

*Swiss Life Funds (F) Equity
ESG Euro Zone Minimum
Volatility*

Information Périodique au 28.06.2024

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		120 002 950,87
b) Avoirs bancaires		2 502 292,34
c) Autres actifs détenus par l'OPC		186 680,42
d) Total des actifs détenus par l'OPC (lignes a+b+c)		122 691 923,63
e) Passif		-438 632,66
f) Valeur nette d'inventaire (lignes d+e = actif net OPC)		122 253 290,97

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	338 156,0253	EUR	182,01
PART I / FR0010654236	2 528,50	EUR	21 088,54
PART F / FR0013356987	528,957	EUR	125,70
PART SF / FR0013458742	69 616,417	EUR	105,09

Portefeuille titres

Éléments du portefeuille titres	Pourcentage	
	Actif net	Total des actifs
a) Les titres financiers éligibles et les 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.	98,16	97,81
b) Les titres financiers éligibles et les 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.	-	-
c) Les titres financiers éligibles et les 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'OPC / du fonds d'investissement à vocation générale.	-	-
d) Les titres financiers nouvellement émis mentionnés au 4° du I de l'article R. 214-11 / 4° du I de l'article R.214-32-18 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
Euro	120 002 950,87	98,16	97,81
-	-	-	-
-	-	-	-
-	-	-	-
-	-	-	-
-	-	-	-
-	-	-	-
-	-	-	-
-	-	-	-
-	-	-	-
Autres devises	-	-	-
Total	120 002 950,87	98,16	97,81

Répartition des actifs par pays de résidence de l'émetteur

Pays (10 principaux pays)	Pourcentage	
	Actif net	Total des actifs
France	26,55	26,46
Allemagne	18,69	18,62
Pays-Bas	13,41	13,36
Espagne	10,79	10,75
Finlande	9,59	9,56
Italie	8,54	8,51
Belgique	4,39	4,37
Portugal	2,61	2,60
Irlande	2,03	2,02
Autriche	1,04	1,04
Autres pays	0,52	0,52
Total	98,16	97,81

Répartition des actifs par secteur économique

Secteur économique (10 principaux secteurs)	Pourcentage	
	Actif net	Total des actifs
Électricité conventionnelle	7,62	7,59
Télécommunications filaires	7,19	7,17
Pharmacie	5,76	5,74
Sociétés pétrolières et gazières intégrées	4,94	4,92
Logiciels	4,85	4,83
Assurance services complets	4,80	4,78
Réassurance	3,69	3,67
Produits alimentaires	3,67	3,66
Banques	3,11	3,10
Expert en finance	2,89	2,88
Autres secteurs	49,64	49,47
Total	98,16	97,81

Ventilation des autres actifs par nature

Nature d'actifs	Pourcentage	
	Actif net	Total des actifs
Parts d'OPC	-	-
- OPCVM et équivalents d'autres Etats membres de l'Union européenne	-	-
- FIA et équivalents d'autres Etats membres de l'Union européenne	-	-
- Autres OPC et fonds d'investissements	-	-
Autres actifs	-	-
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 les 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.	20 739 698,91	54 857 146,70
b) Les titres financiers éligibles et les 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.	-	-
c) Les titres financiers éligibles et les 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'OPC / du fonds d'investissement à vocation générale.	-	-
d) Les titres financiers nouvellement émis mentionnés au 4° du I de l'article R. 214-11 / 4° du I de l'article R.214-32-18 du code monétaire et financier.	-	-
e) Les autres actifs	-	-
Total sur la période	20 739 698,91	54 857 146,70

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
-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-

Information sur les commissions de surperformance (en EUR)

Commission de surperformance (frais variables) : montant et % des frais sur la période				
Catégorie de part :	Frais de gestion variables provisionnés	%	Frais de gestion variables acquis (<i>dus aux rachats</i>)	%
PART P / FR0010645515	-	-	-	-
PART I / FR0010654236	-	-	-	-
PART F / FR0013356987	-	-	-	-
PART SF / FR0013458742	-	-	-	-

Récapitulatif des cas et conditions dans lesquels le plafonnement des rachats a, au cours de la période, été décidé

Le Fonds n'a pas recouru à des opérations de plafonnement des rachats au cours de la période.

Informations relatives aux opérations de financement sur titres et contrat d'échange sur rendement global (TRS) au 28/06/2024 :

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

Swiss Life Funds (F) Equity ESG Euro Zone Minimum Volatility

	Opérations de financement sur titres	Contrat d'échange sur rendement global
La monnaie de la garantie	Néant	Néant
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

Inventaire au 28.06.2024

Code valeur	Libellé valeur	Statut Valeur	Quantité	Valeur boursière	Devise de cotation	% Actif net
Valeurs mobilières						
Action						
ES0167050915	ACS	PROPRE	25 430,00	1 024 320,40	EUR	0,84
FR0010340141	ADP	PROPRE	2 065,00	234 584,00	EUR	0,19
ES0105046009	AENA SME SA	PROPRE	1 292,00	242 896,00	EUR	0,20
IE00BF0L3536	AIB GROUP PLC	PROPRE	149 526,00	738 060,34	EUR	0,60
NL0000235190	AIRBUS BR BEARER SHS	PROPRE	1 630,00	209 063,80	EUR	0,17
NL0013267909	AKZO NOBEL NV	PROPRE	4 180,00	237 340,40	EUR	0,19
DE0008404005	ALLIANZ SE-NOM	PROPRE	7 366,00	1 911 477,00	EUR	1,56
ES0109067019	AMADEUS IT GROUP SA	PROPRE	25 174,00	1 564 312,36	EUR	1,28
IT0004056880	AMPLIFON	PROPRE	7 203,00	239 427,72	EUR	0,20
BE0974293251	ANHEUSER BUSCH INBEV SA/NV	PROPRE	25 032,00	1 354 731,84	EUR	1,11
NL0010832176	ARGEN-X N V	PROPRE	2 552,00	1 042 747,20	EUR	0,85
NL0010273215	ASML HOLDING N.V.	PROPRE	1 604,00	1 546 576,80	EUR	1,27
NL0011872643	ASR NEDERLAND N.V	PROPRE	5 429,00	241 644,79	EUR	0,20
IT0000062072	ASSICURAZIONI GENERALI	PROPRE	113 389,00	2 640 829,81	EUR	2,16
FR0000120628	AXA SA	PROPRE	34 942,00	1 068 176,94	EUR	0,87
ES0113860A34	BANCO DE SABADELL	PROPRE	135 271,00	243 555,44	EUR	0,20
DE0005190037	BAYERISCHE MOTOREN WERKE PFD	PROPRE	6 673,00	550 188,85	EUR	0,45
DE0005158703	BECHTLE	PROPRE	5 371,00	236 001,74	EUR	0,19
DE0005200000	BEIERSDORF	PROPRE	10 941,00	1 493 993,55	EUR	1,22
FR0013280286	BIOMERIEUX SA	PROPRE	3 594,00	318 967,50	EUR	0,26
FR0000120503	BOUYGUES	PROPRE	21 791,00	653 076,27	EUR	0,53
FR0006174348	BUREAU VERITAS	PROPRE	16 019,00	414 251,34	EUR	0,34
ES0140609019	CAIXABANK	PROPRE	90 233,00	446 021,72	EUR	0,36
FR0000125338	CAPGEMINI SE	PROPRE	5 051,00	937 970,70	EUR	0,77
FR0000120172	CARREFOUR SA	PROPRE	17 585,00	232 122,00	EUR	0,19
ES0105066007	CELLNEX TELECOM S.A.	PROPRE	7 738,00	235 003,06	EUR	0,19

Swiss Life Funds (F) Equity ESG Euro Zone Minimum Volatility

Code valeur	Libellé valeur	Statut Valeur	Quantité	Valeur boursière	Devise de cotation	% Actif net
FR001400AJ45	CIE GENERALE DES ETABLISSEMENTS MICHELIN SA	PROPRE	58 147,00	2 099 688,17	EUR	1,72
FR0000064578	COVIVIO SA REIT	PROPRE	8 551,00	379 493,38	EUR	0,31
FR0000120644	DANONE SA	PROPRE	41 733,00	2 382 119,64	EUR	1,95
FR0014003TT8	DASSAULT SYSTEMES SE	PROPRE	72 404,00	2 555 861,20	EUR	2,09
DE0005810055	DEUTSCHE BOERSE AG	PROPRE	13 363,00	2 553 669,30	EUR	2,09
DE0005557508	DEUTSCHE TELEKOM AG-NOM	PROPRE	40 885,00	959 979,80	EUR	0,79
BE0974259880	D'IETEREN GROUP	PROPRE	2 031,00	402 341,10	EUR	0,33
CH1216478797	DSM FIRMENICH LTD	PROPRE	3 527,00	372 451,20	EUR	0,30
FR0010908533	EDENRED	PROPRE	7 286,00	287 141,26	EUR	0,23
PTEDP0AM0009	EDP - ENERGIAS DE PORTUGAL	PROPRE	361 770,00	1 265 833,23	EUR	1,04
FI0009007884	ELISA OYJ	PROPRE	57 487,00	2 462 743,08	EUR	2,01
ES0130670112	ENDESA	PROPRE	77 750,00	1 363 346,25	EUR	1,12
IT0003128367	ENEL SPA	PROPRE	174 178,00	1 131 111,93	EUR	0,93
FR0010208488	ENGIE SA	PROPRE	21 552,00	287 395,92	EUR	0,24
IT0003132476	ENI SPA	PROPRE	61 069,00	876 584,43	EUR	0,72
DE000ENAG999	E.ON SE	PROPRE	91 625,00	1 122 864,38	EUR	0,92
FR0000121667	ESSILOR LUXOTTICA SA	PROPRE	11 091,00	2 231 509,20	EUR	1,83
FR0000121121	EURAZEO SE	PROPRE	3 185,00	236 804,75	EUR	0,19
FR0014000MR3	EUROFINS SCIENTIFIC SE	PROPRE	5 671,00	263 985,05	EUR	0,22
NL0011585146	FERRARI NV	PROPRE	2 190,00	833 733,00	EUR	0,68
NL0015001FS8	FERROVIAL SE	PROPRE	7 831,00	283 952,06	EUR	0,23
PTGAL0AM0009	GALP ENERGIA SGPS SA-B	PROPRE	97 873,00	1 930 055,56	EUR	1,58
DE0006602006	GEA GROUP AG	PROPRE	11 470,00	446 183,00	EUR	0,36
FR0010040865	GECINA ACT	PROPRE	2 632,00	226 220,40	EUR	0,19
FR0010533075	GETLINK SE	PROPRE	55 604,00	859 081,80	EUR	0,70
BE0003797140	GROUPE BRUXELLES LAMBERT	PROPRE	11 127,00	741 614,55	EUR	0,61
DE0008402215	HANNOVER RUECK SE	PROPRE	4 788,00	1 133 319,60	EUR	0,93
NL0000009165	HEINEKEN NV	PROPRE	15 448,00	1 394 954,40	EUR	1,14
DE0006048408	HENKEL KGAA	PROPRE	23 956,00	1 759 568,20	EUR	1,44
DE0006048432	HENKEL KGAA VZ PFD	PROPRE	12 115,00	1 008 210,30	EUR	0,82
FR0000052292	HERMES INTERNATIONAL	PROPRE	623,00	1 333 220,00	EUR	1,09

Swiss Life Funds (F) Equity ESG Euro Zone Minimum Volatility

Code valeur	Libellé valeur	Statut Valeur	Quantité	Valeur boursière	Devise de cotation	% Actif net
ES0144580Y14	IBERDROLA SA	PROPRE	226 605,00	2 745 319,58	EUR	2,25
ES0148396007	INDITEX	PROPRE	44 877,00	2 080 497,72	EUR	1,70
DE0006231004	INFINEON TECHNOLOGIES AG-NOM	PROPRE	7 094,00	243 359,67	EUR	0,20
IT0005090300	INFRASTRUTTURE WIRELESS ITALIANE SPA	PROPRE	35 645,00	347 538,75	EUR	0,28
FR0010259150	IPSEN	PROPRE	7 708,00	882 566,00	EUR	0,72
NL0014332678	JDE PEETS B V	PROPRE	12 337,00	229 468,20	EUR	0,19
BE0003565737	KBC GROUPE	PROPRE	18 868,00	1 243 401,20	EUR	1,02
FR0000121485	KERING	PROPRE	751,00	254 213,50	EUR	0,21
IE0004906560	KERRY GROUP A	PROPRE	22 969,00	1 737 604,85	EUR	1,42
FI0009000202	KESKO OYJ B	PROPRE	14 475,00	237 245,25	EUR	0,19
FI0009013403	KONE B	PROPRE	9 465,00	436 241,85	EUR	0,36
NL0011794037	KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE	PROPRE	96 303,00	2 656 999,77	EUR	2,17
NL0000009082	KONINKLIJKE KPN NV	PROPRE	745 671,00	2 669 502,18	EUR	2,18
FR0013451333	LA FRANCAISE DES JEUX SA	PROPRE	37 979,00	1 207 732,20	EUR	0,99
FR0010307819	LEGRAND	PROPRE	2 589,00	239 844,96	EUR	0,20
IT0003856405	LEONARDO AZIONE POST RAGGRUPPAMENTO	PROPRE	26 975,00	584 818,00	EUR	0,48
FR0000120321	LOREAL SA	PROPRE	4 159,00	1 705 397,95	EUR	1,39
FR0000121014	LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	PROPRE	800,00	570 880,00	EUR	0,47
IT0000062957	MEDIOBANCA SPA	PROPRE	17 643,00	241 532,67	EUR	0,20
DE0006599905	MERCK KGAA	PROPRE	10 058,00	1 556 475,50	EUR	1,27
FI0009014575	METSO CORPORATION	PROPRE	23 780,00	235 041,52	EUR	0,19
IT0004965148	MONCLER SPA	PROPRE	11 767,00	671 425,02	EUR	0,55
DE000A0D9PT0	MTU AERO ENGINES HLDG AG	PROPRE	1 339,00	319 753,20	EUR	0,26
DE0008430026	MUENCHENER RUECKVERSICHERUNGS AG-NOM	PROPRE	5 948,00	2 777 716,00	EUR	2,27
DE0006452907	NEMETSCHKE	PROPRE	4 541,00	417 090,85	EUR	0,34
FI0009013296	NESTE CORPORATION	PROPRE	14 514,00	241 295,25	EUR	0,20
FI0009000681	NOKIA OYJ	PROPRE	576 991,00	2 053 222,47	EUR	1,68
FI4000297767	NORDEA BANK ABP	PROPRE	80 250,00	891 978,75	EUR	0,73
AT0000743059	OMV AG	PROPRE	13 805,00	561 311,30	EUR	0,46
FR0000133308	ORANGE	PROPRE	156 198,00	1 461 076,09	EUR	1,20
FI0009014377	ORION NEW B	PROPRE	23 542,00	938 384,12	EUR	0,77

Swiss Life Funds (F) Equity ESG Euro Zone Minimum Volatility

Code valeur	Libellé valeur	Statut Valeur	Quantité	Valeur boursière	Devise de cotation	% Actif net
FR0000120693	PERNOD RICARD	PROPRE	3 311,00	419 503,70	EUR	0,34
NL0015001W49	PLUXEE NV	PROPRE	5 675,00	148 656,63	EUR	0,12
IT0003796171	POSTE ITALIANE SPA	PROPRE	20 248,00	240 849,96	EUR	0,20
NL0013654783	PROSUS N V	PROPRE	7 037,00	234 050,62	EUR	0,19
FR0000130577	PUBLICIS GROUPE	PROPRE	2 355,00	234 039,90	EUR	0,19
DE0006969603	PUMA AG	PROPRE	5 427,00	232 655,49	EUR	0,19
NL0015001WM6	QIAGEN NV	PROPRE	23 430,00	903 226,50	EUR	0,74
IT0003828271	RECORDATI INDUSTRIA CHIMICA E	PROPRE	12 011,00	584 935,70	EUR	0,48
ES0173093024	REDEIA CORPORACION SA	PROPRE	158 123,00	2 580 567,36	EUR	2,11
FR0010451203	REXEL	PROPRE	19 588,00	473 246,08	EUR	0,39
DE0007030009	RHEINMETALL AG	PROPRE	572,00	272 100,40	EUR	0,22
FI4000552500	SAMPO OYJ A	PROPRE	66 595,00	2 670 459,50	EUR	2,18
FR0000120578	SANOFI	PROPRE	16 167,00	1 454 059,98	EUR	1,19
DE0007164600	SAP SE	PROPRE	15 610,00	2 958 407,20	EUR	2,42
FR0000121972	SCHNEIDER ELECTRIC SA	PROPRE	6 360,00	1 426 548,00	EUR	1,17
DE0007236101	SIEMENS AG-NOM	PROPRE	1 687,00	293 065,64	EUR	0,24
IT0003153415	SNAM RETE GAS	PROPRE	278 168,00	1 149 112,01	EUR	0,94
FR0000121220	SODEXO	PROPRE	7 754,00	651 336,00	EUR	0,53
NL0000226223	STMICROELECTRONICS NV	PROPRE	19 011,00	700 840,52	EUR	0,57
FI0009005961	STORA ENSO OYJ-R	PROPRE	19 375,00	247 128,13	EUR	0,20
DE000TLX1005	TALANX AG	PROPRE	8 012,00	597 294,60	EUR	0,49
ES0178430E18	TELEFONICA SA	PROPRE	166 518,00	659 411,28	EUR	0,54
IT0003242622	TERNA SPA	PROPRE	207 002,00	1 494 140,44	EUR	1,22
FR0000121329	THALES SA	PROPRE	12 048,00	1 801 176,00	EUR	1,47
FR0000120271	TOTAL ENERGIES SE	PROPRE	42 763,00	2 665 417,79	EUR	2,18
BE0003739530	UCB SA	PROPRE	11 717,00	1 625 147,90	EUR	1,33
IT0005239360	UNICREDIT SPA	PROPRE	6 950,00	240 504,75	EUR	0,20
NL0015000IY2	UNIVERSAL MUSIC GROUP NV	PROPRE	8 667,00	240 769,26	EUR	0,20
FI0009005987	UPM KYMMENE OYJ	PROPRE	32 910,00	1 073 524,20	EUR	0,88
AT0000746409	VERBUND A	PROPRE	9 677,00	712 711,05	EUR	0,58
FR0000125486	VINCI SA	PROPRE	2 830,00	278 415,40	EUR	0,23

Swiss Life Funds (F) Equity ESG Euro Zone Minimum Volatility

Code valeur	Libellé valeur	Statut Valeur	Quantité	Valeur boursière	Devise de cotation	% Actif net
FI0009003727	WARTSILA OYJ	PROPRE	13 121,00	236 178,00	EUR	0,19
NL0000395903	WOLTERS KLUWER CVA	PROPRE	18 231,00	2 822 158,80	EUR	2,31
Total Action				120 002 950,87		98,16
Total Valeurs mobilières				120 002 950,87		98,16
Liquidités						
BANQUE OU ATTENTE						
	ACH DIFF OP DE CAPI	PROPRE	-9 854,93	-9 854,93	EUR	-0,01
	BANQUE EUR SWISSLIFE	PROPRE	2 475 660,82	2 475 660,82	EUR	2,03
	BANQUE GBP SWISSLIFE	PROPRE	21 271,18	25 088,38	GBP	0,02
	BANQUE USD SWISSLIFE	PROPRE	1 653,86	1 543,14	USD	0,00
	SOUS RECEV EUR SWB	PROPRE	27 723,34	27 723,34	EUR	0,02
Total BANQUE OU ATTENTE				2 520 160,75		2,06
FRAIS DE GESTION						
	PRCOMGESTFIN	PROPRE	-76 131,34	-76 131,34	EUR	-0,06
	PRCOMGESTFIN	PROPRE	-41 198,32	-41 198,32	EUR	-0,03
	PRCOMGESTFIN	PROPRE	-44,75	-44,75	EUR	-0,00
	PRCOMGESTFIN	PROPRE	-13 718,44	-13 718,44	EUR	-0,01
	PRFRAISDIVERS	PROPRE	-2 913,79	-2 913,79	EUR	-0,00
	PRN-1COMGESTFIN	PROPRE	-156 110,42	-156 110,42	EUR	-0,13
	PRN-1COMGESTFIN	PROPRE	-95 277,49	-95 277,49	EUR	-0,08
	PRN-1COMGESTFIN	PROPRE	-95,21	-95,21	EUR	-0,00
	PRN-1COMGESTFIN	PROPRE	-26 989,10	-26 989,10	EUR	-0,02
	PRN-1FRAISDIVERS	PROPRE	-16 298,87	-16 298,87	EUR	-0,01
Total FRAIS DE GESTION				-428 777,73		-0,35
Total Liquidités				2 091 383,02		1,71
Coupons						
Action						
ES0130670112	ENDESA	ACHLIG	77 750,00	31 488,75	EUR	0,03
ES0173093024	REDEIA CORP	ACHLIG	158 123,00	93 152,31	EUR	0,08
FR0000120271	TOTAL ENERGIES	ACHLIG	43 438,00	34 316,02	EUR	0,03
Total Action				158 957,08		0,13
Total Coupons				158 957,08		0,13
Total Swiss Life Funds (F) Equity ESG Euro Zone Minimum Volatility				122 253 290,97		100,00

ANNEXE AU RAPPORT
destinée aux souscripteurs suisses

Le prospectus du Fonds, le document d'information clé (DIC), 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 : 29-déc.

Fortune moyenne du fonds pour la période du 01/07/23 au 28/06/24 : 152 128 858,65

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 01/07/23 au 28/06/24 : 94 240 634,92

extrait du compte de résultat

Charges en euro	Rapport semestriel	Rapport annuel	Rapport semestriel
	30/06/2023	29/12/2023	28/06/2024
Commission de la direction de l'OPCVM	422 000,51	787 629,88	290 437,60
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	422 000,51	787 629,88	290 437,60
Total des charges d'exploitation avec bonification	422 000,51	787 629,88	290 437,60

TER y compris rémunération en fonction de la performance

$$(((787629.88-422000.51)+290437.6)/94240634.92)*100$$

TER **0,70** %

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

0.00 %

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 01/07/23 au 28/06/24 : 57 888 223,73

extrait du compte de résultat

Charges en euro	Rapport semestriel	Rapport annuel	Rapport semestriel
	30/06/2023	29/12/2023	28/06/2024
Commission de la direction de l'OPCVM	437 262,31	886 949,51	470 903,17
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	437 262,31	886 949,51	470 903,17
Total des charges d'exploitation avec bonification	437 262,31	886 949,51	470 903,17

TER y compris rémunération en fonction de la performance

$$(((886949.51-437262.31)+470903.17)/57888223.73)*100$$

TER 1,59 %

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

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 01/07/23 au 28/06/24 : 111 484,92

extrait du compte de résultat

Charges en euro	Rapport semestriel	Rapport semestriel	Rapport semestriel
	30/06/2023	29/12/2023	28/06/2024
Commission de la direction de l'OPCVM	2 343,97	2 999,72	286,30
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	2 343,97	2 999,72	286,30
Total des charges d'exploitation avec bonification	2 343,97	2 999,72	286,30

TER y compris rémunération en fonction de la performance

$$(((2999.72-2343.97)+286.3)/111484.92)*100$$

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

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 01/07/23 au 28/06/24 : 5 658 215,87

extrait du compte de résultat

Charges en euro	Rapport semestriel 30/06/2023	Rapport semestriel 29/12/2023	Rapport semestriel 28/06/2024
Commission de la direction de l'OPCVM	44 276,81	102 497,67	80 114,30
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	44 276,81	102 497,67	80 114,30
Total des charges d'exploitation avec bonification	44 276,81	102 497,67	80 114,30

TER y compris rémunération en fonction de la performance

$$(((102497.67-44276.81)+80114.3)/5658215.87)*100$$

TER 2,44 %

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

0.00 %

Bilan**Actif**

	28.06.2024
Devise	EUR
Immobilisations corporelles nettes	-
Titres financiers	
Actions et valeurs assimilées (A) ⁽¹⁾	120 002 950,87
Négoiciées sur un marché réglementé ou assimilé	120 002 950,87
Non négoiciées sur un marché réglementé ou assimilé	-
Obligations convertibles en actions (B) ⁽¹⁾	-
Négoiciées sur un marché réglementé ou assimilé	-
Non négoiciées sur un marché réglementé ou assimilé	-
Obligations et valeurs assimilées (C) ⁽¹⁾	-
Négoiciées sur un marché réglementé ou assimilé	-
Non négoiciées sur un marché réglementé ou assimilé	-
Titres de créances (D)	-
Négoiciées sur un marché réglementé ou assimilé	-
Non négoiciées sur un marché réglementé ou assimilé	-
Parts d'OPC et de fonds d'investissements (E)	-
OPCVM	-
FIA et équivalents d'autres Etats membres de l'Union Européenne	-
Autres OPC et fonds d'investissement	-
Dépôts (F)	-
Instruments financiers à terme (G)	-
Opérations temporaires sur titres (H)	-
Créances représentatives de titres financiers reçus en pension	-
Créances représentatives de titres donnés en garantie	-
Créances représentatives de titres financiers prêtés	-
Titres financiers empruntés	-
Titres financiers donnés en pension	-
Autres opérations temporaires	-
Prêts (I)	-
Autres actifs éligibles (J)	-
Sous-total actifs éligibles I = (A + B + C + D + E + F + G + H + I + J)	120 002 950,87
Créances et comptes d'ajustement actifs	186 680,42
Comptes financiers	2 502 292,34
Sous-total actifs autres que les actifs éligibles II	2 688 972,76
Total Actif I + II	122 691 923,63

⁽¹⁾ Les autres actifs sont les actifs autres que les actifs éligibles tels que définis par le règlement ou les statuts de l'OPC à capital variable qui sont nécessaires à leur fonctionnement.

Bilan**Passif**

	28.06.2024
Devise	EUR
Capitaux propres :	
Capital	114 975 989,54
Report à nouveau sur revenu net	-
Report à nouveau des plus et moins-values latentes nettes	-
Report à nouveau des plus et moins-values réalisées nettes	-0,01
Résultat net de l'exercice	7 277 301,44
Capitaux propres I	122 253 290,97
Passifs de financement II ⁽¹⁾	-
Capitaux propres et passifs de financement (I+II) ⁽¹⁾	-
Passifs éligibles :	
Instruments financiers (A)	-
Opérations de cession sur instruments financiers	-
Opérations temporaires sur titres financiers	-
Instruments financiers à terme (B)	-
Emprunts	-
Autres passifs éligibles (C)	-
Sous-total passifs éligibles III = A + B + C	-
Autres passifs :	
Dettes et comptes d'ajustement passifs	438 632,66
Concours bancaires	-
Sous-total autres passifs IV	438 632,66
Total Passifs: I + II + III + IV	122 691 923,63

⁽¹⁾ Cette rubrique est facultative, et ne concerne que les OFS. Les passifs de financement sont les passifs émis par l'OFS autres que les parts ou actions.

Compte de résultat

	28.06.2024
Devise	EUR
Revenus financiers nets	
Produits sur opérations financières	
Produits sur actions	3 018 700,63
Produits sur obligations	-
Produits sur titres de créance	-
Produits sur des parts d'OPC	-
Produits sur instruments financiers à terme	-
Produits sur opérations temporaires sur titres	-
Produits sur prêts et créances	-
Produits sur autres actifs et passifs éligibles	16 921,75
Autres produits financiers	98 778,23
Sous-total Produits sur opérations financières	3 134 400,61
Charges sur opérations financières	
Charges sur opérations financières	-
Charges sur instruments financiers à terme	-
Charges sur opérations temporaires sur titres	-
Charges sur emprunts	-
Charges sur autres actifs et passifs éligibles	-
Charges sur passifs de financement	-
Autres charges financières	-
Sous-total charges sur opérations financières	-
Total Revenus financiers nets (A)	3 134 400,61
Autres produits :	
Frais pris en charge par l'entreprise ⁽¹⁾	-
Rétrocession des frais de gestion au bénéfice de l'OPC	-
Versements en garantie de capital ou de performance	-
Autres produits	-
Autres charges :	
Frais de gestion de la société de gestion	-845 945,29
Frais d'audit, d'études des fonds de capital investissement	-
Impôts et taxes	-
Autres charges	-31 670,42
Sous-total Autres produits et Autres charges (B)	-877 615,71
Sous total Revenus nets avant compte de régularisation C = A - B	2 256 784,90
Régularisation des revenus nets de l'exercice (D)	-455 700,30

⁽¹⁾ Seulement pour les FCPE.

Compte de résultat (suite)

	28.06.2024
Devise	EUR
Sous-total revenus nets I = C + D	1 801 084,60
Plus ou moins-values réalisées nettes avant compte de régularisations :	
Plus et moins-values réalisées	5 133 399,45
Frais de transactions externes et frais de cession	-62 066,16
Frais de recherche	-
Quote-part des plus-values réalisées restituées aux assureurs	-
Indemnités d'assurance perçues	-
Versements en garantie de capital ou de performance reçus	-
Sous total plus ou moins-values réalisées nettes avant compte de régularisations E	5 071 333,29
Régularisations des plus ou moins-values réalisées nettes F	-918 986,53
Plus ou moins-values réalisées nettes II = E + F	4 152 346,76
Plus ou moins-values latentes nettes avant compte de régularisations :	
Variation des plus ou moins-values latentes yc les écarts de change sur les actifs éligibles	2 412 761,38
Écarts de change sur les comptes financiers en devises	451,42
Versements en garantie de capital ou de performance à recevoir	-
Quote-part des plus-values latentes à restituer aux assureurs	-
Sous total plus ou moins-values latentes nettes avant compte de régularisation G	2 413 212,80
Régularisations des plus ou moins-values latentes nettes H	-1 089 342,72
Plus ou moins-values latentes nettes III = G + H	1 323 870,08
Acomptes :	
Acomptes sur revenus nets versés au titre de l'exercice J	-
Acomptes sur plus ou moins-values réalisées nettes versés au titre de l'exercice K	-
Acomptes sur plus ou moins-values latentes nettes versés au titre de l'exercice L ⁽²⁾	-
Total acomptes versés au titre de l'exercice IV = J + K + L	-
Impôt sur le résultat V	-
Résultat net I + II + III -IV -V	7 277 301,44

⁽²⁾ Seulement pour les MMF.

Evolution du nombre de parts ou actions au cours de la période**PART P**

FR0010645515	En parts ou actions	En montant
Parts ou actions souscrites durant la période	62 307,4401	10 744 570,93
Parts ou actions rachetées durant la période	54 747,9228	9 418 783,39
Solde net des souscriptions/rachats	7 559,5173	1 325 787,54

PART I

FR0010654236	En parts ou actions	En montant
Parts ou actions souscrites durant la période	822,65	16 309 209,22
Parts ou actions rachetées durant la période	4 549,80	90 963 191,42
Solde net des souscriptions/rachats	-3 727,15	-74 653 982,20

PART F

FR0013356987	En parts ou actions	En montant
Parts ou actions souscrites durant la période	-	-
Parts ou actions rachetées durant la période	4 143,749	475 306,57
Solde net des souscriptions/rachats	-4 143,749	-475 306,57

PART SF

FR0013458742	En parts ou actions	En montant
Parts ou actions souscrites durant la période	33 041,339	3 300 516,00
Parts ou actions rachetées durant la période	6 495,70	649 712,75
Solde net des souscriptions/rachats	26 545,639	2 650 803,25

*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