



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

NAV des Fonds: 149.79 Mio. EUR | NAV je Anteil: 161.31 EUR

Morningstar® ★★★

SFDR Offenlegung: Artikel 6

Management Kommentar

Im März setzten die Finanzmärkte ihren Aufwärtstrend dank robuster Konjunktur, sinkender Inflationsraten und unerschütterlichem Anlegervertrauen fort. Globale Aktien legten erneut positiv zu, da sich die europäischen Aktien besser entwickelten als die Märkte in den USA und in Asien. Die regionale Allokation im Aktienportfolio hatte einen leicht negativen Einfluss auf die relative Performance. Dank tieferer Zinsen erzielten auch Staatsanleihen positive Renditen. Insgesamt war die Fondsperformance im März positiv.

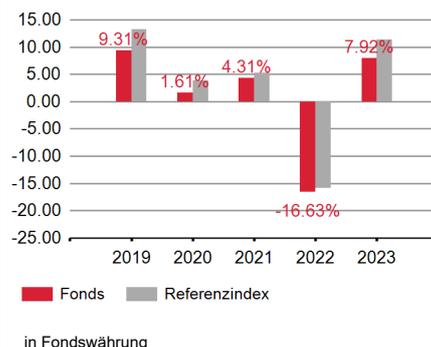
Anlagestrategie

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)



Performance



Performance in Referenzwährung

	Kumulierte Performance						Annualisierte Performance		
	YTD	1 Monat	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	Aufl.	3 Jahre	5 Jahre	Aufl.
Fonds	2.52%	1.75%	6.52%	-4.47%	1.95%	61.31%	-1.51%	0.39%	3.10%
Ref. Index	3.06%	1.95%	9.35%	0.21%	13.09%	102.18%	0.07%	2.49%	4.60%

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 Level
Mindestanlage: Keine
Zeichnungsgebühren (max.): 5.00%
Rücknahmegebühren (max.): 0.00%
Verwaltungsgebühren: 1.30%
Performancegebühren: Keine
Laufende Kosten per 29/12/2023: 1.66%
Zeichnung / Rückzahlung: Orderschluss 15:00 Abwicklung T+2
Ertragsverwendung: Thesaurierung
 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

-18.61%

Recovery

-

Effektive Duration

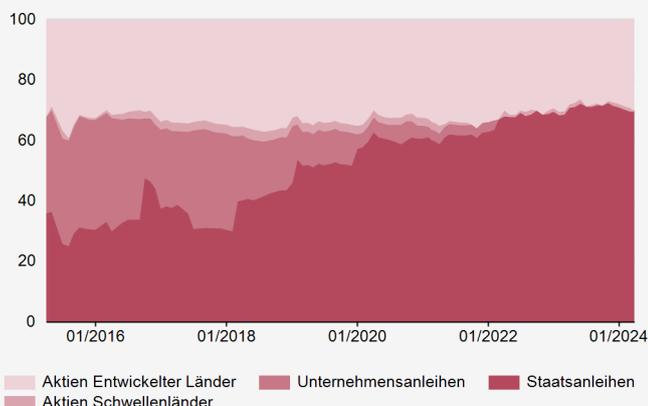
Fonds Ref. Index
7.37 7.24

Wöchentlich annualisiert

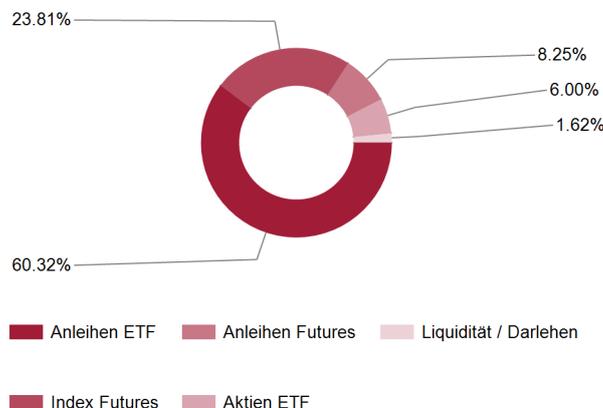
	1 Jahr	3 Jahre	Aufl.
Volatilität Portfolio	6.28%	6.77%	6.22%
Volatilität Ref. Index	6.11%	7.26%	6.80%
Tracking Error	0.82	1.36	2.61
Information Ratio	-3.45	-1.14	-0.57
Sharpe Ratio	0.44	-0.40	0.43

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

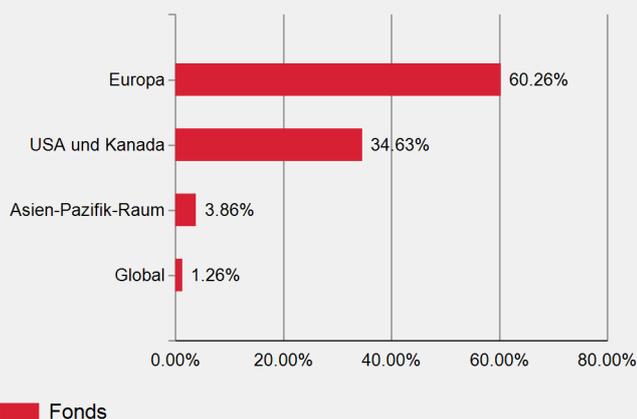
Entwicklung der Asset Allocation



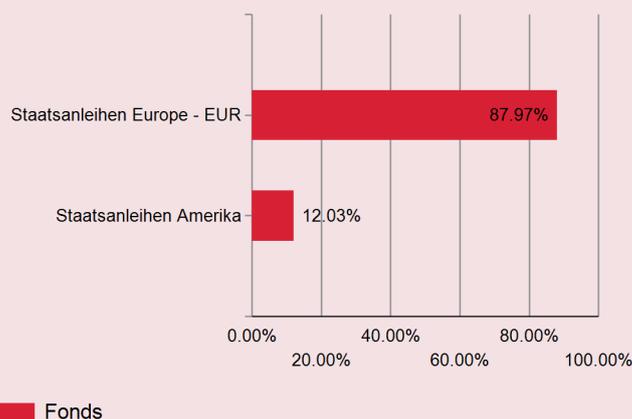
Portfoliostruktur



Geografische Aufteilung Aktien



Aufteilung Obligationenportfolio



Grösste Positionen Aktien

Nr.	Emittent	Länder	%
1	EURO STOXX 50 JUN24	Deutschland	17.04%
2	S&P500 EMINI FUT JUN24	Vereinigte Staaten	5.25%
3	VANG S&P500 USDD		4.70%
4	NIKKEI 225 (OSE) JUN24	Japan	1.15%
5	VANG FTSE100 GBP D		0.92%

Grösste Positionen Anleihen

Nr.	Emittent	Länder	%
1	AMUNDI EURO GOV TILT GRN BON		17.38%
2	X EUROZONE GOVT BOND 1C		14.00%
3	X EURZ GOVT BOND 5-7 1C		12.33%
4	ISHARES EURO GOVT 3-5Y		7.62%
5	US 10YR NOTE (CBT)JUN24	Vereinigte Staaten	6.29%