



Swiss Life Funds (LUX) Equity ESG Global Minimum Volatility EUR I Cap

Actif net du fonds : 155.96 M USD | Valeur liquidative : 109.62 EUR

Morningstar® ★★★



Information SFDR: Article 8

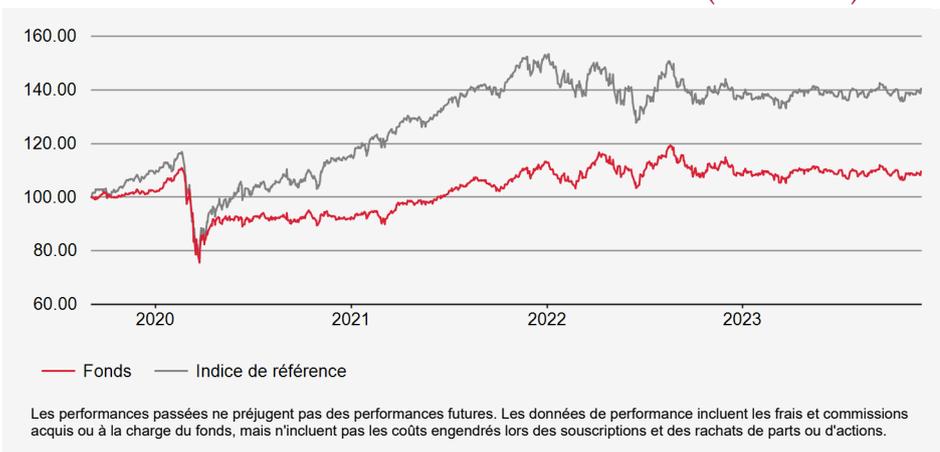
Commentaire de gestion

Novembre a été sous le signe du rebond. Les marchés ont été poussés par la détente sur les taux, les chiffres économiques plaçant pour un atterrissage en douceur de l'économie mondiale. La sous-performance observée provient intégralement de la sélection des titres et plus particulièrement de la consommation discrétionnaire au travers de la sous-pondération de l'action Ferrari. Par ailleurs, le biais de durabilité du fonds a été positif au cours du mois.

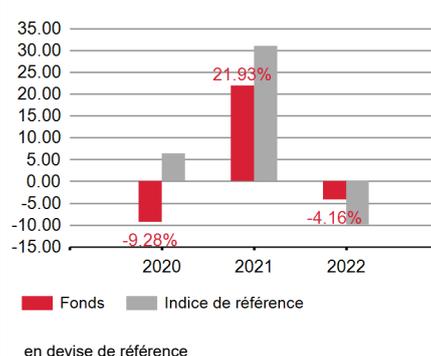
Stratégie d'investissement

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)



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	1.35%	2.22%	-4.59%	18.09%	-	9.62%	5.70%	-	2.19%
Indice de réf.	2.76%	2.54%	-2.48%	23.69%	-	40.48%	7.34%	-	8.34%

Caractéristiques du fonds

Date de création: 03/09/2019
ISIN: LU2038871914
Code Bloomberg: EQGMVEI LX
Catégorie Morningstar: Actions International Gdes Cap. Mixte
Devise de référence: EUR
Domicile: Luxembourg
Indice de réf.: MSCI World Min. Vol. Opt. In EUR Net TR USD IX
Souscription minimale: 1000 parts
Commission de souscription (max.): 5.00%
Commission de rachat (max.): 0.00%
Frais de gestion: 0.60%
Commission de performance: Néant
Frais courants au 28/02/2023: 0.70%
Souscriptions / Rachats: Ordre J avant 15:00 Règlement J+2
Distribution des revenus: Capitalisation
 Le produit présente un risque de perte en capital.

Indicateurs de risque

Max. Drawdown
-31.82%

Recouvrement
611 jours

Beta
1.00

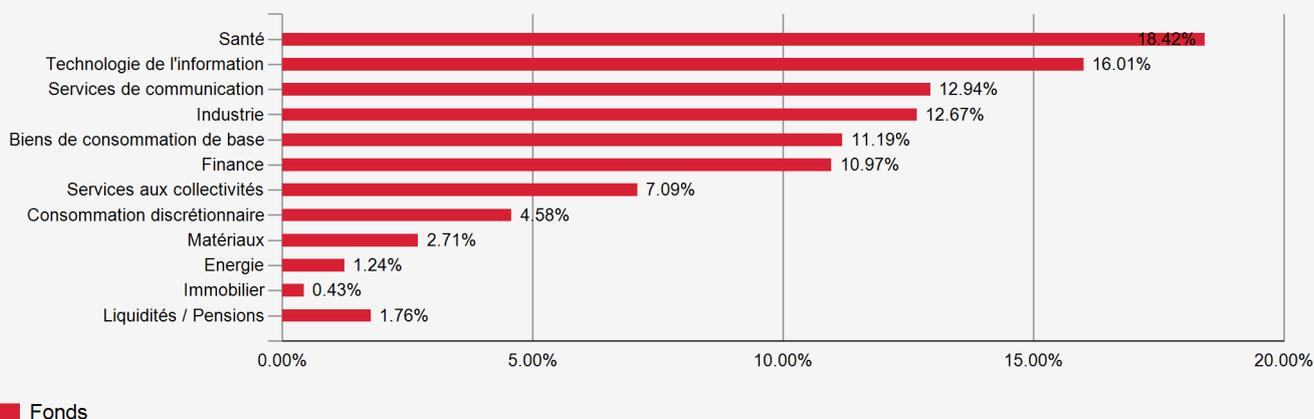
Alpha
-0.04

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

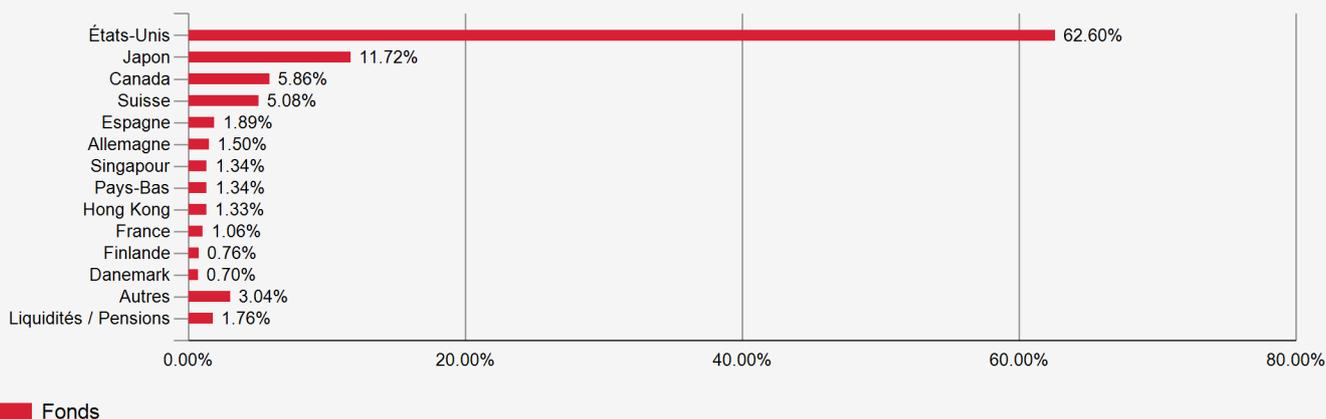
Hebdo. annualisée	1 an	3 ans	Origine
Volatilité du portefeuille	9.06%	10.99%	15.20%
Volatilité de l'indice de réf.	9.01%	12.43%	16.78%
Tracking Error	1.20	6.04	7.87
Ratio d'information	-1.52	-0.34	-0.78
Ratio de Sharpe	-0.74	0.40	0.11

Swiss Life Funds (LUX) Equity ESG Global Minimum Volatility EUR I Cap

Répartition sectorielle



Répartition géographique



Principales positions

N°	Émission	Pays	Secteur	%
1	CISCO SYSTEMS INC	États-Unis	Technologie de l'information	1.63%
2	SOFTBANK CORP	Japon	Services de communication	1.58%
3	MERCK & CO. INC.	États-Unis	Santé	1.50%
4	ELI LILLY & CO	États-Unis	Santé	1.48%
5	WASTE MANAGEMENT INC	États-Unis	Industrie	1.48%
6	GILEAD SCIENCES INC	États-Unis	Santé	1.47%
7	MOTOROLA SOLUTIONS INC	États-Unis	Technologie de l'information	1.43%
8	NOVARTIS AG-REG	Suisse	Santé	1.40%
9	UNITEDHEALTH GROUP INC	États-Unis	Santé	1.37%
10	REPUBLIC SERVICES INC	États-Unis	Industrie	1.33%
Total des principales positions				14.67%
Nombre de lignes				213