

SWISS LIFE FUNDS (F)
EQUITY ESG EURO ZONE
MINIMUM VOLATILITY

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		180 796 417,11
b) Avoirs bancaires		3 033 115,60
c) Autres actifs détenus par l'OPC		288 738,14
d) Total des actifs détenus par l'OPC (<i>lignes a+b+c</i>)		184 118 270,85
e) Passif		-167 887,85
f) Valeur nette d'inventaire (<i>lignes d+e = actif net OPC</i>)		183 950 383,00

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 P / FR0010645515	330 571,5258	EUR	170,77
PART I / FR0010654236	6 255,65	EUR	19 609,94
PART F / FR0013356987	4 672,706	EUR	117,01
PART SF / FR0013458742	43 011,99	EUR	99,45

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.	98,29	98,20
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	-	-

Répartition des actifs par devise

Devises (10 principales devises)	Montant En devise de comptabilité de l'OPC	Pourcentage	
	EUR	Actif net	Total des actifs
EUR	180 796 417,11	98,29	98,20
-	-	-	-
-	-	-	-
-	-	-	-
-	-	-	-
-	-	-	-
-	-	-	-
-	-	-	-
-	-	-	-
-	-	-	-
-	-	-	-
Autres devises	-	-	-
Total	180 796 417,11	98,29	98,20

Répartition des actifs par pays de résidence de l'émetteur

Pays (10 principaux pays)	Pourcentage	
	Actif net	Total des actifs
France	29,51	29,47
Allemagne	17,71	17,70
Pays-Bas	13,97	13,96
Espagne	11,72	11,71
Italie	7,82	7,81
Finlande	7,67	7,66
Belgique	4,09	4,09
Portugal	2,52	2,52
Irlande	2,31	2,31
Suisse	0,69	0,69
Autres pays	0,28	0,28
Total	98,29	98,20

Répartition des actifs par secteur économique

Secteur économique (10 principaux secteurs)	Pourcentage	
	Actif net	Total des actifs
Services de télécommunications	7,77	7,77
Pharmacie	6,85	6,84
Électricité conventionnelle	6,77	6,76
Produits alimentaires	4,80	4,79
Assurance services complets	4,76	4,75
Logiciels	4,33	4,32
Détaillants et grossistes d'alimentation	3,15	3,15
Habillement et accessoires	3,15	3,15
Chimie de spécialité	2,95	2,95
Services financiers diversifiés	2,83	2,82
Autres secteurs	50,93	50,90
Total	98,29	98,20

Ventilation des autres actifs par nature

Nature d'actifs	Pourcentage	
	Actif net	Total des actifs
PARTS OU ACTIONS D'OPCVM :	-	-
- 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	-	-
AUTRE NATURE D'ACTIFS :	-	-
- Bons de souscription	-	-
- Bons de caisse	-	-
- Billets à ordre	-	-
- Billets hypothécaires	-	-
- Autres	-	-
TOTAL	-	-

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.	49 340 025,76	51 749 467,93
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	49 340 025,76	51 749 467,93

Frais de gestion

Commission de surperformance (frais variables) : montant et % des frais sur la période	Montant	%
Catégorie de part :		
PART P / FR0010645515	-	-
PART I / FR0010654236	-	-
PART F / FR0013356987	-	-
PART SF / FR0013458742	-	-

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 : 176 980 717,19

Part I **FR0010654236**

Commission de gestion de la direction de l'OPCVM : 0,70 % TTC

Fortune moyenne de la part I pour la période du 01/07/22 au 30/06/23 : 123 760 292,31

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	513 345,89	957 914,99	422 000,51
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	513 345,89	957 914,99	422 000,51
Total des charges d'exploitation avec bonification	513 345,89	957 914,99	422 000,51

TER y compris rémunération en fonction de la performance

$$(((957914.99-513345.89)+422000.51)/123760292.31)*100$$

TER 0,70 %

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

0.00 %

SWISS LIFE FUNDS (F) EQUITY ESG EURO ZONE MINIMUM VOLATILITY
plaquette au 30/06/2023

Part P

FR0010645515

Commission de gestion de la direction
de l'OPCVM : 1,60 % TTC

Fortune moyenne de la part P pour la
période du 01/07/22 au 30/06/23 : 53 220 424,88

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	412 274,61	827 356,20	437 262,31
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	412 274,61	827 356,20	437 262,31
Total des charges d'exploitation avec bonification	412 274,61	827 356,20	437 262,31

TER y compris rémunération en fonction de la performance

$$(((827356.2-412274.61)+437262.31)/53220424.88)*100$$

TER 1,60 %

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

0.00 %

SWISS LIFE FUNDS (F) EQUITY ESG EURO ZONE MINIMUM VOLATILITY
plaquette au 30/06/2023

Part F

FR0013356987

Commission de gestion de la direction
de l'OPCVM : 0,85 % TTC

Fortune moyenne de la part F pour la
période du 01/07/22 au 30/06/23 : 705 635,76

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	5 167,65	8 822,97	2 343,97
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	5 167,65	8 822,97	2 343,97
Total des charges d'exploitation avec bonification	5 167,65	8 822,97	2 343,97

TER y compris rémunération en fonction de la performance

$$(((8822.97-5167.65)+2343.97)/705635.76)*100$$

TER 0,85 %

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

0.00 %

SWISS LIFE FUNDS (F) EQUITY ESG EURO ZONE MINIMUM VOLATILITY
plaquette au 30/06/2023

Part SF

FR0013458742

Commission de gestion de la direction
de l'OPCVM : 2,46 % TTC

Fortune moyenne de la part SF pour la
période du 01/07/22 au 30/06/23 : 2 911 029,13

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	16 106,88	43 618,51	44 276,81
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	16 106,88	43 618,51	44 276,81
Total des charges d'exploitation avec bonification	16 106,88	43 618,51	44 276,81

TER y compris rémunération en fonction de la performance

$$(((43618.51-16106.88)+44276.81)/2911029.13)*100$$

TER 2,47 %

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

0.00 %

BILAN ACTIF

Devise	30.06.2023	30.06.2022
	EUR	EUR
Immobilisations nettes	-	-
Dépôts	-	-
Instruments financiers	180 796 417,11	175 225 464,42
• ACTIONS ET VALEURS ASSIMILÉES		
Négoiciées sur un marché réglementé ou assimilé	180 796 417,11	175 211 464,42
Non négoiciées sur un marché réglementé ou assimilé	-	-
• OBLIGATIONS ET VALEURS ASSIMILÉES		
Négoiciées sur un marché réglementé ou assimilé	-	-
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	-	-
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	-	14 000,00
Autres opérations	-	-
• AUTRES INSTRUMENTS FINANCIERS	-	-
Créances	288 738,14	408 757,84
Opérations de change à terme de devises	-	-
Autres	288 738,14	408 757,84
Comptes financiers	3 033 115,60	3 745 954,82
Liquidités	3 033 115,60	3 745 954,82
Autres actifs	-	-
Total de l'actif	184 118 270,85	179 380 177,08

BILAN PASSIF

	30.06.2023	30.06.2022
Devise	EUR	EUR
Capitaux propres		
• Capital	179 903 490,58	177 005 106,33
• Plus et moins-values nettes antérieures non distribuées	-0,01	-0,01
• Report à nouveau	-	-
• Plus et moins-values nettes de l'exercice	1 114 962,60	-635 497,22
• Résultat de l'exercice	2 931 929,83	2 851 582,77
Total des capitaux propres <i>(montant représentatif de l'actif net)</i>	183 950 383,00	179 221 191,89
Instruments financiers	-	14 000,00
• 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	-	14 000,00
Autres opérations	-	-
Dettes	167 887,85	144 985,19
Opérations de change à terme de devises	-	-
Autres	167 887,85	144 985,19
Comptes financiers	-	-
Concours bancaires courants	-	-
Emprunts	-	-
Total du passif	184 118 270,85	179 380 177,08

COMPTE DE RÉSULTAT

	30.06.2023	30.06.2022
Devise	EUR	EUR
Produits sur opérations financières		
• Produits sur dépôts et sur comptes financiers	28 225,21	-
• Produits sur actions et valeurs assimilées	3 819 817,49	3 945 737,38
• Produits sur obligations et valeurs assimilées	-	-
• Produits sur titres de créances	-	-
• Produits sur acquisitions et cessions temporaires de titres financiers	-	-
• Produits sur contrats financiers	-	-
• Autres produits financiers	-	-
Total (I)	3 848 042,70	3 945 737,38
Charges sur opérations financières		
• Charges sur acquisitions et cessions temporaires de titres financiers	-	-
• Charges sur contrats financiers	-	-
• Charges sur dettes financières	-	-12 856,49
• Autres charges financières	-	-
Total (II)	-	-12 856,49
Résultat sur opérations financières (I - II)	3 848 042,70	3 932 880,89
Autres produits (III)	-	-
Frais de gestion et dotations aux amortissements (IV)	-905 883,60	-946 895,03
Résultat net de l'exercice (L.214-17-1) (I - II + III - IV)	-2 942 159,10	2 985 985,86
Régularisation des revenus de l'exercice (V)	-10 229,27	-134 403,09
Acomptes sur résultat versés au titre de l'exercice (VI)	-	-
Résultat (I - II + III - IV +/- V - VI) :	2 931 929,83	2 851 582,77

Capitaux propres

PART P / FR0010645515	Souscriptions		Rachats	
	Nombre de parts	Montant	Nombre de parts	Montant
Nombre de parts émises / rachetées pendant l'exercice	66 338,0395	10 713 820,25	58 003,8176	9 490 049,32

PART I / FR0010654236	Souscriptions		Rachats	
	Nombre de parts	Montant	Nombre de parts	Montant
Nombre de parts émises / rachetées pendant l'exercice	264,29	4 733 832,51	1 288,23	23 317 217,64

PART F / FR0013356987	Souscriptions		Rachats	
	Nombre de parts	Montant	Nombre de parts	Montant
Nombre de parts émises / rachetées pendant l'exercice	755,178	80 114,44	6 905,36	677 535,81

PART SF / FR0013458742	Souscriptions		Rachats	
	Nombre de parts	Montant	Nombre de parts	Montant
Nombre de parts émises / rachetées pendant l'exercice	29 400,402	2 781 482,25	5 087,607	483 511,18

*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  