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

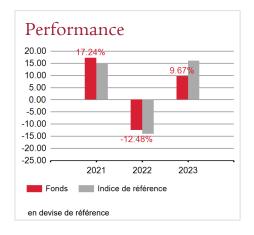
Le fonds affiche une performance positive en mars. Il sous-performe son indice de référence. L'effet allocation est négatif à cause de notre positionnement prudent sur les actions. Toutefois, la sélection est positive. En effet, au sein de la poche action, nous sous-jacents ont, pour la plupart, surperformé. 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)





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	Risque	3 4 5	4 5 6 7 > Risque Élevé Rendement potentiellement plus fort		
Max.Drawdown	Hebdo. annualisée	1 an	3 ans 9.61%	Origine	
-25.61%	Volatilité du portefeuille	7.29%			
Recouvrement 290 jours	Volatilité de l'indice de réf.	8.32%	11.37%	15.99%	
Duration effective	Tracking Error	1.62	5.27	6.42	
Fonds Indice de réf. 1.44 1.95	Ratio d'information	-2.97	-0.10	-0.04	
1.33	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.):

.00%

Commission de rachat (max.): 0.00%

Frais de gestion: 0.80%

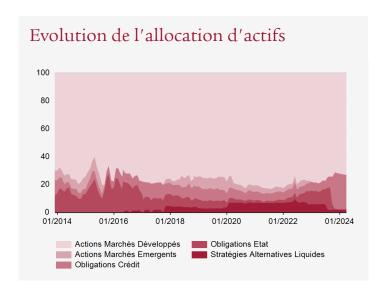
Commission de performance: Néant Frais courants au 29/12/2023: 1.08% Souscriptions / Rachats: Ordre J avant

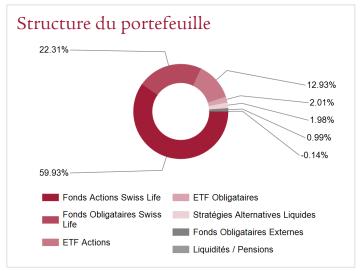
11:00 Règlement J+2

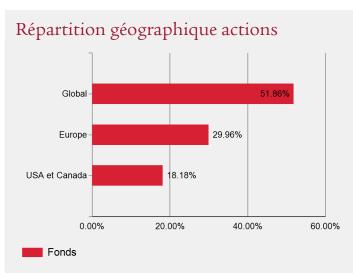
Distribution des revenus: Capitalisation Le produit présente un risque de perte en capital.

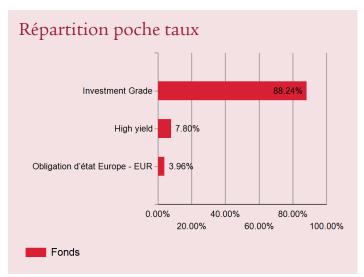
Swiss Life Funds (F) Multi Asset Growth F











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%

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, demiers rapports annuel/semestriel, document d'information olé pour l'investisseur (PIRIPS KIDI), qui constitue la sole base règlementaire 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 Invest GmbH, Zeppelinstrasse 1, 85784 Garching b. Munich | France : Swiss Life Asset Management SA, General-Guisan-Quai 40, 8002 Zurich | Agents payeurs : UBS Switzerland AG, Bahnhofstrasse 45, 8001 Zurich | Allemagne : Swiss Life Invest GmbH, Zeppelinstrasse 1, 85784 Garching b. Munich | France : Swiss Life Asset Management Prace, 153, no. Saint Honoré, 75001 Paris | ou sur www.swissilie-am.com. Les rendements et la valeur des parts de fonds peur de la capital invest dans les parts ne peut être exclue. La performance bet exclue. La performance bristorique 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