



Swiss Life Funds (LUX) Multi Asset ESG Balanced EUR R Cap

Actif net du fonds : 49.41 M EUR | Valeur liquidative : 99.19 EUR



Information SFDR: Article 8

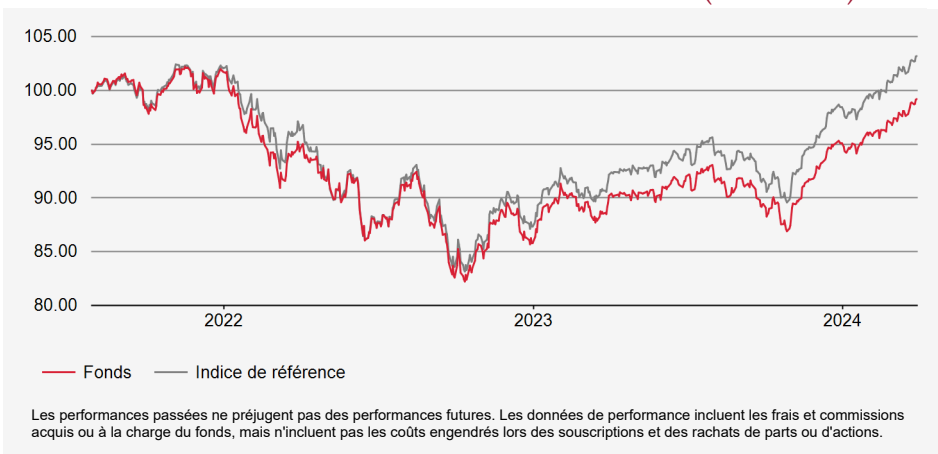
Commentaire de gestion

Le fonds affiche une performance positive en mars. Il surperforme son indice de référence. L'effet allocation est positif avec une légère surexposition sur les actions. De plus la sélection au sein de la poche Obligataire est positive, où notre ajustement en duration a été bénéfique, tout comme notre exposition à la dette d'entreprise. La poche Action a également bien performé avec l'allocation multi factorielle qui surperforme.

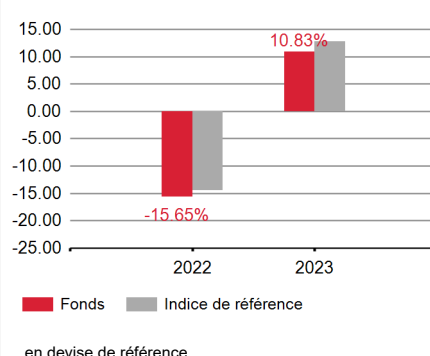
Stratégie d'investissement

Le sous-fonds investit dans plusieurs classes d'actifs avec un profil d'investisseur équilibré. L'objectif est de générer des revenus et d'atteindre une croissance à long terme du point de vue d'un investisseur en euro en s'exposant activement à un large éventail de marchés financiers mondiaux. Un objectif extra-financier est associé à cette fin, entraînant l'intégration systématique de critères ESG.

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	4.32%	2.26%	9.95%	-	-	-0.81%	-	-	-0.30%
Indice de réf.	4.82%	2.20%	11.96%	-	-	3.18%	-	-	1.18%

Caractéristiques du fonds

Date de création: 29/07/2021

ISIN: LU2350032103

Code Bloomberg: MUAEBRC LX

Catégorie Morningstar: Allocation EUR
Modérée - International

Devise de référence: EUR

Domicile: Luxembourg

Indice de réf.: 50% BLOOMBERG GLO AGG
IND HEDGED EUR + 35% MSCI World 100%
Hedged to EUR Net Total Return Ind + 15% 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: 1.45%

Commission de performance: Néant

Frais courants au 29/12/2023: 1.79%

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.

Indicateurs de risque

Max. Drawdown

-19.52%

Recouvrement

-

Duration effective

Fonds Indice de réf.

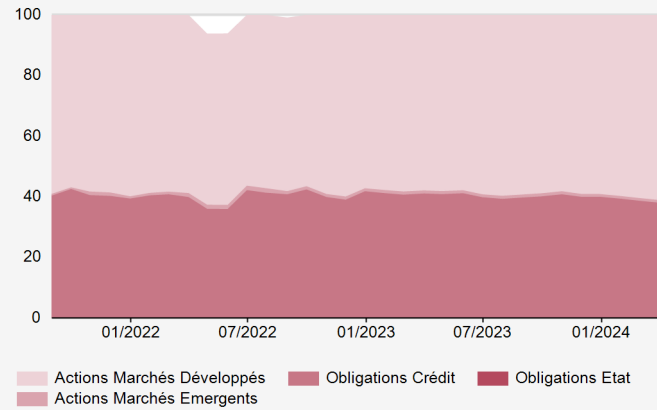
2.49 3.26

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

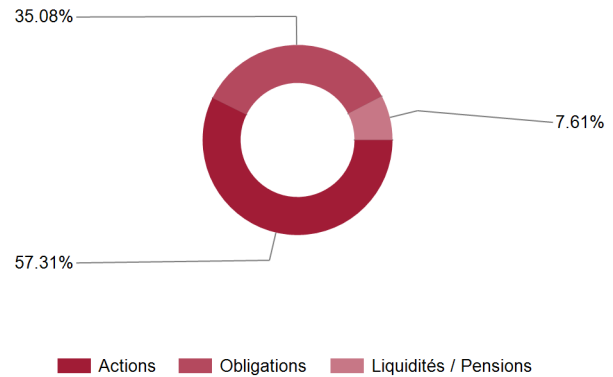
Hebdo. annualisée	1 an	3 ans	Origine
Volatilité du portefeuille	6.75%	-	8.70%
Volatilité de l'indice de réf.	6.84%	-	8.66%
Tracking Error	0.85	-	1.42
Ratio d'information	-2.37	-	-1.03
Ratio de Sharpe	0.88	-	-0.20

Swiss Life Funds (LUX) Multi Asset ESG Balanced EUR R Cap

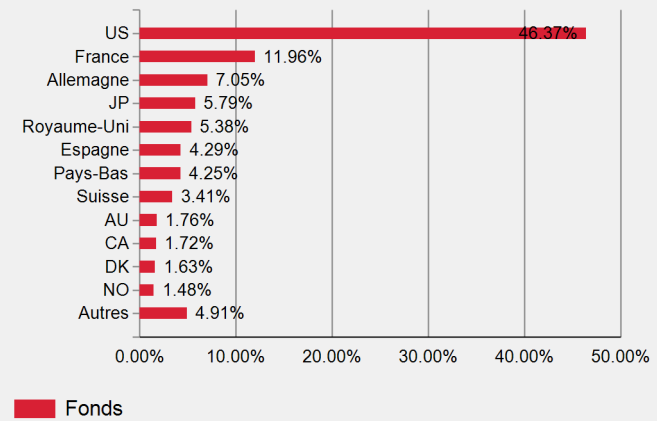
Evolution de l'allocation d'actifs



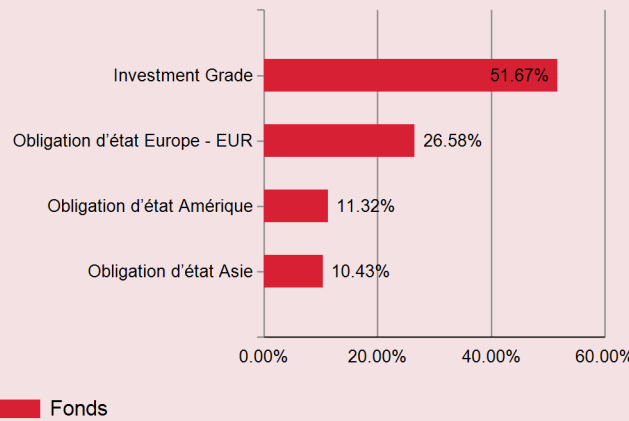
Structure du portefeuille



Répartition géographique actions



Répartition poche taux



Principales positions actions

N°	Émission	Pays	%
1	MICROSOFT CORP	États-Unis	2.01%
2	NVIDIA CORP	États-Unis	1.70%
3	APPLE INC	États-Unis	1.43%
4	ASML HOLDING NV	Pays-Bas	1.30%
5	LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI	France	0.79%

Principales positions taux

N°	Émission	Pays	%
1	FRANCE O.A.T. FRTR 0 3/4 11/25/28	France	1.99%
2	US TREASURY N/B T 4 1/8 11/15/32	États-Unis	1.46%
3	DEUTSCHLAND REP DBR 1.7 08/15/32	Allemagne	1.39%
4	JAPAN GOVT 10-YR JGB 0.1 03/20/31	Japon	1.33%
5	US TREASURY N/B T 2 3/4 08/15/32	États-Unis	1.05%