



# Swiss Life Index Funds (LUX) Balance (EUR) R Cap

NAV des Fonds: 145.62 Mio. EUR | NAV je Anteil: 188.46 EUR

Morningstar® ★★★

SFDR Offenlegung: Artikel 6

## Management Kommentar

Die Aktienmärkte entwickelten sich im Februar aufgrund robuster Wirtschaftsdaten und guter Gewinnaussicht erneut positiv. Die US-Märkte und Technologiewerte legten dank anhaltendem KI-Optimismus kräftig zu. Die robuste Wirtschaft und der anhaltende Inflationsdruck deuten auf vorerst unveränderte Leitzinsen hin. Die verringerte Wahrscheinlichkeit baldiger Zinssenkungen setzte den Anleihenmärkten zu. Die regionale Allokation hatte bei Aktien wie auch bei Anleihen einen leicht negativen Einfluss auf die relative Performance. Die Gesamtpurpose des Fonds war jedoch positiv.

## Anlagestrategie

Um ein hohes 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. Bis zu 70% des Teilfonds sind indirekt in Aktien investiert.

## 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	2.69%	1.65%	9.60%	6.06%	16.54%	88.46%	1.98%	3.11%	4.15%
Ref. Index	2.96%	1.80%	12.26%	12.37%	28.71%	134.90%	3.95%	5.17%	5.63%

## Fondseigenschaften

**Auflagedatum:** 31/07/2008  
**ISIN:** LU0362483603  
**Bloomberg-Code:** SLBALER LX  
**Morningstar Kategorie:** Mischfonds EUR ausgewogen - Global  
**Fondswährung:** EUR  
**Fondsdomizil:** Luxemburg  
**Ref. Index:** 50% BLOOMBERG EUR AGG TREAS TR Unhedged + 30% DJ Euro Stoxx50 Return (EUR) Index Level + 15% MSCI USA Net Total Return USD - IX + 5% MSCI United Kingdom Net (loc) Index Level  
**Mindestanlage:** Keine  
**Zeichnungsgebühren (max.):** 5.00%  
**Rücknahmegebühren (max.):** 0.00%  
**Verwaltungsgebühren:** 1.40%  
**Performancegebühren:** Keine  
**Laufende Kosten per 28/02/2023:** 1.72%  
**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

-19.49%

### Recovery

326 Tage

### Effektive Duration

Fonds	Ref. Index
7.28	7.16

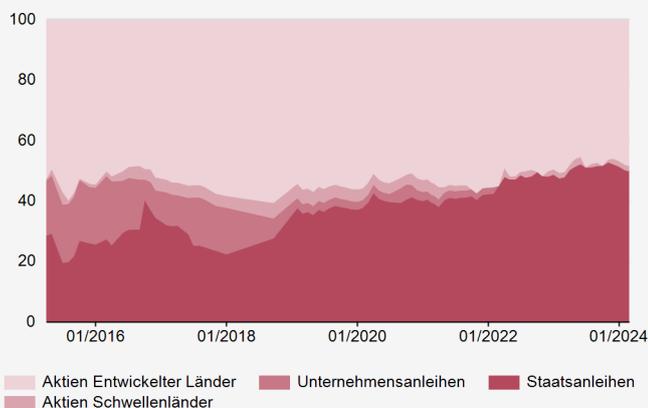
### Wöchentlich annualisiert

	1 Jahr	3 Jahre	Aufl.
Volatilität Portfolio	6.97%	8.06%	9.15%
Volatilität Ref. Index	6.98%	8.59%	10.02%
Tracking Error	0.82	1.39	2.61
Information Ratio	-3.54	-1.53	-0.57
Sharpe Ratio	0.81	0.04	0.41

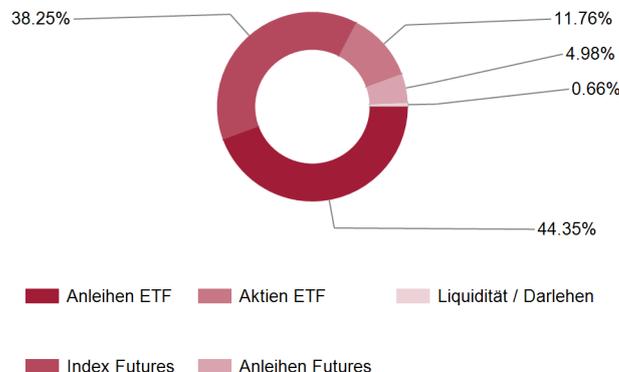
# Swiss Life Index Funds (LUX) Balance (EUR)

## R Cap

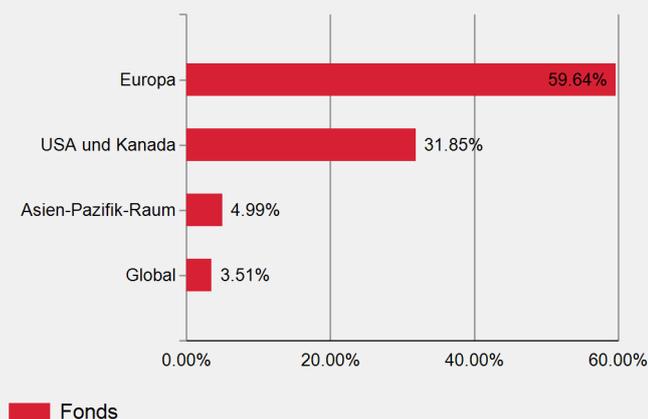
### Entwicklung der Asset Allocation



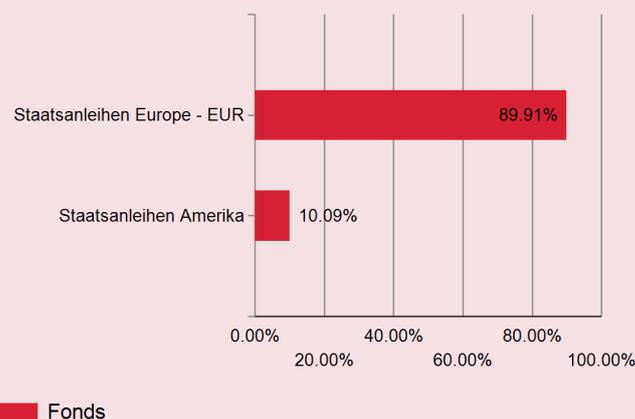
### Portfoliostruktur



### Geografische Aufteilung Aktien



### Aufteilung Obligationenportfolio



### Grösste Positionen Aktien

Nr.	Emittent	Länder	%
1	EURO STOXX 50 MAR24	Deutschland	28.06%
2	VANG S&P500 USDD		8.24%
3	S&P500 EMINI FUT MAR24	Vereinigte Staaten	6.96%
4	NIKKEI 225 (OSE) MAR24	Japan	2.50%
5	VANG FTSE100 GBPDD		1.76%

### Grösste Positionen Anleihen

Nr.	Emittent	Länder	%
1	AMUNDI EURO GOV TILT GRN BON		16.33%
2	X EUROZONE GOVT BOND 1C		9.64%
3	X EURZ GOVT BOND 5-7 1C		8.71%
4	ISHARES EURO GOVT 3-5Y		5.60%
5	ISHARES EURO GOVT 15-30YR		4.08%

**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 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](http://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](http://www.swisslife-am.com). **Quelle:** Swiss Life Asset Managers / ©2024, Morningstar. Alle Rechte vorbehalten. **Kontakt:** [info@swisslife-am.com](mailto:info@swisslife-am.com)