

SWISS LIFE FUNDS (F) ESG MONEY MARKET EURO

Information Périodique au 29.06.2023

**SOCIÉTÉ D'INVESTISSEMENT À CAPITAL VARIABLE - SICAV 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		5 781 137 092,71
b) Avoirs bancaires		754 409 199,00
c) Autres actifs détenus par l'OPC		854 386 611,47
d) Total des actifs détenus par l'OPC (<i>lignes a+b+c</i>)		7 389 932 903,18
e) Passif		-309 783 000,67
f) Valeur nette d'inventaire (<i>lignes d+e = actif net OPC</i>)		7 080 149 902,51

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)
ACTION I / FR0010089649	272 178,052	EUR	25 081,96
ACTION P / FR0010540385	2 323 815,227	EUR	109,04

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.	81,65	78,23
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	9,27	8,88

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
EUR	5 781 137 092,71	81,65	78,23
-	-	-	-
-	-	-	-
-	-	-	-
-	-	-	-
-	-	-	-
-	-	-	-
-	-	-	-
-	-	-	-
-	-	-	-
-	-	-	-
Autres devises	-	-	-
Total	5 781 137 092,71	81,65	78,23

Répartition des actifs par pays de résidence de l'émetteur

Pays (10 principaux pays)	Pourcentage	
	Actif net	Total des actifs
France	42,83	41,03
Royaume-Uni	7,38	7,07
Pays-Bas	6,79	6,51
Etats-Unis d'Amérique	4,38	4,20
Canada	4,35	4,17
Luxembourg	3,16	3,03
Belgique	2,73	2,62
Espagne	2,29	2,19
Suède	2,01	1,93
Allemagne	1,47	1,41
Autres pays	4,26	4,07
Total	81,65	78,23

Répartition des actifs par secteur économique

Secteur économique (10 principaux secteurs)	Pourcentage	
	Actif net	Total des actifs
Banques	43,61	41,80
Services financiers diversifiés	7,58	7,27
Services de traitement des transactions	3,63	3,48
Électricité conventionnelle	2,98	2,85
Industries diversifiées	2,43	2,33
Bâtiment	1,94	1,86
Composants électriques	1,93	1,85
SCPI santé	1,50	1,43
Détaillants et grossistes d'alimentation	1,34	1,29
Pipelines	1,34	1,28
Autres secteurs	13,37	12,79
Total	81,65	78,23

Ventilation des autres actifs par nature

Nature d'actifs	Pourcentage	
	Actif net	Total des actifs
PARTS OU ACTIONS D'OPCVM :	9,27	8,88
- 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	9,27	8,88
AUTRE NATURE D'ACTIFS :	-	-
- Bons de souscription	-	-
- Bons de caisse	-	-
- Billets à ordre	-	-
- Billets hypothécaires	-	-
- Autres	-	-
TOTAL	9,27	8,88

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.	23 646 408 769,45	22 818 214 478,01
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	390 132 187,13	411 442 741,16
Total sur la période	24 036 540 956,58	23 229 657 219,17

Frais de gestion

Commission de surperformance (frais variables) : montant et % des frais sur la période	Montant	%
Catégorie de part :		
ACTION I / FR0010089649	-	-
ACTION P / FR0010540385	-	-

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 29/06/2023 :

La Sicav 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 de la Sicav, 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 la Sicav durant la période sous revue est disponible gratuitement auprès du représentant de la Sicav 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 de la Sicav pour l'offre et la distribution en Suisse ou à partir de la Suisse, des actions de la Sicav 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 de la Sicav pour la Suisse, conformément à l'art. 121 LPCC.

Clôture annuelle de la sicav : 31-déc.

Fortune moyenne de la sicav pour la période du 01/07/22 au 30/06/23 : 6 197 073 767,49

Action I **FR0010089649**

Commission de gestion de la direction de l'OPCVM : 0,30 % TTC

Fortune moyenne de l'action I pour la période du 01/07/22 au 30/06/23 : 5 979 191 736,43

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	2 921 794,63	6 306 079,84	3 768 800,34
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	10218,90
Impôts	0,00	0,00	0,00
Total des charges d'exploitation hors bonification	2 921 794,63	6 306 079,84	3 779 019,24
Total des charges d'exploitation avec bonification	2 921 794,63	6 306 079,84	3 779 019,24

TER y compris rémunération en fonction de la performance

$$(((6306079.84-2921794.63)+3779019.24)/5979191736.43)*100$$

TER 0,12 %

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

0,00 %

Action P

FR0010540385

Commission de gestion de la direction
de l'OPCVM : 0,60 % TTC

Fortune moyenne de l'action P pour la
période du 01/07/22 au 30/06/23 : 217 882 031,06

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	207 629,71	448 715,48	301 846,69
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	369,33
Impôts	0,00	0,00	0,00
Total des charges d'exploitation hors bonification	207 629,71	448 715,48	302 216,02
Total des charges d'exploitation avec bonification	207 629,71	448 715,48	302 216,02

TER y compris rémunération en fonction de la performance

$$(((448715.48-207629.71)+302216.02)/217882031.06)*100$$

TER 0,25 %

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

0,00 %

BILAN ACTIF

Devise	29.06.2023	30.06.2022
	EUR	EUR
Immobilisations nettes	-	-
Dépôts	189 780 736,64	49 987 767,50
Instruments financiers	6 441 572 839,34	4 496 375 747,31
• 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	1 051 728 889,99	1 153 117 938,37
Non négoiciées sur un marché réglementé ou assimilé	14 516 775,00	30 008 705,00
• TITRES DE CRÉANCES		
Négoiés sur un marché réglementé ou assimilé		
<i>Titres de créances négociables</i>	2 906 774 713,35	1 756 149 398,91
<i>Autres titres de créances</i>	-	-
Non négociés sur un marché réglementé ou assimilé	1 808 116 714,37	1 072 941 596,18
• ORGANISMES DE PLACEMENTS COLLECTIFS		
OPCVM et Fonds d'Investissement à Vocation Générale destinés aux non professionnels et équivalents d'autres pays	656 297 448,50	483 337 822,84
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	-	-
Autres opérations	4 138 298,13	820 286,01
• AUTRES INSTRUMENTS FINANCIERS	-	-
Créances	4 170 128,20	723 488,66
Opérations de change à terme de devises	-	-
Autres	4 170 128,20	723 488,66
Comptes financiers	754 409 199,00	675 802 093,67
Liquidités	754 409 199,00	675 802 093,67
Autres actifs	-	-
Total de l'actif	7 389 932 903,18	5 222 889 097,14

BILAN PASSIF

	29.06.2023	30.06.2022
Devise	EUR	EUR
Capitaux propres		
• Capital	7 019 093 523,31	5 213 388 501,37
• Plus et moins-values nettes antérieures non distribuées	-0,02	-0,11
• Report à nouveau	-	-
• Plus et moins-values nettes de l'exercice	-4 040 351,59	-9 909 693,65
• Résultat de l'exercice	65 096 730,81	-2 410 789,44
Total des capitaux propres <i>(montant représentatif de l'actif net)</i>	7 080 149 902,51	5 201 068 018,17
Instruments financiers	4 138 298,13	820 286,01
• 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	4 138 298,13	771 242,35
Autres opérations	-	49 043,66
Dettes	305 637 418,58	20 999 529,05
Opérations de change à terme de devises	-	-
Autres	305 637 418,58	20 999 529,05
Comptes financiers	7 283,96	1 263,91
Concours bancaires courants	7 283,96	1 263,91
Emprunts	-	-
Total du passif	7 389 932 903,18	5 222 889 097,14

COMPTE DE RÉSULTAT

	29.06.2023	30.06.2022
Devise	EUR	EUR
Produits sur opérations financières		
• Produits sur dépôts et sur comptes financiers	784 327,95	-337 165,24
• Produits sur actions et valeurs assimilées	-	-
• Produits sur obligations et valeurs assimilées	14 841 534,95	3 760 232,93
• Produits sur titres de créances	39 722 250,01	-630 814,99
• Produits sur acquisitions et cessions temporaires de titres financiers	-	-
• Produits sur contrats financiers	454 603,16	24 320,15
• Autres produits financiers	-	-
Total (I)	55 802 716,07	2 816 572,85
Charges sur opérations financières		
• Charges sur acquisitions et cessions temporaires de titres financiers	-	-
• Charges sur contrats financiers	-215 860,62	-44 036,40
• Charges sur dettes financières	9 495 722,45	-2 063 701,62
• Autres charges financières	-	-
Total (II)	9 279 861,83	-2 107 738,02
Résultat sur opérations financières (I - II)	-	708 834,83
Autres produits (III)	-	-
Frais de gestion et dotations aux amortissements (IV)	-4 081 235,26	-3 138 424,34
Résultat net de l'exercice (L.214-17-1) (I - II + III - IV)	61 001 342,64	-2 429 589,51
Régularisation des revenus de l'exercice (V)	4 095 388,17	18 800,07
Acomptes sur résultat versés au titre de l'exercice (VI)	-	-
Résultat (I - II + III - IV +/- V - VI) :	65 096 730,81	-2 410 789,44

Capitaux propres

ACTION I / FR0010089649	Souscriptions		Rachats	
	Nombre de parts	Montant	Nombre de parts	Montant
Nombre de parts émises / rachetées pendant l'exercice	1 328 190,002	32 929 578 650,30	1 260 285,355	31 246 012 131,25

ACTION P / FR0010540385	Souscriptions		Rachats	
	Nombre de parts	Montant	Nombre de parts	Montant
Nombre de parts émises / rachetées pendant l'exercice	5 029 936,015	542 384 101,96	4 273 380,428	461 039 118,01

*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  