



Swiss Life Funds (LUX) Equity ESG USA USD F Cap

NAV des Fonds: 711.42 Mio. USD | NAV je Anteil: 197.64 USD

Morningstar® ★★

SFDR Offenlegung: Artikel 8

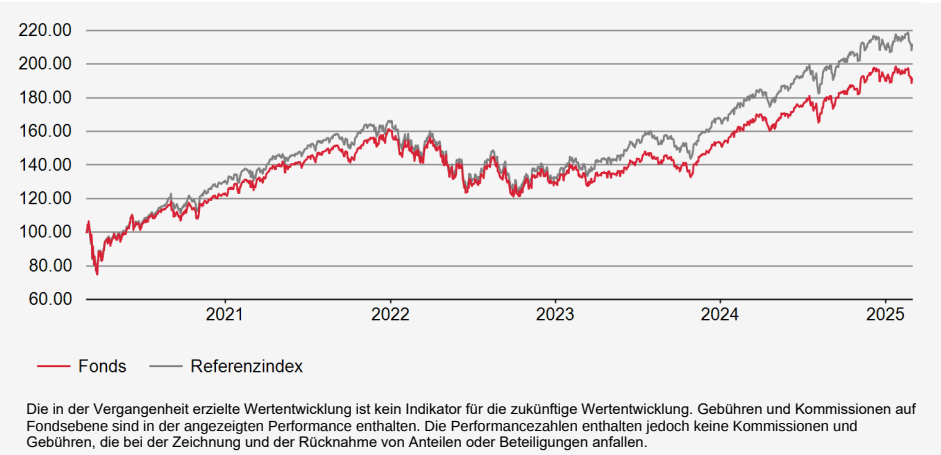
Management Kommentar

Der Fonds lag mit seiner Performance letzten Monat rund 50 BP unter dem Referenzindex. Die Underperformance stammt v. a. von einem spezifischen Effekt, während die Anlagestile sich positiv auswirkten. Das Untergewicht in Restvolatilität und Pharma und Life Sciences sowie das Übergewicht in Leverage trugen positiv bei, das Untergewicht in Grösse und Luft- und Raumfahrt und Verteidigung sowie das Übergewicht in Einzelhandel negativ. Das Untergewicht in Tesla und Unitedhealth Group sowie das Übergewicht in Gilead Sciences wirkten sich positiv aus, das Untergewicht in Eli Lilly und das Übergewicht in Netapp und Deckers Outdoor negativ.

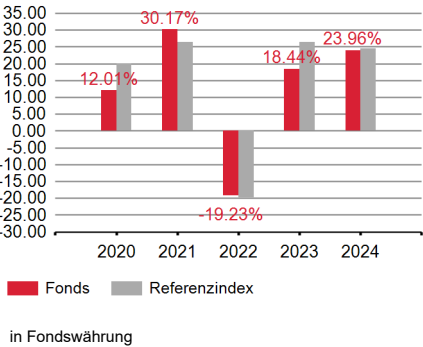
Anlagestrategie

Der Teilfonds verwendet einen systematischen, faktorbasierten Anlageprozess, um in Aktien grosser börsennotierter Gesellschaften zu investieren. Die Titelauswahl erfolgt monatlich anhand eines quantitativen Filters, der auf Risikofaktoren beruht.

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	0.65%	-2.08%	16.44%	29.28%	91.40%	97.64%	8.93%	13.85%	11.51%
Ref. Index	1.36%	-1.61%	18.09%	39.90%	111.70%	132.28%	11.83%	16.16%	14.43%

Risikoindikatoren

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

Max. Drawdown

-29.71%

Recovery

74 Tage

Beta

0.99

Alpha

-0.03

Wöchentlich annualisiert

	1 Jahr	3 Jahre	Aufl.
Volatilität Portfolio	13.09%	16.71%	19.51%
Volatilität Ref. Index	13.09%	17.10%	19.26%
Tracking Error	1.90	2.37	2.79
Information Ratio	-0.89	-1.18	-1.04
Sharpe Ratio	0.73	0.27	0.43

Fondseigenschaften

Auflagedatum: 30/11/2018

ISIN: LU1897149479

Bloomberg-Code: SWLEUFU LX

Morningstar Kategorie: Aktien USA
Standardwerte Blend

Fondswährung: USD

Fondsdomizil: Luxemburg

Ref. Index: MSCI USA NET TR USD
INDEX

Mindestanlage: 1 Anteil

Zeichnungsgebühren (max.): 5.00%

Rücknahmekommission (max.): 0.00%

Verwaltungsgebühren: 0.85%

Performancegebühren: Keine

Laufende Kosten per 30/08/2024: 0.99%

Zeichnung / Rückzahlung: Orderschluss
15:00 Abwicklung T+2

Ertragsverwendung: Thesaurierung

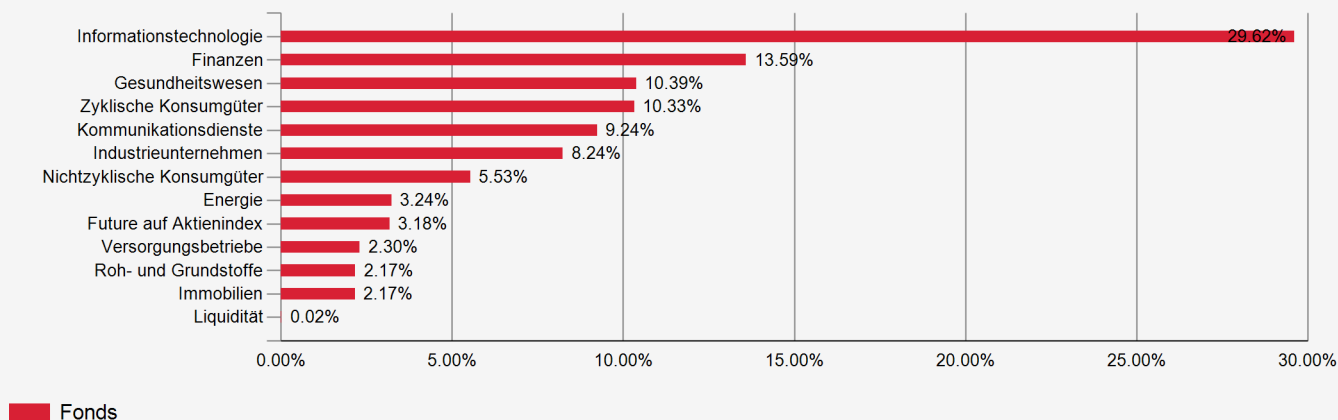
Swinging Single Pricing: Ja

Das Produkt beinhaltet ein Kapitalverlustrisiko.

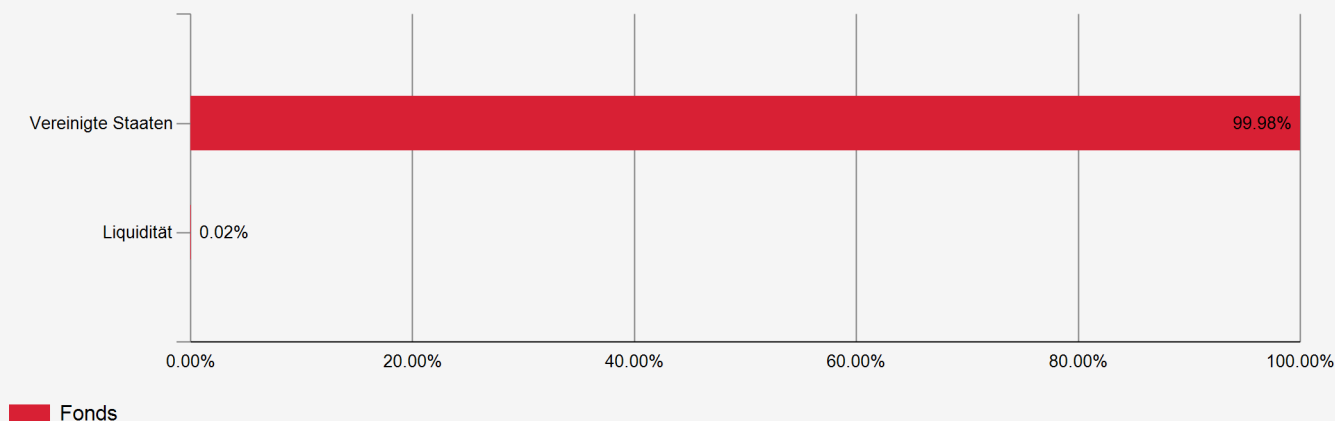
Swiss Life Funds (LUX) Equity ESG USA USD

F Cap

Aufteilung nach Sektoren



Geografische Aufteilung



Grösste Positionen

Nr.	Emittent	Länder	Sektoren	%
1	NVIDIA CORP	Vereinigte Staaten	Informationstechnologie	6.35%
2	APPLE INC	Vereinigte Staaten	Informationstechnologie	6.17%
3	MICROSOFT CORP	Vereinigte Staaten	Informationstechnologie	4.85%
4	AMAZON.COM INC	Vereinigte Staaten	Zyklische Konsumgüter	3.12%
5	ALPHABET INC-CL A	Vereinigte Staaten	Kommunikationsdienste	2.07%
6	META PLATFORMS INC-CLASS A	Vereinigte Staaten	Kommunikationsdienste	1.94%
7	ALPHABET INC-CL C	Vereinigte Staaten	Kommunikationsdienste	1.73%
8	JPMORGAN CHASE & CO	Vereinigte Staaten	Finanzen	1.58%
9	BROADCOM INC	Vereinigte Staaten	Informationstechnologie	1.46%
10	HOME DEPOT INC	Vereinigte Staaten	Zyklische Konsumgüter	1.26%
Total der grössten Positionen				30.54%
Anzahl Positionen				127