



SwissLife
Asset Managers

Swiss Life Funds (F) Multi Asset Growth F

Actif net du fonds : 132.55 M EUR | Valeur liquidative : 118.50 EUR

Morningstar® ★★★



Information SFDR: Article 8

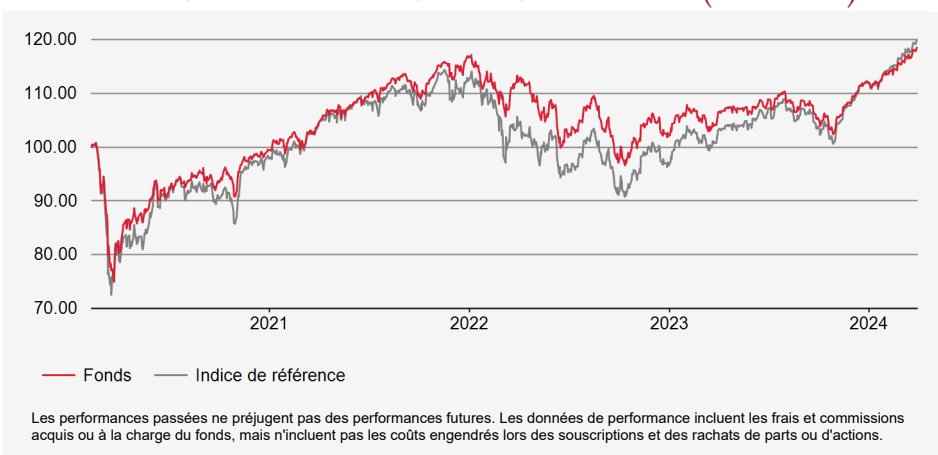
Commentaire de gestion

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 duration a été bénéfique, tout comme notre exposition au High Yield.

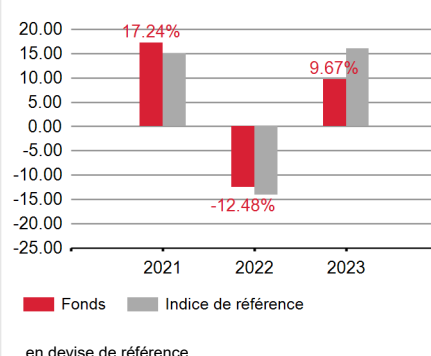
Stratégie d'investissement

Le fonds 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	5.85%	-	11.31%	13.98%	-	18.50%	4.47%	-	4.20%
Indice de réf.	6.93%	-	16.13%	15.18%	-	19.86%	4.83%	-	4.48%

Indicateurs de risque

Max.Drawdown

-25.61%

Recouvrement

290 jours

Duration effective

Fonds Indice de réf.

1.44 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	7.29%	9.61%	13.20%
Volatilité de l'indice de réf.	8.32%	11.37%	15.99%
Tracking Error	1.62	5.27	6.42
Ratio d'information	-2.97	-0.10	-0.04
Ratio de Sharpe	0.98	0.34	0.25

Caractéristiques du fonds

Date de création: 11/02/2020

ISIN: FR0013351533

Code Bloomberg: SLFFVFE FP

Catégorie Morningstar: EUR Aggressive
Allocation - Global

Classification AMF: not applicable

Devise de référence: EUR

Domicile: France

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.): 1.00%

Commission de rachat (max.): 0.00%

Frais de gestion: 0.80%

Commission de performance: Néant

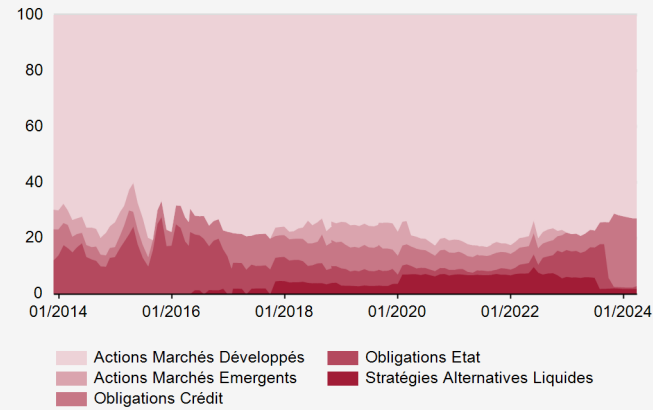
Frais courants au 29/12/2023: 1.08%

Souscriptions / Rachats: Ordre J avant 11:00 Règlement J+2

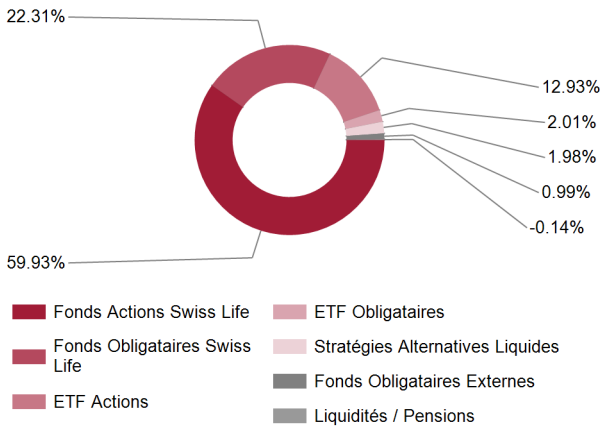
Distribution des revenus: Capitalisation

Le produit présente un risque de perte en capital.

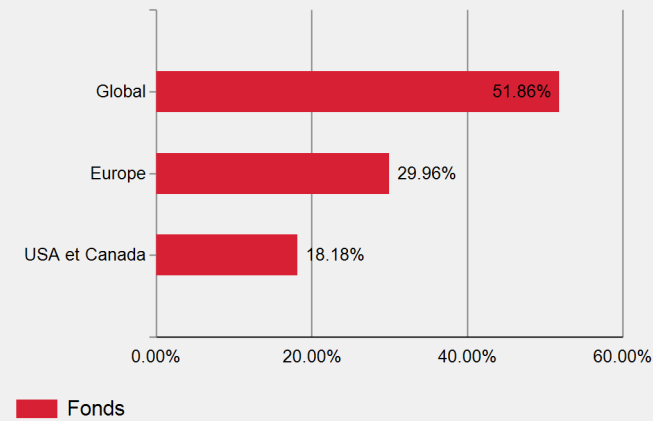
Evolution de l'allocation d'actifs



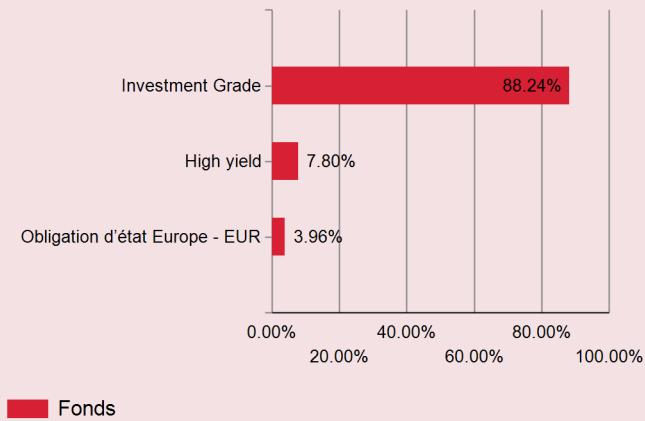
Structure du portefeuille



Répartition géographique actions



Répartition poche taux



Principales positions actions

N°	Émission	Pays	%
1	S LIFE LX-EQUITY ESG USA-AM		13.24%
2	S L LX-EQ ESG GLOBAL-AM		11.14%
3	SWIS LI EQ ESG EUR ZONE-AM		11.02%
4	SL LX EQ ESG GLBL PCT-EU I C		9.99%
5	AMUNDI MSCI USA ESG LEADERS		7.08%

Principales positions taux

N°	Émission	Pays	%
1	SWISS LF BN ESG GBL SVR-AMCP		14.34%
2	S L LX-BD ESG GB CP-AM		3.95%
3	SLF (F) BOND 6M I CAP		2.48%
4	ISHARES USD TRES 20+ EUR-H D		1.01%
5	ISHARES EURO GOV 20Y TGT DUR		1.00%