



Swiss Life Funds (F) Bond ESG 6M P2 Cap

NAV des Fonds: 2'157.01 Mio. EUR | NAV je Anteil: 103.70 EUR



SFDR Offenlegung: Artikel 8

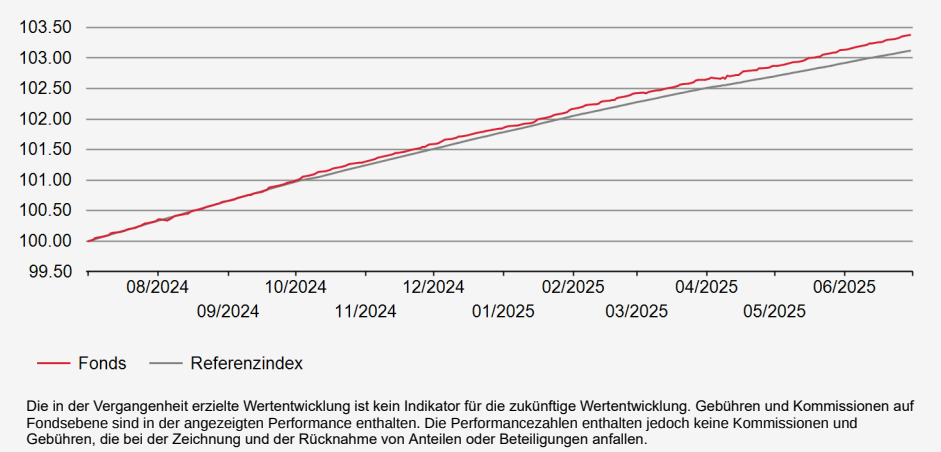
Management Kommentar

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

Datenhistorie unzureichend

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%	-	3.40%	-	-	3.70%	-	-	3.41%
Ref. Index	1.32%	-	3.15%	-	-	3.47%	-	-	3.20%

Fondseigenschaften

Auflagedatum: 30/05/2024
ISIN: FR001400OWY4
Bloomberg-Code: SWLFBP2 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: 0.21%
Performancegebühren: Keine
Laufende Kosten per 31/12/2024: 0.31%
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

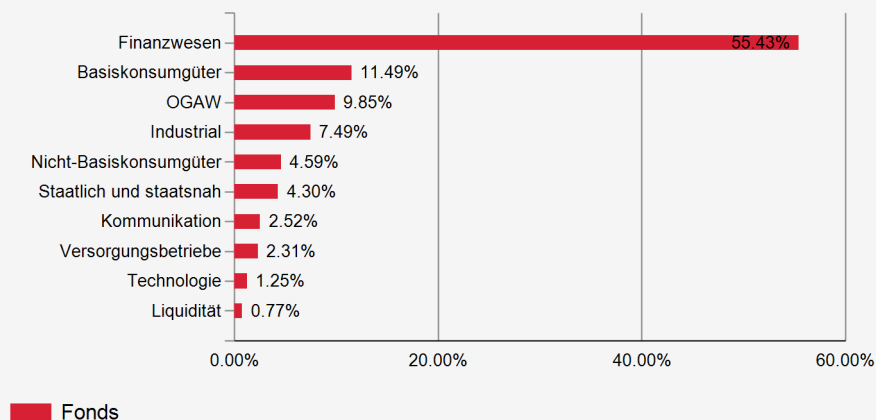
WARF (gewichteter
durchschn. Ratingfaktor)
[A-/A]

Wöchentlich annualisiert	1 Jahr	3 Jahre	Aufl.
Volatilität Portfolio	0.12%	-	0.13%
Volatilität Ref. Index	0.08%	-	0.09%
Tracking Error	0.10	-	0.10
Information Ratio	2.50	-	2.09
Sharpe Ratio	3.45	-	2.58

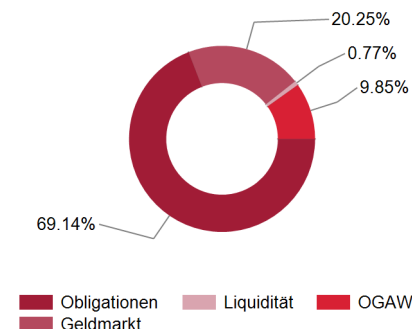
Hinweis: Eine Investition in einen Geldmarktfonds unterscheidet sich von einer Investition in Einlagen: Sie ist nicht garantiert und das investierte Kapital kann schwanken. Der Geldmarktfonds ist nicht auf externe Unterstützung angewiesen, um seine Liquidität zu gewährleisten oder seinen Nettoinventarwert pro Anteil zu stabilisieren. Das Risiko eines Kapitalverlusts wird daher vom Anleger getragen. Die in Artikel 17 Absatz 7 der Europäischen Verordnung 2017/1131 vorgesehene Ausnahme sowie die Regeln für die Bewertung und Bilanzierung der gehaltenen Vermögenswerte sind im Prospekt dargelegt. Die zur Berechnung des synthetischen Risikoindikatoren (SRI) zugrunde gelegten historischen Daten sind kein zuverlässiger Hinweis auf das künftige Risikoprofil des Fonds. Die diesem Fonds zugeordnete Risikokategorie ist nicht garantiert und kann Schwankungen unterworfen sein. Die niedrigste Kategorie bedeutet nicht, dass es sich um eine „risikofreie Anlage“ handelt (von 1 = geringes Risiko, potenziell niedrigere Wertentwicklung bis 7 = hohes Risiko, potenziell höhere Wertentwicklung). **Ref. Index-Chronik:** EONIA Capitalized 7 Day bis 31/10/2020 **Quelle:** Swiss Life Asset Managers / ©2025 Morningstar. Alle Rechte vorbehalten.

Swiss Life Funds (F) Bond ESG 6M P2 Cap

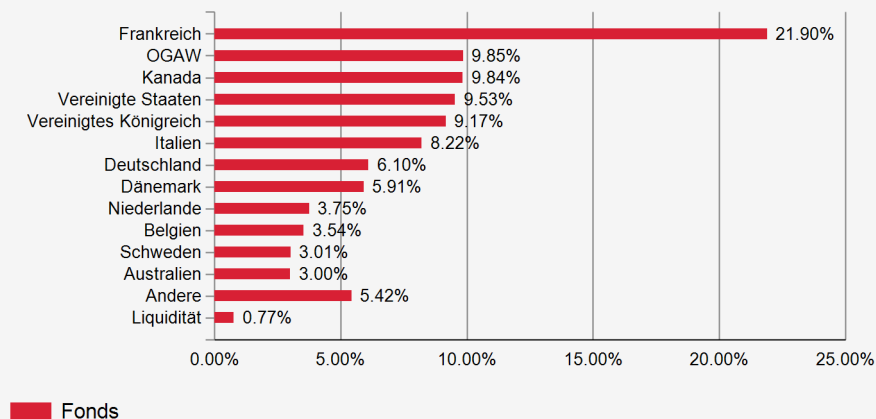
Aufteilung nach Sektoren



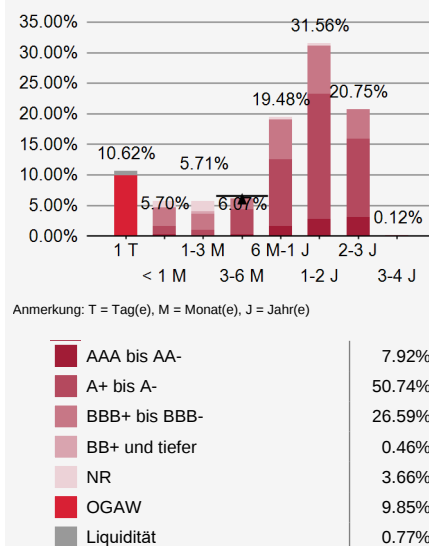
Portfoliostruktur



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

