



Swiss Life Funds (LUX) Equity ESG Global Minimum Volatility EUR R Dis

NAV des Fonds: 109.86 Mio. USD | NAV je Anteil: 146.52 EUR

Morningstar[®] ★★

SFDR Offenlegung: Artikel 8

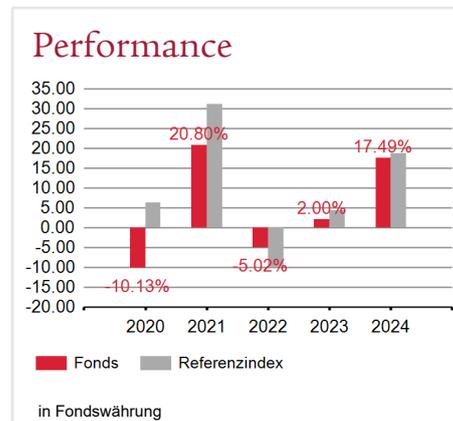
Management Kommentar

Im Februar fielen die Performances unterschiedlich aus: In Europa verzeichneten sie einen Anstieg und in den USA eine Baisse, v. a. bei Technologie- und Kommunikationswerten. Die Underperformance des Fonds ist hauptsächlich auf die Titelselektion zurückzuführen, v. a. im Technologie- oder im Kommunikationssektor, etwa mit Alphabet, T-Mobile oder Microsoft. Der Nachhaltigkeitsfokus des Fonds war während des Monats zudem negativ.

Anlagestrategie

Der Teilfonds investiert über eine quantitative MinVar-Strategie in Aktien primär von grossen und mittleren Unternehmen aus Industriestaaten. Dabei wird jeden Monat aus den Titeln des MSCI World das am wenigsten volatile Portfolio identifiziert. Das Portfolio wird mit einem internen Optimierungsmodell konstruiert.

Wertentwicklung in Referenzwährung (Basis 100)



Performance in Referenzwährung

	Kumulierte Performance						Annualisierte Performance		
	YTD	1 Monat	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	Aufl.	3 Jahre	5 Jahre	Aufl.
Fonds	4.39%	2.48%	17.34%	26.79%	35.23%	70.52%	8.23%	6.22%	6.70%
Ref. Index	6.97%	3.17%	21.35%	27.65%	78.82%	123.18%	8.47%	12.31%	10.25%

Fondseigenschaften

Auflagedatum: 09/12/2016
ISIN: LU1531540661
Bloomberg-Code: SLEGMRD LX
Fondswährung: EUR
Fondsdomizil: Luxemburg
Ref. Index: MSCI World Min. Vol. Opt. In EUR Net TR USD IX
Mindestanlage: 1 Anteil
Zeichnungsgebühren (max.): 5.00%
Rücknahmekommission (max.): 0.00%
Verwaltungsgebühren: 1.50%
Performancegebühren: Keine
Laufende Kosten per 30/08/2024: 1.70%
Zeichnung / Rückzahlung: Orderschluss 15:00 Abwicklung T+2
Ertragsverwendung: Ausschüttung
Swinging Single Pricing: Ja
 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

-26.40%

Recovery

487 Tage

Beta

0.92

Alpha

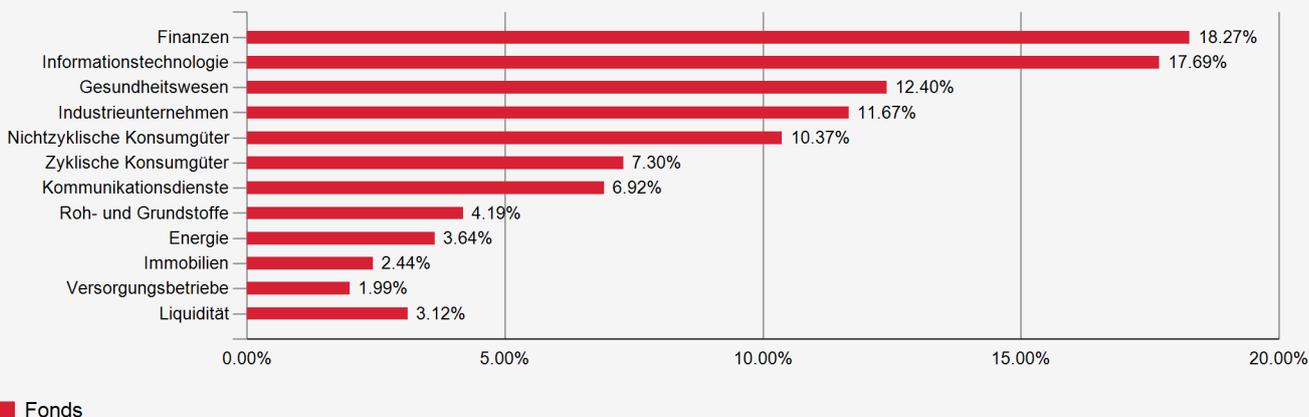
-0.04

Wöchentlich annualisiert

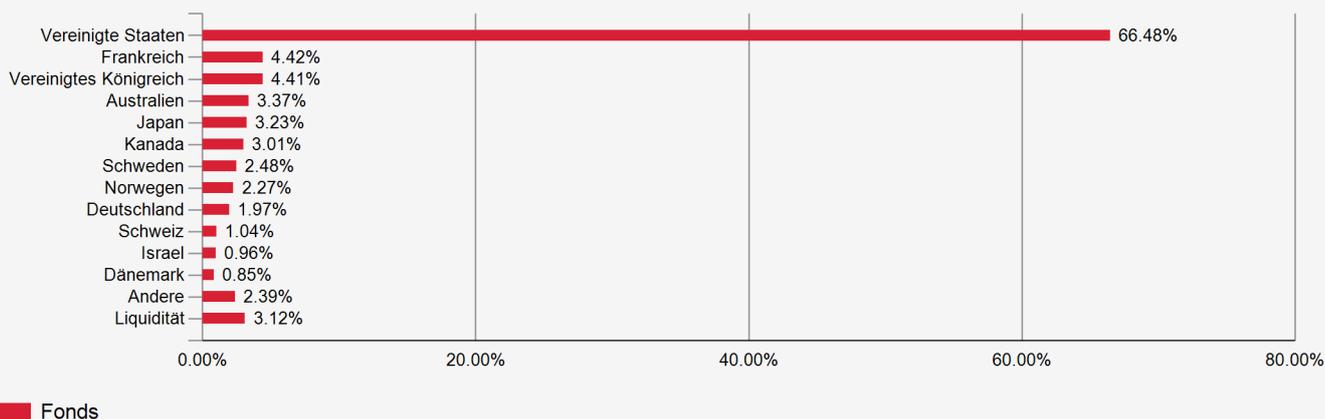
	1 Jahr	3 Jahre	Aufl.
Volatilität Portfolio	8.37%	10.82%	12.45%
Volatilität Ref. Index	8.82%	11.55%	14.26%
Tracking Error	2.24	4.21	6.80
Information Ratio	-1.77	-0.07	-0.52
Sharpe Ratio	1.50	0.50	0.47

Swiss Life Funds (LUX) Equity ESG Global Minimum Volatility EUR R Dis

Aufteilung nach Sektoren



Geografische Aufteilung



Grösste Positionen

Nr.	Emittent	Länder	Sektoren	%
1	NVIDIA CORP	Vereinigte Staaten	Informationstechnologie	3.74%
2	APPLE INC	Vereinigte Staaten	Informationstechnologie	3.45%
3	MICROSOFT CORP	Vereinigte Staaten	Informationstechnologie	3.10%
4	ALPHABET INC-CL C	Vereinigte Staaten	Kommunikationsdienste	1.51%
5	VISA INC-CLASS A SHARES	Vereinigte Staaten	Finanzen	1.37%
6	MASTERCARD INC - A	Vereinigte Staaten	Finanzen	1.16%
7	JOHNSON & JOHNSON	Vereinigte Staaten	Gesundheitswesen	1.10%
8	ABBVIE INC	Vereinigte Staaten	Gesundheitswesen	1.09%
9	PROCTER & GAMBLE CO/THE	Vereinigte Staaten	Nichtzyklische Konsumgüter	1.04%
10	COCA-COLA CO/THE	Vereinigte Staaten	Nichtzyklische Konsumgüter	0.95%
Total der grössten Positionen				18.50%
Anzahl Positionen				189

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 Anlagerglement, neueste Jahres-/Zwischenberichte und wesentliche Anlegerinformationen (PRIIPs KIID)), 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