



# Swiss Life Index Funds (LUX) Income (EUR) R Cap

NAV des Fonds: 156.18 Mio. EUR | NAV je Anteil: 166.12 EUR

SFDR Offenlegung: Artikel 6

## Management Kommentar

Die US-Aktienmärkte erholten sich im Juni weiter auf neue Allzeithochs, gefolgt von Japan und den Schwellenländern, bedingt durch neue Handelsabkommen zwischen den USA und anderen Ländern und die Entspannung im Nahen Osten. Die europäischen Aktienmärkte hingegen hinkten hinterher. Bei den Anleihen entspannten sich auch die US-Zinsen mit sinkenden längerfristigen Zinsen, während sie in Europa leicht anstiegen. Der USD wertete weiter ab. Wegen des Fokus auf europäische Anlagen rentierte der Fonds im Juni insgesamt negativ.

## Anlagestrategie

Um ein langfristiges Kapitalwachstum zu erreichen, investiert der Teilfonds in europäische und internationale Staatsanleihen- und Aktienmärkte. Zu diesem Zweck werden ETFs innerhalb des Teilfonds aktiv verwaltet. Diese Strategie kombiniert die Vorteile von passiven und aktiven Managementstrategien in einem Dachfondskonzept. Mindestens 51% des Teilfonds sind indirekt in Staatsanleihen investiert.

## Wertentwicklung in Referenzwährung (Basis 100)



## Performance in Referenzwährung

	Kumulierte Performance						Annualisierte Performance		
	YTD	1 Monat	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	Aufl.	3 Jahre	5 Jahre	Aufl.
Fonds	1.00%	-0.29%	4.11%	9.57%	3.08%	66.12%	3.09%	0.61%	3.04%
Ref. Index	1.86%	-0.27%	6.04%	16.97%	12.92%	112.79%	5.36%	2.46%	4.56%

## Fondseigenschaften

**Auflagedatum:** 31/07/2008  
**ISIN:** LU0362483272  
**Bloomberg-Code:** SLINCOB LX  
**Morningstar Kategorie:** Mischfonds EUR defensiv  
**Fondswährung:** EUR  
**Fondsdomizil:** Luxemburg  
**Ref. Index:** 70% BLOOMBERG EUR AGG TREAS TR Unhedged + 18% DJ Euro Stoxx50 Return (EUR) Index Level + 9% MSCI USA Net Total Return USD - IX + 3% MSCI United Kingdom Net (loc) Index Level  
**Mindestanlage:** Keine  
**Zeichnungsgebühren (max.):** 5.00%  
**Rücknahmekommission (max.):** 0.00%  
**Verwaltungsgebühren:** 1.30%  
**Performancegebühren:** Keine  
**Laufende Kosten per 30/08/2024:** 1.64%  
**Zeichnung / Rückzahlung:** Orderschluss 15:00 Abwicklung T+2  
**Ertragsverwendung:** Thesaurierung  
 Das Produkt beinhaltet ein Kapitalverlustrisiko.

### Risikoindikatoren

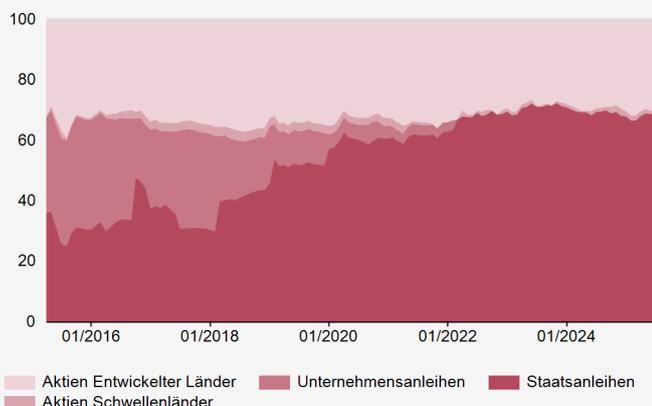
Geringes Risiko < 1 2 **3** 4 5 6 7 > Hohes Risiko  
 Potenziell niedrigere Wertentwicklung Potenziell höhere Wertentwicklung

	Wöchentlich annualisiert	1 Jahr	3 Jahre	Aufl.
Max. Drawdown	-18.61%			
Recovery	-			
Effektive Duration				
Fonds	7.24			
Ref. Index	7.18			
Volatilität Portfolio	5.75%	5.75%	6.49%	6.16%
Volatilität Ref. Index	5.82%	5.82%	6.83%	6.71%
Tracking Error	1.35	1.35	1.30	2.54
Information Ratio	-1.39	-1.39	-1.63	-0.60
Sharpe Ratio	0.21	0.21	0.05	0.40

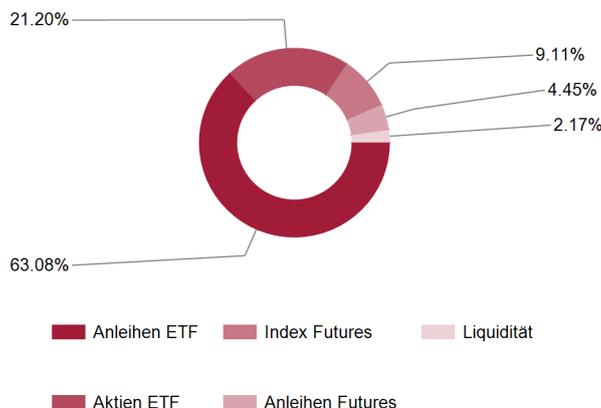
**Hinweis:** Die zur Berechnung des synthetischen Risikoindikators (SRI) zugrunde gelegten historischen Daten sind kein zuverlässiger Hinweis auf das künftige Risikoprofil des Fonds. Die diesem Fonds zugeordnete Risikokategorie ist nicht garantiert und kann Schwankungen unterworfen sein. Die niedrigste 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:** Customized benchmark bis 31/12/2021 **Quelle:** Swiss Life Asset Managers / ©2025, Morningstar. Alle Rechte vorbehalten.

# Swiss Life Index Funds (LUX) Income (EUR) R Cap

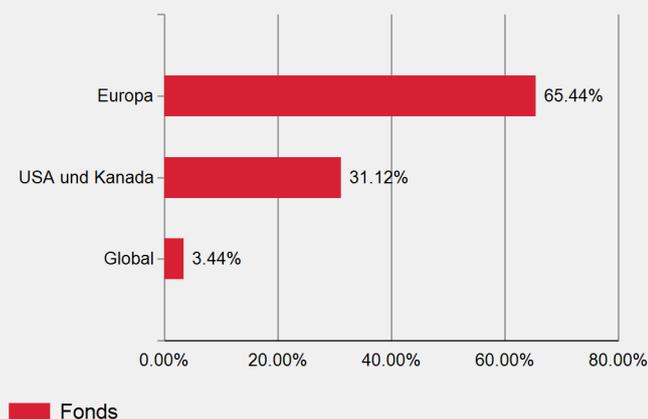
## Entwicklung der Asset Allocation



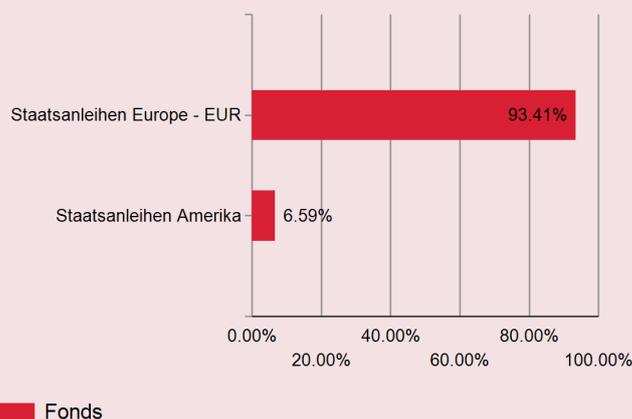
## Portfoliostruktur



## Geografische Aufteilung Aktien



## Aufteilung Obligationenportfolio



## Grösste Positionen Aktien

Nr.	Emittent	Länder	%
1	HSBC EURO STOXX 50 UCITS ETF		12.55%
2	INVESCO S&P 500 ACC		6.36%
3	EURO STOXX 50 SEP25	Deutschland	6.04%
4	S&P500 EMINI FUT SEP25	Vereinigte Staaten	2.05%
5	VANG FTSE100 GBP D		1.25%

## Grösste Positionen Anleihen

Nr.	Emittent	Länder	%
1	X EUROZONE GOVT BOND 1C		17.65%
2	AMUNDI EURO GOV TILT GRN BON		17.40%
3	X EURZ GOVT BOND 5-7 1C		12.21%
4	ISHARES EURO GOVT 3-5Y		7.48%
5	ISHARES EURO GOVT 15-30YR		4.94%