

SWISS LIFE FUNDS (F) BOND GLOBAL INFLATION

Information Périodique au 30.06.2023

FONDS COMMUN DE PLACEMENT - FCP DE DROIT FRANÇAIS

État du patrimoine

Éléments de l'état du patrimoine	<i>Devise de comptabilité de l'OPC : EUR</i>	Montant à l'arrêté périodique
a) Titres financiers éligibles mentionnés au 1° du I de l'article L.214-20 / 1° du I de l'article L.214-24-55 du code monétaire et financier		71 876 539,09
b) Avoirs bancaires		1 532 897,70
c) Autres actifs détenus par l'OPC		69 769 192,14
d) Total des actifs détenus par l'OPC (<i>lignes a+b+c</i>)		143 178 628,93
e) Passif		-68 060 810,20
f) Valeur nette d'inventaire (<i>lignes d+e = actif net OPC</i>)		75 117 818,73

Nombre de parts ou actions en circulation et valeur nette d'inventaire par part ou action

Parts ou actions	Nombre de parts ou actions en circulation	<i>Devise parts ou actions</i>	Valeur nette d'inventaire par part ou action (Valeur Liquidative)
PART I / FR0010199703	1 636	EUR	13 643,39
PART P / FR0010636399	78 101	EUR	638,51
PART SF / FR0013458726	6 388	EUR	458,43

Portefeuille titres

Éléments du portefeuille titres	Pourcentage	
	Actif net	Total des actifs
a) Les titres financiers éligibles et des instruments du marché monétaire admis à la négociation sur un marché réglementé au sens de l'article L. 422-1° du code monétaire et financier.		
et b) Les titres financiers éligibles et des instruments du marché monétaire admis à la négociation sur un autre marché réglementé, en fonctionnement régulier, reconnu, ouvert au public et dont le siège est situé dans un Etat membre de l'Union européenne ou dans un autre Etat partie à l'accord sur l'Espace économique européen.	95,69	50,20
c) Les titres financiers éligibles et des instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs d'un pays tiers ou négociés sur un autre marché d'un pays tiers, réglementé, en fonctionnement régulier, reconnu et ouvert au public, pour autant que cette bourse ou ce marché ne figure pas sur une liste établie par l'Autorité des marchés financiers ou que le choix de cette bourse ou de ce marché soit prévu par la loi ou par le règlement ou les statuts de l'OPCVM / du fonds d'investissement à vocation générale.	-	-
d) Les titres financiers nouvellement émis mentionnés au 4° du I de l'article R. 214-11 du code monétaire et financier.	-	-
e) Les autres actifs	2,42	1,27

Répartition des actifs par devise

Devises (10 principales devises)	Montant <i>En devise de comptabilité de l'OPC</i>	Pourcentage	
	EUR	Actif net	Total des actifs
USD	31 398 686,48	41,80	21,92
GBP	18 205 566,79	24,24	12,72
EUR	16 674 198,89	22,20	11,65
CAD	2 300 530,75	3,06	1,61
JPY	1 765 198,93	2,35	1,23
SEK	1 532 357,25	2,04	1,07
-	-	-	-
-	-	-	-
-	-	-	-
-	-	-	-
Autres devises	-	-	-
Total	71 876 539,09	95,69	50,20

Répartition des actifs par pays de résidence de l'émetteur

Pays (10 principaux pays)	Pourcentage	
	Actif net	Total des actifs
Etats-Unis d'Amérique	41,81	21,93
Royaume-Uni	24,24	12,72
Allemagne	10,38	5,45
France	8,49	4,45
Canada	3,06	1,61
Japon	2,35	1,23
Suède	2,04	1,07
Italie	1,77	0,93
Espagne	1,55	0,81
-	-	-
Autres pays	-	-
Total	95,69	50,20

Répartition des actifs par secteur économique

Secteur économique (10 principaux secteurs)	Pourcentage	
	Actif net	Total des actifs
Etat	95,69	50,20
-	-	-
-	-	-
-	-	-
-	-	-
-	-	-
-	-	-
-	-	-
-	-	-
-	-	-
Autres secteurs	-	-
Total	95,69	50,20

Ventilation des autres actifs par nature

Nature d'actifs	Pourcentage	
	Actif net	Total des actifs
PARTS OU ACTIONS D'OPCVM :	2,42	1,27
- Fonds professionnels à vocation générale	-	-
- OPCVM nourriciers	-	-
- Fonds professionnels spécialisés	-	-
- Fonds de capital investissement (FCPR, FCPI, FIP)	-	-
- OPCI et OPPCI (Organismes Professionnels de Placement Collectif Immobilier)	-	-
- Autres	2,42	1,27
AUTRE NATURE D'ACTIFS :	-	-
- Bons de souscription	-	-
- Bons de caisse	-	-
- Billets à ordre	-	-
- Billets hypothécaires	-	-
- Autres	-	-
TOTAL	2,42	1,27

Indication des mouvements intervenus dans la composition du portefeuille titres, au cours de la période de référence

Éléments du portefeuille titres	Mouvements (en montant)	
	Acquisitions	Cessions / Remboursements
<i>Devise de comptabilité de l'OPC : EUR</i>		
a) Les titres financiers éligibles et des instruments du marché monétaire admis à la négociation sur un marché réglementé au sens de l'article L. 422-1° du code monétaire et financier. et b) Les titres financiers éligibles et des instruments du marché monétaire admis à la négociation sur un autre marché réglementé, en fonctionnement régulier, reconnu, ouvert au public et dont le siège est situé dans un Etat membre de l'Union européenne ou dans un autre Etat partie à l'accord sur l'Espace économique européen.	26 117 266,23	20 367 243,56
c) Les titres financiers éligibles et des instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs d'un pays tiers ou négociés sur un autre marché d'un pays tiers, réglementé, en fonctionnement régulier, reconnu et ouvert au public, pour autant que cette bourse ou ce marché ne figure pas sur une liste établie par l'Autorité des marchés financiers ou que le choix de cette bourse ou de ce marché soit prévu par la loi ou par le règlement ou les statuts de l'OPCVM / du fonds d'investissement à vocation générale.	-	-
d) Les titres financiers nouvellement émis mentionnés au 4° du I de l'article R. 214-11 du code monétaire et financier.	-	-
e) Les autres actifs	-	-
Total sur la période	26 117 266,23	20 367 243,56

Frais de gestion

Commission de surperformance (frais variables) : montant et % des frais sur la période	Montant	%
Catégorie de part :		
PART I / FR0010199703	-	-
PART P / FR0010636399	-	-
PART SF / FR0013458726	-	-

Indication des données chiffrées relatives aux distributions unitaires sur résultat et/ou sur plus ou moins-values nettes réalisées (« PVNR »), versées au cours de la période ou à verser, après déduction des impôts

Date	Catégorie de parts/actions	Devise parts/actions	Nature	Montant net unitaire	Crédit d'impôt unitaire	Montant brut unitaire
-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-

Informations relatives aux opérations de financement sur titres et contrat d'échange sur rendement global (TRS) au 30/06/2023 :

Le Fonds n'a pas recouru à des opérations de financement sur titres au cours de la période.

Informations générales :

Montant des titres et matières premières prêtés en proportion du total des actifs pouvant être prêtés définis comme excluant la trésorerie et les équivalents de trésorerie.	Néant
--	-------

	Opérations de financement sur titres	Contrat d'échange sur rendement global
Le montant des actifs engagés dans chaque type d'opération de financement sur titres et de contrats d'échange sur rendement global exprimés en valeur absolue (dans la monnaie de l'organisme de placement collectif) et en proportion des actifs sous gestion de l'OPC.	Néant	Néant

Données sur la concentration :

	Opérations de financement sur titres	Contrat d'échange sur rendement global
Les dix plus gros émetteurs de garanties pour tous les types d'opérations de financement sur titres et de contrats d'échange sur rendement global (ventilation des volumes de garanties et de matières premières reçus par noms d'émetteurs)	Néant	Néant
Les dix principales contreparties pour chaque type d'opérations de financement sur titres et de contrats d'échange sur rendement global séparément (nom de la contrepartie et volume brut des opérations en cours).	Néant	Néant

Données d'opération agrégées pour chaque type d'opérations de financement sur titres et de contrats d'échange sur rendement global séparément ventilées en fonction des catégories suivantes :

	Opérations de financement sur titres	Contrat d'échange sur rendement global
Le type et la qualité des garanties (collatéral)	Néant	Néant
L'échéance de la garantie, ventilée en fonction des tranches d'échéance suivantes: moins d'un jour, un jour à une semaine, une semaine à un mois, un à trois mois, trois mois à un an, plus d'un an, opérations ouvertes	Néant	Néant
La monnaie de la garantie	Néant	Néant

	Opérations de financement sur titres	Contrat d'échange sur rendement global
L'échéance des opérations de financement sur titres et des contrats d'échange sur rendement global, ventilée en fonction des tranches d'échéance suivantes : moins d'un jour, un jour à une semaine, une semaine à un mois, un à trois mois, trois mois à un an, plus d'un an, opérations ouvertes	Néant	Néant
Le pays où sont établies les contreparties	Néant	Néant
Le règlement et la compensation (p. ex. à trois parties, contrepartie centrale, bilatéraux)	Néant	Néant

Données sur la réutilisation des garanties (collatéral) :

	Opérations de financement sur titres	Contrat d'échange sur rendement global
La part des garanties reçues qui est réutilisée, par rapport au montant maximum précisé dans le prospectus ou dans les informations à communiquer aux investisseurs	Néant	Néant
Les revenus, pour l'OPC, du réinvestissement des garanties en espèces	Néant	Néant

Conservation des garanties reçues par l'OPC dans le cadre des opérations de financement sur titres et des contrats d'échange sur rendement global :

Nom de(s)Dépositaire(s)	Montant des actifs en garantie conservés par chacun des dépositaires
Swiss Life Banque Privée	Néant

Conservation des garanties fournies par l'OPC dans le cadre des opérations de financement sur titres et des contrats d'échange sur rendement global :

Néant.

Données sur les revenus et les coûts de chaque type d'opération de financement sur titres et de contrat d'échange sur rendement global :

	Opérations de financement sur titres	Contrat d'échange sur rendement global
Ventilation entre l'OPC, le gestionnaire de l'organisme de placement collectif et les tiers (par exemple, l'agent prêteur), en valeur absolue et en pourcentage des revenus globaux générés par ce type d'opération de financement sur titres et de contrat d'échange sur rendement global	Néant	Néant

ANNEXE AU RAPPORT
destinée aux souscripteurs suisses

Le prospectus du Fonds, le document d'information clé pour l'investisseur (DICI), les rapports annuels et semi-annuels peuvent être obtenus gratuitement et sur simple demande auprès des bureaux du Représentant en Suisse. Une liste de toutes les transactions effectuées pour le Fonds durant la période sous revue est disponible gratuitement auprès du représentant du Fonds en Suisse.

Représentant en Suisse :

Swiss Life Asset Management AG, General-Guisan-Quai 40, 8002 Zurich, a été autorisé par l'Autorité fédérale de surveillance des marchés financiers (FINMA) en tant que représentant en Suisse du Fonds pour l'offre et la distribution en Suisse ou à partir de la Suisse, des parts du Fonds en vertu de l'article 120 de la Loi fédérale sur les placements collectifs de capitaux du 23 juin 2006 (LPCC).

Agent payeur en Suisse :

UBS Switzerland AG, Bahnhofstrasse 45, 8001 Zurich, est une banque dûment licenciée selon la Loi fédérale sur les banques ; elle a été nommée Agent Payeur du fonds pour la Suisse, conformément à l'art. 121 LPCC.

Clôture annuelle du fonds : 30-déc.

Fortune moyenne du fonds pour la période du 01/07/22 au 30/06/23 : 74 656 988,25

Part I **FR0010199703**

Commission de gestion de la direction de l'OPCVM : 0,50 % TTC

Fortune moyenne de la part I pour la période du 01/07/22 au 30/06/23 : 22 931 944,19

extrait du compte de résultat

Charges en euro	Rapport semestriel 30/06/2022	Rapport annuel 30/12/2022	Rapport semestriel 30/06/2023
Commission de la direction de l'OPCVM	58 922,57	111 483,49	50 593,69
Rémunération en fonction de la performance	0,00	0,00	0,00
Commission de la banque dépositaire	0,00	0,00	0,00
Autres charges	0,00	0,00	0,00
Impôts	0,00	0,00	0,00
Total des charges d'exploitation hors bonification	58 922,57	111 483,49	50 593,69
Total des charges d'exploitation avec bonification	58 922,57	111 483,49	50 593,69

TER y compris rémunération en fonction de la performance

$$(((111483.49-58922.57)+50593.69)/22931944.19)*100$$

TER 0,45 %

Rémunération de la performance comme quote-part en pour cent de la fortune moyenne

0.00 %

SWISS LIFE FUNDS (F) BOND GLOBAL INFLATION
plaquette au 30/06/2023

Part P

FR0010636399

Commission de gestion de la direction
de l'OPCVM : 1,00 % TTC

Fortune moyenne de la part P pour la
période du 01/07/22 au 30/06/23 : 49 636 361,52

extrait du compte de résultat

Charges en euro	Rapport semestriel	Rapport annuel	Rapport semestriel
	30/06/2022	30/12/2022	30/06/2023
Commission de la direction de l'OPCVM	245 187,83	469 214,43	222 834,43
Rémunération en fonction de la performance	0,00	0,00	0,00
Commission de la banque dépositaire	0,00	0,00	0,00
Autres charges	0,00	0,00	0,00
Impôts	0,00	0,00	0,00
Total des charges d'exploitation hors bonification	245 187,83	469 214,43	222 834,43
Total des charges d'exploitation avec bonification	245 187,83	469 214,43	222 834,43

TER y compris rémunération en fonction de la performance

$$(((469214.43-245187.83)+222834.43)/49636361.52)*100$$

TER 0,90 %

Rémunération de la performance comme quote-part en pour cent de la fortune moyenne

0.00 %

SWISS LIFE FUNDS (F) BOND GLOBAL INFLATION
plaquette au 30/06/2023

Part SF

FR0013458726

Commission de gestion de la direction
de l'OPCVM : 1,96 % TTC

Fortune moyenne de la part SF pour la
période du 01/07/22 au 30/06/23 : 2 088 682,54

extrait du compte de résultat

Charges en euro	Rapport semestriel	Rapport annuel	Rapport semestriel
	30/06/2022	30/12/2022	30/06/2023
Commission de la direction de l'OPCVM	9 000,56	23 346,96	22 479,25
Rémunération en fonction de la performance	0,00	0,00	0,00
Commission de la banque dépositaire	0,00	0,00	0,00
Autres charges	0,00	0,00	0,00
Impôts	0,00	0,00	0,00
Total des charges d'exploitation hors bonification	9 000,56	23 346,96	22 479,25
Total des charges d'exploitation avec bonification	9 000,56	23 346,96	22 479,25

TER y compris rémunération en fonction de la performance

$$(((23346.96-9000.56)+22479.25)/2088682.54)*100$$

TER 1,76 %

Rémunération de la performance comme quote-part en pour cent de la fortune moyenne

0.00 %

BILAN ACTIF

Devise	30.06.2023 EUR	30.06.2022 EUR
Immobilisations nettes	-	-
Dépôts	-	-
Instruments financiers	73 717 549,09	74 370 661,51
• ACTIONS ET VALEURS ASSIMILÉES		
Négoiciées sur un marché réglementé ou assimilé	-	-
Non négoiciées sur un marché réglementé ou assimilé	-	-
• OBLIGATIONS ET VALEURS ASSIMILÉES		
Négoiciées sur un marché réglementé ou assimilé	71 876 539,09	72 467 422,93
Non négoiciées sur un marché réglementé ou assimilé	-	-
• TITRES DE CRÉANCES		
Négoiés sur un marché réglementé ou assimilé		
<i>Titres de créances négociables</i>	-	-
<i>Autres titres de créances</i>	-	-
Non négociés sur un marché réglementé ou assimilé	-	-
• ORGANISMES DE PLACEMENTS COLLECTIFS		
OPCVM et Fonds d'Investissement à Vocation Générale destinés aux non professionnels et équivalents d'autres pays	1 814 600,00	1 750 800,00
Autres Fonds destinés à des non professionnels et équivalents d'autres pays États membres de l'Union européenne	-	-
Fonds professionnels à vocation générale et équivalents d'autres États membres de l'union européenne et organismes de titrisations cotés	-	-
Autres Fonds d'investissement professionnels et équivalents d'autres États membres de l'union européenne et organismes de titrisations non cotés	-	-
Autres organismes non européens	-	-
• OPÉRATIONS TEMPORAIRES SUR TITRES		
Créances représentatives de titres financiers reçus en pension	-	-
Créances représentatives de titres financiers prêtés	-	-
Titres financiers empruntés	-	-
Titres financiers donnés en pension	-	-
Autres opérations temporaires	-	-
• CONTRATS FINANCIERS		
Opérations sur un marché réglementé ou assimilé	26 410,00	152 438,58
Autres opérations	-	-
• AUTRES INSTRUMENTS FINANCIERS	-	-
Créances	67 928 182,14	205 587 997,77
Opérations de change à terme de devises	67 095 402,61	204 774 189,52
Autres	832 779,53	813 808,25
Comptes financiers	1 532 897,70	2 074 487,72
Liquidités	1 532 897,70	2 074 487,72
Autres actifs	-	-
Total de l'actif	143 178 628,93	282 033 147,00

BILAN PASSIF

	30.06.2023	30.06.2022
Devise	EUR	EUR
Capitaux propres		
• Capital	72 981 345,35	77 665 289,36
• Plus et moins-values nettes antérieures non distribuées	-	0,96
• Report à nouveau	-	-
• Plus et moins-values nettes de l'exercice	2 144 044,13	-1 205 500,76
• Résultat de l'exercice	-7 570,75	-37 599,15
Total des capitaux propres <i>(montant représentatif de l'actif net)</i>	75 117 818,73	76 422 190,41
Instruments financiers	26 410,00	152 438,58
• OPÉRATIONS DE CESSION SUR INSTRUMENTS FINANCIERS	-	-
• OPÉRATIONS TEMPORAIRES SUR TITRES FINANCIERS		
Dettes représentatives de titres financiers donnés en pension	-	-
Dettes représentatives de titres financiers empruntés	-	-
Autres opérations temporaires	-	-
• CONTRATS FINANCIERS		
Opérations sur un marché réglementé ou assimilé	26 410,00	152 438,58
Autres opérations	-	-
Dettes	68 034 400,20	205 458 518,01
Opérations de change à terme de devises	67 631 931,19	205 409 368,88
Autres	402 469,01	49 149,13
Comptes financiers	-	-
Concours bancaires courants	-	-
Emprunts	-	-
Total du passif	143 178 628,93	282 033 147,00

COMPTE DE RÉSULTAT

	30.06.2023	30.06.2022
Devise	EUR	EUR
Produits sur opérations financières		
• Produits sur dépôts et sur comptes financiers	23 930,66	64,75
• Produits sur actions et valeurs assimilées	-	-
• Produits sur obligations et valeurs assimilées	269 528,52	286 653,45
• Produits sur titres de créances	-	-
• Produits sur acquisitions et cessions temporaires de titres financiers	-	-
• Produits sur contrats financiers	-	-
• Autres produits financiers	-	-
Total (I)	293 459,18	286 718,20
Charges sur opérations financières		
• Charges sur acquisitions et cessions temporaires de titres financiers	-	-
• Charges sur contrats financiers	-	-
• Charges sur dettes financières	-2 953,18	-6 010,42
• Autres charges financières	-	-
Total (II)	-2 953,18	-6 010,42
Résultat sur opérations financières (I - II)	290 506,00	280 707,78
Autres produits (III)	-	-
Frais de gestion et dotations aux amortissements (IV)	-295 907,37	-313 110,96
Résultat net de l'exercice (L.214-17-1) (I - II + III - IV)	-5 401,37	-32 403,18
Régularisation des revenus de l'exercice (V)	-2 169,38	-5 195,97
Acomptes sur résultat versés au titre de l'exercice (VI)	-	-
Résultat (I - II + III - IV +/- V - VI) :	-7 570,75	-37 599,15

SWISS LIFE FUNDS (F) BOND GLOBAL INFLATION
plaquette au 30/06/2023

Capitaux propres

PART P / FR0010636399	Souscriptions		Rachats	
	Nombre de parts	Montant	Nombre de parts	Montant
Nombre de parts émises / rachetées pendant l'exercice	15 865,76	10 432 136,32	10 611,627	6 921 538,92

PART SF / FR0013458726	Souscriptions		Rachats	
	Nombre de parts	Montant	Nombre de parts	Montant
Nombre de parts émises / rachetées pendant l'exercice	4 139,895	1 960 612,21	353,874	169 017,04

*Nous permettons à chacun
de vivre selon ses propres choix.*

Swiss Life Asset Managers France
153, rue Saint-Honoré
75001 Paris

Siège social :
Tour la Marseillaise
2 bis, boulevard Euroméditerranée
Quai d'Arenc - CS 50575
13236 Marseille Cedex 02

fr.swisslife-am.com

SA au capital social de 671 167 €
499 320 059 R.C.S. Marseille
Société de gestion de portefeuille
Agrément AMF n° GP 07000055
Carte professionnelle n° A12-5387
Caisse de Garantie CEGC
16, rue Hoche, Tour Kupka B, TSA 39999,
92919 La Défense Cedex

Suivez-nous sur  