



# Swiss Life Funds (LUX) Multi Asset Balanced EUR R Cap

Nav des Fonds: 846.21 Mio. EUR | Nav je Anteil: 146.69 EUR

Morningstar® ★★★



SFDR-Klassifizierung: Artikel 8

## Management Kommentar

Der Fonds verzeichnete letzten Monat wegen des Rückgangs von Staatsanleihen und der Aktienmärkte eine negative Performance. Er entwickelte sich unter seinem Referenzindex. Der Allokationseffekt war dank unserem Engagement in Geldmarktfonds besonders positiv. Die Anleiheauswahl war jedoch aufgrund des grösseren Engagements in Staatsanleihen negativ. Bei den Aktien war die Auswahl dank den defensiven Strategien, die sich über den klassischen Indizes entwickelten, positiv. Unser Engagement in kleinen und mittleren US-Firmen war diesen Monat negativ.

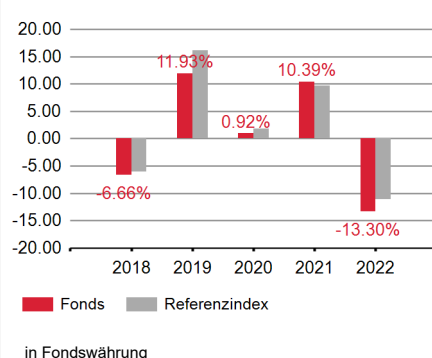
## Anlagestrategie

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



## Performance in Referenzwährung

	Kumulierte Performance						Annualisierte Performance		
	YTD	1 Monat	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	Aufl.	3 Jahre	5 Jahre	Aufl.
Fonds	-1.00%	-2.14%	-0.32%	0.99%	4.19%	46.69%	0.33%	0.82%	2.53%
Ref. Index	5.82%	-1.78%	8.49%	13.46%	19.40%	49.03%	4.29%	3.61%	2.64%

## Fondseigenschaften

Auflagedatum: 08/07/2008

ISIN: LU0367332680

Bloomberg-Code: SLPFHC LX

Morningstar Kategorie: Mischfonds EUR ausgewogen - Global

Fondswährung: EUR

Fondsdomizil: Luxemburg

Ref. Index: 50% BLOOMBERG GLO AGG IND HEDGED EUR + 35% MSCI World 100% Hedged to EUR Net Total Return Ind + 15% MSCI Euro TR Net Index (EUR)

Mindestanlage: 1 Anteil

Zeichnungsgebühren (max.): 5.00%

Rücknahmegebühren (max.): 0.00%

Verwaltungsgebühren: 1.45%

Performancegebühren: Keine

Laufende Kosten per 28/02/2023: 1.94%

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%

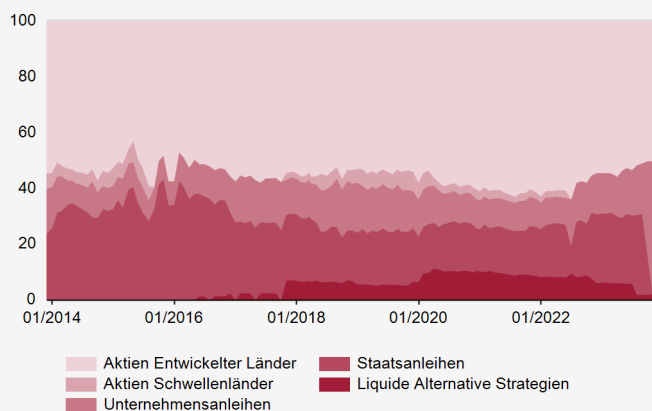
### Recovery

323 Tage

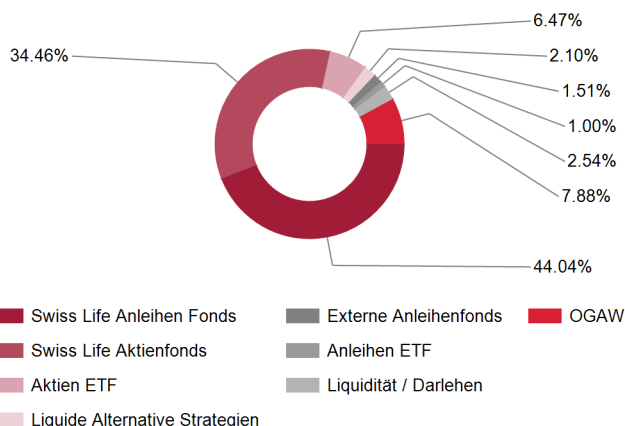
Wöchentlich annualisiert	1 Jahr	3 Jahre	Aufl.
Volatilität Portfolio	7.07%	7.82%	8.86%
Volatilität Ref. Index	8.41%	9.50%	10.91%
Tracking Error	4.35	5.69	5.41
Information Ratio	-1.74	-0.58	-0.01
Sharpe Ratio	-0.36	-0.15	0.25

# Swiss Life Funds (LUX) Multi Asset Balanced EUR R Cap

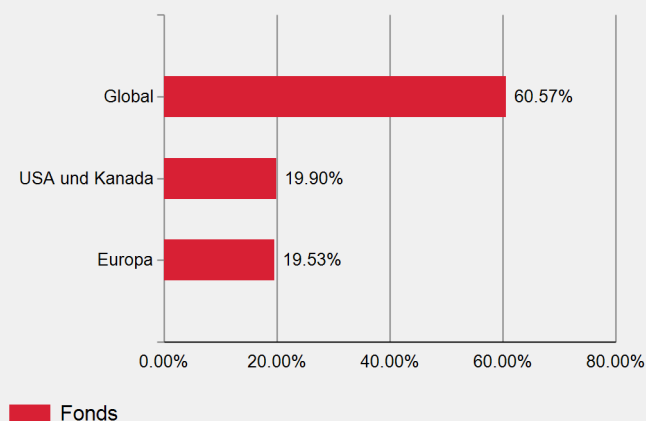
## Entwicklung der Asset Allocation



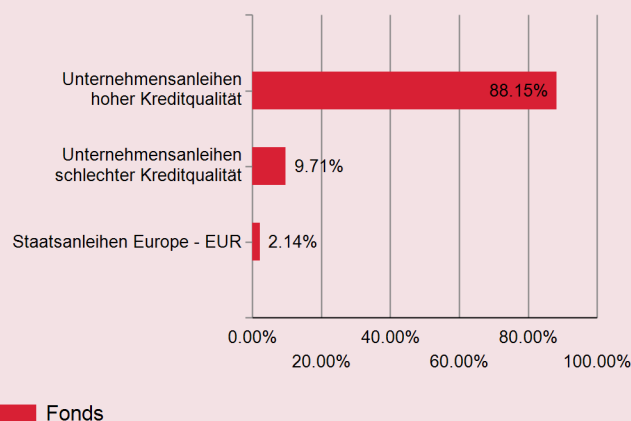
## Portfoliostruktur



## Geografische Aufteilung Aktien



## Aufteilung Obligationenportfolio



## Grösste Positionen Aktien

Nr.	Emittent	Länder	%
1	S LIFE LX-EQUITY ESG USA-S A		8.31%
2	SL LX EQ ESG GLBL PRTCT EUSC		7.88%
3	S L LX-EQ ESG GL-S EURCAP		6.82%
4	SWIS LI EQ ESG EUR ZONE-SEUR		6.46%
5	LYXOR MSCI EUR ESG LEADERS		5.06%

## Grösste Positionen Anleihen

Nr.	Emittent	Länder	%
1	SWISS LF BN ESG GBL SVR-SCAP		18.14%
2	SWISS LF BN ESG GBL AGG-SCAP		12.05%
3	S L LX-BD ESG GB CP-S		6.06%
4	SLF (F) BOND 6M I CAP		4.01%
5	SWISS LIFE LX-BD GL HY-SCE		3.01%

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