

SWISS LIFE FUNDS (F) BOND ESG 6M

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		1 389 029 530,11
b) Avoirs bancaires		20 380 418,70
c) Autres actifs détenus par l'OPC		155 047 847,51
d) Total des actifs détenus par l'OPC (<i>lignes a+b+c</i>)		1 564 457 796,32
e) Passif		-28 050 112,17
f) Valeur nette d'inventaire (<i>lignes d+e = actif net OPC</i>)		1 536 407 684,15

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

Parts ou actions	Nombre de parts ou actions en circulation	<i>Devise parts ou actions</i>	Valeur nette d'inventaire par part ou action (Valeur Liquidative)
PART I / FR0010899179	141 626,435	EUR	10 776,8
PART P / FR0010914358	96 923,346	EUR	104,48

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.	90,41	88,79
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	9,31	9,15

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	1 389 029 530,11	90,41	88,79
-	-	-	-
-	-	-	-
-	-	-	-
-	-	-	-
-	-	-	-
-	-	-	-
-	-	-	-
-	-	-	-
-	-	-	-
-	-	-	-
Autres devises	-	-	-
Total	1 389 029 530,11	90,41	88,79

Répartition des actifs par pays de résidence de l'émetteur

Pays (10 principaux pays)	Pourcentage	
	Actif net	Total des actifs
France	51,33	50,41
Pays-Bas	6,14	6,03
Espagne	5,75	5,64
Royaume-Uni	4,84	4,76
Etats-Unis d'Amérique	4,72	4,64
Suède	2,97	2,92
Canada	2,76	2,71
Irlande	2,06	2,02
Japon	1,85	1,82
Allemagne	1,71	1,68
Autres pays	6,28	6,16
Total	90,41	88,79

Répartition des actifs par secteur économique

Secteur économique (10 principaux secteurs)	Pourcentage	
	Actif net	Total des actifs
Banques	64,13	62,95
Services financiers diversifiés	5,63	5,53
Bâtiment	2,49	2,44
Électricité conventionnelle	2,03	1,99
Équipements et produits ménagers	1,91	1,88
Services d'investissement	1,44	1,42
Articles personnels	1,30	1,28
Gestionnaires d'actifs et services de garde	1,30	1,27
Biens de consommation courante - Divers	1,17	1,15
Participation et promotion immobilières	0,98	0,96
Autres secteurs	8,03	7,92
Total	90,41	88,79

Ventilation des autres actifs par nature

Nature d'actifs	Pourcentage	
	Actif net	Total des actifs
PARTS OU ACTIONS D'OPCVM :	9,31	9,15
- 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	9,31	9,15
AUTRE NATURE D'ACTIFS :	-	-
- Bons de souscription	-	-
- Bons de caisse	-	-
- Billets à ordre	-	-
- Billets hypothécaires	-	-
- Autres	-	-
TOTAL	9,31	9,15

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.	4 745 102 104,92	4 734 558 740,32
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	173 819 918,31	189 867 525,79
Total sur la période	4 918 922 023,23	4 924 426 266,11

Frais de gestion

Commission de surperformance (frais variables) : montant et % des frais sur la période	Montant	%
Catégorie de part :		
PART I / FR0010899179	-	-
PART P / FR0010914358	-	-

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 : 1 693 372 291,67

Part I **FR0010899179**

Commission de gestion de la direction de l'OPCVM : 0,25 % TTC

Fortune moyenne de la part I pour la période du 01/07/22 au 30/06/23 : 1 691 041 927,32

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	1 600 257,92	3 180 623,00	1 461 881,05
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	1 600 257,92	3 180 623,00	1 461 881,05
Total des charges d'exploitation avec bonification	1 600 257,92	3 180 623,00	1 461 881,05

TER y compris rémunération en fonction de la performance

$$(((3180623-1600257.92)+1461881.05)/1691041927.32)*100$$

TER 0,18 %

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

0,00 %

SWISS LIFE FUNDS (F) BOND ESG 6M
plaquette au 30/06/2023

Part P

FR0010914358

Commission de gestion de la direction de l'OPCVM : 0,40 % TTC

Fortune moyenne de la part P pour la période du 01/07/22 au 30/06/23 : 2 330 364,35

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	2 085,85	4 084,99	7 366,29
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	2 085,85	4 084,99	7 366,29
Total des charges d'exploitation avec bonification	2 085,85	4 084,99	7 366,29

TER y compris rémunération en fonction de la performance

$$(((4084.99-2085.85)+7366.29)/2330364.35)*100$$

TER 0,40 %

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

0.00 %

BILAN ACTIF

	30.06.2023	30.06.2022
Devise	EUR	EUR
Immobilisations nettes	-	-
Dépôts	-	-
Instruments financiers	1 541 001 351,06	1 605 788 635,60
• 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	603 745 064,00	769 239 568,85
Non négoiciées sur un marché réglementé ou assimilé	9 861 865,28	29 254 252,50
• TITRES DE CRÉANCES		
Négoiés sur un marché réglementé ou assimilé		
<i>Titres de créances négociables</i>	616 686 374,63	529 650 115,07
<i>Autres titres de créances</i>	-	-
Non négociés sur un marché réglementé ou assimilé	158 736 226,20	101 867 822,79
• ORGANISMES DE PLACEMENTS COLLECTIFS		
OPCVM et Fonds d'Investissement à Vocation Générale destinés aux non professionnels et équivalents d'autres pays	143 087 083,40	171 581 886,00
Autres Fonds destinés à des non professionnels et équivalents d'autres pays États membres de l'Union européenne	-	-
Fonds professionnels à vocation générale et équivalents d'autres États membres de l'union européenne et organismes de titrisations cotés	-	-
Autres Fonds d'investissement professionnels et équivalents d'autres États membres de l'union européenne et organismes de titrisations non cotés	-	-
Autres organismes non européens	-	-
• OPÉRATIONS TEMPORAIRES SUR TITRES		
Créances représentatives de titres financiers reçus en pension	-	-
Créances représentatives de titres financiers prêtés	-	-
Titres financiers empruntés	-	-
Titres financiers donnés en pension	-	-
Autres opérations temporaires	-	-
• CONTRATS FINANCIERS		
Opérations sur un marché réglementé ou assimilé	-	-
Autres opérations	8 884 737,55	4 194 990,39
• AUTRES INSTRUMENTS FINANCIERS	-	-
Créances	3 076 026,56	1 617 006,21
Opérations de change à terme de devises	-	-
Autres	3 076 026,56	1 617 006,21
Comptes financiers	20 380 418,70	262 822 107,47
Liquidités	20 380 418,70	262 822 107,47
Autres actifs	-	-
Total de l'actif	1 564 457 796,32	1 870 227 749,28

BILAN PASSIF

Devise	30.06.2023	30.06.2022
	EUR	EUR
Capitaux propres		
• Capital	1 519 271 189,93	1 842 311 635,81
• Plus et moins-values nettes antérieures non distribuées	0,17	0,19
• Report à nouveau	-	-
• Plus et moins-values nettes de l'exercice	-785 188,08	-3 166 935,80
• Résultat de l'exercice	17 921 682,13	-227 756,59
Total des capitaux propres <i>(montant représentatif de l'actif net)</i>	1 536 407 684,15	1 838 916 943,61
Instruments financiers	8 884 737,48	4 194 990,39
• 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	7 822 310,53	3 459 630,52
Autres opérations	1 062 426,95	735 359,87
Dettes	19 165 374,69	26 494 997,98
Opérations de change à terme de devises	-	-
Autres	19 165 374,69	26 494 997,98
Comptes financiers	-	620 817,30
Concours bancaires courants	-	620 817,30
Emprunts	-	-
Total du passif	1 564 457 796,32	1 870 227 749,28

COMPTE DE RÉSULTAT

	30.06.2023	30.06.2022
Devise	EUR	EUR
Produits sur opérations financières		
• Produits sur dépôts et sur comptes financiers	8 625,81	2 653,27
• Produits sur actions et valeurs assimilées	-	-
• Produits sur obligations et valeurs assimilées	8 497 881,11	1 939 127,13
• Produits sur titres de créances	9 196 242,22	-175 823,21
• Produits sur acquisitions et cessions temporaires de titres financiers	-	-
• Produits sur contrats financiers	2 745 458,51	147 166,99
• Autres produits financiers	-	-
Total (I)	20 448 207,65	1 913 124,18
Charges sur opérations financières		
• Charges sur acquisitions et cessions temporaires de titres financiers	-	-
• Charges sur contrats financiers	-889 146,57	-255 833,50
• Charges sur dettes financières	857 641,40	-294 547,68
• Autres charges financières	-	-
Total (II)	-31 505,17	-550 381,18
Résultat sur opérations financières (I - II)	20 416 702,48	1 362 743,00
Autres produits (III)	-	-
Frais de gestion et dotations aux amortissements (IV)	-1 469 247,34	-1 602 343,77
Résultat net de l'exercice (L.214-17-1) (I - II + III - IV)	18 947 455,14	-239 600,77
Régularisation des revenus de l'exercice (V)	-1 025 773,01	11 844,18
Acomptes sur résultat versés au titre de l'exercice (VI)	-	-
Résultat (I - II + III - IV +/- V - VI) :	17 921 682,13	-227 756,59

Capitaux propres

PART I / FR0010899179	Souscriptions		Rachats	
	Nombre de parts	Montant	Nombre de parts	Montant
Nombre de parts émises / rachetées pendant l'exercice	135 579,288	1 442 700 532,81	168 152,394	1 788 987 767,73

PART P / FR0010914358	Souscriptions		Rachats	
	Nombre de parts	Montant	Nombre de parts	Montant
Nombre de parts émises / rachetées pendant l'exercice	93 221,093	9 693 144,70	6 233,579	648 984,44

*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  