



Swiss Life Funds (F) ESG Money Market Euro I3

Standard-Geldmarkt-SICAV mit variablem Nettoinventarwert

NAV des Fonds: 8'445.93 Mio. EUR | NAV je Anteil: 10'026.70 EUR

SFDR Offenlegung: Artikel 8

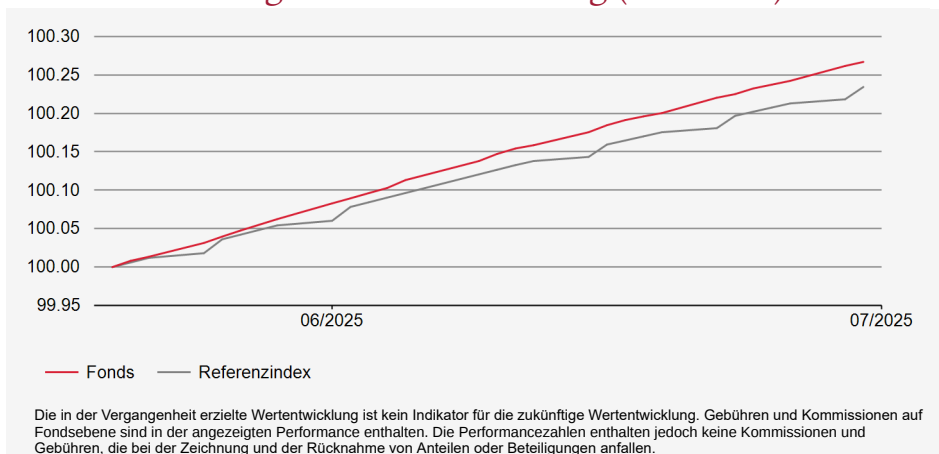
Management Kommentar

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

Die SICAV ist eine Geldmarkt-SICAV in Euro, mit dem Ziel, eine höhere Rendite als jene des kapitalisierten Ester zu erzielen. Die SICAV investiert in fest- oder variabel verzinsliche Emissionen. Ihre Auswahl basiert auf einer Analyse des Kreditrisikos, der Liquidität und der Diversifikation des Portfolios. Die gewichtete durchschnittliche Restlaufzeit (WAM) der Titel liegt bei unter 6 Monaten.

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	-	0.20%	-	-	-	0.27%	-	-	-
Ref. Index	-	0.18%	-	-	-	0.23%	-	-	-

Fondseigenschaften

Auflagedatum: 20/05/2025

ISIN: FR001400ZAY6

Bloomberg-Code: SWLMMI3 FP

Klassifizierung: Renten und andere verzinsliche Wertpapiere in EUR

Fondswährung: EUR

Fondsdomizil: Frankreich

Ref. Index: ESTR Capitalized

Mindestanlage: 200 000 EUR

Zeichnungsgebühren (max.): 2.00%

Rücknahmekommission (max.): 0.00%

Verwaltungsgebühren: 0.14%

Performancegebühren: Keine

Zeichnung / Rückzahlung: Orderschluss 12:00 Abwicklung T+0

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

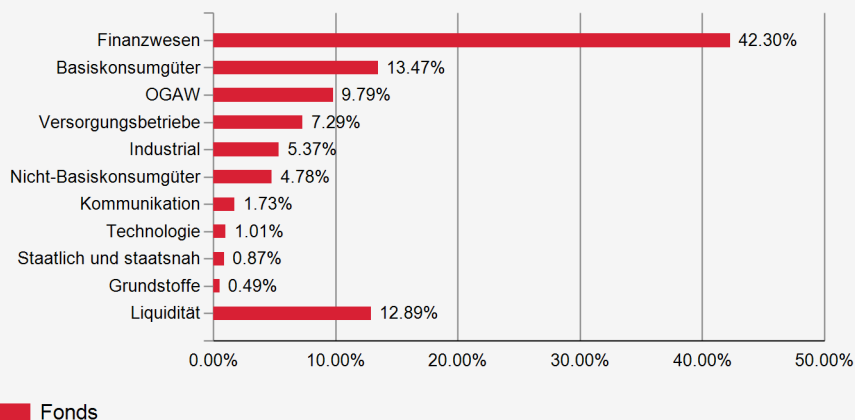
WAL (gewichtete
durchschn. Laufzeit)
165.28

WAM (gewichtete
durchschn. Fälligkeit)
33.34

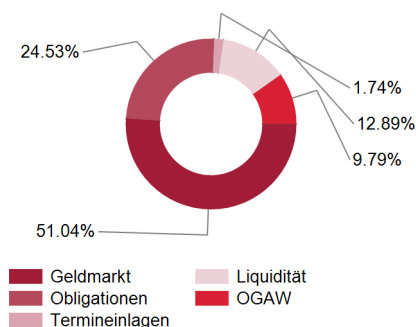
WARF (gewichteter
durchschn. Ratingfaktor)
[A-/A]

Wöchentlich annualisiert	1 Jahr	3 Jahre	Aufl.
Volatilität Portfolio	-	-	0.10%
Volatilität Ref. Index	-	-	0.08%
Tracking Error	-	-	0.02
Information Ratio	-	-	14.42
Sharpe Ratio	-	-	0.58

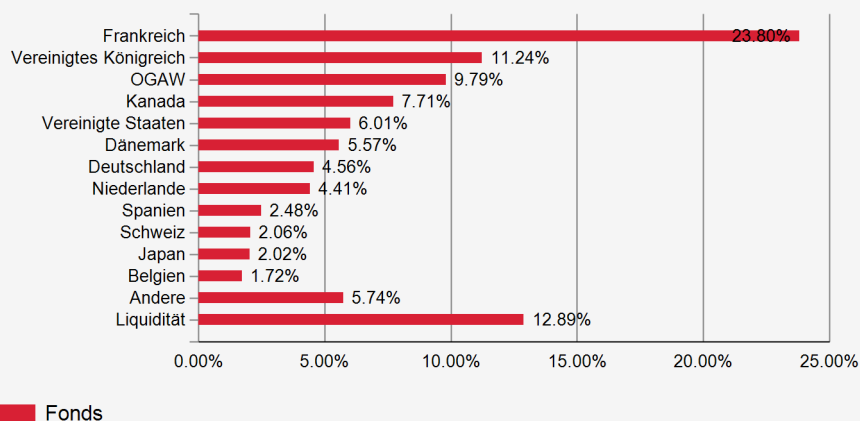
Aufteilung nach Sektoren



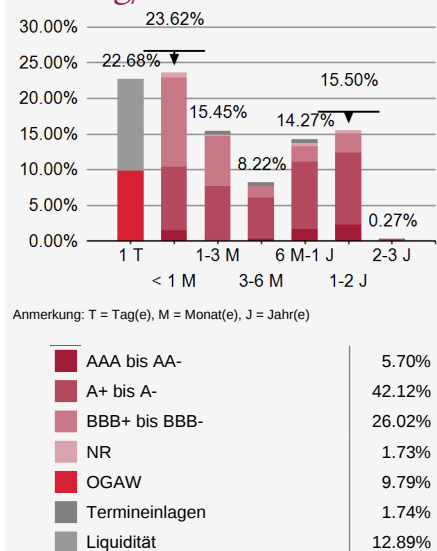
Portfoliostruktur



Geografische Aufteilung



Aufteilung nach Rating/Laufzeit



Grösste Positionen

Nr.	Emittent	Länder	Sektoren	%
1	COCA-COLA EURO CCEPRT ECP 0 07/02/25	Vereinigtes Königreich	Basiskonsumgüter	1.42%
2	COCA-COLA EURO CCEPRT ECP 0 07/23/25	Vereinigtes Königreich	Basiskonsumgüter	1.42%
3	SMBC BRUSSELS SMCBE ECP 0 07/31/25	Japan	Finanzwesen	1.18%
4	NOVO NORDISK FIN NOVOB FLOAT 05/27/27	Dänemark	Basiskonsumgüter	1.08%
5	JYSKE BANK A/S JYBCDC EUCP 0 07/07/25	Dänemark	Finanzwesen	1.07%
6	BRED BANQ POPLRE BREDBQ EUCP 0 07/04/25	Frankreich	Finanzwesen	1.01%
7	BANK OF AMER CRP BAC FLOAT 03/10/27	Vereinigte Staaten	Finanzwesen	0.95%
8	IBERDROLA INT BV IBERDU ECP 0 07/04/25	Spanien	Versorgungsbetriebe	0.89%
9	JYSKE BANK A/S JYBCDC EUCP 0 07/11/25	Dänemark	Finanzwesen	0.89%
10	NATL BANK CANADA NACN FLOAT 03/06/26	Kanada	Finanzwesen	0.87%
Total der grössten Positionen				10.77%
Anzahl Positionen				219

Aufteilung nach kurzfristigem Rating

