



# SLF (France) FCPE Harmonie

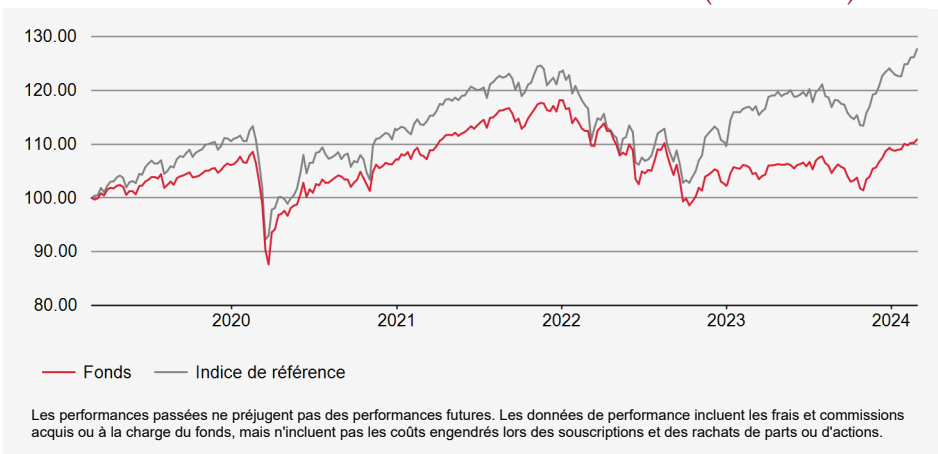
Actif net du fonds : 15.91 M EUR | Valeur liquidative : 19.39 EUR

Information SFDR: Article 8

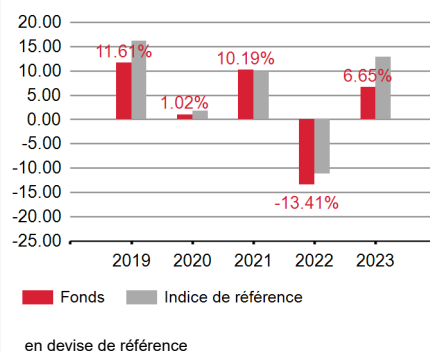
## Stratégie d'investissement

SLF (France) FCPE Harmonie est un fonds multi-entreprises, réservé aux entreprises clientes du Groupe SwissLife. Le FCPE est exposé, au travers du FCP maître Swiss Life Funds (F) Harmony, à différentes classes d'actifs internationales avec un profil de type équilibré. 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)



## 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	1.62%	-	6.13%	2.65%	10.86%	93.90%	0.87%	2.08%	3.34%
Indice de réf.	3.16%	-	9.80%	12.32%	27.67%	103.76%	3.93%	5.00%	3.59%

## Caractéristiques du fonds

**Date de création:** 29/12/2003  
**ISIN:** FR0000085672  
**Code Bloomberg:** SLFCPEQ FP  
**Catégorie Morningstar:** Allocation EUR Modérée - International  
**Classification AMF:** not applicable  
**Devise de référence:** EUR  
**Domicile:** France  
**Indice de réf.:** 50% DJ Euro Stoxx50 Return (EUR) Index Level + 50% JPMorgan Government Bond Index Broad Hedged EUR TR  
**Souscription minimale:** Néant  
**Commission de souscription (max.):** 4.75%  
**Commission de rachat (max.):** 0.00%  
**Frais de gestion:** 0.80%  
**Commission de performance:** Néant  
**Frais courants au 29/12/2023:** 1.95%  
**Souscriptions / Rachats:** Ordre Vendredi avant 14:00 Règlement J+2  
**Distribution des revenus:** Capitalisation  
 Le produit présente un risque de perte en capital.

## Indicateurs de risque

**Max. Drawdown**

**-19.27%**

**Recouvrement**

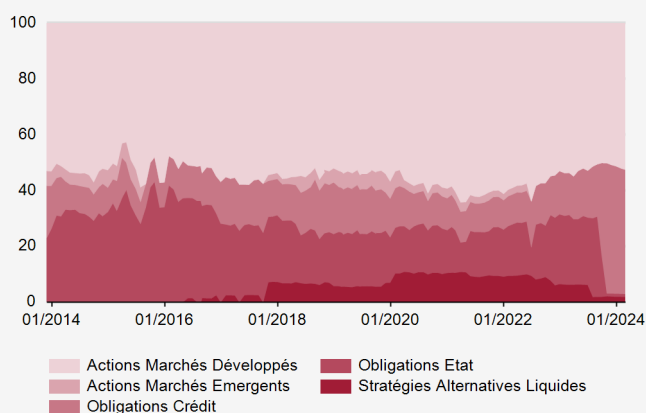
**322 jours**

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

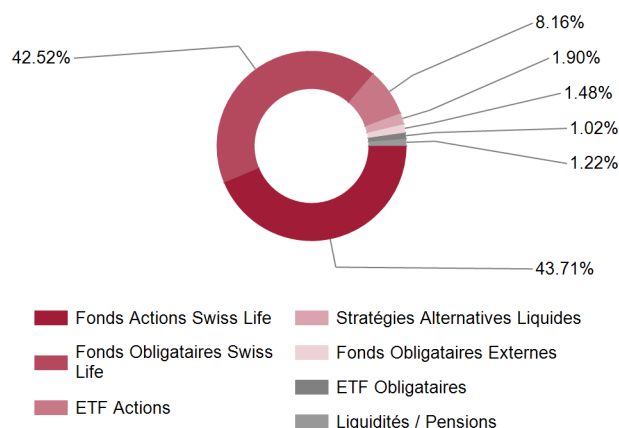
Hebdo. annualisée	1 an	3 ans	Origine
Volatilité du portefeuille	5.71%	8.06%	8.66%
Volatilité de l'indice de réf.	6.96%	9.45%	10.22%
Tracking Error	2.84	4.05	5.01
Ratio d'information	-1.29	-0.75	-0.05
Ratio de Sharpe	0.44	-0.03	0.27

# SLF (France) FCPE Harmonie

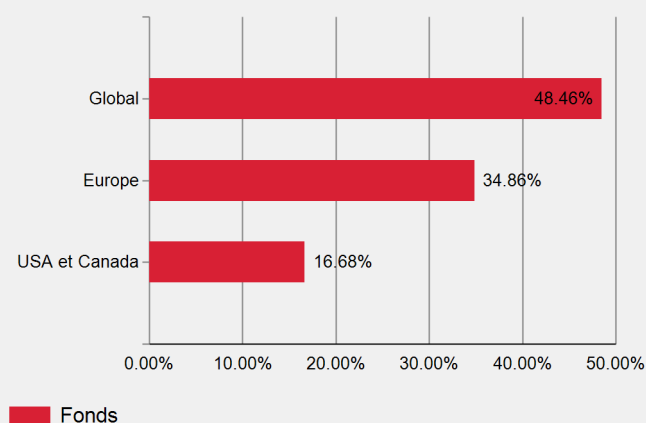
## Evolution de l'allocation d'actifs



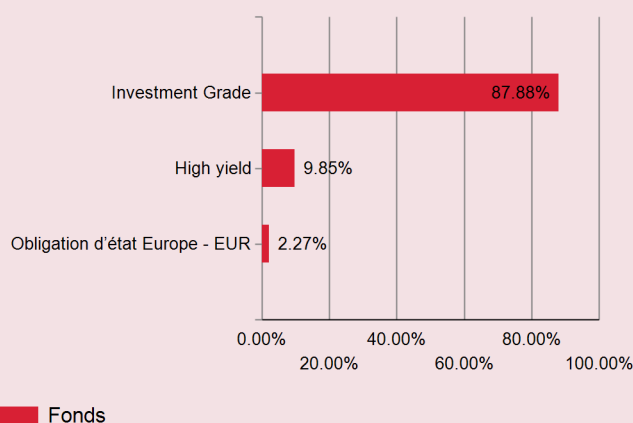
## Structure du portefeuille



## Répartition géographique actions



## Répartition poche taux



## Principales positions actions

N°	Émission	Pays	%
1	S LIFE LX-EQUITY ESG USA-AM		8.65%
2	SL LX EQ ESG GLBL PCT-EU I C		8.06%
3	S L LX-EQ ESG GLOBAL-AM		7.08%
4	AM MSCI EU ESG LEAD-ETF A		6.59%
5	SWIS LI EQ ESG EUR ZONE-AM		6.07%

## Principales positions taux

N°	Émission	Pays	%
1	SWISS LF BN ESG GBL SVR-AMCP		17.64%
2	SWISS LF BN ESG GBL AGG-AMCP		11.74%
3	S L LX-BD ESG GB CP-AM		5.84%
4	SLF (F) BOND 6M I CAP		3.63%
5	SWISS LIFE LX-BD GL HY-AM		2.96%