Werbedokument
Monatsreport 28. Februar 2025

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

NAV des Fonds: 158.63 Mio. EUR | NAV je Anteil: 168.50 EUR

Morningstar© ★★

SFDR Offenlegung: Artikel 6

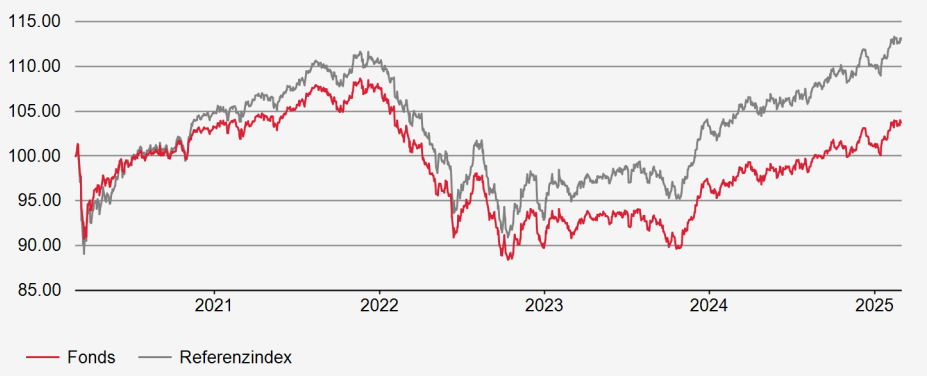
Management Kommentar

Nach einem starken Start ins 2025 kam es im Februar wegen der Unsicherheit über den politischen Kurs der US-Regierung zu erhöhter Volatilität an den Finanzmärkten. Die globalen Aktien litten unter den Bedenken über die US-Mega-Cap-Tech-Aktien. Europäische Aktien hingegen rendierten positiv, angetrieben von der Hoffnung auf einen Waffenstillstand in der Ukraine und höhere Verteidigungsausgaben. Die positive Dynamik chinesischer Techaktien beflügelte die Schwellenmärkte. Die globalen Anleihen erzielten positive Renditen, da sinkende US-Renditen andere Märkte beeinflussten. Insgesamt war die Performance des Fonds im Februar positiv.

Anlagestrategie

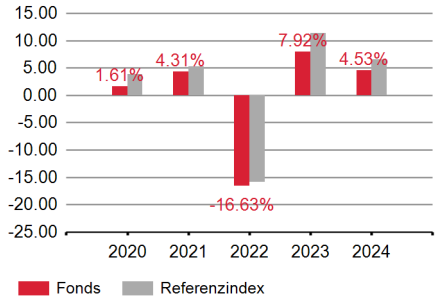
Um ein langfristiges Kapitalwachstum zu erreichen, investiert der Teilfonds in europäische und internationale Staatsanleihen- und Aktienmärkte. Zu diesem Zweck werden ETFs innerhalb des Teilfonds aktiv verwaltet. Diese Strategie kombiniert die Vorteile von passiven und aktiven Managementstrategien in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

Wertentwicklung in Referenzwährung (Basis 100)



Die in der Vergangenheit erzielte Wertentwicklung ist kein Indikator für die zukünftige Wertentwicklung. Gebühren und Kommissionen auf Fondsebene sind in der angezeigten Performance enthalten. Die Performancezahlen enthalten jedoch keine Kommissionen und Gebühren, die bei der Zeichnung und der Rücknahme von Anteilen oder Beteiligungen anfallen.

Performance



in Fondswährung

Performance in Referenzwährung

	Kumulierte Performance						Annualisierte Performance		
	YTD	1 Monat	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	Aufl.	3 Jahre	5 Jahre	Aufl.
Fonds	2.44%	0.90%	6.29%	0.92%	3.74%	68.50%	0.30%	0.74%	3.19%
Ref. Index	2.78%	1.07%	8.27%	7.04%	13.16%	114.71%	2.29%	2.50%	4.71%

Risikoindikatoren

Geringes Risiko < 1 2 **3** 4 5 6 7 > Hohes Risiko

Potenziell niedrigere Wertentwicklung — Potenziell höhere Wertentwicklung

Max. Drawdown
-18.61%

Recovery
-

Effektive Duration

Fonds	Ref. Index
7.61	7.19

Wöchentlich annualisiert	1 Jahr	3 Jahre	Aufl.
Volatilität Portfolio	4.66%	6.83%	6.14%
Volatilität Ref. Index	4.64%	7.29%	6.70%
Tracking Error	1.12	1.41	2.55
Information Ratio	-1.75	-1.33	-0.59
Sharpe Ratio	0.55	-0.29	0.43

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 Leve

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

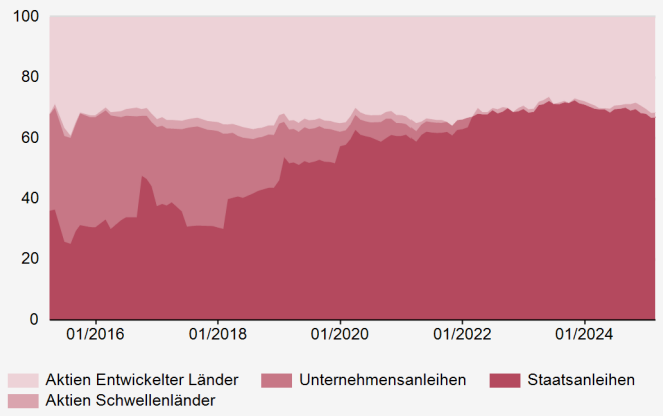
Das Produkt beinhaltet ein Kapitalverlustrisiko.

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.

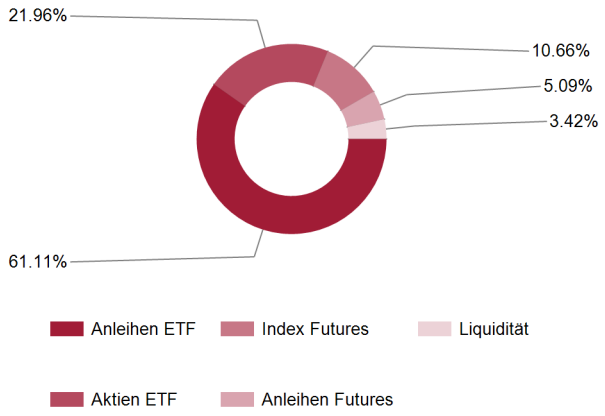
Monatsreport 28. Februar 2025

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

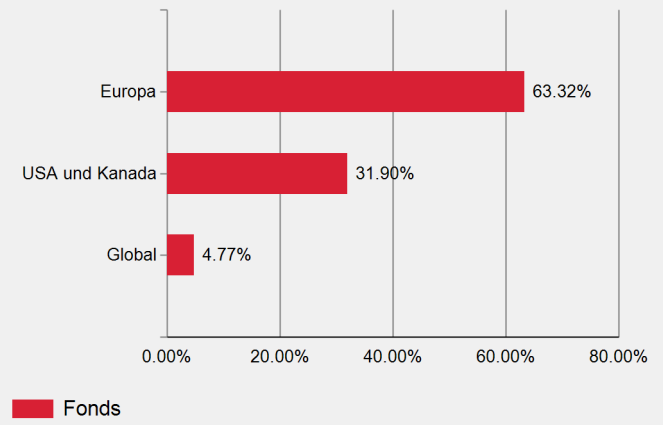
Entwicklung der Asset Allocation



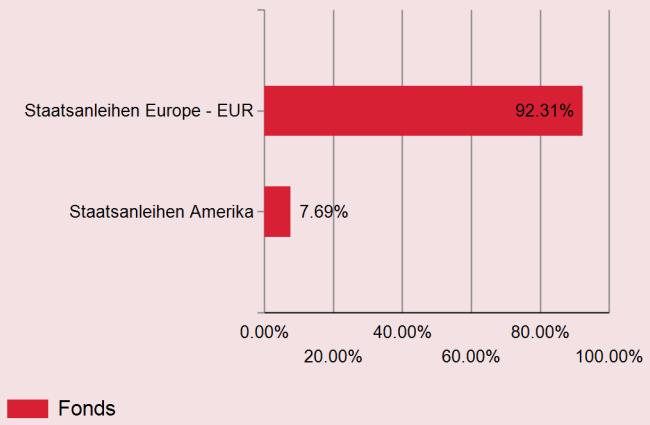
Portfoliostruktur



Geografische Aufteilung Aktien



Aufteilung Obligationenportfolio



Grösste Positionen Aktien

Nr.	Emittent	Länder	%
1	HSBC EURO STOXX 50 UCITS ETF		12.42%
2	EURO STOXX 50 MAR25	Deutschland	6.95%
3	INVESCO S&P 500 ACC		6.69%
4	S&P500 EMINI FUT MAR25	Vereinigte Staaten	2.17%
5	ISHARES MSCI EM		1.56%

Grösste Positionen Anleihen

Nr.	Emittent	Länder	%
1	X EUROZONE GOVT BOND 1C		17.33%
2	AMUNDI EURO GOV TILT GRN BON		16.04%
3	X EURZ GOVT BOND 5-7 1C		11.90%
4	ISHARES EURO GOVT 3-5Y		7.38%
5	ISHARES EURO GOVT 15-30YR		5.09%

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 / ©2025, Morningstar. Alle Rechte vorbehalten. **Kontakt:** info@swisslife-am.com