



Swiss Life Funds (F) Multi Asset Growth P

ACTIF NET DU FONDS : 112.62 M EUR | VALEUR LIQUIDATIVE : 236.36 EUR

Morningstar® ★★★



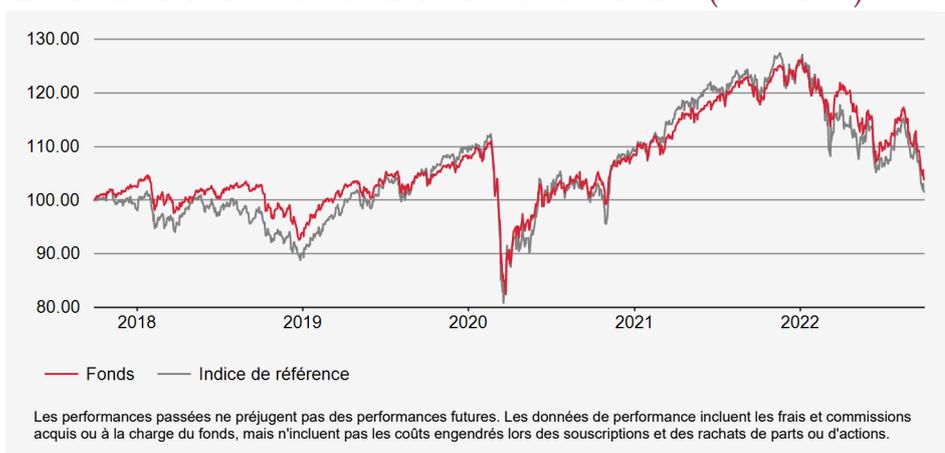
Commentaire de gestion

Le fonds a eu des performances négatives sur le mois de septembre, majoritairement alimentées par la baisse des marchés actions. Le fonds surperforme son indice de référence sur la période. Face à la baisse de l'ensemble des marchés, c'est l'effet sélection qui mène la surperformance. L'allocation et la diversification sont légèrement négatives sur la période. La sélection est, elle, plus que positive avec des stratégies plus prudentes visant à réduire la volatilité de notre exposition aux actions.

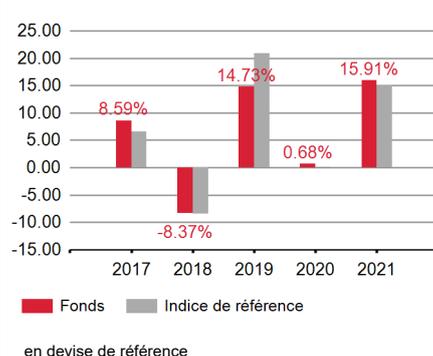
Stratégie d'investissement

Le fonds met en œuvre une gestion multi-actifs sur l'ensemble des zones géographiques avec un profil de type dynamique. 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 ANNUELISÉES			
	YTD	1 MOIS	1 AN	3 ANS	5 ANS	ORIGINE	3 ANS	5 ANS	ORIGINE
FONDS	-17.44%	-	-12.34%	-1.34%	3.85%	55.04%	-0.45%	0.76%	1.96%
INDICE DE RÉF.	-19.05%	-	-15.37%	-4.11%	1.54%	9.96%	-1.39%	0.31%	0.42%

Caractéristiques du fonds

Date de création: 18/02/2000
ISIN: FR0000977779
Code Bloomberg: SLFTOPF FP
Catégorie Morningstar: EUR Aggressive Allocation - Global
Classification AMF: not applicable
Devise de référence: EUR
Domicile: France
Indice de réf.: 50% MSCI World 100% Hedged to EUR Net Total Return Ind + 30% BLOOMBERG GLO AGG IND HEDGED EUR + 20% MSCI Euro TR Net Index (EUR)
Souscription minimale: 0.001 part(s)
Commission de souscription (max.): 1.00%
Commission de rachat (max.): 0.00%
Frais de gestion: 1.70%
Commission de performance: Néant
Frais courants au 31/12/2021: 2.03%
Souscriptions / Rachats: Ordre J avant 11:00 Règlement J+2
Distribution des revenus: Capitalisation
 Le produit présente un risque de perte en capital.

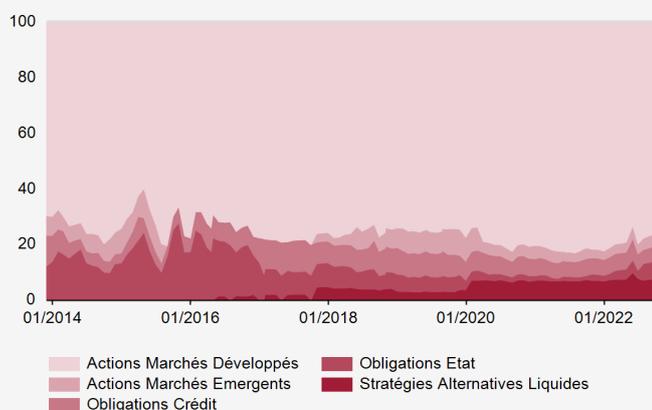
Indicateurs de risque

RISQUE FAIBLE < 1 2 3 4 5 6 7 > RISQUE ÉLEVÉ
 RENDEMENT POTENTIELLEMENT PLUS FAIBLE RENDEMENT POTENTIELLEMENT PLUS FORT

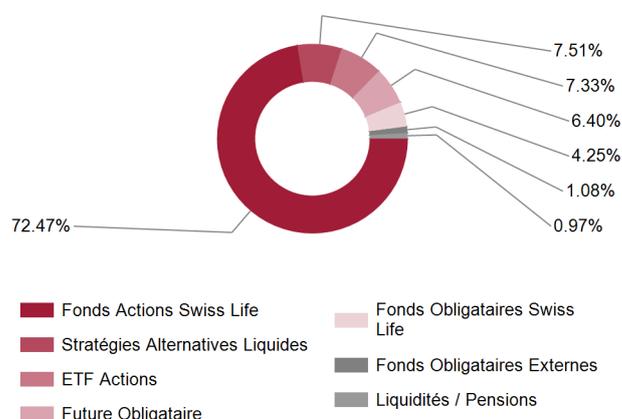
	HEBDO. ANNUELISÉE	1 AN	3 ANS	ORIGINE
MAX.DRAWDOWN	-25.68%			
RECOUVREMENT	322 jours			
Duration effective				
Fonds	0.74			
Indice de réf.	2.21			
VOLATILITÉ DU PORTEFEUILLE		12.15%	14.46%	12.05%
VOLATILITÉ DE L'INDICE DE RÉF.		15.09%	17.76%	15.02%
TRACKING ERROR		8.65	7.54	6.81
RATIO D'INFORMATION		0.33	0.11	0.22
RATIO DE SHARPE		-1.05	0.01	0.06

Swiss Life Funds (F) Multi Asset Growth P

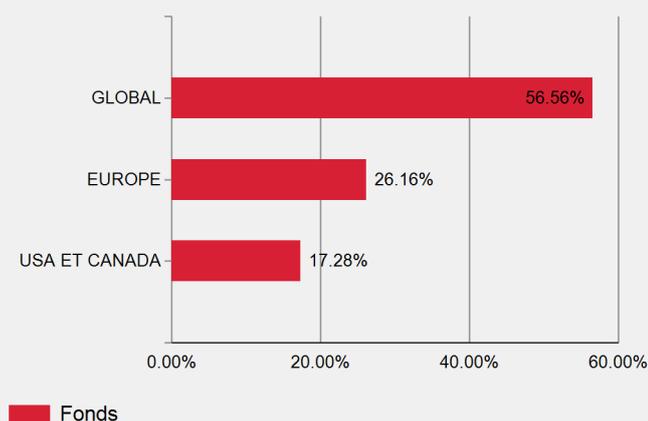
Evolution de l'allocation d'actifs



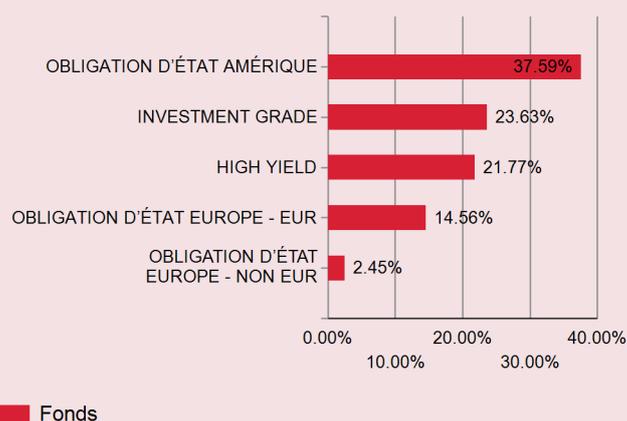
Structure du portefeuille



Répartition géographique actions



Répartition poche taux



Principales positions actions

N°	ÉMISSION	PAYS	%
1	SL LX EQ ESG GLBL PCT-EU I C		16.00%
2	S LIFE LX-EQUITY ESG USA-AM		13.79%
3	S L LX-EQ ESG GLOBAL-AM		9.85%
4	SWIS L LX-EQ ESG GL HD-AM		8.00%
5	SL LX-EQ ESG GL MIN VOL-AM		7.05%

Principales positions taux

N°	ÉMISSION	PAYS	%
1	US 10YR NOTE (CBT)DEC22	États-Unis	4.41%
2	EURO-BUND FUTURE DEC22	Allemagne	1.71%
3	SWISS LIFE LX-BD GL HY-AM		1.48%
4	SLF (F) BOND 6M I CAP		1.13%
5	PARETO-NORDIC CORP BD-I EUR		1.08%