



# Swiss Life Funds (F) Bond ESG 6M F Cap

NAV des Fonds: 2'157.01 Mio. EUR | NAV je Anteil: 106.55 EUR



SFDR Offenlegung: Artikel 8

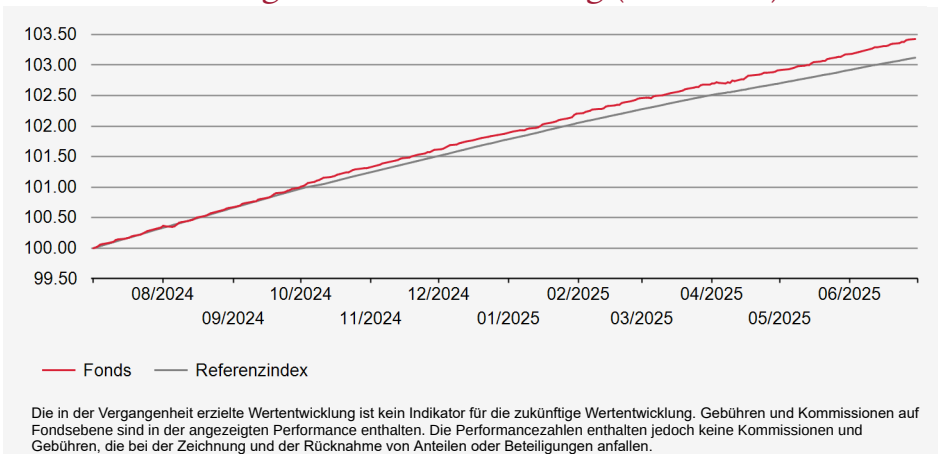
## Management Kommentar

Der Juni war geprägt von den eskalierenden Konflikten im Nahen Osten und den ausbleibenden Fortschritten bei den Handelsabkommen zwischen den USA und ihren Partnern. Diese Unsicherheiten belasteten die Geldmärkte jedoch nicht. Die EZB senkte die Leitzinsen angesichts der makroökonomischen Daten und des makroökonomischen Ausblicks erneut um 25 BP. Der 1-Jahres-ESTER-Swap stieg um 5 BP auf 1,77%. Der 3-Monats-Euribor sank um 5 BP auf 1,94%.

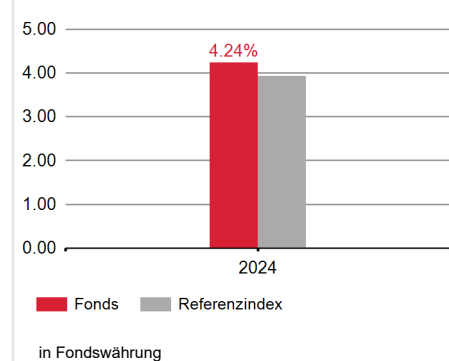
## Anlagestrategie

Der Fonds ist ein kurzfristiger Anleihenfonds, der in notierte Investment-Grade-Emissionen mit einer Restlaufzeit von unter 3 Jahren investiert. Die gewichtete durchschnittliche Restlaufzeit (WAM) der Titel liegt bei unter 6 Monaten, die gewichtete durchschnittliche Laufzeit (WAL) bei höchstens 18 Monaten. Empfohlener Anlagehorizont des FCP ist mindestens 6 Monate.

## Wertentwicklung in Referenzwährung (Basis 100)



## Performance



## Performance in Referenzwährung

|            | Kumulierte Performance |         |        |         |         |       | Annualisierte Performance |         |       |
|------------|------------------------|---------|--------|---------|---------|-------|---------------------------|---------|-------|
|            | YTD                    | 1 Monat | 1 Jahr | 3 Jahre | 5 Jahre | Aufl. | 3 Jahre                   | 5 Jahre | Aufl. |
| Fonds      | 1.51%                  | -       | 3.45%  | -       | -       | 6.55% | -                         | -       | 3.90% |
| Ref. Index | 1.32%                  | -       | 3.15%  | -       | -       | 5.99% | -                         | -       | 3.57% |

## Fondseigenschaften

**Auflagedatum:** 03/11/2023  
**ISIN:** FR001400LFN8  
**Bloomberg-Code:** SWISLFF FP  
**Morningstar Kategorie:** Anleihen EUR ultra-short  
**Klassifizierung:** Renten und andere verzinsliche Wertpapiere in EUR  
**Fondswährung:** EUR  
**Fondsdomizil:** Frankreich  
**Ref. Index:** 70% ESTR Capitalized + 30% BLOOMBERG EUR FRN IND UNHEDGED EUR  
**Mindestanlage:** 10 Anteile  
**Zeichnungsgebühren (max.):** 2.00%  
**Verwaltungsgebühren:** 0.19%  
**Performancegebühren:** Keine  
**Laufende Kosten per 31/12/2024:** 0.27%  
**Zeichnung / Rückzahlung:** Orderschluss 11:00 Abwicklung T+1  
**Ertragsverwendung:** Thesaurierung  
Das Produkt beinhaltet ein Kapitalverlustrisiko.

## Risikoindikatoren

Geringes Risiko < 1 2 3 4 5 6 7 > Hohes Risiko  
Potenziell niedrigere Wertentwicklung Potenziell höhere Wertentwicklung

**WAL** (gewichtete  
durchschn. Laufzeit)  
**452.12**

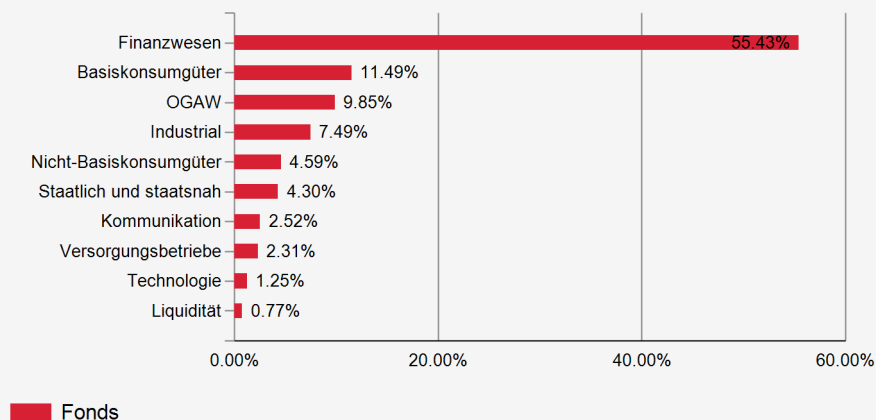
**WAM** (gewichtete  
durchschn. Fälligkeit)  
**131.55**

**WARF** (gewichteter  
durchschn. Ratingfaktor)  
**[A-/A]**

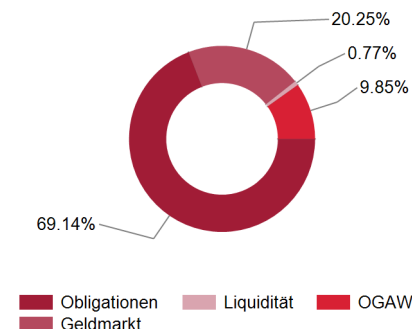
| Wöchentlich annualisiert | 1 Jahr | 3 Jahre | Aufl. |
|--------------------------|--------|---------|-------|
| Volatilität Portfolio    | 0.12%  | -       | 0.16% |
| Volatilität Ref. Index   | 0.08%  | -       | 0.11% |
| Tracking Error           | 0.10   | -       | 0.11  |
| Information Ratio        | 3.00   | -       | 3.16  |
| Sharpe Ratio             | 3.89   | -       | 3.33  |

## Swiss Life Funds (F) Bond ESG 6M F Cap

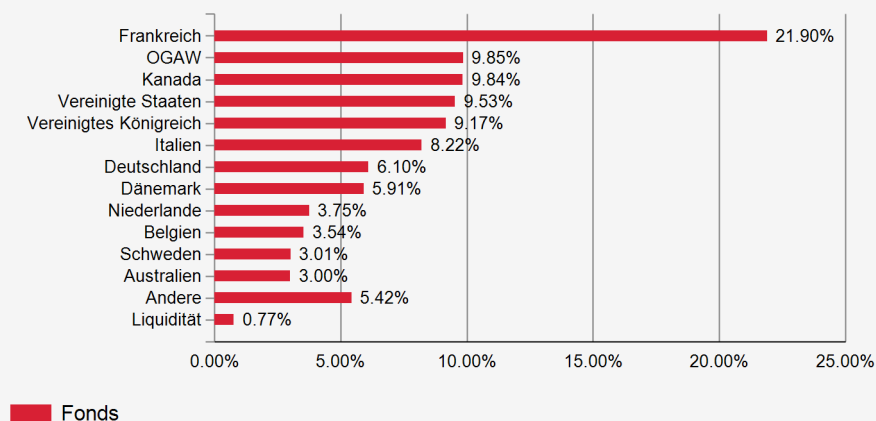
## Aufteilung nach Sektoren



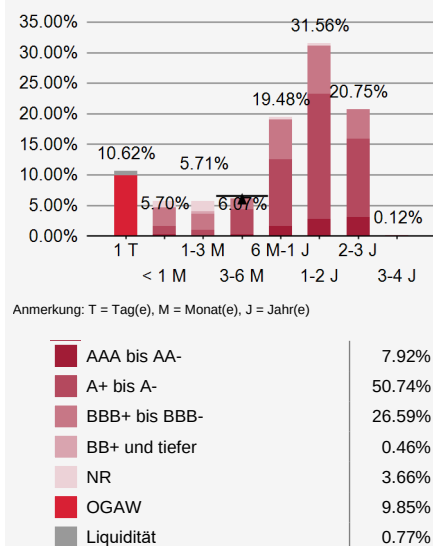
## Portfoliostruktur



## Geografische Aufteilung



## Aufteilung nach Rating/Laufzeit



## Grösste Positionen

| Nr.                           | Emittent                                | Länder             | Sektoren                | %      |
|-------------------------------|-----------------------------------------|--------------------|-------------------------|--------|
| 1                             | MORGAN STANLEY MS FLOAT 04/05/28        | Vereinigte Staaten | Finanzwesen             | 1.92%  |
| 2                             | CREDIT MUT ARKEA CFCMAR EUCP 0 12/01/25 | Frankreich         | Finanzwesen             | 1.16%  |
| 3                             | BOTS BOTS 0 06/12/26                    | Italien            | Staatlich und staatsnah | 1.12%  |
| 4                             | NATL BANK CANADA NACN FLOAT 03/06/26    | Kanada             | Finanzwesen             | 1.02%  |
| 5                             | NOVO NORDISK FIN NOVOB 2 3/8 05/27/28   | Dänemark           | Basiskonsumgüter        | 1.02%  |
| 6                             | TORONTO DOM BANK TD FLOAT 09/10/27      | Kanada             | Finanzwesen             | 0.93%  |
| 7                             | CAISSE FED OCEAN CCOCEA MTN 0 03/27/26  | Frankreich         | Finanzwesen             | 0.93%  |
| 8                             | JYSKE BANK A/S JYBCDC EUCP 0 07/07/25   | Dänemark           | Finanzwesen             | 0.93%  |
| 9                             | LAGARDERE SCA LAGARD EUCP 0 07/31/25    | Frankreich         | Kommunikation           | 0.93%  |
| 10                            | BOTS BOTS 0 03/13/26                    | Italien            | Staatlich und staatsnah | 0.91%  |
| Total der grössten Positionen |                                         |                    |                         | 10.88% |
| Anzahl Positionen             |                                         |                    |                         | 232    |

## Aufteilung nach kurzfristigem Rating

