



SwissLife
Asset Managers

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

NAV des Fonds: 1'084.69 Mio. EUR | NAV je Anteil: 171.67 EUR

Morningstar® ★★★



SFDR Offenlegung: Artikel 8

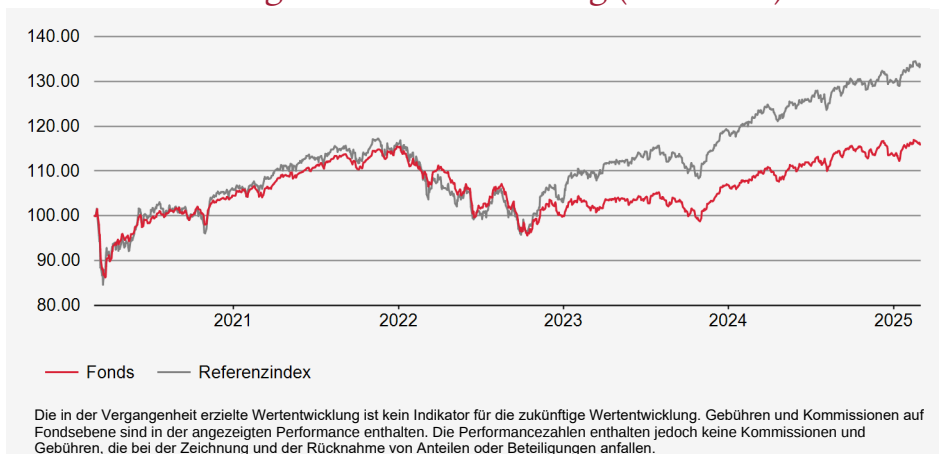
Management Kommentar

Der Fonds pausierte mit einer leicht negativen Performance im Februar und entwickelte sich unter seinem Referenzindex. Unsere Long-Position in der Duration hat sich angesichts der Ängste vor einem Konjunkturabschwung in den USA als günstig erwiesen. Unsere Aktienselektion wirkte sich hingegen negativ auf die Performance aus, wegen der relativen Underperformance der Basiswerte und unserer Präferenz für den US-Markt, der sich ebenfalls unterdurchschnittlich entwickelte.

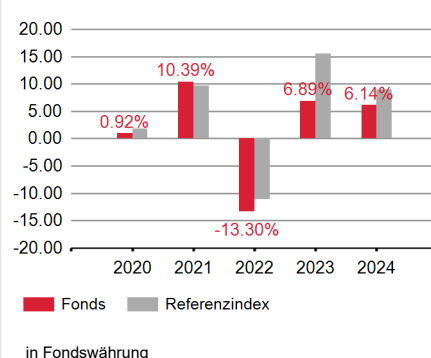
Anlagestrategie

Der Teilfonds wendet in allen Regionen eine Multi-Asset-Strategie mit ausgewogenem 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	2.12%	-0.14%	6.77%	5.51%	15.88%	71.67%	1.80%	2.99%	3.30%
Ref. Index	3.14%	0.68%	9.56%	22.13%	33.79%	82.87%	6.88%	5.99%	3.69%

Risikoindikatoren

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

Max. Drawdown

-17.19%

Recovery

715 Tage

Effektive Duration

Fonds 3.89 Ref. Index 3.22

Wöchentlich annualisiert

	1 Jahr	3 Jahre	Aufl.
Volatilität Portfolio	5.97%	7.67%	8.66%
Volatilität Ref. Index	6.25%	8.80%	10.63%
Tracking Error	3.06	5.31	5.26
Information Ratio	-0.83	-0.89	-0.07
Sharpe Ratio	0.49	-0.06	0.31

Fondseigenschaften

Auflagedatum: 08/07/2008

ISIN: LU0367332680

Bloomberg-Code: SLPFHC LX

Morningstar Kategorie: Mischfonds EUR ausgewogen - Global

Fondswährung: EUR

Fondsdomizil: Luxemburg

Ref. Index: 50% BLOOMBERG GLO AGG IND HEDGED EUR + 35% MSCI World 100% Hedged to EUR Net Total Return Ind + 15% MSCI Euro TR Net Index (EUR)

Mindestanlage: 1 Anteil

Zeichnungsgebühren (max.): 5.00%

Rücknahmekommission (max.): 0.00%

Verwaltungsgebühren: 1.45%

Performancegebühren: Keine

Laufende Kosten per 30/08/2024: 2.03%

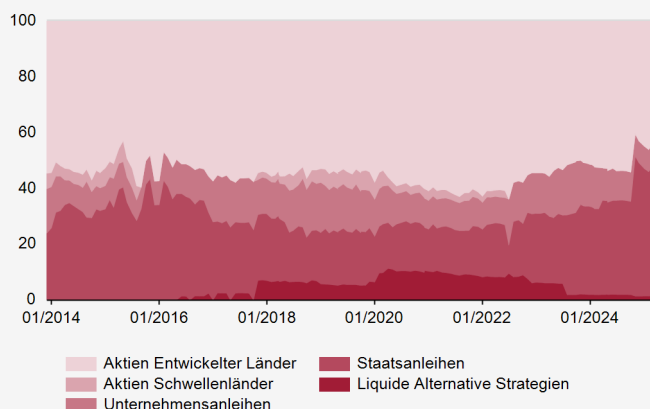
Zeichnung / Rückzahlung: Orderschluss 15:00 Abwicklung T+2

Ertragsverwendung: Thesaurierung

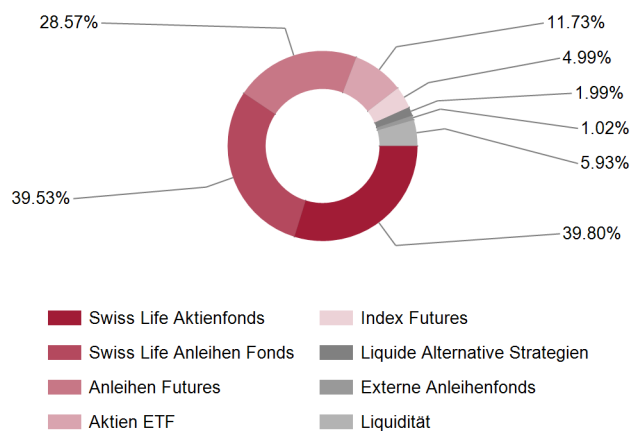
Das Produkt beinhaltet ein Kapitalverlustrisiko.

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

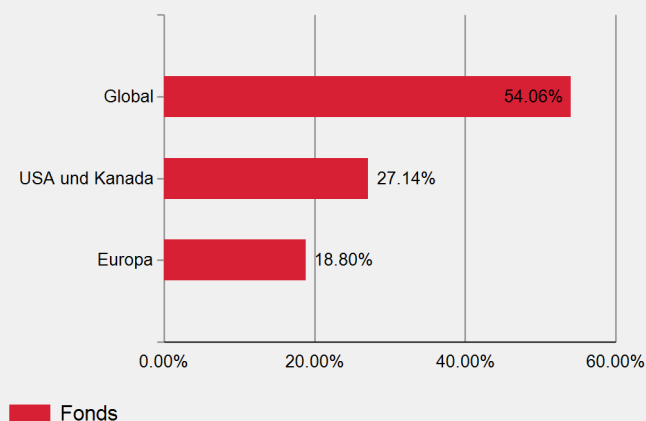
Entwicklung der Asset Allocation



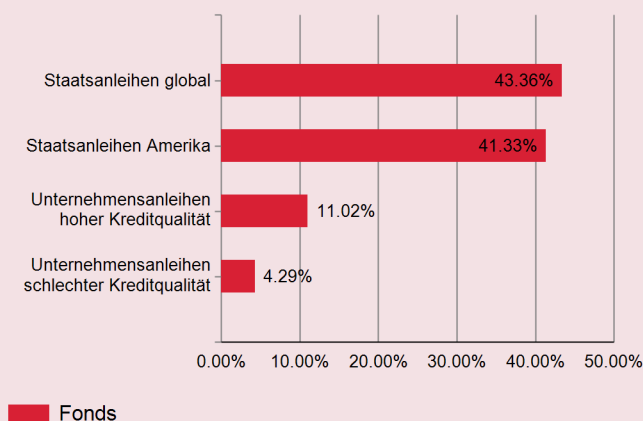
Portfoliostruktur



Geografische Aufteilung Aktien



Aufteilung Obligationenportfolio



Grösste Positionen Aktien

Nr.	Emittent	Länder	%
1	S LIFE LX-EQUITY ESG USA-S A		8.57%
2	SWIS LI EQ ESG EUR ZONE-SEUR		8.18%
3	S L LX-EQ ESG GL-S EURCAP		7.26%
4	AMUNDI MSCI USA ESG LEADERS		5.71%
5	SLF F EQ ESG USA LWCB-AM CAP		3.84%

Grösste Positionen Anleihen

Nr.	Emittent	Länder	%
1	SWISS LF BN ESG GBL SVR-SCAP		17.97%
2	SWISS LF BN ESG GBL AGG-SCAP		12.00%
3	US 2YR NOTE (CBT) JUN25	Vereinigte Staaten	10.41%
4	S L LX-BD ESG GB CP-S		6.02%
5	US 5YR NOTE (CBT) JUN25	Vereinigte Staaten	5.82%