



Swiss Life Funds (LUX) Multi Asset Moderate EUR R Cap

NAV des Fonds: 1'369.38 Mio. EUR | NAV je Anteil: 159.00 EUR



SFDR Offenlegung: Artikel 8

Management Kommentar

Der Fonds rentierte im Juni positiv, lag jedoch unter seinem Referenzindex. Unser Aktienübergewicht wirkte sich in einem für risikobehaftete Anlagen günstigen Umfeld positiv aus. Ein Teil dieses erhöhten Exposure wurde jedoch über defensive Strategien umgesetzt, die deutlich unterperformten. Schliesslich wirkte sich unsere Long-Durationsposition positiv auf die Performance in den USA und im Vereinigten Königreich aus, wirkte sich aber in Europa negativ aus, wo die deutschen Zinsen anstiegen.

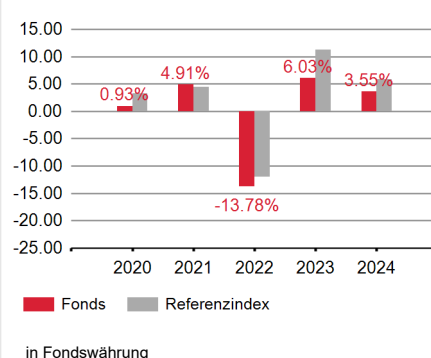
Anlagestrategie

Der Teilfonds wendet in allen Regionen eine Multi-Asset-Strategie mit defensivem Risikoprofil an. Die Allokation zwischen den Anlageklassen (Zinsprodukten, Aktien, ...) und Regionen wird monatlich anhand quantitativer Modelle neu definiert.

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	2.10%	0.93%	3.30%	8.33%	5.16%	59.00%	2.70%	1.01%	2.77%
Ref. Index	3.64%	1.15%	6.64%	21.78%	16.17%	86.24%	6.78%	3.04%	3.73%

Risikoindikatoren

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

Max. Drawdown

-16.44%

Recovery

-

Effektive Duration

Fonds Ref. Index
4.91 4.48

Wöchentlich annualisiert

	1 Jahr	3 Jahre	Aufl.
Volatilität Portfolio	5.47%	6.22%	5.67%
Volatilität Ref. Index	5.22%	6.01%	5.88%
Tracking Error	2.70	2.69	3.77
Information Ratio	-1.22	-1.38	-0.25
Sharpe Ratio	0.04	0.01	0.38

Fondseigenschaften

Auflagedatum: 08/07/2008

ISIN: LU0367327417

Bloomberg-Code: SLPFDRCLX

Morningstar Kategorie: Mischfonds EUR defensiv - Global

Fondswährung: EUR

Fondsdomizil: Luxemburg

Ref. Index: 70% BLOOMBERG GLO AGG IND HEDGED EUR + 20% MSCI World 100% Hedged to EUR Net Total Return Ind + 10% MSCI Euro TR Net Index (EUR)

Mindestanlage: 1 Anteil

Zeichnungsgebühren (max.): 5.00%

Rücknahmekommission (max.): 0.00%

Verwaltungsgebühren: 1.20%

Performancegebühren: Keine

Laufende Kosten per 30/08/2024: 1.79%

Zeichnung / Rückzahlung: Orderschluss 15:00 Abwicklung T+2

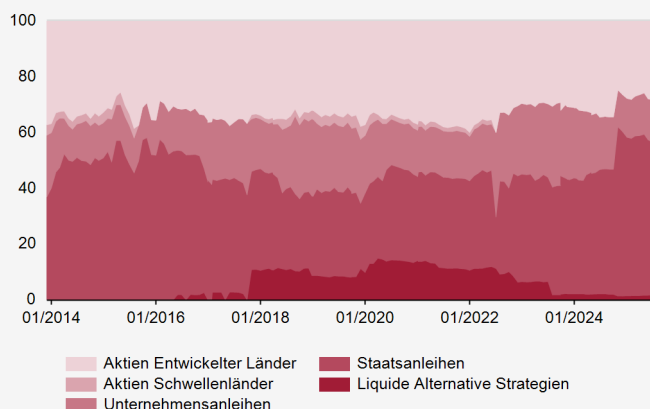
Ertragsverwendung: Thesaurierung

Das Produkt beinhaltet ein Kapitalverlustrisiko.

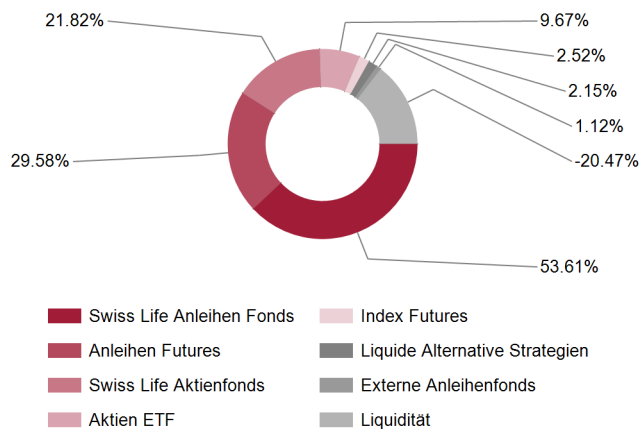
Swiss Life Funds (LUX) Multi Asset Moderate EUR

R Cap

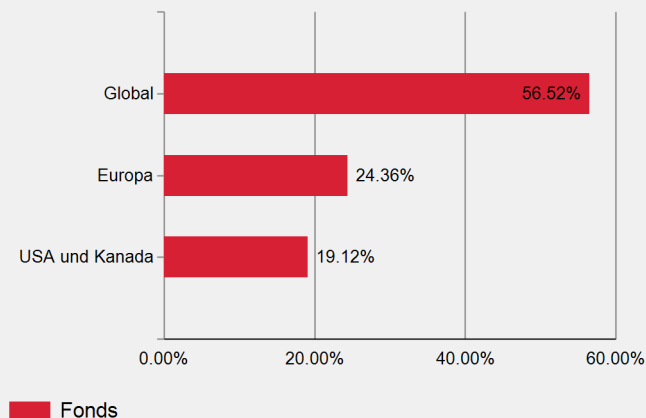
Entwicklung der Asset Allocation



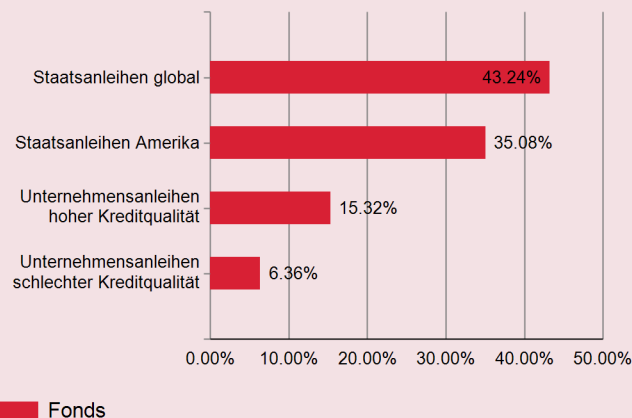
Portfoliostruktur



Geografische Aufteilung Aktien



Aufteilung Obligationenportfolio



Grösste Positionen Aktien

Nr.	Emittent	Länder	%
1	SWISS LI EQ ESG EUR ZONE-SEUR		5.40%
2	AMUNDI MSCI EMU ESG SELECT		4.69%
3	S LIFE LX-EQUITY USA-SUA		4.62%
4	S L LX-EQ ESG GL-S EURCAP		4.37%
5	EURO STOXX 50 SEP25	Deutschland	2.52%

Grösste Positionen Anleihen

Nr.	Emittent	Länder	%
1	SWISS LF BN ESG GBL AGG-SCAP		18.28%
2	SWISS LF BN ESG GBL SVR-SCAP		18.17%
3	S L LX-BND ESG GBL CRP-S EUR		11.70%
4	US 2YR NOTE (CBT) SEP25	Vereinigte Staaten	10.00%
5	US 5YR NOTE (CBT) SEP25	Vereinigte Staaten	6.83%