



SwissLife
Asset Managers

Swiss Life Funds (F) Equity ESG Europe Minimum Volatility D

Actif net du fonds : 173.84 M EUR | Valeur liquidative : 154.97 EUR

Morningstar® ★★★



Information SFDR: Article 8

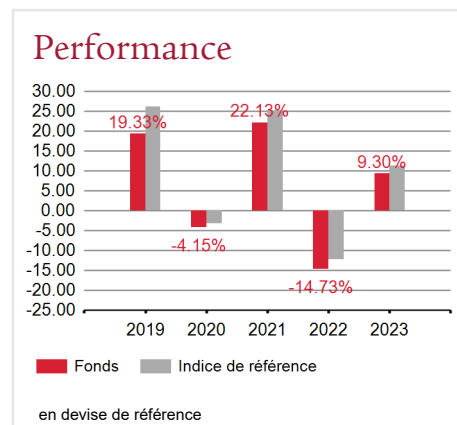
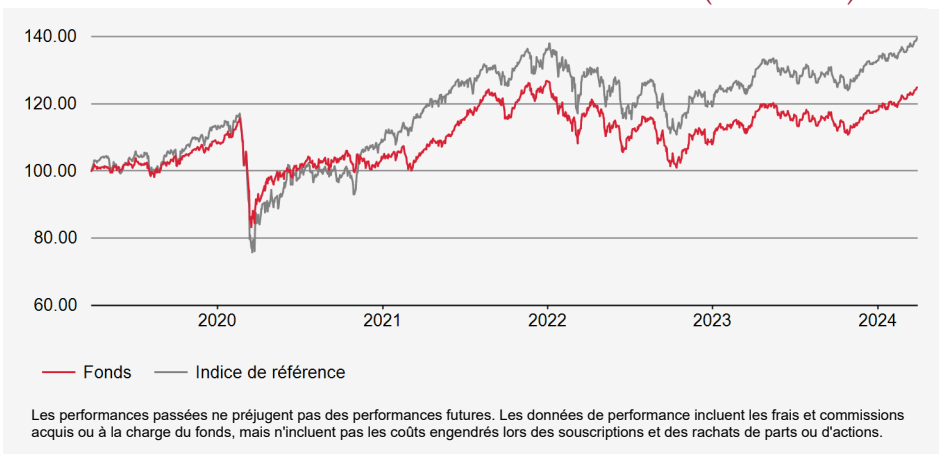
Commentaire de gestion

Le mois de mars a été la poursuite des mois précédents avec les acteurs du marché espérant pour une baisse prochaine des taux directeur lié à une inflation proche de la stabilisation. La sous-performance observée provient de la sélection de titres et particulièrement provenant des valeurs technologiques telles que SAP et des industrielles Par ailleurs, le biais de durabilité du fonds a été fortement négatif au cours du mois.

Stratégie d'investissement

Le fonds investit en actions européennes, 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 de son univers. Le portefeuille est construit grâce à un modèle d'optimisation propriétaire.

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



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	5.84%	-	7.57%	18.02%	24.63%	45.97%	5.69%	4.50%	1.47%
Indice de réf.	5.13%	-	8.84%	18.47%	38.63%	166.34%	5.82%	6.75%	3.85%

Caractéristiques du fonds

Date de création: 21/04/1998
ISIN: FR0010074922
Code Bloomberg: SLFAEUD FP
Catégorie Morningstar: Actions Europe Gdes Cap. Mixte
Classification AMF: Actions Internationales
Devise de référence: EUR
Domicile: France
Indice de réf.: MSCI Europe Min. Volatility Opt in Euro Net Local
Souscription minimale: 0.01 part
Commission de souscription (max.): 3.00%
Commission de rachat (max.): 0.00%
Frais de gestion: 1.75%
Commission de performance: Néant
Frais courants au 29/12/2023: 1.75%
Souscriptions / Rachats: Ordre J avant 15:00 Règlement J+2
Distribution des revenus: Distribution
Swing Pricing: Oui
Le produit présente un risque de perte en capital.

Indicateurs de risque

Max. Drawdown

-27.94%

Recouvrement

473 jours

Beta

0.98

Alpha

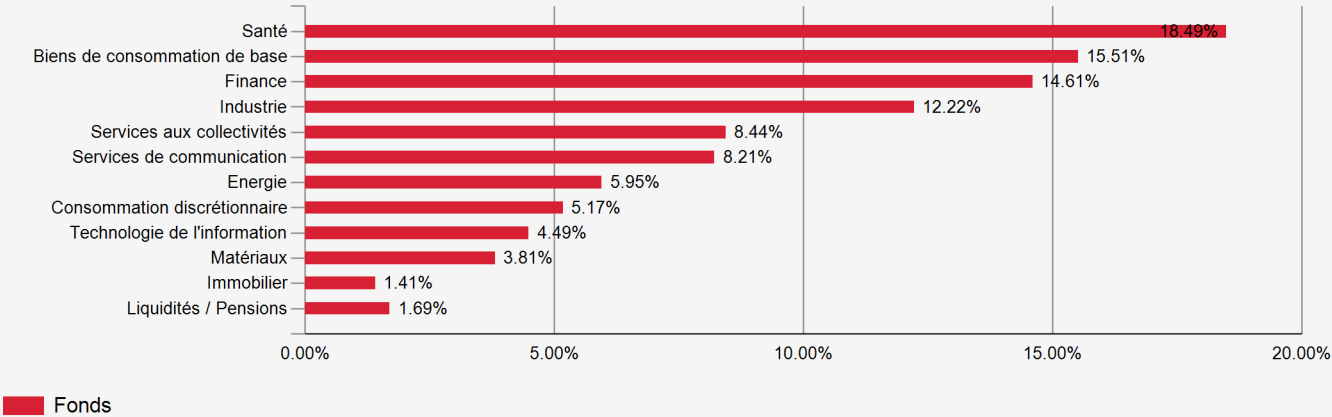
-0.02

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

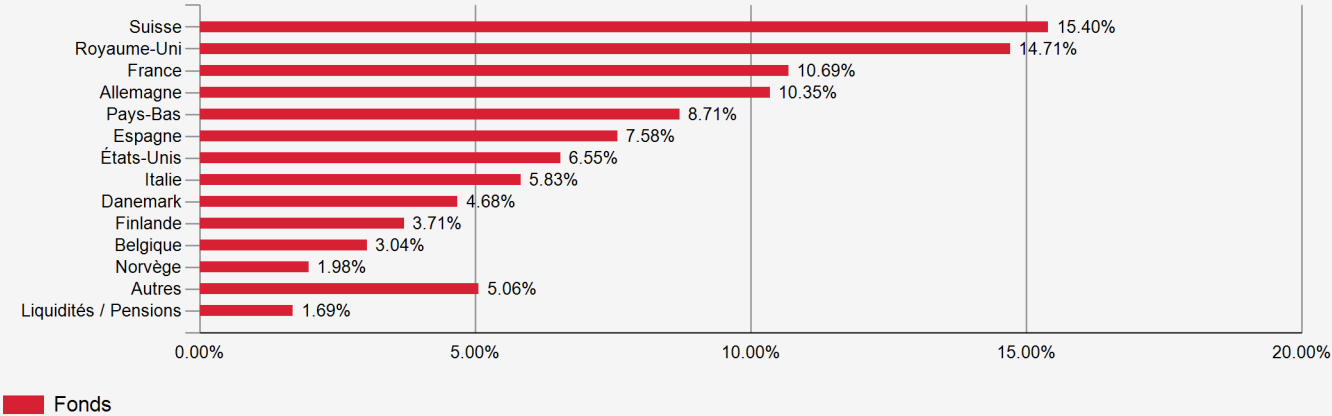
Hebdo. annualisée	1 an	3 ans	Origine
Volatilité du portefeuille	9.05%	11.71%	17.41%
Volatilité de l'indice de réf.	9.17%	12.50%	20.25%
Tracking Error	0.96	5.11	7.26
Ratio d'information	-1.33	-0.02	-0.33
Ratio de Sharpe	0.41	0.38	0.00

Swiss Life Funds (F) Equity ESG Europe Minimum Volatility D

Répartition sectorielle



Répartition géographique



Principales positions

N°	Émission	Pays	Secteur	%
1	ZURICH INSURANCE GROUP AG	Suisse	Finance	2.33%
2	RELX PLC	Royaume-Uni	Industrie	2.28%
3	KONINKLIJKE KPN NV	Pays-Bas	Services de communication	2.25%
4	NOVO NORDISK A/S-B	Danemark	Santé	2.15%
5	REDEIA CORP SA	Espagne	Services aux collectivités	2.15%
6	UNILEVER PLC	Royaume-Uni	Biens de consommation de base	2.13%
7	ASSICURAZIONI GENERALI	Italie	Finance	2.06%
8	KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N	Pays-Bas	Biens de consommation de base	1.99%
9	BAE SYSTEMS PLC	Royaume-Uni	Industrie	1.95%
10	SAP SE	Allemagne	Technologie de l'information	1.83%
Total des principales positions				21.12%
Nombre de lignes				138

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 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 Invest GmbH, Zeppelinstrasse 1, 85784 Garching b. Munich | 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 acquis ou à la charge du fonds (par exemple la commission de gestion). La performance n'inclut pas les coûts engendrés au niveau du client (coûts et commissions de souscription 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 / ©2024, Morningstar. Tous droits réservés. **Service client:** service.client-securites@swisslife-am.com