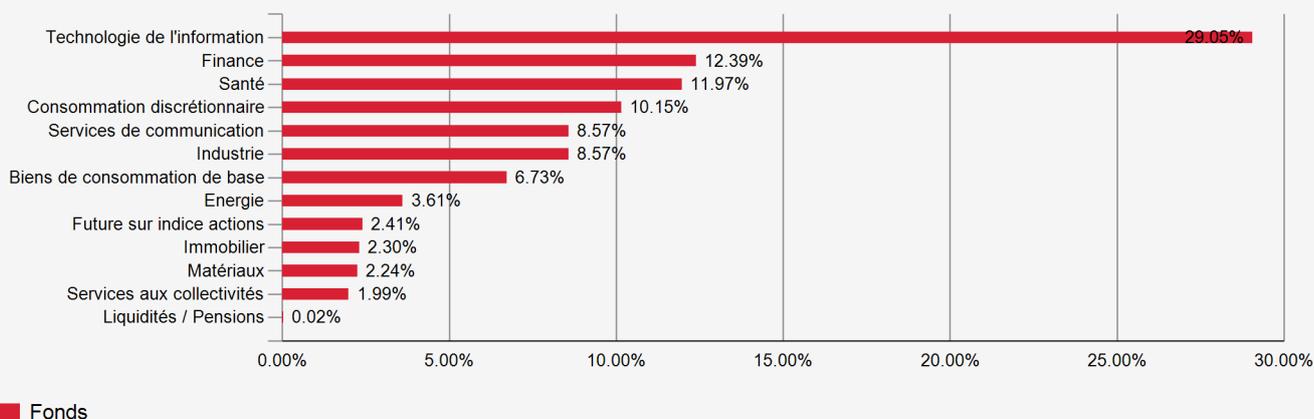
Risque Faible < 1 2 3 4 5 6 7 > Risque Élevé
 Rendement potentiellement plus faible Rendement potentiellement plus fort

Max. Drawdown -34.47%	Hebdo. annualisée	1 an	3 ans	Origine
Recouvrement 303 jours	Volatilité du portefeuille	12.36%	15.15%	18.45%
Beta 0.98	Volatilité de l'indice de réf.	12.39%	15.21%	18.26%
Alpha -0.08	Tracking Error	2.45	2.56	2.88
	Ratio d'information	-2.25	-0.35	-0.75
	Ratio de Sharpe	1.26	0.71	0.57

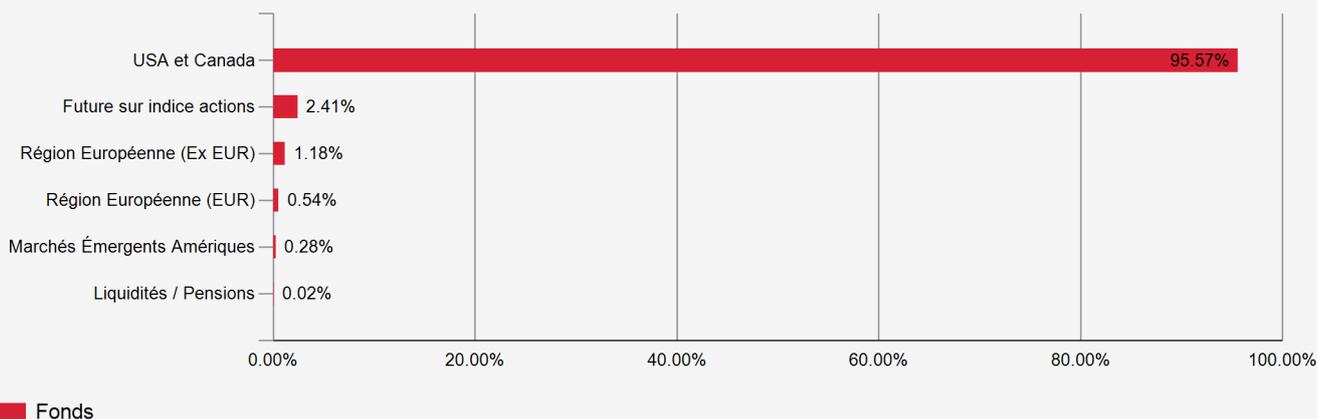
Swiss Life Funds (LUX) Equity ESG USA EUR

SL Dis

Répartition sectorielle



Répartition géographique



Principales positions

N°	Émission	Pays	Secteur	%
1	MICROSOFT CORP	États-Unis	Technologie de l'information	6.86%
2	APPLE INC	États-Unis	Technologie de l'information	5.43%
3	NVIDIA CORP	États-Unis	Technologie de l'information	4.73%
4	AMAZON.COM INC	États-Unis	Consommation discrétionnaire	2.84%
5	META PLATFORMS INC-CLASS A	États-Unis	Services de communication	2.33%
6	ALPHABET INC-CL A	États-Unis	Services de communication	2.04%
7	ALPHABET INC-CL C	États-Unis	Services de communication	1.89%
8	JPMORGAN CHASE & CO	États-Unis	Finance	1.71%
9	UNITEDHEALTH GROUP INC	États-Unis	Santé	1.49%
10	MASTERCARD INC - A	États-Unis	Finance	1.39%
Total des principales positions				30.71%
Nombre de lignes				121