Document promotionnel
Reporting mensuel au 29 février 2024

Swiss Life Funds (LUX) Equity ESG USA USD F Cap

Actif net du fonds : 605.48 M USD | Valeur liquidative : 169.74 USD

Morningstar© ★★

Information SFDR: Article 8

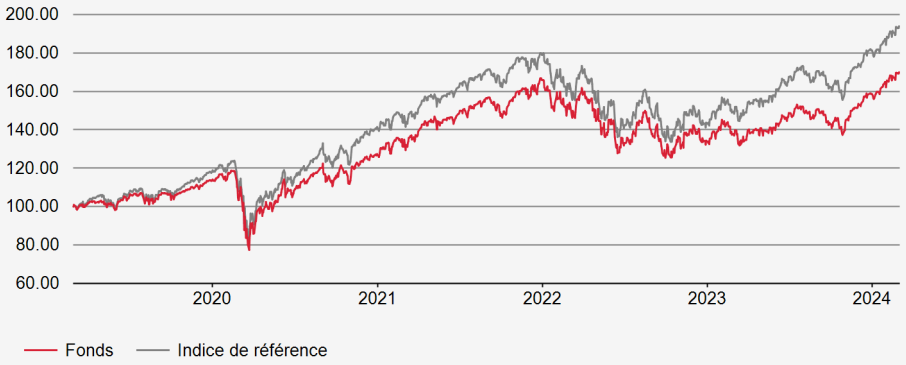
Commentaire de gestion

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

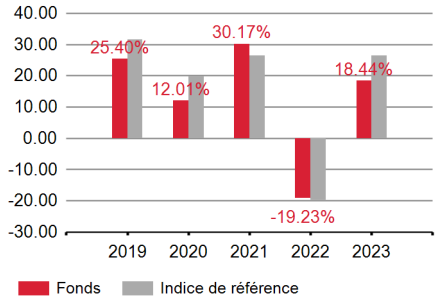
Le compartiment utilise un processus d'investissement systématique, basé sur des facteurs, pour investir dans des actions de grandes sociétés cotées. La sélection des titres est effectuée sur une base mensuelle à l'aide d'un filtre quantitatif basé sur des facteurs de risque.

Évolution de la valeur en devise de référence (base 100)



Les performances passées ne préjugent pas des performances futures. Les données de performance incluent les frais et commissions acquis ou à la charge du fonds, mais n'incluent pas les coûts engendrés lors des souscriptions et des rachats de parts ou d'actions.

Performance



en devise de référence

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	7.16%	4.87%	23.69%	29.59%	70.01%	69.74%	9.00%	11.18%	10.60%
Indice de réf.	6.93%	5.32%	30.11%	34.95%	93.95%	96.70%	10.48%	14.15%	13.75%

Indicateurs de risque

Max.Drawdown
-34.78%

Recouvrement
154 jours

Beta
0.96

Alpha
-0.08

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	13.01%	16.80%	20.55%
Volatilité de l'indice de réf.	13.20%	17.02%	20.27%
Tracking Error	2.75	2.65	2.94
Ratio d'information	-2.32	-0.55	-1.07
Ratio de Sharpe	1.24	0.30	0.39

Caractéristiques du fonds

Date de création: 30/11/2018

ISIN: LU1897149479

Code Bloomberg: SWLEUFU LX

Catégorie Morningstar: Actions Etats-Unis Gdes Cap. Mixte

Devise de référence: USD

Domicile: Luxembourg

Indice de réf.: MSCI USA NET TR USD INDEX

Souscription minimale: 1 Part

Commission de souscription (max.): 5.00%

Commission de rachat (max.): 0.00%

Frais de gestion: 0.85%

Commission de performance: Néant

Frais courants au 28/02/2023: 0.97%

Souscriptions / Rachats: Ordre J avant 15:00 Règlement J+2

Distribution des revenus: Capitalisation

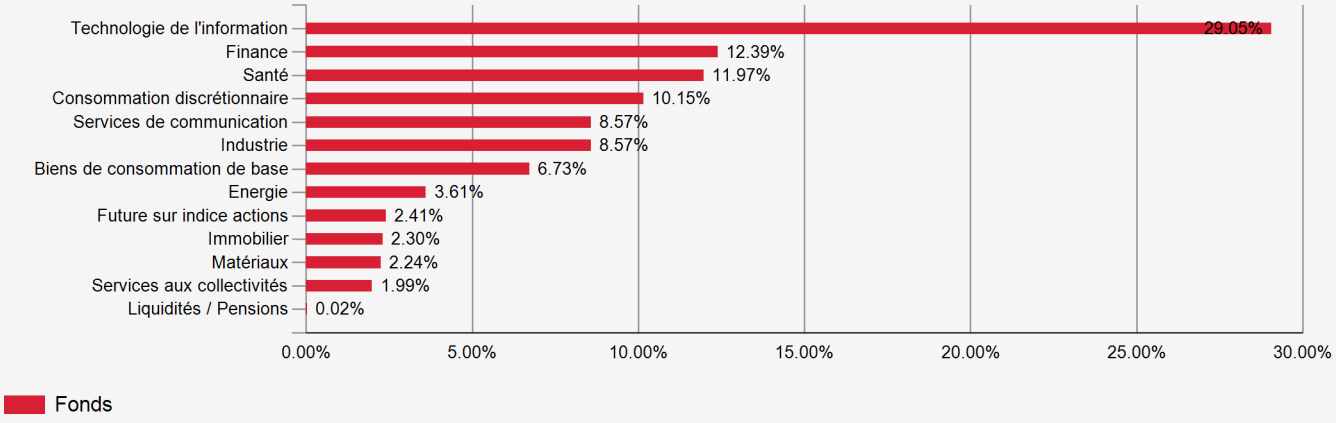
Swing Pricing: Oui

Le produit présente un risque de perte en capital.

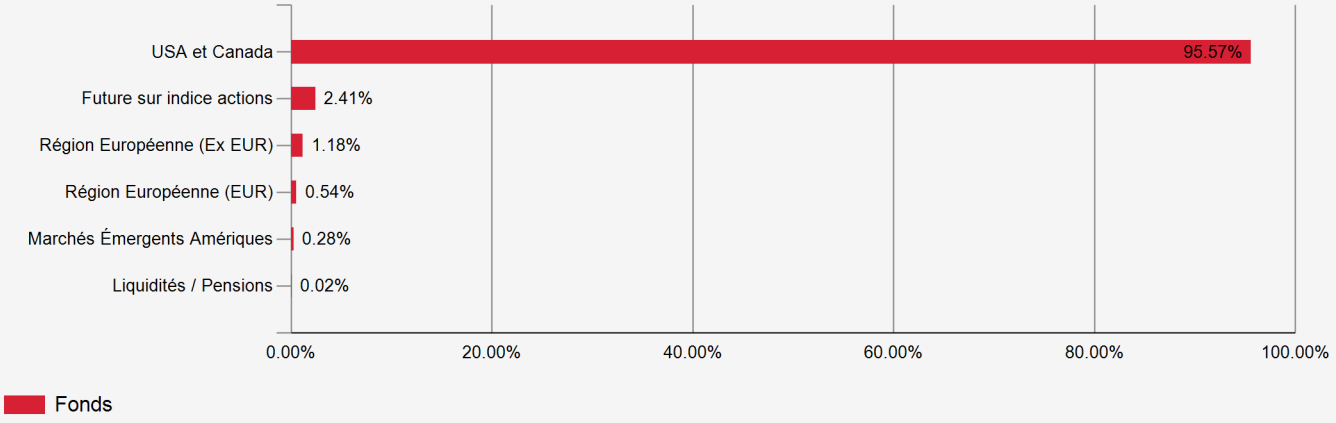
Swing Pricing: L'application du mécanisme de Swing pricing vise à protéger les porteurs existants des effets de dilution causés par des frais de transactions liés à des Souscriptions ou Rachats effectués par d'autres porteurs du fonds. Pour plus d'information veuillez-vous référer au prospectus du fonds. **Avertissement:** Les données historiques utilisées pour calculer l'indicateur synthétique de risque (SRI) pourraient ne pas constituer une indication fiable du profil de risque futur du fonds. La catégorie de risque associée à ce fonds n'est pas garantie et pourra évoluer dans le temps. La catégorie la plus faible n'est pas synonyme de placement sans risque (de 1 = risque faible, rendement potentiellement plus faible à 7 = risque élevé, rendement potentiellement plus fort). **Source:** Swiss Life Asset Managers / ©2024, Morningstar. Tous droits réservés.

Swiss Life Funds (LUX) Equity ESG USA USD F Cap

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**

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 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 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. 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 Etats-Unis, ni bénéficier directement ou indirectement à un citoyen américain ou US Person résidant aux Etats-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. **Source:** Swiss Life Asset Managers / ©2024, Morningstar. Tous droits réservés. **Service client:** info@swisslife-am.com