



Swiss Life Funds (LUX) Multi Asset Moderate EUR SF Cap

Actif net du fonds : 1,533.09 M EUR | Valeur liquidative : 94.45 EUR



Information SFDR: Article 8

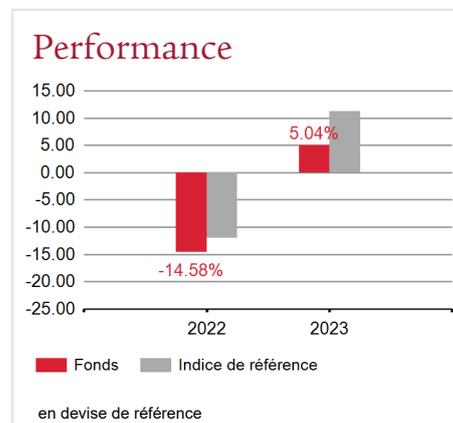
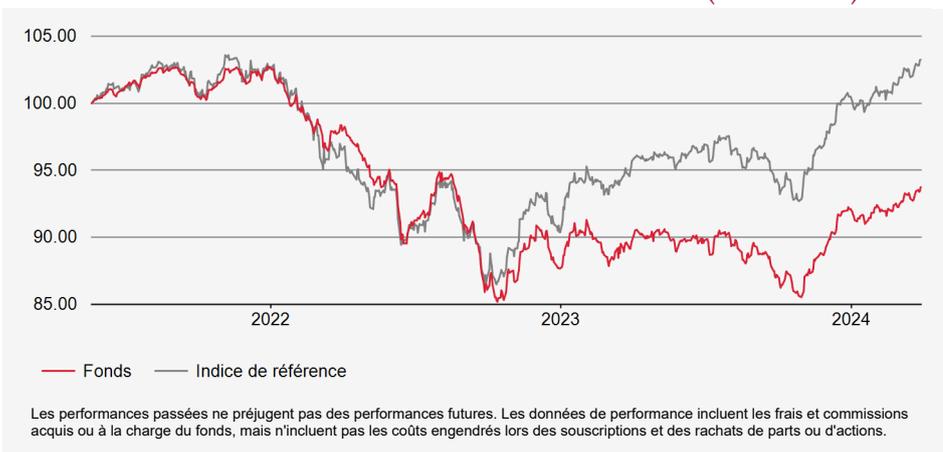
Commentaire de gestion

Le fonds affiche une performance positive en mars. Il est en ligne avec 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, les sous-jacents ont, pour la plupart, surperformé. De même, au sein de la poche Obligataire, où notre ajustement en durée a été bénéfique, tout comme notre exposition au High Yield.

Stratégie d'investissement

Le compartiment met en œuvre une gestion multi-actifs sur l'ensemble des zones géographiques avec un profil de type défensif. 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					Origine	Performances annualisées		
	YTD	1 mois	1 an	3 ans	5 ans		3 ans	5 ans	Origine
Fonds	1.79%	1.62%	4.49%	-	-	-6.24%	-	-	-2.13%
Indice de réf.	2.74%	1.65%	7.90%	-	-	3.25%	-	-	1.07%

Caractéristiques du fonds

Date de création: 01/04/2021
ISIN: LU2083923446
Code Bloomberg: SLMAMSF LX
Catégorie Morningstar: Allocation EUR Prudente - International
Devise de référence: EUR
Domicile: Luxembourg
Indice de réf.: 70% BLOOMBERG GLO AGG IND HEDGED EUR + 20% MSCI World 100% Hedged to EUR Net Total Return Ind + 10% MSCI Euro TR Net Index (EUR)
Souscription minimale: 1 part
Commission de souscription (max.): 5.00%
Commission de rachat (max.): 0.00%
Frais de gestion: 2.16%
Commission de performance: Néant
Frais courants au 29/12/2023: 2.64%
Souscriptions / Rachats: Ordre J avant 15:00 Réglément J+2
Distribution des revenus: Capitalisation
 Le produit présente un risque de perte en capital.

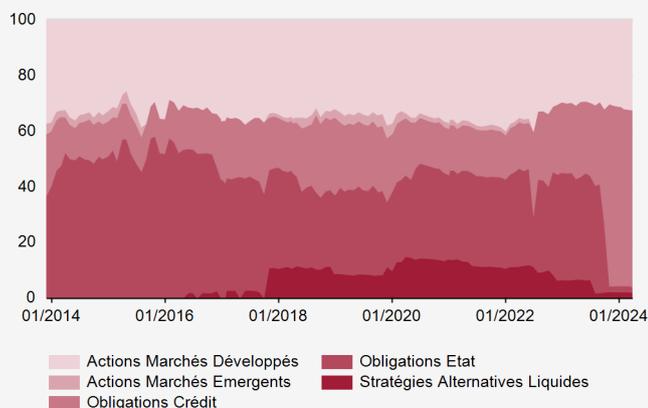
Indicateurs de risque

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

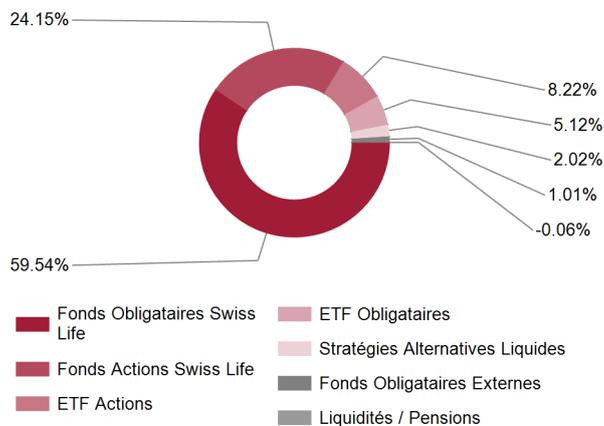
Max. Drawdown -17.05%	Hebdo. annualisée	1 an	3 ans	Origine
Recouvrement -	Volatilité du portefeuille	5.46%	-	6.27%
Duration effective	Volatilité de l'indice de réf.	5.73%	-	6.57%
Fonds: 3.92 Indice de réf.: 4.59	Tracking Error	1.96	-	3.66
	Ratio d'information	-1.74	-	-0.91
	Ratio de Sharpe	0.15	-	-0.57

Swiss Life Funds (LUX) Multi Asset Moderate EUR SF Cap

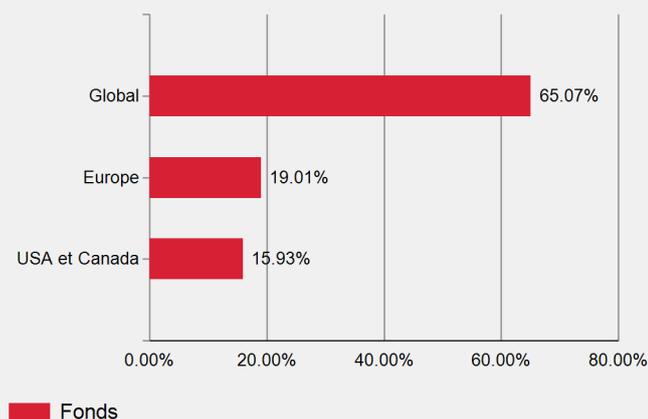
Evolution de l'allocation d'actifs



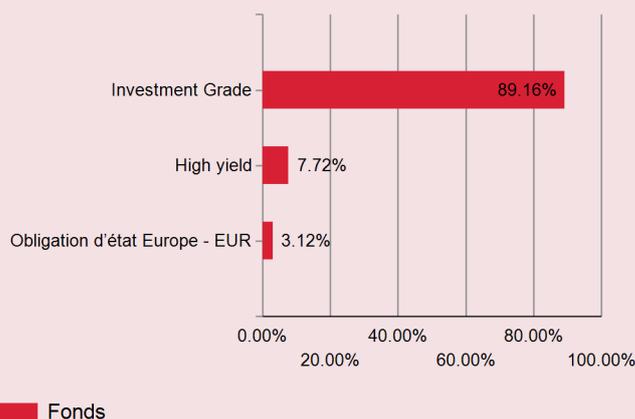
Structure du portefeuille



Répartition géographique actions



Répartition poche taux



Principales positions actions

N°	Émission	Pays	%
1	S L LX-EQ ESG GL-S EURCAP		5.16%
2	S LIFE LX-EQUITY ESG USA-S A		5.16%
3	AM MSCI EU ESG LEAD-ETF A		5.13%
4	SWIS LI EQ ESG EUR ZONE-SEUR		5.12%
5	SL LX EQ ESG GLBL PRTCT EUSC		4.08%

Principales positions taux

N°	Émission	Pays	%
1	SWISS LF BN ESG GBL SVR-SCAP		18.95%
2	SWISS LF BN ESG GBL AGG-SCAP		18.94%
3	S L LX-BD ESG GB CP-S		14.06%
4	S LIFE LX-BD ESG EU HY-S		4.06%
5	ISHARES USD TRES 20+ EUR-H D		3.08%