



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

NAV DES FONDS: 599.97 Mio. EUR | NAV JE ANTEIL: 158.66 EUR

Morningstar® ★★★



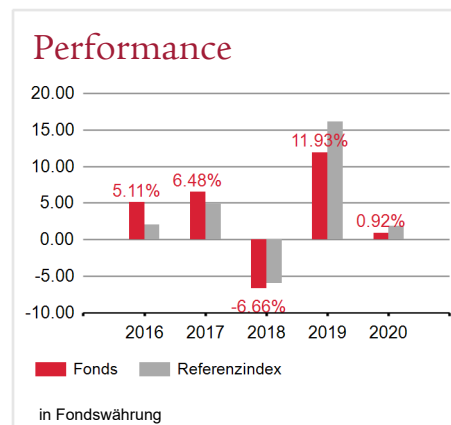
Management Kommentar

Unsere Multi-Asset-Fondspalette verzeichnete im März positive absolute Performances. Der Effekt der geografischen Allokation wirkte sich bei unseren Portfolios negativ aus, da die globalen Märkte hinter den europäischen Märkten zurückblieben. Bei unseren Fonds wirkte sich der Allokationseffekt positiv aus; unsere Aktienübergewichtung kam den Fonds zugute. Der Selektionseffekt leistete ebenfalls einen negativen Beitrag, wobei die defensiven Strategien unter ihrem Vergleichsindex lagen. Trotzdem erfüllten diese Strategien ihre Rolle und trugen während des Monats zur Verringerung der Volatilität des Portfolios bei.

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 in Referenzwährung

	KUMULIERTE PERFORMANCE						ANNUALISIERTE PERFORMANCE		
	YTD	1 MONAT	1 JAHR	3 JAHRE	5 JAHRE	AUFL.	3 JAHRE	5 JAHRE	AUFL.
FONDS	2.49%	2.71%	17.42%	11.72%	20.17%	58.66%	3.75%	3.74%	3.69%
REF. INDEX	3.49%	3.74%	18.97%	17.27%	25.84%	49.63%	5.44%	4.70%	3.21%

Fondseigenschaften

Auflegedatum: 08/07/2008
ISIN: LU0367332680
Bloomberg-Code: SLPFHC LX
Morningstar Kategorie: Mischfonds EUR ausgewogen - Global
Fondswährung: EUR
Fondsdomizil: Luxemburg
Ref. Index: 50% DJ Euro Stoxx50 Return (EUR) Index Level + 50% JPMorgan Government Bond Index Broad Hedged EUR TR
Mindestanlage: 1 Anteil
Zeichnungsgebühren (max.): 5.00%
Rücknahmegebühren (max.): 0.00%
Verwaltungsgebühren: 1.45%
Performancegebühren: Keine
Laufende Kosten per 31/12/2020: 1.73%
Zeichnung / Rückzahlung: Orderschluss 15:00 Abwicklung T+2
Ertragsverwendung: Thesaurierung
 Das Produkt beinhaltet ein Kapitalverlustrisiko.

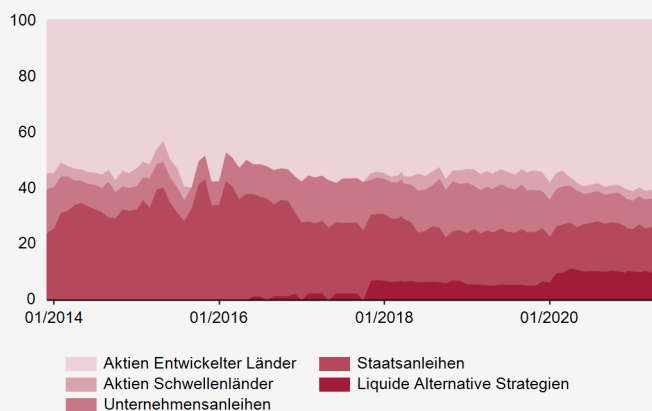
Risikoindikatoren

GERINGES RISIKO < 1 2 3 4 5 6 7 > HOHES RISIKO
 POTENZIELL NIEDRIGERE WERTENTWICKLUNG POTENZIELL HÖHERE WERTENTWICKLUNG

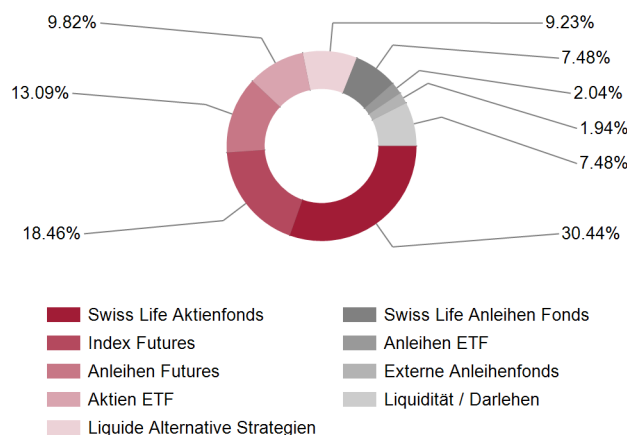
MAX. DRAWDOWN -18.64%	WÖCHENTLICH ANNUALISIERT	1 JAHR	3 JAHRE	AUFL.
RECOVERY 323 Tage	VOLATILITÄT PORTFOLIO	8.71%	9.82%	9.08%
Effektive Duration	VOLATILITÄT REF. INDEX	12.48%	11.63%	11.26%
Fonds 1.46 Ref. Index 4.13	TRACKING ERROR	5.46	4.65	5.32
	INFORMATION RATIO	-0.31	-0.42	0.09
	SHARPE RATIO	1.93	0.41	0.38

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

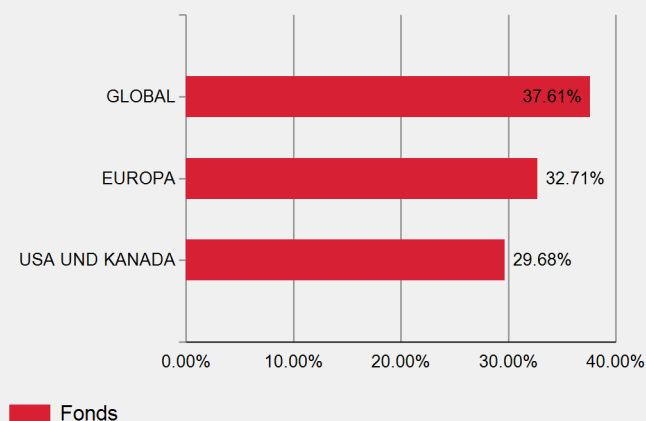
Entwicklung der Asset Allocation



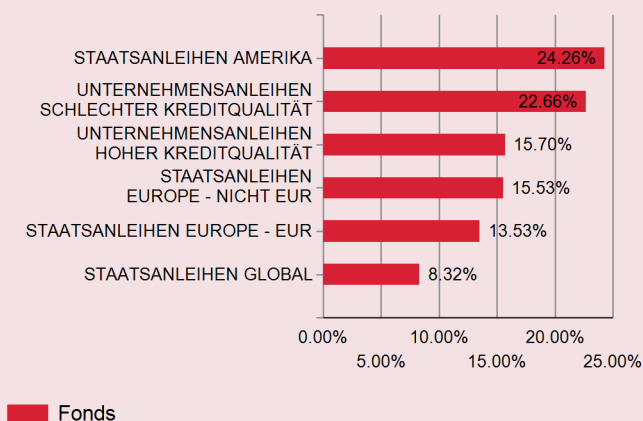
Portfoliostruktur



Geografische Aufteilung Aktien



Aufteilung Obligationenportfolio



Grösste Positionen Aktien

NR.	EMITTENT	LÄNDER	%
1	S&P500 EMINI FUT JUN21	Vereinigte Staaten	8.21%
2	SL LX EQUITY GLBL PRTCT EUSC		7.45%
3	EURO STOXX 50 JUN21	Deutschland	5.77%
4	SWISS LIFE LX-EQUITY USA-S A		5.21%
5	SWISS LIFE LX-EQ GL HD-E SA		4.71%

Grösste Positionen Anleihen

NR.	EMITTENT	LÄNDER	%
1	US 5YR NOTE (CBT) JUN21	Vereinigte Staaten	5.96%
2	LONG GILT FUTURE JUN21	Vereinigte Staaten	3.81%
3	EURO-BUND FUTURE JUN21	Deutschland	3.32%
4	SWISS LIFE LX-BD GL HY-SCE		2.90%
5	PARETO-NORDIC CORP BD-I EUR		1.94%

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 (Verkaufprospekt, Fondsvertrag oder -satzung und Anlagerglement, neueste Jahres-/Zwischenberichte und wesentliche Anlegerinformationen [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 / ©2021, Morningstar. Alle Rechte vorbehalten. **Kontakt:** info@swisslife-am.com