



# Swiss Life Funds (F) Equity ESG Europe Minimum Volatility I

NAV des Fonds: 191.98 Mio. EUR | NAV je Anteil: 17'679.90 EUR



SFDR Offenlegung: Artikel 8

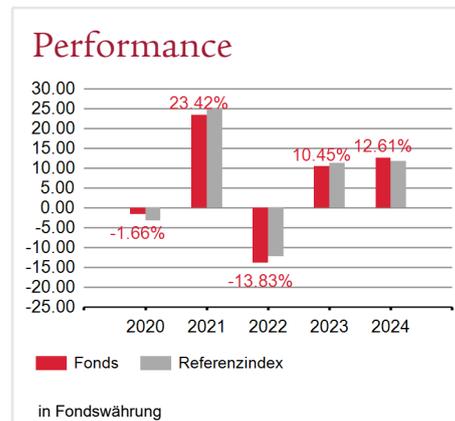
## Management Kommentar

Der europäische Markt ging im Juni zurück, v. a. in den sogenannten defensiven Sektoren wie Basiskonsumgüter und Gesundheitswesen. Die Outperformance ist primär auf die Titelauswahl in den Sektoren Energie und Grundstoffe zurückzuführen. Das Untergewicht des Energiesektors wirkte sich hingegen leicht negativ auf die Strategie aus. Der Nachhaltigkeitsfokus des Fonds war während des Monats neutral.

## Anlagestrategie

Der Fonds investiert über eine quantitative MinVar-Strategie in europäische Aktien primär von grossen und mittleren Unternehmen. Dabei wird jeden Monat aus den Titeln des Universums das am wenigsten volatile Portfolio identifiziert. Das Portfolio wird mit einem internen Optimierungsmodell konstruiert.

## 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	8.60%	-2.48%	12.28%	34.38%	48.66%	76.81%	10.34%	8.25%	3.07%
Ref. Index	8.74%	-2.58%	13.16%	37.55%	64.48%	124.92%	11.20%	10.46%	4.40%

## Fondseigenschaften

**Auflegedatum:** 31/08/2006  
**ISIN:** FR0010661124  
**Bloomberg-Code:** SLFAEU FI  
**Morningstar Kategorie:** Aktien Europa Standardwerte Blend  
**Fondswährung:** EUR  
**Fondsdomizil:** Frankreich  
**Ref. Index:** MSCI Europe Min. Volatility Opt in Euro Net Local  
**Mindestanlage:** 100 000 EUR  
**Zeichnungsgebühren (max.):** 3.00%  
**Rücknahmekommission (max.):** 0.00%  
**Verwaltungsgebühren:** 0.70%  
**Performancegebühren:** Keine  
**Laufende Kosten per 31/12/2024:** 0.73%  
**Zeichnung / Rückzahlung:** Orderschluss 15:00 Abwicklung T+2  
**Ertragsverwendung:** Thesaurierung  
**Swinging Single Pricing:** Ja  
 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

-19.69%

### Recovery

526 Tage

### Beta

0.99

### Alpha

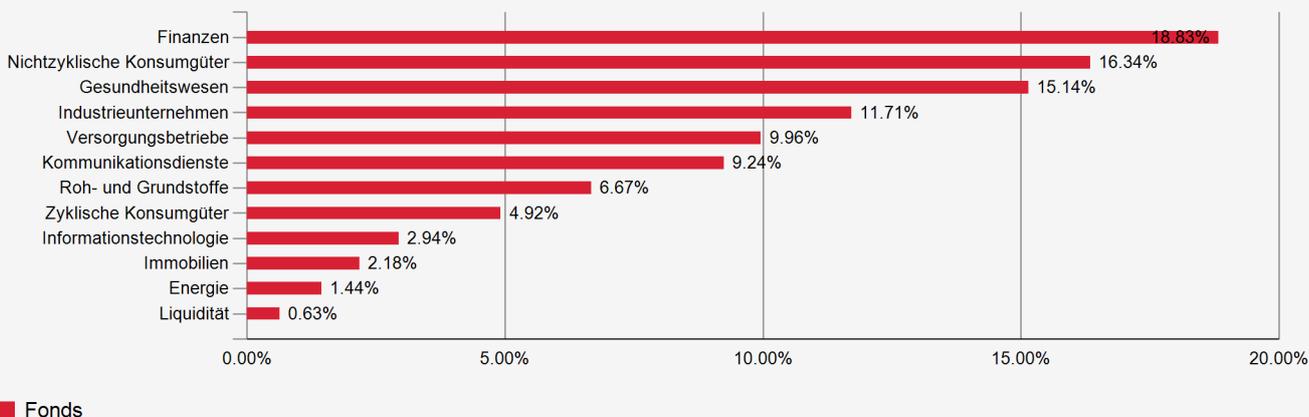
-0.01

### Wöchentlich annualisiert

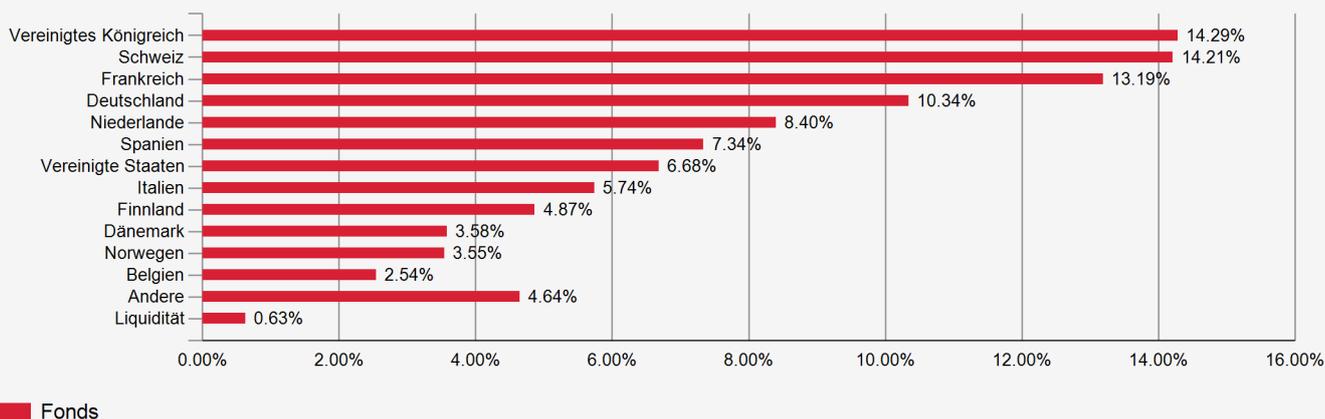
	1 Jahr	3 Jahre	Aufl.
Volatilität Portfolio	10.73%	10.71%	16.81%
Volatilität Ref. Index	10.78%	10.81%	18.87%
Tracking Error	1.29	1.68	6.22
Information Ratio	-0.77	-0.33	-0.21
Sharpe Ratio	0.82	0.65	0.13

# Swiss Life Funds (F) Equity ESG Europe Minimum Volatility I

## Aufteilung nach Sektoren



## Geografische Aufteilung



## Grösste Positionen

Nr.	Emittent	Länder	Sektoren	%
1	NOVARTIS AG-REG	Schweiz	Gesundheitswesen	2.03%
2	IBERDROLA SA	Spanien	Versorgungsbetriebe	1.99%
3	DANONE	Frankreich	Nichtzyklische Konsumgüter	1.92%
4	KONINKLIJKE KPN NV	Niederlande	Kommunikationsdienste	1.89%
5	SWISS PRIME SITE-REG	Schweiz	Immobilien	1.89%
6	KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N	Niederlande	Nichtzyklische Konsumgüter	1.86%
7	REDEIA CORP SA	Spanien	Versorgungsbetriebe	1.72%
8	WOLTERS KLUWER	Niederlande	Industrieunternehmen	1.72%
9	SAMPO OYJ-A SHS	Finnland	Finanzen	1.70%
10	UNILEVER PLC	Vereinigtes Königreich	Nichtzyklische Konsumgüter	1.64%
<b>Total der grössten Positionen</b>				<b>18.34%</b>
<b>Anzahl Positionen</b>				<b>179</b>

**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 KID]), 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 Invest GmbH, Zeppelinstrasse 1, 85784 Garching b. München | 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. Dieses Dokument wurde möglicherweise mithilfe künstlicher Intelligenz erstellt. «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 / ©2025, Morningstar. Alle Rechte vorbehalten. **Kontakt:** [service.client-securities@swisslife-am.com](mailto:service.client-securities@swisslife-am.com)