



SLF (France) FCPE Modéré

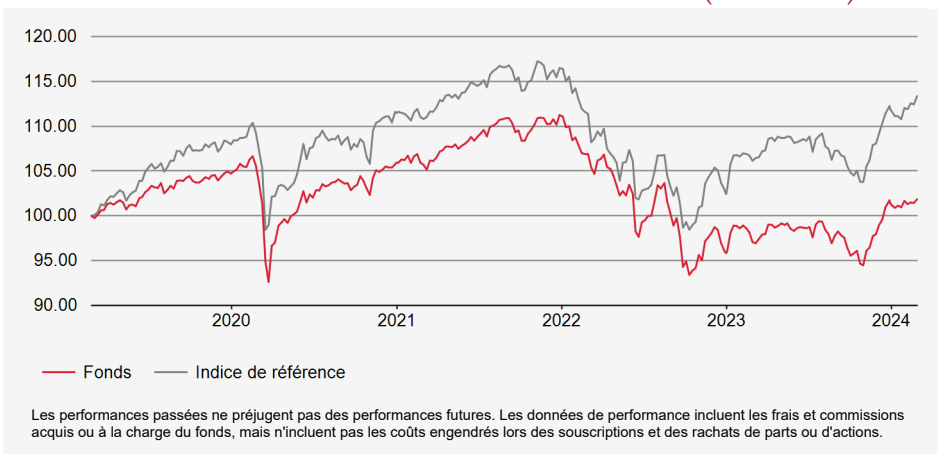
Actif net du fonds : 24.67 M EUR | Valeur liquidative : 17.01 EUR

Information SFDR: Article 8

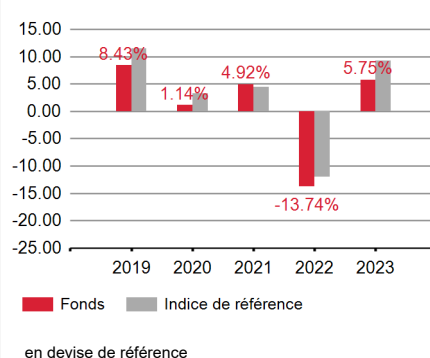
Stratégie d'investissement

SLF (France) FCPE Modéré 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) Defensive, à différentes classes d'actifs internationales 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)



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	0.47%	-	4.94%	-3.84%	1.86%	70.79%	-1.29%	0.37%	2.69%
Indice de réf.	1.33%	-	6.80%	2.11%	13.36%	86.28%	0.69%	2.54%	3.13%

Indicateurs de risque

Max. Drawdown

-16.04%

Recouvrement

-

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	4.84%	6.44%	5.77%
Volatilité de l'indice de réf.	5.08%	6.68%	6.15%
Tracking Error	1.97	2.57	4.15
Ratio d'information	-0.95	-0.77	-0.11
Ratio de Sharpe	0.28	-0.37	0.30

Caractéristiques du fonds

Date de création: 28/12/2003

ISIN: FR0000085680

Code Bloomberg: SLFCPMD FP

Catégorie Morningstar: Allocation EUR Prudente - International

Classification AMF: not applicable

Devise de référence: EUR

Domicile: France

Indice de réf.: 70% JPMorgan Government Bond Index Broad Hedged EUR TR + 30% DJ Euro Stoxx50 Return (EUR) Index Level

Souscription minimale: Néant

Commission de souscription (max.): 4.75%

Commission de rachat (max.): 0.00%

Frais de gestion: 0.70%

Commission de performance: Néant

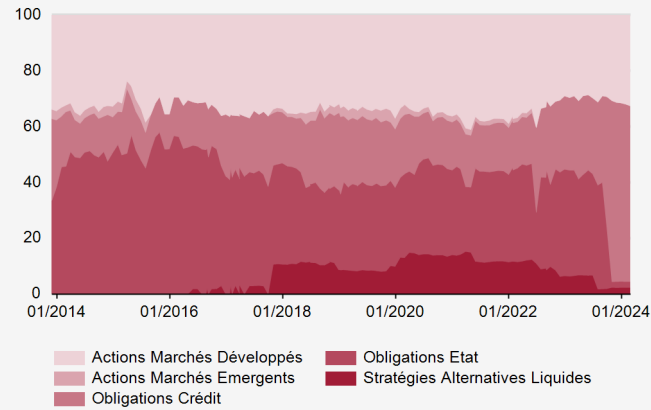
Frais courants au 29/12/2023: 1.61%

Souscriptions / Rachats: Ordre Vendredi avant 14:00 Règlement J+2

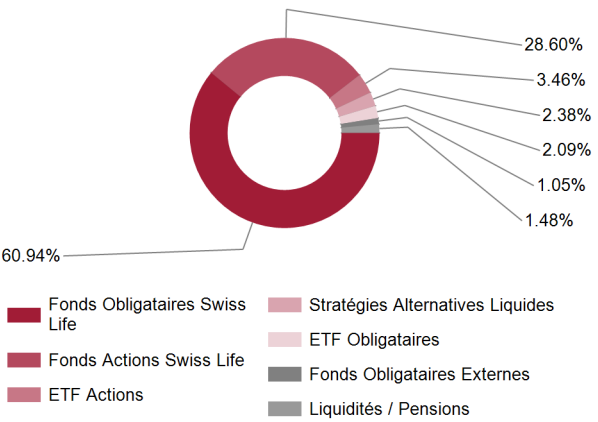
Distribution des revenus: Capitalisation

Le produit présente un risque de perte en capital.

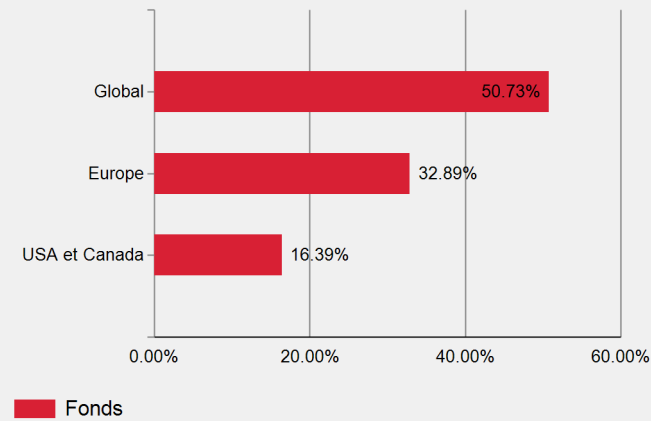
Evolution de l'allocation d'actifs



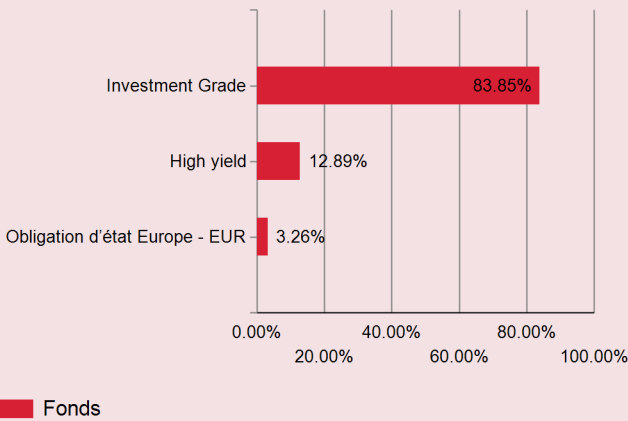
Structure du portefeuille



Répartition géographique actions



Répartition poche taux



Principales positions actions

N°	Émission	Pays	%
1	S LIFE LX-EQUITY ESG USA-AM		5.25%
2	S L LX-EQ ESG GLOBAL-AM		5.25%
3	SL LX EQ ESG GLBL PCT-EU I C		5.22%
4	SWIS LI EQ ESG EUR ZONE-AM		3.66%
5	SWIS L LX-EQ ESG GL HD-AM		2.57%

Principales positions taux

N°	Émission	Pays	%
1	SWISS LF BN ESG GBL AGG-AMCP		19.24%
2	SWISS LF BN ESG GBL SVR-AMCP		19.22%
3	S L LX-BD ESG GB CP-AM		14.15%
4	S LIFE LX-BD ESG EU HY-AM		5.12%
5	ISHARES EURO GOV 20Y TGT DUR		2.09%