

Swiss Life Funds (F) ESG Money Market Euro P

Standard-Geldmarkt-SICAV mit variablem Nettoinventarwert

NAV des Fonds: 7'468.63 Mio. EUR | NAV je Anteil: 117.47 EUR



SFDR Offenlegung: Artikel 8

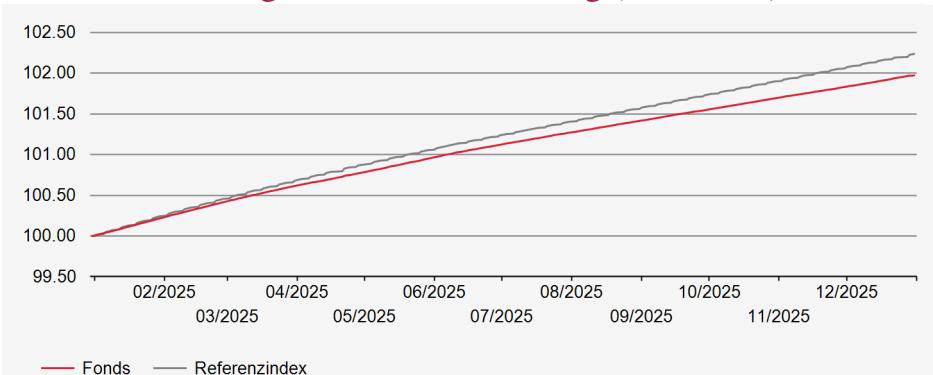
Management Kommentar

Die nach dem Shutdown publizierten US-Statistiken zeigten ein gemischtes Bild: einen weiterhin robusten Privatkonsum, aber eine schwächernde Produktion. Die Wachstumsabschwächung und die geringere Inflationsdruck veranlassen das Fed, die Zinsen zu senken. In der Eurozone liess die EZB ihre Geldpolitik unverändert, da die Inflation bei rund 2% liegt und sich die Wirtschaft weiterhin robust zeigt. Der 1-Jahres-ESTER-Swap legte um 4 BP auf 1,94% zu, der 3-Monats-Euribor sank um 3 BP auf 2,03%.

Anlagestrategie

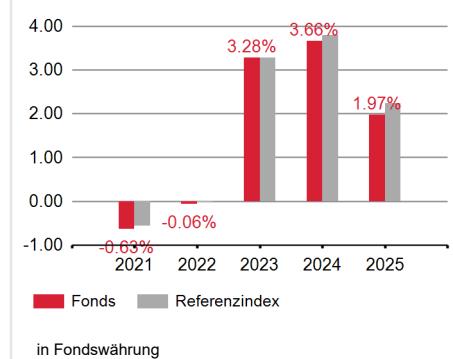
Die SICAV ist eine Geldmarkt-SICAV in Euro, mit dem Ziel, eine höhere Rendite als jene des kapitalisierten Ester zu erzielen. Die SICAV investiert in fest- oder variabel verzinsliche Emisionen. Ihre Auswahl basiert auf einer Analyse des Kreditrisikos, der Liquidität und der Diversifikation des Portfolios. Die gewichtete durchschnittliche Restlaufzeit (WAM) der Titel liegt bei unter 6 Monaten.

Wertentwicklung in Referenzwährung (Basis 100)



Die in der Vergangenheit erzielte Wertentwicklung ist kein Indikator für die zukünftige Wertentwicklung. Gebühren und Kommissionen auf Fondsebene sind in der angezeigten Performance enthalten. Die Performancezahlen enthalten jedoch keine Kommissionen und Gebühren, die bei der Zeichnung und der Rücknahme von Anteilen oder Beteiligungen anfallen.

Performance



Performance in Referenzwährung

Kumulierte Performance							Annualisierte Performance			
YTD	1 Monat	3 Monate	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	Aufl.	3 Jahre	5 Jahre	Aufl.	
Fonds	1.97%	-	-	1.97%	9.17%	8.41%	17.47%	2.96%	1.63%	0.89%
Ref. Index	2.24%	-	-	2.24%	9.60%	8.96%	14.11%	3.10%	1.73%	0.73%

Risikoindikatoren



WAL (gewichtete durchschn. Laufzeit)
174.09

WAM (gewichtete durchschn. Fälligkeit)
41.59

WARF (gewichteter durchschn. Ratingfaktor)
[A/A+]

Wöchentlich annualisiert		1 Jahr	3 Jahre	Aufl.
Volatilität Portfolio		0.06%	0.12%	0.21%
Volatilität Ref. Index		0.06%	0.11%	0.21%
Tracking Error		0.02	0.03	0.09
Information Ratio		-11.04	-3.98	1.84
Sharpe Ratio		-3.80	-0.45	0.86

Fondseigenschaften

Auflagedatum: 09/12/2007

ISIN: FR0010540385

Bloomberg-Code: SLFMONP FP

Klassifizierung: Geldmarkt

Fondswährung: EUR

Fondsdomizil: Frankreich

Ref. Index: ESTR Capitalized

Mindestanlage: 0.001 Anteil(e)

Zeichnungsgebühren (max.): 2.00%

Rücknahmekommission (max.): 0.00%

Verwaltungsgebühren: 0.55%

Performancegebühren: Keine

Laufende Kosten per 31/12/2024: 0.45%

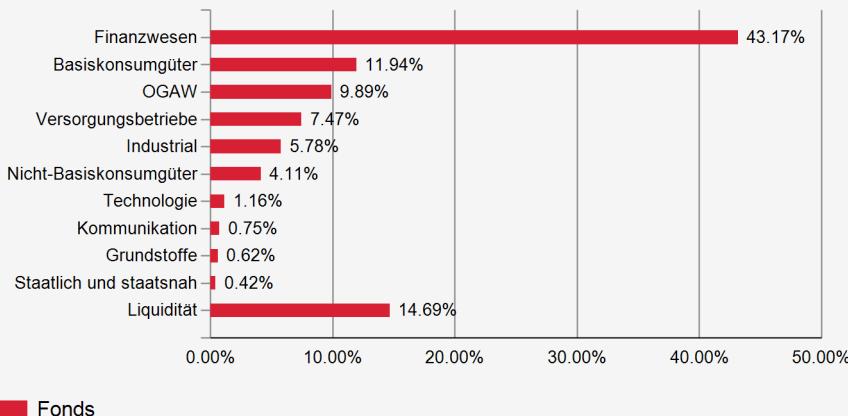
Zeichnung / Rückzahlung: Orderschluss 12:00 Abwicklung T+0

Ertragsverwendung: Thesaurierung

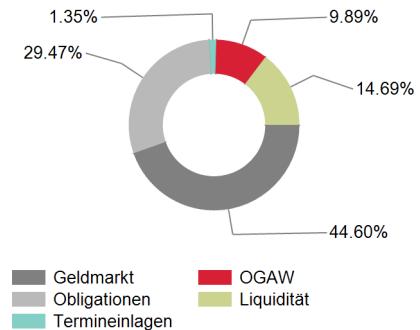
Das Produkt beinhaltet ein Kapitalverlustrisiko.

Swiss Life Funds (F) ESG Money Market Euro P

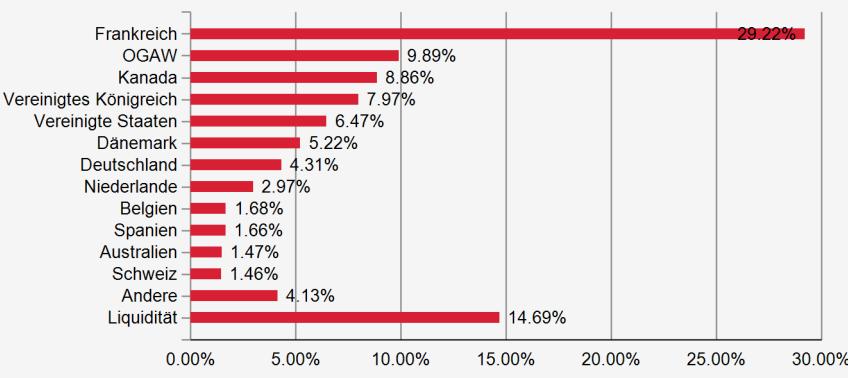
Aufteilung nach Sektoren



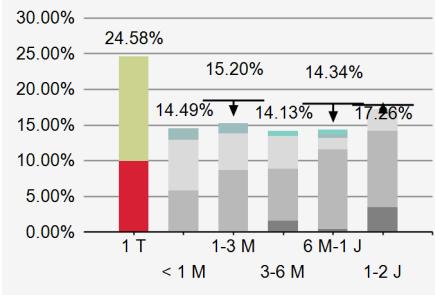
Portfoliostruktur



Geografische Aufteilung



Aufteilung nach Rating/Laufzeit



Anmerkung: T = Tag(e), M = Monat(e), J = Jahr(e)

AAA bis AA-	5.36%
A+ bis A-	43.57%
BBB+ bis BBB-	21.58%
NR	3.56%
OGAW	9.89%
Termineinlagen	1.35%
Liquidität	14.69%

Grösste Positionen

Nr.	Emittent	Länder	Sektoren	%
1	NOVO NORDISK FIN NOVOB FLOAT 05/27/27	Dänemark	Basiskonsumgüter	1.22%
2	BANK OF AMER CRP BAC FLOAT 03/10/27	Vereinigte Staaten	Finanzwesen	1.07%
3	NATL BANK CANADA NACN FLOAT 03/06/26	Kanada	Finanzwesen	0.98%
4	MAREX FINANCIAL MAREX EMTN 0 04/27/26	Vereinigtes Königreich	Finanzwesen	0.93%
5	ELEC DE FRANCE EDF EUCP 0 05/11/26	Frankreich	Versorgungsbetriebe	0.88%
6	KBC IFIMA SA KBC FLOAT 03/04/26	Belgien	Finanzwesen	0.88%
7	ELEC DE FRANCE EDF EUCP 0 04/27/26	Frankreich	Versorgungsbetriebe	0.86%
8	GOLDMAN SACHS IN GSIBK ECD 0 04/24/26	Vereinigte Staaten	Finanzwesen	0.83%
9	JYSKE BANK A/S JYBCDC EUCP 0 01/14/26	Dänemark	Finanzwesen	0.80%
10	CARLSBERG BREW CARLB FLOAT 02/28/27	Dänemark	Basiskonsumgüter	0.79%
Total der grössten Positionen				9.26%
Anzahl Positionen				221

Aufteilung nach kurzfristigem Rating

