



SwissLife
Asset Managers

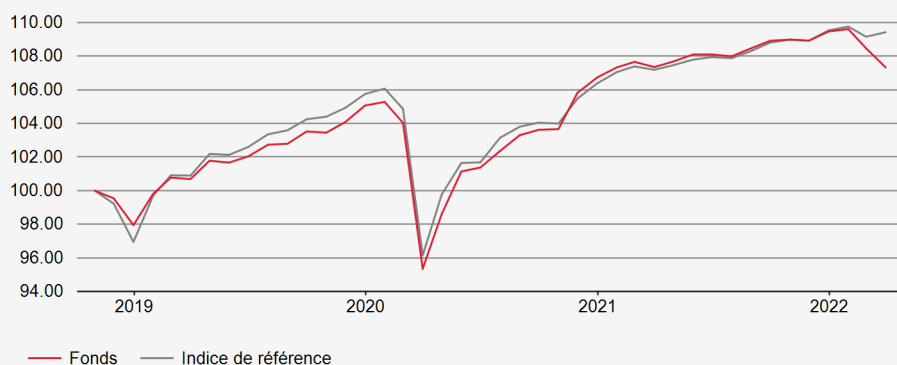
Swiss Life Loan Fund (LUX) S.A., SICAV - SIF Senior Secured Loans V AM-Shares (USD)

ACTIF NET DU FONDS : 333.07 M USD | VALEUR LIQUIDATIVE : 108.79 USD

Stratégie d'investissement

Le fonds vise des rendements stables et élevés avec une volatilité des prix minimale et une durée de taux courte. Le fonds investit principalement dans des prêts privilégiés de premier rang garantis par des sociétés de pays développés. Au moins 85% seront investis dans des prêts garantis de premier rang. Limitation des débiteurs par entreprise: 5%. Au plus 30% sont investis dans le même groupe industriel.

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.

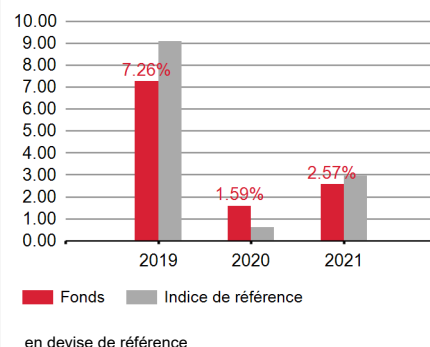
Performances en devise de référence

	PERFORMANCES CUMULÉES				PERFORMANCES ANNUELISÉES			
	YTD	1 MOIS	3 MOIS	1 AN	3 ANS	5 ANS	10 ANS	ORIGINE
FONDS	-1.96%	-1.06%	-1.96%	-0.02%	2.14%	-	-	2.09%
INDICE DE RÉF.	-0.10%	0.25%	-0.10%	2.09%	2.73%	-	-	2.67%

Données statistiques (annualisées)

	1 AN	3 ANS	5 ANS	10 ANS	ORIGINE
Volatilité du portefeuille (en %)	1.85	6.08	-	-	5.88
Volatilité de l'indice de référence (en %)	1.02	5.93	-	-	5.87
Tracking Error ex post (en %)	1.34	1.09	-	-	1.20
Information Ratio	-1.57	-0.54	-	-	-0.48
Sharpe Ratio	-0.06	0.23	-	-	0.20
Corrélation	0.70	0.98	-	-	0.98
Beta	1.28	1.01	-	-	0.97
Jensen alpha	-2.67	-0.61	-	-	-0.53
Maximum Drawdown (en %)	-2.09	-14.26	-	-	-14.26
Recovery Period (ans)	-	0.68	-	-	0.68

Performance



Info. sur le produit

ISIN: LU1902390712
LEI: 254900EGYSHRY8PDOR86
GIIN: YFGBH8.00225.ME.442
Code Bloomberg: SLLSSAM LX
Indice de réf.: 80% JPM USLL USD + 20% EULL USD hedged
Monnaie: USD
Pays d'origine: Luxembourg
Date de création: 31/10/2018
Valeur de lancement: 100.00
Clôture de l'exercice: 31.12
Souscription/Rachat: mensuelle
Délai final d'acceptation:
Souscriptions: Ultimo -2
Rachats: Ultimo -5
Commission de souscription/rachat: aucune
Investissement min.: USD 125,000.00
Asset Manager
Swisslife Asset Management SA
Publication de cours:
www.swisslife-am.com
Frais p.a.: 0.40%
Taux des charges d'exploitation (TER)
Au: 31/12/2020 0.47%

Le cercle des investisseurs est limité aux investisseurs qualifiés, qui ont signé un contrat de gestion de fortune ou un autre contrat de services financiers onéreux avec Swiss Life Asset Management SA ou avec une autre société appartenante au groupe Swiss Life..

Délai final d'acceptation: Ultimo = dernier jour ouvrable bancaire du mois

Frais: Comprend les indemnités selon le contrat de placement

Avertissement: Tous les noms de produits et d'entreprises sont des marques commerciales (™) ou des marques déposées (®) des détenteurs respectifs. Leur utilisation n'implique aucune adhésion ni affiliation de leur part. Source: Swiss Life Asset Managers / © 2022, Morningstar. Tous droits réservés.

Swiss Life Loan Fund (LUX) S.A., SICAV - SIF Senior Secured Loans V AM-Shares (USD)

Structure du portefeuille par branches

	Fonds	Indice de référence
SERVICES	12.14%	5.86%
SANTÉ	11.84%	14.15%
TECHNOLOGIE	9.87%	9.70%
CHIMIE	7.26%	8.45%
CÂBLE ET SATELLITE	6.70%	8.77%
ALIMENTATION ET BOISSONS	5.36%	2.93%
FINANCE	4.46%	4.90%
RADIODIFFUSION	4.40%	2.69%
JEUX/LOISIRS	4.25%	8.75%
HOUSING	4.19%	3.06%
AUTRES	24.08%	30.51%
LIQUIDITÉS	5.02%	-

Débiteurs les plus importants et note

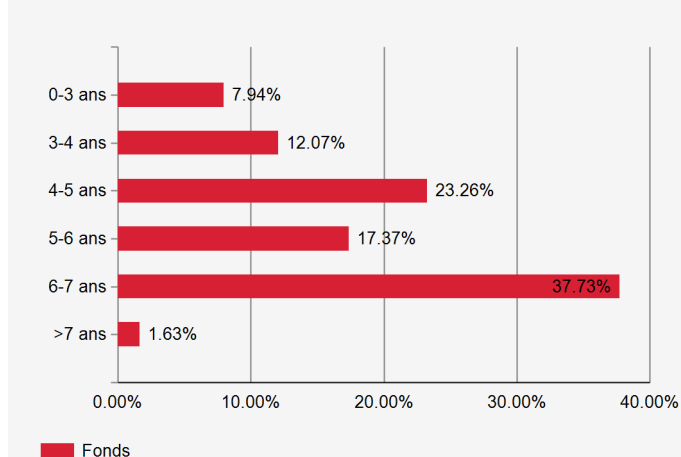
		Fonds
Altice USA	BB	1.74%
CenturyLink	BBB-	1.58%
Virgin/O2	BB-	1.43%
Belron	BB+	1.40%
Avantor	BB+	1.39%

Indications supplémentaires sur les débiteurs

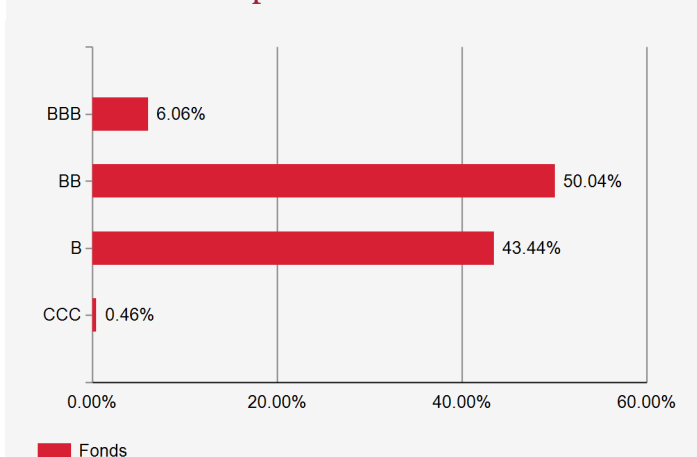
Nombre de débiteurs

247

Structure de l'échéance des titres



Investissement par notes



Structure du portefeuille par monnaies/rendements (sans liquidités)

	Fonds		Indice de référence	
	Poids	Rendements	Poids	Rendements
USD	62.07%	4.05%	80.00%	3.93%
EUR	37.93%	4.25%	20.00%	3.39%
Moyenne	-	4.13%	-	3.82%

Structure du portefeuille selon les pays/régions

	Fonds	Indice de réf.
ÉTATS-UNIS	56.48%	81.23%
ROYAUME-UNI	9.40%	4.81%
PAYS-BAS	7.41%	1.29%
LUXEMBOURG	6.61%	0.55%
ALLEMAGNE	3.25%	1.03%
ESPAGNE	2.55%	1.10%
FRANCE	2.23%	0.32%
IRLANDE	1.83%	3.99%
BELGIQUE	1.47%	0.74%
SUÈDE	1.33%	-
AUTRES	2.43%	4.94%
LIQUIDITÉS	5.02%	-

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 (DICI)), qui constitue la seule base réglementaire 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 présumant 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 États-Unis, ni bénéficier directement ou indirectement à un citoyen américain ou US Person résidant aux États-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 / ©2022, Morningstar. Tous droits réservés. **Service client:** info@swisslife-am.com