



Swiss Life Funds (LUX) Equity ESG Euro Zone EUR F Cap

Nav des Fonds: 397.02 Mio. EUR | Nav je anteil: 137.47 EUR

Morningstar® ★★★★★



SFDR Offenlegung: Artikel 8

Management Kommentar

Die Sektoren Finanzwesen, IT und Gesundheitswesen leisteten diesen Monat einen negativen Performancebeitrag, anders als die Kommunikation, die sich positiv auswirkte. Die Allokation war positiv, wurde aber durch die schlechte Auswahl wieder wettgemacht. Bei den Risikoprämien ist die Underperformance allein auf «Low Risk» zurückzuführen. Value, Sentiment und Quality waren zwar positiv, konnten aber die Underperformance nicht ausgleichen.

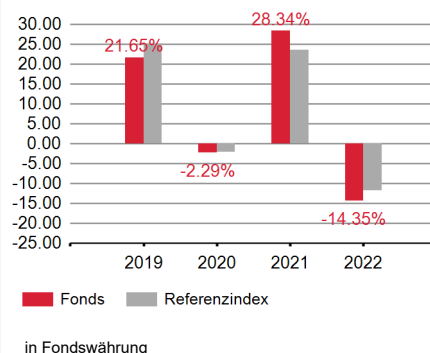
Anlagestrategie

Der Fonds verwendet einen systematischen, auf einer Risikofaktoranalyse basierenden Anlageprozess, um in Aktien grosser börsennotierter Unternehmen aus der Europäischen Währungsunion zu investieren. Umwelt-, Sozial- und Governance-Kriterien («ESG-Kriterien») werden im Anlageprozess und bei der Auswahl der Unternehmen systematisch berücksichtigt.

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	12.55%	7.58%	8.54%	25.90%	37.47%	37.47%	7.98%	6.57%	6.57%
Ref. Index	17.35%	7.99%	12.66%	29.98%	47.53%	47.53%	9.13%	8.08%	8.08%

Risikoindikatoren

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

Max. Drawdown

-36.61%

Recovery

356 Tage

Beta

0.96

Alpha

-0.07

Wöchentlich annualisiert

	1 Jahr	3 Jahre	Aufl.
Volatilität Portfolio	14.59%	15.56%	19.74%
Volatilität Ref. Index	15.08%	16.32%	21.29%
Tracking Error	1.64	2.37	3.75
Information Ratio	-2.67	-0.72	-0.40
Sharpe Ratio	0.32	0.42	0.30

Fondseigenschaften

Auflagedatum: 30/11/2018

ISIN: LU1897149552

Bloomberg-Code: SWIEQFE LX

Morningstar Kategorie: Aktien Euroland flexibel

Fondswährung: EUR

Fondsdomizil: Luxemburg

Ref. Index: MSCI Euro TR Net Index (EUR)

Mindestanlage: 1 Anteil

Zeichnungsgebühren (max.): 5.00%

Rücknahmegebühren (max.): 0.00%

Verwaltungsgebühren: 0.85%

Performancegebühren: Keine

Laufende Kosten per 28/02/2023: 0.98%

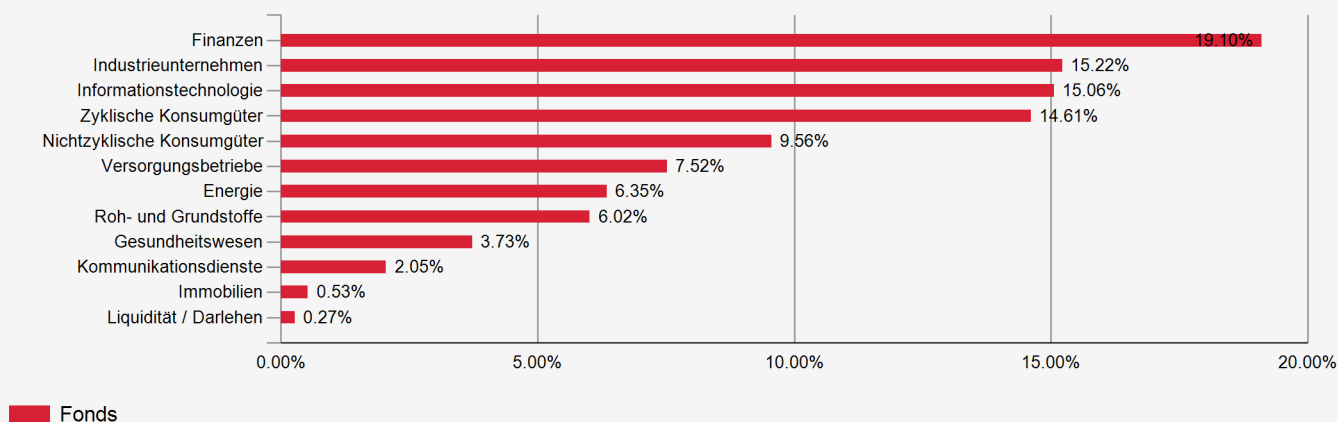
Zeichnung / Rückzahlung: Orderschluss 15:00 Abwicklung T+2

Ertragsverwendung: Thesaurierung

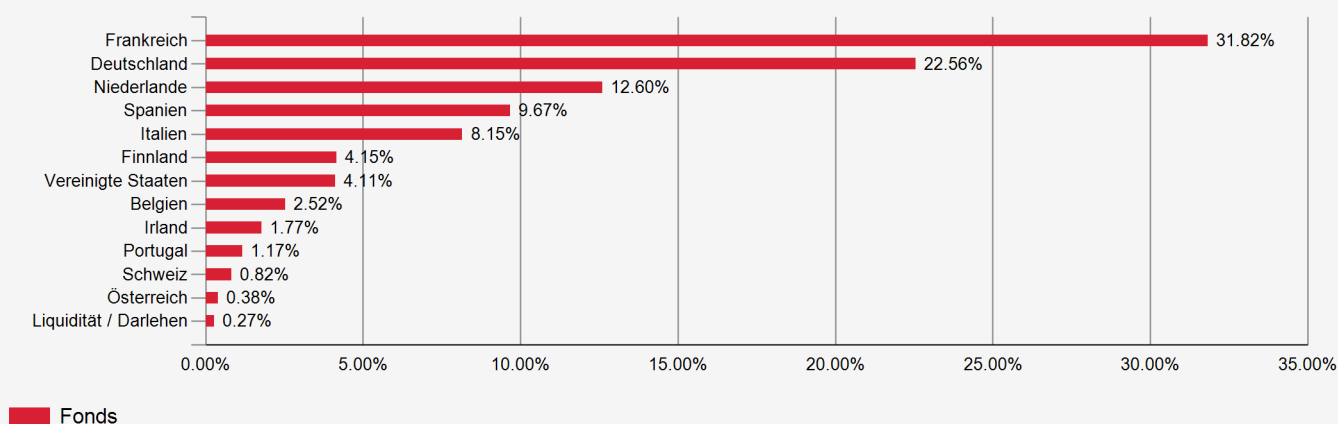
Das Produkt beinhaltet ein Kapitalverlustrisiko.

Swiss Life Funds (LUX) Equity ESG Euro Zone EUR F Cap

Aufteilung nach Sektoren



Geografische Aufteilung



Grösste Positionen

Nr.	Emittent	Länder	Sektoren	%
1	ASML HOLDING NV	Niederlande	Informationstechnologie	6.67%
2	SAP SE	Deutschland	Informationstechnologie	4.34%
3	LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI	Frankreich	Zyklische Konsumgüter	4.25%
4	TOTALENERGIES SE	Frankreich	Energie	3.88%
5	L'OREAL	Frankreich	Nichtzyklische Konsumgüter	3.09%
6	ALLIANZ SE-REG	Deutschland	Finanzen	2.78%
7	SIEMENS AG-REG	Deutschland	Industrieunternehmen	2.18%
8	HERMES INTERNATIONAL	Frankreich	Zyklische Konsumgüter	1.98%
9	SCHNEIDER ELECTRIC SE	Vereinigte Staaten	Industrieunternehmen	1.92%
10	MUENCHENER RUECKVER AG-REG	Deutschland	Finanzen	1.82%
Total der grössten Positionen				32.91%
Anzahl Positionen				109

Haftungsausschluss: Dieses Dokument wurde mit grösstmöglicher Sorgfalt und nach bestem Wissen und Gewissen erstellt. Die hierin enthaltenen Informationen dienen ausschliesslich zu Informationszwecken und sind nicht als Vertragsdokument, Anlageberatung, Anlageempfehlung oder Aufforderung zum Kauf oder Verkauf von Fondsanteilen zu verstehen. Vor einer Zeichnung sollten sich die Anleger die detaillierten Informationen über den betreffenden Fonds in den jeweiligen regulatorischen Unterlagen (Verkaufsprospekt, Fondsvertrag oder -satzung und Anlagereglement, neueste Jahres-/Zwischenberichte und wesentliche Anlegerinformationen (PRIIPs KID)), die als alleinige Rechtsgrundlage für den Kauf von Fondsanteilen gelten, beschaffen und sie sorgfältig lesen. Sie sind kostenlos in gedruckter oder elektronischer Form bei der Fondsverwaltungsgesellschaft oder dem Vertreter erhältlich: Schweiz: Swiss Life Asset Management AG, General-Guisan-Quai 40, 8002 Zürich / Zahlstelle: UBS Switzerland AG, Bahnhofstrasse 45, 8001 Zürich | Deutschland: Swiss Life Asset Managers Luxembourg, Niederlassung Deutschland, Hochstrasse 53, 60313 Frankfurt am Main, Deutschland | Frankreich: Swiss Life Asset Managers France, 153, rue Saint-Honoré, 75001 Paris | oder auf www.swisslife-am.com. Erträge und Wert von Fondsanteilen können sinken oder steigen, und ein Totalverlust des in den Anteilen angelegten Kapitals ist nicht auszuschliessen. Für die Prognose zukünftiger Wert- und Preisentwicklungen sind historische Wertentwicklungen keine ausreichende Basis. Die in der Vergangenheit erzielte Wertentwicklung ist kein Indikator für laufende oder zukünftige Wertentwicklungen. Sie stellt in keiner Weise eine Garantie für die zukünftige Wertentwicklung oder das Kapital dar. In der Wertentwicklung sind sämtliche auf Fondsebene entstehenden Kommissionen und Kosten berücksichtigt (z. B. Verwaltungsgebühr). Auf Kundenebene entstandene Kosten werden in der Wertentwicklung nicht berücksichtigt (Ausgabe- und Rücknahmekosten und -kommissionen, Depotgebühren usw.). Fonds von Swiss Life Asset Managers dürfen in den USA oder im Namen von US-Staatsbürgern oder US-Personen mit Wohnsitz in den USA nicht zum Verkauf angeboten oder verkauft werden. «Swiss Life Asset Managers» ist der Markenname für die Vermögensverwaltungsaktivitäten der Swiss Life-Gruppe. Mehr Informationen auf www.swisslife-am.com. **Quelle:** Swiss Life Asset Managers / ©2023, Morningstar. Alle Rechte vorbehalten. **Kontakt:** info@swisslife-am.com