

SWISS LIFE FUNDS (F)  
EQUITY ESG EUROPE  
MINIMUM VOLATILITY

Information Périodique au 30.06.2023

**FONDS COMMUN DE PLACEMENT - FCP DE DROIT FRANÇAIS**

**État du patrimoine**

<b>Éléments de l'état du patrimoine</b>	<i>Devise de comptabilité de l'OPC : EUR</i>	<b>Montant à l'arrêté périodique</b>
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		169 193 772,29
b) Avoirs bancaires		2 152 782,04
c) Autres actifs détenus par l'OPC		349 199,44
d) Total des actifs détenus par l'OPC ( <i>lignes a+b+c</i> )		<b>171 695 753,77</b>
e) Passif		-192 261,98
f) Valeur nette d'inventaire ( <i>lignes d+e = actif net OPC</i> )		<b>171 503 491,79</b>

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

<b>Parts ou actions</b>	<b>Nombre de parts ou actions en circulation</b>	<i>Devise parts ou actions</i>	<b>Valeur nette d'inventaire par part ou action (Valeur Liquidative)</b>
PART C / FR0010074914	144 061,3337	EUR	211,38
PART I / FR0010661124	9 909,0003	EUR	14 233,26
PART D / FR0010074922	96,8301	EUR	144,91
PART F / FR0013356995	1	EUR	111,12

**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.	77,89	77,81
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.	20,76	20,73
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 <i>En devise de comptabilité de l'OPC</i>	Pourcentage	
	EUR	Actif net	Total des actifs
EUR	88 460 700,49	51,57	51,51
CHF	33 850 540,19	19,74	19,72
GBP	30 194 293,20	17,61	17,59
DKK	9 560 602,47	5,57	5,57
NOK	3 536 885,15	2,06	2,06
SEK	1 844 403,47	1,08	1,07
USD	1 746 347,32	1,02	1,02
-	-	-	-
-	-	-	-
-	-	-	-
Autres devises	-	-	-
<b>Total</b>	<b>169 193 772,29</b>	<b>98,65</b>	<b>98,54</b>

**Répartition des actifs par pays de résidence de l'émetteur**

Pays (10 principaux pays)	Pourcentage	
	Actif net	Total des actifs
Suisse	20,90	20,90
Royaume-Uni	17,61	17,59
France	12,49	12,48
Pays-Bas	9,89	9,88
Allemagne	7,95	7,94
Espagne	7,12	7,11
Danemark	5,57	5,57
Italie	4,49	4,48
Finlande	3,51	3,50
Belgique	2,77	2,76
Autres pays	6,35	6,33
<b>Total</b>	<b>98,65</b>	<b>98,54</b>

**Répartition des actifs par secteur économique**

Secteur économique (10 principaux secteurs)	Pourcentage	
	Actif net	Total des actifs
Pharmacie	15,50	15,49
Services de télécommunications	7,49	7,48
Assurance services complets	5,82	5,82
Produits alimentaires	5,28	5,27
Électricité conventionnelle	4,97	4,96
Édition	3,74	3,74
Détaillants et grossistes d'alimentation	3,71	3,71
Chimie de spécialité	3,57	3,57
Logiciels	3,00	2,99
Banques	2,73	2,73
Autres secteurs	42,84	42,78
<b>Total</b>	<b>98,65</b>	<b>98,54</b>

**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	-	-
<b>TOTAL</b>	<b>-</b>	<b>-</b>

**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.	90 160 635,18	88 395 699,51
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.	15 939 593,61	13 818 190,16
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	-	-
<b>Total sur la période</b>	<b>106 100 228,79</b>	<b>102 213 889,67</b>

**Frais de gestion**

Commission de surperformance (frais variables) : montant et % des frais sur la période	Montant	%
Catégorie de part :		
PART C / FR0010074914	-	-
PART I / FR0010661124	-	-
PART D / FR0010074922	-	-
PART F / FR0013356995	-	-

**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
19/04/2023	PART D / FR0010074922	EUR	Dividende sur résultat versé	1,16999	0,205	1,37499
-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-

**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-Dec

Fortune moyenne du fonds pour la période du 01/07/22 au 30/06/23 : 173 238 769,20

**Part C FR0010074914**

Commission de gestion de la direction de l'OPCVM : 1,75 % TTC

Fortune moyenne de la part C pour la période du 01/07/22 au 30/06/23 : 29 828 555,31

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	275 963,53	534 923,32	263 228,79
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	275 963,53	534 923,32	263 228,79
Total des charges d'exploitation avec bonification	275 963,53	534 923,32	263 228,79

**TER y compris rémunération en fonction de la performance**

$$(((534923.32-275963.53)+263228.79)/29828555.31)*100$$

TER 1,75 %

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

0.00 %

**Part I**

**FR0010661124**

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 :

143 396 604,02

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	666 449,76	1 178 402,09	491 983,03
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	666 449,76	1 178 402,09	491 983,03
Total des charges d'exploitation avec bonification	666 449,76	1 178 402,09	491 983,03

**TER y compris rémunération en fonction de la performance**

$$(((1178402.09-666449.76)+491983.03)/143396604.02)*100$$

TER 0,70 %

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

0.00 %

**Part D**

**FR0010074922**

Commission de gestion de la direction de l'OPCVM : 1,75 % TTC

Fortune moyenne de la part D pour la période du 01/07/22 au 30/06/23 :

13 609,87

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	134,58	251,11	121,65
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	134,58	251,11	121,65
Total des charges d'exploitation avec bonification	134,58	251,11	121,65

**TER y compris rémunération en fonction de la performance**

$$(((251.11-134.58)+121.65)/13609.87)*100$$

TER 1,75 %

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

0.00 %

**Part F**

**FR0013356995**

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 :

441 158,24

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	7 386,30	11 136,58	0,27
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	7 386,30	11 136,58	0,27
Total des charges d'exploitation avec bonification	7 386,30	11 136,58	0,27

**TER y compris rémunération en fonction de la performance**

$$(((11136.58-7386.3)+0.27)/441158.24)*100$$

TER 0,85 %

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
<b>Immobilisations nettes</b>	-	-
<b>Dépôts</b>	-	-
<b>Instruments financiers</b>	<b>169 193 772,29</b>	<b>187 311 142,50</b>
• <b>ACTIONS ET VALEURS ASSIMILÉES</b>		
Négoiciées sur un marché réglementé ou assimilé	169 193 772,29	187 287 142,50
Non négoiciées sur un marché réglementé ou assimilé	-	-
• <b>OBLIGATIONS ET VALEURS ASSIMILÉES</b>		
Négoiciées sur un marché réglementé ou assimilé	-	-
Non négoiciées sur un marché réglementé ou assimilé	-	-
• <b>TITRES DE CRÉANCES</b>		
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	-	-
• <b>ORGANISMES DE PLACEMENTS COLLECTIFS</b>		
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	-	-
• <b>OPÉRATIONS TEMPORAIRES SUR TITRES</b>		
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	-	-
• <b>CONTRATS FINANCIERS</b>		
Opérations sur un marché réglementé ou assimilé	-	24 000,00
Autres opérations	-	-
• <b>AUTRES INSTRUMENTS FINANCIERS</b>	-	-
<b>Créances</b>	<b>349 199,44</b>	<b>847 250,45</b>
Opérations de change à terme de devises	-	-
Autres	349 199,44	847 250,45
<b>Comptes financiers</b>	<b>2 152 782,04</b>	<b>2 998 454,18</b>
Liquidités	2 152 782,04	2 998 454,18
<b>Autres actifs</b>	-	-
<b>Total de l'actif</b>	<b>171 695 753,77</b>	<b>191 156 847,13</b>

## BILAN PASSIF

	30.06.2023	30.06.2022
Devise	EUR	EUR
<b>Capitaux propres</b>		
• Capital	166 818 328,52	186 724 767,69
• Plus et moins-values nettes antérieures non distribuées	-	0,84
• Report à nouveau	-	0,65
• Plus et moins-values nettes de l'exercice	1 913 062,96	1 456 253,80
• Résultat de l'exercice	2 772 099,77	2 815 128,25
<b>Total des capitaux propres</b> <i>(montant représentatif de l'actif net)</i>	<b>171 503 491,79</b>	<b>190 996 151,23</b>
<b>Instruments financiers</b>	-	<b>24 000,00</b>
• 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	-	24 000,00
Autres opérations	-	-
<b>Dettes</b>	<b>138 667,04</b>	<b>136 695,90</b>
Opérations de change à terme de devises	-	-
Autres	138 667,04	136 695,90
<b>Comptes financiers</b>	<b>53 594,94</b>	-
Concours bancaires courants	53 594,94	-
Emprunts	-	-
<b>Total du passif</b>	<b>171 695 753,77</b>	<b>191 156 847,13</b>

## COMPTE DE RÉSULTAT

	30.06.2023	30.06.2022
Devise	EUR	EUR
<b>Produits sur opérations financières</b>		
• Produits sur dépôts et sur comptes financiers	33 468,16	-
• Produits sur actions et valeurs assimilées	3 544 785,87	4 017 444,33
• 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	-	-
<b>Total (I)</b>	<b>3 578 254,03</b>	<b>4 017 444,33</b>
<b>Charges sur opérations financières</b>		
• Charges sur acquisitions et cessions temporaires de titres financiers	-	-
• Charges sur contrats financiers	-	-
• Charges sur dettes financières	-	-13 819,51
• Autres charges financières	-	-
<b>Total (II)</b>	<b>-</b>	<b>-13 819,51</b>
<b>Résultat sur opérations financières (I - II)</b>	<b>3 578 254,03</b>	<b>4 003 624,82</b>
Autres produits (III)	-	-
Frais de gestion et dotations aux amortissements (IV)	-755 333,74	-949 934,17
<b>Résultat net de l'exercice (L.214-17-1) (I - II + III - IV)</b>	<b>2 822 920,29</b>	<b>3 053 690,65</b>
Régularisation des revenus de l'exercice (V)	-50 820,52	-238 562,40
Acomptes sur résultat versés au titre de l'exercice (VI)	-	-
<b>Résultat (I - II + III - IV +/- V - VI) :</b>	<b>2 772 099,77</b>	<b>2 815 128,25</b>

**Capitaux propres**

PART C / FR0010074914		<b>Souscriptions</b>		<b>Rachats</b>	
	Nombre de parts	Montant	Nombre de parts	Montant	
Nombre de parts émises / rachetées pendant l'exercice	13 259,1205	2 604 902,42	20 490,3593	4 089 497,82	

PART I / FR0010661124		<b>Souscriptions</b>		<b>Rachats</b>	
	Nombre de parts	Montant	Nombre de parts	Montant	
Nombre de parts émises / rachetées pendant l'exercice	2 027,1	26 811 260,12	4 235,91	54 325 672,36	

PART F / FR0013356995		<b>Souscriptions</b>		<b>Rachats</b>	
	Nombre de parts	Montant	Nombre de parts	Montant	
Nombre de parts émises / rachetées pendant l'exercice	741	76 405,75	17 486	1 643 109,70	

---

*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*  