



Swiss Life Index Funds (LUX) Balance (EUR) R Cap

NAV des Fonds: 154.05 Mio. EUR | NAV je Anteil: 200.82 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.

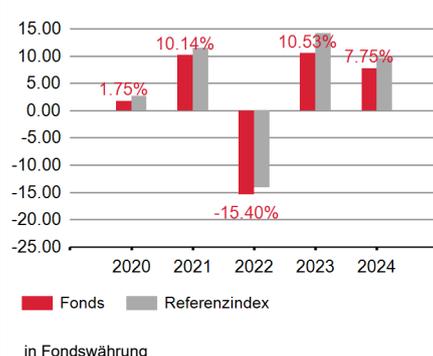
Anlagestrategie

Um ein hohes 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. Bis zu 70% des Teilfonds sind indirekt in Aktien investiert.

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	1.56%	-0.33%	5.00%	18.98%	19.65%	100.82%	5.96%	3.65%	4.21%
Ref. Index	2.72%	-0.30%	7.04%	27.94%	31.83%	156.95%	8.55%	5.68%	5.73%

Fondseigenschaften

Auflagedatum: 31/07/2008
ISIN: LU0362483603
Bloomberg-Code: SLBALER LX
Morningstar Kategorie: Mischfonds EUR ausgewogen - Global
Fondswährung: EUR
Fondsdomizil: Luxemburg
Ref. Index: 50% BLOOMBERG EUR AGG TREAS TR Unhedged + 30% DJ Euro Stoxx50 Return (EUR) Index Level + 15% MSCI USA Net Total Return USD - IX + 5% MSCI United Kingdom Net (loc) Index Level
Mindestanlage: Keine
Zeichnungsgebühren (max.): 5.00%
Rücknahmekommission (max.): 0.00%
Verwaltungsgebühren: 1.40%
Performancegebühren: Keine
Laufende Kosten per 30/08/2024: 1.74%
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

Max. Drawdown
-18.32%

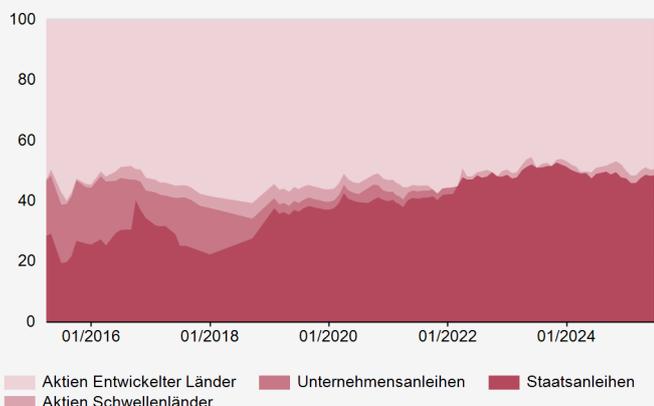
Recovery
734 Tage

Effektive Duration
Fonds 7.28 Ref. Index 7.18

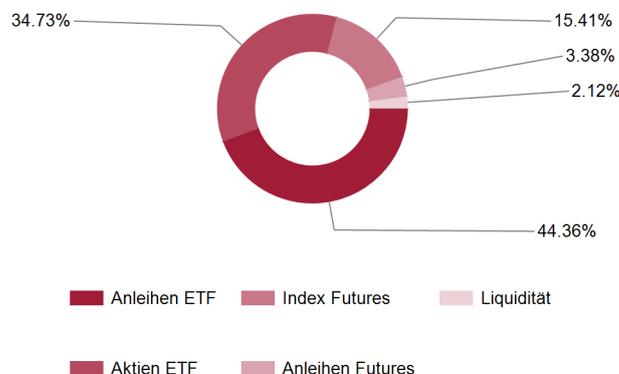
Wöchentlich annualisiert	1 Jahr	3 Jahre	Aufl.
Volatilität Portfolio	8.26%	7.93%	9.04%
Volatilität Ref. Index	8.44%	8.34%	9.86%
Tracking Error	1.79	1.47	2.55
Information Ratio	-1.12	-1.65	-0.60
Sharpe Ratio	0.25	0.37	0.39

Swiss Life Index Funds (LUX) Balance (EUR) R Cap

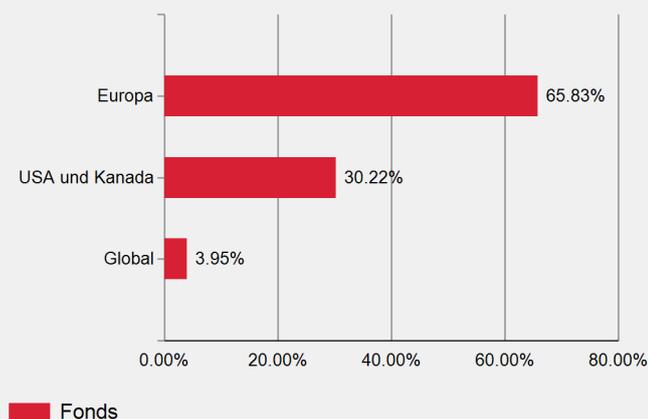
Entwicklung der Asset Allocation



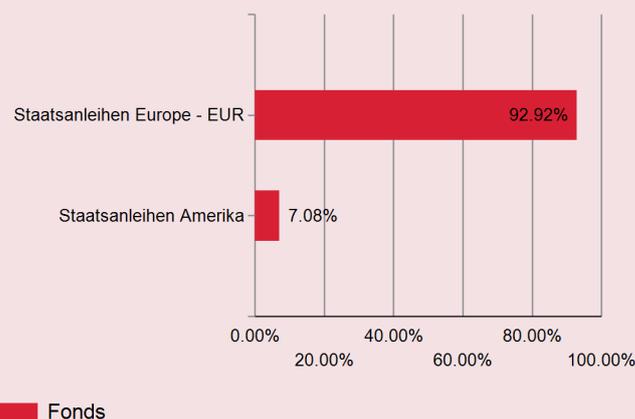
Portfoliostruktur



Geografische Aufteilung Aktien



Aufteilung Obligationenportfolio



Grösste Positionen Aktien

Nr.	Emittent	Länder	%
1	HSBC EURO STOXX 50 UCITS ETF		18.62%
2	EURO STOXX 50 SEP25	Deutschland	12.34%
3	INVESCO S&P 500 ACC		12.08%
4	VANG FTSE100 GBPD		2.04%
5	ISHARES MSCI EM		1.98%

Grösste Positionen Anleihen

Nr.	Emittent	Länder	%
1	AMUNDI EURO GOV TILT GRN BON		13.56%
2	X EUROZONE GOVT BOND 1C		13.07%
3	X EURZ GOVT BOND 5-7 1C		8.69%
4	ISHARES EURO GOVT 3-5Y		5.37%
5	ISHARES EURO GOVT 15-30YR		3.67%