



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

Nav des Fonds: 128.07 Mio. EUR | Nav je Anteil: 169.62 EUR

Morningstar® ★★★

SFDR-Klassifizierung: Artikel 6

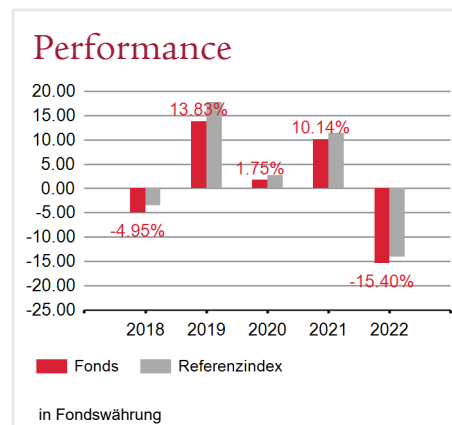
Management Kommentar

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 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	2.16%	-1.45%	1.30%	1.11%	6.75%	69.62%	0.37%	1.31%	3.52%
Ref. Index	5.08%	-1.12%	4.20%	9.06%	18.54%	110.07%	2.93%	3.46%	4.98%

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 Index + 5% MSCI United Kingdom Net (loc) Index Leve
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.

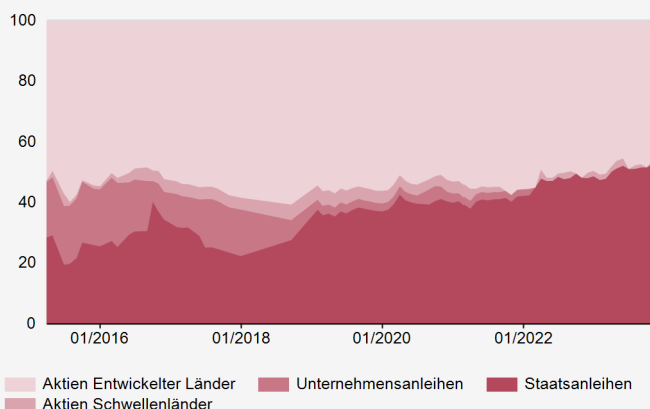
Risikoindikatoren

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

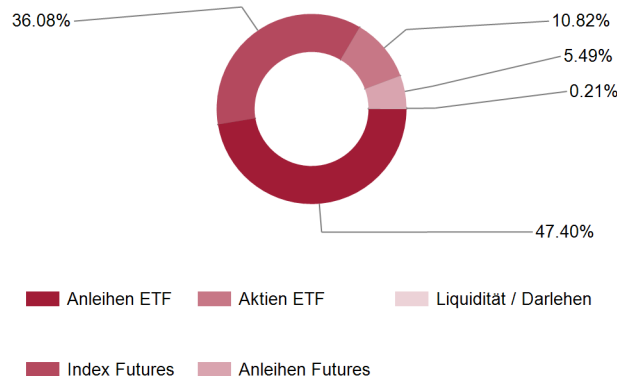
Max. Drawdown -19.49%	Wöchentlich annualisiert	1 Jahr	3 Jahre	Aufl.
Recovery 326 Tage	Volatilität Portfolio	7.58%	8.18%	9.18%
Effektive Duration	Volatilität Ref. Index	8.14%	8.96%	10.06%
Fonds Ref. Index	Tracking Error	1.20	1.68	2.64
7.04 6.91	Information Ratio	-1.91	-1.31	-0.54
	Sharpe Ratio	-0.27	-0.14	0.34

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

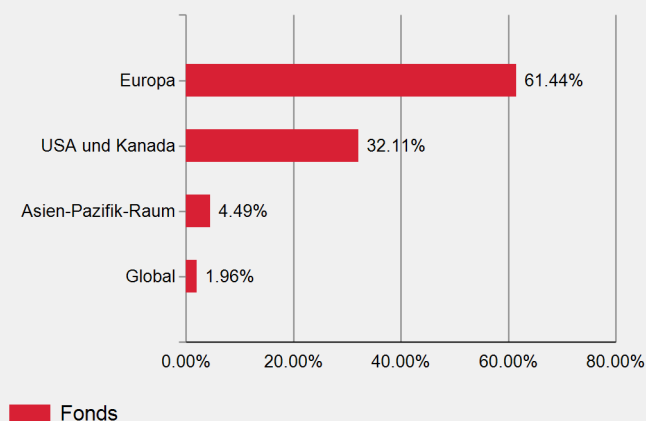
Entwicklung der Asset Allocation



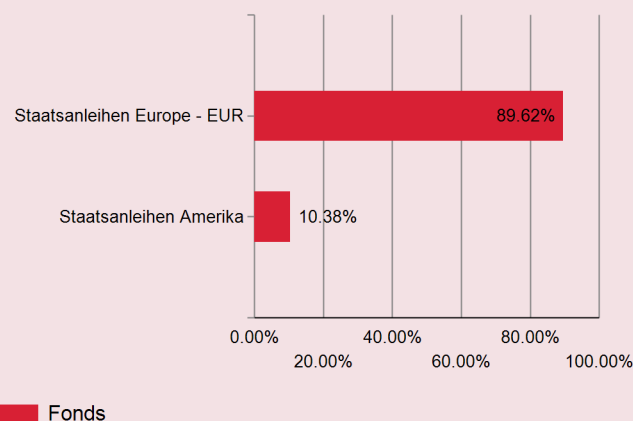
Portfoliostruktur



Geografische Aufteilung Aktien



Aufteilung Obligationenportfolio



Grösste Positionen Aktien

Nr.	Emittent	Länder	%
1	EURO STOXX 50 DEC23	Deutschland	26.79%
2	VANG S&P500 USDD		7.87%
3	S&P500 EMINI FUT DEC23	Vereinigte Staaten	5.13%
4	NIKKEI 225 (OSE) DEC23	Japan	2.11%
5	S&P/TSX 60 IX FUT DEC23	Kanada	2.05%

Grösste Positionen Anleihen

Nr.	Emittent	Länder	%
1	AMUNDI EURO GOV TILT GRN BON		17.66%
2	X EURZ GOVT BOND 5-7 1C		9.56%
3	X EUROZONE GOVT BOND 1C		9.47%
4	ISHARES EURO GOVT 3-5Y		7.52%
5	US 10YR NOTE (CBT)DEC23	Vereinigte Staaten	3.42%