



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

SwissLife  
Asset Managers

Nav des Fonds: 135.84 Mio. EUR | Nav je Anteil: 146.33 EUR

Morningstar® \*\*

SFDR-Klassifizierung: Artikel 6

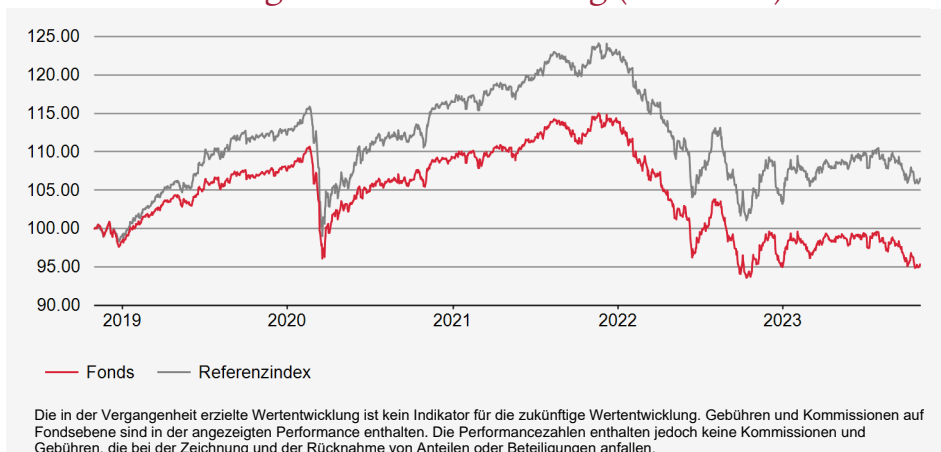
## Management Kommentar

Der Oktober brachte starke regionale Unterschiede bei den Anleihen- und den Aktienrenditen mit sich. Die US-Zinsen kletterten erstmals seit 2007 auf über 5%, EUR-Staatsanleihen performten leicht positiv. Daher wirkte sich die Zuführung von US-Anleihen negativ auf die Portfolioerträge aus. Aktien gingen aufgrund der Aussicht auf «für längere Zeit höhere» Zinsen und des Konflikts zwischen Israel und der Hamas, der den Risikoappetit dämpfte, weltweit zurück. Bei den Aktien entwickelten sich die USA besser als die anderen Regionen. Die Gesamtpformance war im Oktober negativ.

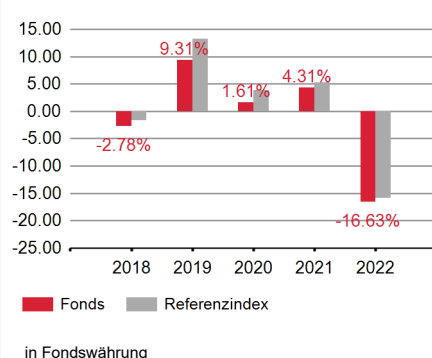
## Anlagestrategie

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	0.36%	-0.84%	-0.67%	-9.59%	-4.63%	46.33%	-3.30%	-0.94%	2.53%
Ref. Index	3.19%	-0.51%	1.72%	-3.85%	6.54%	81.85%	-1.30%	1.27%	4.00%

## 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 Index + 3% MSCI United Kingdom Net (loc) Index Leve  
**Mindestanlage:** Keine  
**Zeichnungsgebühren (max.):** 5.00%  
**Rücknahmegebühren (max.):** 0.00%  
**Verwaltungsgebühren:** 1.30%  
**Performancegebühren:** Keine  
**Laufende Kosten per 28/02/2023:** 1.62%  
**Zeichnung / Rückzahlung:** Orderschluss 15:00 Abwicklung T+2  
**Ertragsverwendung:** Thesaurierung  
 Das Produkt beinhaltet ein Kapitalverlustrisiko.

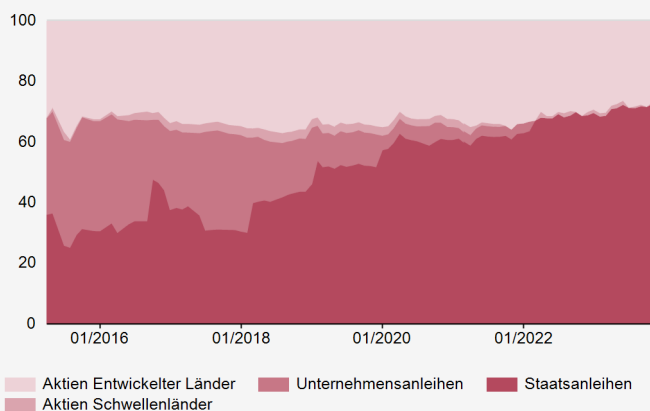
## Risikoindikatoren

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

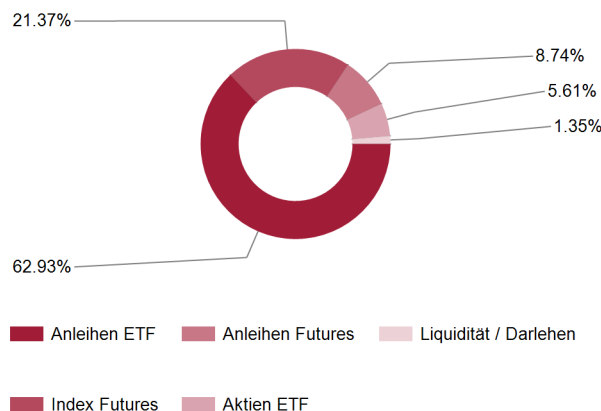
Max. Drawdown -18.61%	Wöchentlich annualisiert				
	1 Jahr	3 Jahre	Aufl.		
Recovery -	Volatilität Portfolio	6.63%	6.57%	6.20%	
Effektive Duration Fonds 7.06 Ref. Index 6.91	Volatilität Ref. Index	7.14%	7.20%	6.81%	
	Tracking Error	1.24	1.52	2.65	
	Information Ratio	-1.54	-1.18	-0.55	
	Sharpe Ratio	-0.61	-0.68	0.36	

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

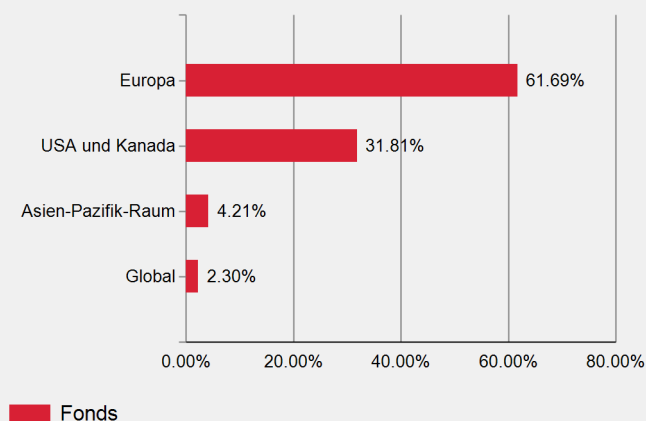
## Entwicklung der Asset Allocation



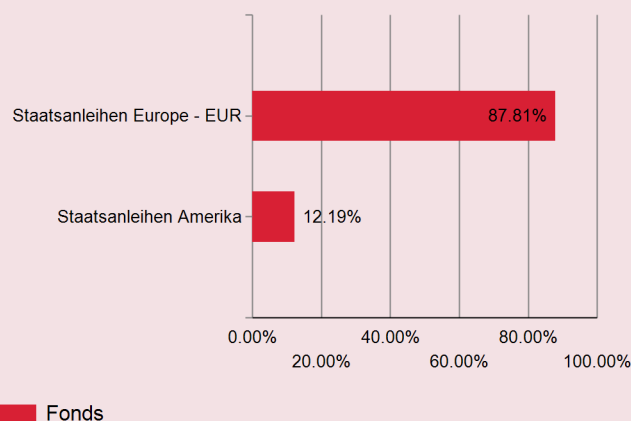
## Portfoliostruktur



## Geografische Aufteilung Aktien



## Aufteilung Obligationenportfolio



## Grösste Positionen Aktien

Nr.	Emittent	Länder	%
1	EURO STOXX 50 DEC23	Deutschland	15.43%
2	VANG S&P500 USDD		3.78%
3	S&P500 EMINI FUT DEC23	Vereinigte Staaten	3.67%
4	VANG FTSE100 GBPD		1.21%
5	S&P/TSX 60 IX FUT DEC23	Kanada	1.14%

## Grösste Positionen Anleihen

Nr.	Emittent	Länder	%
1	AMUNDI EURO GOV TILT GRN BON		18.06%
2	X EUROZONE GOVT BOND 1C		14.53%
3	X EURZ GOVT BOND 5-7 1C		13.02%
4	ISHARES EURO GOVT 3-5Y		9.64%
5	US 10YR NOTE (CBT)DEC23	Vereinigte Staaten	5.37%

**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 und 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 / ©2023, Morningstar. Alle Rechte vorbehalten. **Kontakt:** [info@swisslife-am.com](mailto:info@swisslife-am.com)