

*Swiss Life Funds (F) ESG
Money Market Euro*

Halbjahresbericht vom 30.06.2024

Aktueller Vermögenswert

Aktueller Vermögenswert	<i>Fondswährung des OGAW: EUR</i>	Betrag zum periodischen Rechnungsschluss
a) Qualifizierte Finanzinstrumente, die in 1. des I des Artikels L.214-20/ 1. des I des Artikels L.214-24-55 des Währungs- und Finanzgesetzbuchs aufgeführt sind		4 931 105 625,58
b) Bankguthaben		1 021 418 731,37
c) Sonstige Aktiva des OGAW		799 057 238,96
d) Aktiva des OGAW gesamt (Summe a+b+c)		6 751 581 595,91
e) Passiva		-19 844 779,70
f) Nettoinventarwert (Summe d+e = OGAW-Nettovermögen)		6 731 736 816,21

Anzahl der Anteile oder Aktien in Umlauf und Nettoinventarwert pro Anteil oder Aktie

Anteile oder Aktien	Anzahl der Anteile oder Aktien in Umlauf	<i>Währung Anteile oder Aktien</i>	Nettoinventarwert pro Anteil oder Aktie (Liquidationswert)
AKTION I / FR0010089649	239 471,195	EUR	26 125,65
AKTION P / FR0010540385	4 194 791,051	EUR	113,329

Wertpapierportfolio

Elemente des Wertpapierportfolios	Prozentsatz	
	Nettovermögen	Gesamtvermögen
a) Notenbankfähige Wertpapiere und zum Handel auf einem geregelten Markt zugelassene Geldmarktinstrumente im Sinne von Artikel L. 422-1° des Währungs- und Finanzgesetzes.	73,25	73,04
b) Qualifizierte Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelten Markt im ordnungsgemäßen Betrieb zum Handel zugelassen sind, anerkannt, öffentlich zugänglich und mit Sitz in einem Mitgliedstaat der Europäischen Union oder in einem anderen Vertragsstaat des Abkommens über den Europäischen Wirtschaftsraum.	-	-
c) Anrechnungsfähige Finanzinstrumente und Geldmarktinstrumente, die an einer Börse eines Drittlandes notiert oder auf einem anderen Markt eines Drittlands gehandelt werden, der reguliert ist, regulär funktioniert, anerkannt ist und der Öffentlichkeit zugänglich ist, sofern diese Börse oder dieser Markt nicht in einer von der Autorité des marchés financiers erstellten Liste aufgeführt ist oder die Auswahl dieser Börse oder dieses Marktes gesetzlich, durch die Satzung oder die Statuten des OGA/des allgemeinen Investmentfonds vorgesehen ist.	-	-
d) Neu ausgegebene Finanzwertpapiere, die in 4. des I. des Artikels R. 214-11/ 4. des I. des Artikels R.214-32-18 des Währungs- und Finanzgesetzbuches aufgeführt sind.	-	-
e) Sonstige Vermögenswerte	9,59	9,56

Verteilung der Anlagewerte nach Währung sortiert

Währungen (die 10 wichtigsten Währungen)	Betrag <i>In der Fondswährung des OGAW</i>	Prozentsatz	
	<i>EUR</i>	Nettovermögen	Gesamtvermögen
Euro	4 931 105 625,58	73,25	73,04
-	-	-	-
-	-	-	-
-	-	-	-
-	-	-	-
-	-	-	-
-	-	-	-
-	-	-	-
-	-	-	-
-	-	-	-
Sonstige Währungen	-	-	-
Gesamt	4 931 105 625,58	73,25	73,04

Verteilung der Anlagewerte nach Währung sortiert, nach Herkunftsland des Emittenten sortiert

Land (die 10 wichtigsten Länder)	Prozentsatz	
	Nettovermögen	Gesamtvermögen
Frankreich	30,57	30,48
Niederland	10,21	10,19
Großbritannien	8,89	8,87
Kanada	8,16	8,13
Deutschland	3,00	2,99
Dänemark	2,81	2,80
Luxemburg	1,53	1,52
USA	1,50	1,49
Irland	1,45	1,44
Italien	1,39	1,39
Sonstige Länder	3,74	3,74
Gesamt	73,25	73,04

Verteilung der Anlagewerte nach Wirtschaftssektor sortiert

Wirtschaftssektor <i>(die 10 wichtigsten Sektoren)</i>	Prozentsatz	
	Nettovermögen	Gesamtvermögen
Banken	39,86	39,75
Spezielle Finanzdienste	10,17	10,14
Spezielle Chemikalien	1,57	1,56
Kombinierte Energieerzeugung	1,56	1,55
Arzneimittel	1,48	1,47
Pipelines	1,39	1,39
Hoch- und Tiefbau	1,38	1,37
Elektrischen Komponenten	1,35	1,34
Elektrische Bauteile und Ausrüstungselemente	1,33	1,33
Diversifizierte Gewerbe	1,32	1,32
Sonstige Sektoren	11,84	11,82
Gesamt	73,25	73,04

Verteilung der sonstigen Anlagewerte, nach Art sortiert

Art der Vermögenswerte	Prozentsatz	
	Nettovermögen	Gesamtvermögen
Anteile an OGA	9,59	9,56
- OGAW und Äquivalente aus anderen Mitgliedstaaten der Europäischen Union	9,59	9,56
- AIF und entsprechende Fonds aus anderen Mitgliedstaaten der Europäischen Union	-	-
- Sonstige OGA und Investmentfonds	-	-
Sonstige Vermögenswerte	-	-
Gesamt	9,59	9,56

Bewegungen in der Zusammensetzung des Wertpapierportfolios im Berichtszeitraum

Elemente des Wertpapierportfolios	Bewegungen (als Betrag)	
	Erwerb	Veräußerung / Rückzahlungen
Fondswährung des OGAW: <i>EUR</i>		
a) Die zum Handel an einem geregelten Markt zugelassenen Finanzinstrumente und Geldmarktinstrumente im Sinne von Artikel L. 422 1) des Währungs- und Finanzgesetzbuchs.	23 672 264 751,79	23 675 382 623,29
b) Qualifizierte Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelten Markt im ordnungsgemäßen Betrieb zum Handel zugelassen sind, anerkannt, öffentlich zugänglich und mit Sitz in einem Mitgliedstaat der Europäischen Union oder in einem anderen Vertragsstaat des Abkommens über den Europäischen Wirtschaftsraum.	-	-
c) Anrechnungsfähige Finanzinstrumente und Geldmarktinstrumente, die an einer Börse eines Drittlandes notiert oder auf einem anderen Markt eines Drittlands gehandelt werden, der reguliert ist, regulär funktioniert, anerkannt ist und der Öffentlichkeit zugänglich ist, sofern diese Börse oder dieser Markt nicht in einer von der Autorité des marchés financiers erstellten Liste aufgeführt ist oder die Auswahl dieser Börse oder dieses Marktes gesetzlich, durch die Satzung oder die Statuten des OGA/des allgemeinen Investmentfonds vorgesehen ist.	-	-
d) Die neu ausgegebenen Finanzwertpapiere, die in 4. des I. des Artikels R. 214 11/ 4. des I. des Artikels R.214 32 18 des Währungs- und Finanzgesetzbuches aufgeführt sind.	-	-
e) Sonstige Vermögenswerte	435 720 829,15	466 787 416,23
Gesamt im Berichtszeitraum	24 107 985 580,94	24 142 170 039,52

Angabe der Zahlen in Bezug auf die Ausschüttung je Anteil auf Ergebnis und/oder erzielten NettoMehrwert oder erzielte Wertminderung, die im Laufe des Zeitraums nach Abzug der Steuern ausgezahlt wurde

Datum	Kategorie der Anteile/Aktien	Währung Anteile/Ak-	Art	Nettobetrag je Anteil	Steuer gut-schrift je Anteil	Bruttobetrag je Anteil
-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-

Informationen über Performancegebühren (in EUR)

Erfolgsabhängige Provision (variable Kosten) : Betrag und % der Kosten im Zeitraum				
Kategorie der Anteile:	Variable Verwaltungskosten, die in der Reserve enthalten sind	%	Variable Verwaltungskosten erworben (Rückkauf)	%
AKTION I / FR0010089649	-	-	-	-
AKTION P / FR0010540385	-	-	-	-

Zusammenfassung der Fälle und Bedingungen, unter denen die Begrenzung der Rückkäufe im Laufe des Zeitraums beschlossen wurde

Der Fonds hat im Berichtszeitraum keine Rückkaufdeckelungen vorgenommen.

Informationen zu den Finanzierungstransaktionen mit Wertpapieren und Gesamtrenditeswaps (TRS) am 28/06/2024:

Der Sicav hat im Berichtszeitraum keine Wertpapierfinanzierungsgeschäfte getätigt.

Allgemeine Informationen:

Betrag der verliehenen Titel und Rohstoffe im Verhältnis zur Summe der Vermögenswerte, die verliehen werden können, definiert als ausschließlich der liquiden und liquiditätsähnlichen Mittel.	Keine
--	-------

	Finanzierungstransaktionen mit Wertpapieren	Gesamtrenditeswap
Der Betrag, in dessen Höhe Verpflichtungen in die einzelnen Finanzierungstransaktionsarten mit Wertpapieren und Gesamtrenditeswaps eingegangen wurden, ausgedrückt als absoluter Wert (in der Währung des Organismus für gemeinsame Anlagen) und im Verhältnis der Vermögenswerte unter OPCVerwaltung.	Keine	Keine

Daten zur Konzentration:

	Finanzierungstransaktionen mit Wertpapieren	Gesamtrenditeswap
Die zehn größten Sicherheitsemittenten bei allen Finanzierungstransaktionsarten mit Wertpapieren und Gesamtrenditeswaps (Aufschlüsselung der erhaltenen Sicherheits- und Rohstoffvolumen nach Name des Emittenten)	Keine	Keine
Die zehn wichtigsten Vertragspartner bei allen Finanzierungstransaktionsarten mit Wertpapieren und Gesamtrenditeswaps jeweils einzeln (Name des Vertragspartners und Bruttovolumen der laufenden Transaktionen).	Keine	Keine

Aggregierte Transaktionsdaten bei allen Finanzierungstransaktionsarten mit Wertpapieren und Gesamtrenditeswaps jeweils einzeln und aufgeschlüsselt nach den folgenden Kategorien :

	Finanzierungstransaktionen mit Wertpapieren	Gesamtrenditeswap
Art und Qualität der Sicherheiten (kollateral)	Keine	Keine

	Finanzierungstransaktionen mit Wertpapieren	Gesamtrenditeswap
Fälligkeit der Sicherheit, aufgeschlüsselt nach den folgenden Fälligkeitstranchen: Weniger als ein Tag, ein Tag bis eine Woche, eine Woche bis ein Monat, ein bis drei Monate, drei Monate bis ein Jahr, mehr als ein Jahr, offene Transaktionen	Keine	Keine
Währung der Sicherheit	Keine	Keine
Fälligkeit der Finanzierungstransaktionen mit Wertpapieren und Gesamtrenditeswaps, aufgeschlüsselt nach den folgenden Fälligkeitstranchen: Weniger als ein Tag, ein Tag bis eine Woche, eine Woche bis ein Monat, ein bis drei Monate, drei Monate bis ein Jahr, mehr als ein Jahr, offene Transaktionen	Keine	Keine
Land des Sitzes der Vertragsparteien	Keine	Keine
Vorschriften und Kompensation (z. B. drei Parteien, zentrale Vertragsparteien, bilateral)	Keine	Keine

Daten zur Wiederverwendung der Sicherheiten (kollateral):

	Finanzierungstransaktionen mit Wertpapieren	Gesamtrenditeswap
Anteil der erhaltenen Sicherheiten, der wiederverwendet wird, im Verhältnis zum maximalen Betrag, der im Prospekt oder in den Informationen für die Anleger angegeben ist	Keine	Keine
OPC-Erträge der Wiederanlage der Barsicherheiten	Keine	Keine

Verwahrung der vom OPC im Rahmen der Finanzierungstransaktionen mit Wertpapieren und Gesamtrenditeswaps erhaltenen Sicherheiten:

Name des (der) Verwahrer(s)	Betrag der von den einzelnen Verwahrern als Sicherheit verwahrten Vermögenswerte
Swiss Life Banque Privée	Keine

Verwahrung der vom OPC im Rahmen der Finanzierungstransaktionen mit Wertpapieren und Gesamtrenditeswaps bereitgestellten Sicherheiten:

Keine.

Daten zu den Erträgen und Kosten der einzelnen Finanzierungstransaktionsarten mit Wertpapieren und Gesamtrenditeswaps:

	Finanzierungstransaktionen mit Wertpapieren	Gesamtrenditeswap
Aufschlüsselung zwischen OPC, Verwalter des Organismus für gemeinsame Anlagen und Dritten (z. B. Kreditgeber) als absoluter Wert und Prozentsatz des von den einzelnen Finanzierungstransaktionsarten mit Wertpapieren und Gesamtrenditeswaps erzeugten Gesamtertrags	Keine	Keine

Bestand bei 30.06.2024

Wert-Code	Wertelabel	Status Wert	Menge	Wert Markt	Notierungs- währung	%Nettove- rmögen
Valeurs mobilières						
Obligation						
XS2613658470	ABN AMRO BANK NA 3.75% 20/04/2025	PROPRE	9 100 000,00	9 169 110,14	EUR	0,14
FR001400L4Y2	ALD SA FRN 06/10/2025	PROPRE	17 100 000,00	17 361 450,93	EUR	0,26
FR001400G0W1	ALD SA FRN 21/02/2025	PROPRE	18 400 000,00	18 543 274,67	EUR	0,28
FR001400I9F5	ARVAL SERVICE LEASE SA F 4.625% 02/12/2024	PROPRE	17 500 000,00	18 004 756,90	EUR	0,27
XS2575952341	BANCO SANTANDER SA FRN 16/01/2025	PROPRE	25 000 000,00	25 297 718,75	EUR	0,38
XS2632933631	BANK OF MONTREAL FRN 06/06/2025	PROPRE	16 000 000,00	16 082 314,67	EUR	0,24
XS2618508340	BANK OF NOVA SCOTIA FRN 02/05/2025	PROPRE	51 700 000,00	52 188 557,82	EUR	0,78
XS2733010628	BANK OF NOVA SCOTIA FRN 12/12/2025	PROPRE	40 000 000,00	40 238 060,00	EUR	0,60
XS2692247468	BANK OF NOVA SCOTIA FRN 22/09/2025	PROPRE	44 000 000,00	44 188 320,00	EUR	0,66
XS2793212197	BANK OF NOVA SCOTIA FRN 26/03/2026	PROPRE	37 000 000,00	37 058 591,56	EUR	0,55
XS2842855814	BANK OF NOVA SOCITA FRN 17/06/2026	PROPRE	25 000 000,00	25 042 152,08	EUR	0,37
DE000BLB9V03	BAYERISCHE LANDESBANK FRN 31/01/2026	PROPRE	27 200 000,00	27 422 356,22	EUR	0,41
XS2768933603	BMW FINANCE NV FRN 19/02/2026	PROPRE	16 000 000,00	16 088 562,67	EUR	0,24
XS1589881785	BMW FINANCE NV 0.875% 03/04/2025	PROPRE	16 000 000,00	15 706 553,42	EUR	0,23
FR001400OGI0	BPCE SA FRN 06/03/2026	PROPRE	20 000 000,00	20 054 893,33	EUR	0,30
XS2634071489	CANADIAN IMPERIAL BANK FRN 09/06/2025	PROPRE	30 000 000,00	30 137 816,67	EUR	0,45
XS2793782611	CANADIAN IMPERIAL BANK FRN 27/03/2026	PROPRE	25 000 000,00	25 011 537,50	EUR	0,37
FR0013234689	CREDIT AGRICOLE LONDON 0.972% 31/07/2024	PROPRE	50 000 000,00	50 335 336,07	EUR	0,75
FR001400GDG7	CREDIT AGRICOLE SA FRN 07/03/2025	PROPRE	33 100 000,00	33 243 705,49	EUR	0,49
DE000A3826Q8	DEUTSCHE BANK FRN 15/01/2026	PROPRE	12 700 000,00	12 874 094,42	EUR	0,19
XS2844409271	DIAGEO FINANCE PLC FRN 20/06/2026	PROPRE	30 000 000,00	30 036 425,00	EUR	0,45
XS2742659738	FED CAISSES DESJARDINS FRN 17/01/2026	PROPRE	42 000 000,00	42 562 067,33	EUR	0,63
XS2764789231	FORTIVE CORPORATION 3.70% 13/02/2026	PROPRE	19 111 000,00	19 392 520,69	EUR	0,29
DE000HCB0B02	HAMBURG COMMERCIAL BANK FRN 05/12/2025	PROPRE	30 000 000,00	30 315 825,00	EUR	0,45
XS2599731473	HEINEKEN NV 3.875% 23/09/2024	PROPRE	7 500 000,00	7 721 030,12	EUR	0,11
XS2775174340	KBC IFIMA SA FRN 04/03/2026	PROPRE	65 800 000,00	66 055 066,39	EUR	0,98

Swiss Life Funds (F) ESG Money Market Euro

Wert-Code	Wertelabel	Status Wert	Menge	Wert Markt	Notierungs- währung	%Nettove- rmögen
FR001400KI02	KERING 3.75% 05/09/2025	PROPRE	30 800 000,00	31 770 361,57	EUR	0,47
XS2780024977	KONINKIJKE AHOLD DLHAIZE FRN 11/03/2026	PROPRE	21 778 000,00	21 866 903,24	EUR	0,32
XS2752465810	LANDBK HESSEN THUERINGEN FRN 23/01/2026	PROPRE	28 000 000,00	28 250 301,33	EUR	0,42
DE000LB38937	LB BADEN WUERTTEMBERG FRN 28/11/2025	PROPRE	42 000 000,00	42 171 808,00	EUR	0,63
XS2518861641	LLOYDS BANK CORP MKTS PLC FRN 12/08/2024	PROPRE	40 000 000,00	40 255 237,78	EUR	0,60
XS2722857302	MITSUBISHI HITACHI CAPITAL UK PLC FRN 27/11/2024	PROPRE	15 000 000,00	15 065 955,83	EUR	0,22
XS2780858994	NATIONAL BANK OF CANADA FRN 06/03/2026	PROPRE	73 000 000,00	73 278 470,67	EUR	1,09
XS2635167880	NATIONAL BANK OF CANADA FRN 13/06/2025	PROPRE	30 000 000,00	30 148 360,83	EUR	0,45
XS2633055582	NATIONWIDE BLDG SOCIETY FRN 07/06/2025	PROPRE	22 000 000,00	22 116 524,22	EUR	0,33
XS2745115597	NATWEST MARKETS PLC FRN 09/01/2026	PROPRE	55 000 000,00	55 792 870,83	EUR	0,83
XS2820449945	NOVO NORDISK A/S 3.375% 21/05/2026	PROPRE	99 000 000,00	99 385 964,38	EUR	1,48
XS2577030708	ROYAL BANK OF CANADA FRN 17/01/2025	PROPRE	50 715 000,00	51 258 963,46	EUR	0,76
XS2733106657	SIEMENS FINANCIERINGSMAT 4.188% 18/12/2025	PROPRE	24 000 000,00	24 102 360,00	EUR	0,36
XS2616008038	SIKA CAPITAL BV FRN 01/11/2024	PROPRE	15 000 000,00	15 103 543,75	EUR	0,22
XS2635183069	SKANDINAVISKA ENSKILDA FRN 13/06/2025	PROPRE	23 000 000,00	23 110 817,19	EUR	0,34
XS2802190459	SNAM SPA FRN 15/04/2026	PROPRE	42 377 000,00	42 845 350,60	EUR	0,64
FR001400F315	SOCIETE GENERALE FRN 13/01/2025	PROPRE	38 300 000,00	38 715 401,80	EUR	0,58
FR001400N9V5	SOCIETE GENERALE FRN 19/01/2026	PROPRE	22 000 000,00	22 254 540,00	EUR	0,33
XS2827693446	SWISSCOM FINANCE 3.5% 29/05/2026	PROPRE	25 826 000,00	25 981 950,12	EUR	0,39
FR001400L248	THALES SA 4% 18/10/2025	PROPRE	26 200 000,00	27 013 985,32	EUR	0,40
XS2803392021	TORONTO DOMINION BANK FRN 16/04/2026	PROPRE	55 000 000,00	55 528 550,00	EUR	0,82
XS2577740157	TORONTO DOMINION BANK FRN 20/01/2025	PROPRE	26 000 000,00	26 270 185,50	EUR	0,39
XS2652775789	TORONTO DOMINION BANK FRN 21/07/2025	PROPRE	23 286 000,00	23 556 158,35	EUR	0,35
XS2737063722	TOYOTO MOTOR FINANCE BV FRN 22/12/2025	PROPRE	15 000 000,00	15 047 525,00	EUR	0,22
XS2800795291	UBS AG LONDON FRN 12/04/2026	PROPRE	40 000 000,00	40 365 308,89	EUR	0,60
XS2744130852	VOLVO TREASURY AB FRN 09/01/2026	PROPRE	12 800 000,00	12 976 103,11	EUR	0,19
XS2824777267	VOLVO TREASURY AB FRN 22/05/2026	PROPRE	24 000 000,00	24 137 446,42	EUR	0,36
Total Obligation				1 658 503 046,03		24,64
O.P.C.V.M.						
FR0013067790	BFT AUREUS ISR FCP	PROPRE	12 500,00	129 884 010,75	EUR	1,93
FR0010216804	BNP PARIBAS INVEST 3M SUSTAINABLE FCP	PROPRE	250,00	152 963 725,00	EUR	2,27

Swiss Life Funds (F) ESG Money Market Euro

Wert-Code	Wertelabel	Status Wert	Menge	Wert Markt	Notierungs- währung	%Nettove- rmögen
FR0013113222	CANDRIAM MONETAIRE SICAV	PROPRE	1 000,00	104 789 700,00	EUR	1,56
FR0013368065	CM AM MONEPLUS FCP	PROPRE	300,00	33 654 990,00	EUR	0,50
FR0007045109	FEDERAL SUPPORT MONET ESG FCP	PROPRE	16 000,00	177 080 000,00	EUR	2,63
FR0010885236	OSTRUM SRI MONEY PLUS FCP	PROPRE	5,00	540 384,45	EUR	0,01
FR0011060870	SWISS LIFE FUNDS F ESG SHORT TERM EURO FCP	PROPRE	2 200,00	46 562 164,00	EUR	0,69
Total O.P.C.V.M.				645 474 974,20		9,59
Total Valeurs mobilières				2 303 978 020,23		34,23
Swap de Taux						
SWAP04042494	2095227052#S_2025042	PROPRE	11 100 000,00	27 355,53	EUR	0,00
SWAP04056616	2148918172#S_2024120	PROPRE	17 500 000,00	51 336,64	EUR	0,00
SWAP04072531	2180470032#S_2024071	PROPRE	60 000,00	-6,03	EUR	-0,00
SWAP04087989	2197968942#S_2024072	PROPRE	32 000 000,00	39 674,94	EUR	0,00
SWAP04096009	2221369762#S_2025080	PROPRE	30 800 000,00	44 580,21	EUR	0,00
SWAP04098133	2224083672#S_2024082	PROPRE	30 000 000,00	47 832,44	EUR	0,00
SWAP04140603	2255816292#S_2025102	PROPRE	31 200 000,00	16 776,56	EUR	0,00
SWAP04142194	2258773262#S_2025040	PROPRE	16 000 000,00	-64 691,48	EUR	-0,00
SWAP04144047	2261270652#S_2024101	PROPRE	50 000 000,00	-239 072,74	EUR	-0,00
SWAP04187867	2304640972#S_2024091	PROPRE	60 000 000,00	132 351,49	EUR	0,00
SWAP04187862	2305078832#S_2024121	PROPRE	35 000 000,00	126 076,85	EUR	0,00
SWAP04231256	2353428762#S_2026021	PROPRE	24 100 000,00	196 236,95	EUR	0,00
SWAP04256845	2406467692#S_2025041	PROPRE	40 000 000,00	48 174,74	EUR	0,00
SWAP04261052	2409967232#L_2026021	PROPRE	5 000 000,00	-40 713,06	EUR	-0,00
SWAP04265342	2419101602#S_2024072	PROPRE	225 000 000,00	-7 178,87	EUR	-0,00
SWAP04268705	2430945922#S_2026042	PROPRE	107 000 000,00	-23 571,80	EUR	-0,00
SWAP04276300	2441053252#S_2026042	PROPRE	25 826 000,00	-36 488,41	EUR	-0,00
SWAP04276805	2444991952#S_2025060	PROPRE	40 000 000,00	-29 489,16	EUR	-0,00
SWAP04283516	2459624072#S_2025051	PROPRE	104 000 000,00	-46 526,53	EUR	-0,00
SWAP04286883	2463551222#L_2026042	PROPRE	8 000 000,00	2,38	EUR	0,00
SWAP04286886	2463663142#L_2025102	PROPRE	5 000 000,00	-2 688,55	EUR	-0,00

Swiss Life Funds (F) ESG Money Market Euro

Wert-Code	Wertelabel	Status Wert	Menge	Wert Markt	Notierungs- währung %	Nettove- rmögen
SWAP04288530	2468462752#S_2025032	PROPRE	55 000 000,00	-502,79	EUR	-0,00
Total Swap de Taux				239 469,31		0,00
Liquidites						
APPELS DE MARGES						
	APPEL DE MARGE EUR	PROPRE	-239 469,31	-239 469,31	EUR	-0,00
Total APPELS DE MARGES				-239 469,31		-0,00
AUTRES						
	PROV INTCREDCPTDEPCE	PROPRE	2 158 176,51	2 158 176,51	EUR	0,03
Total AUTRES				2 158 176,51		0,03
BANQUE OU ATTENTE						
	ACH DIFF TITRES EUR	PROPRE	-16 835 443,64	-16 835 443,64	EUR	-0,25
	BANQUE EUR BNP	PROPRE	65 521,57	65 521,57	EUR	0,00
	BANQUE EUR SWISSLIFE	PROPRE	1 021 353 209,68	1 021 353 209,68	EUR	15,17
	BANQUE GBP SWISSLIFE	PROPRE	0,01	0,01	GBP	0,00
	BANQUE USD SWISSLIFE	PROPRE	0,12	0,11	USD	0,00
Total BANQUE OU ATTENTE				1 004 583 287,73		14,92
DEPOSIT DE GARANTIE						
	DEPOSIT OTC VERSE	PROPRE	2 794 185,63	2 794 185,63	EUR	0,04
Total DEPOSIT DE GARANTIE				2 794 185,63		0,04
DEPOTS A TERME						
	DEP EUR 0.2 12/06/25	PROPRE	50 000 000,00	50 098 640,00	EUR	0,74
	DEP EUR 0.3 06/12/24	PROPRE	45 000 000,00	46 088 498,75	EUR	0,68
	DEP EUR 0.3 15/09/24	PROPRE	50 000 000,00	51 712 365,14	EUR	0,77
Total DEPOTS A TERME				147 899 503,89		2,20
FRAIS DE GESTION						
	PRCOMGESTFIN	PROPRE	-630 623,65	-630 623,65	EUR	-0,01
	PRCOMGESTFIN	PROPRE	-159 155,93	-159 155,93	EUR	-0,00
	PRN-1COMGESTFIN	PROPRE	-1 209 122,44	-1 209 122,44	EUR	-0,02
	PRN-1COMGESTFIN	PROPRE	-280 035,31	-280 035,31	EUR	-0,00
Total FRAIS DE GESTION				-2 278 937,33		-0,03
Total Liquidites				1 154 916 747,12		17,16
Creances negociables						
Interets postcomptes.						
FR0128662055	AXA BANQUE OIEST+0.26% 13/06/2025	PROPRE	30 000 000,00	30 052 865,59	EUR	0,45
FR0128580893	BANQUE FEDERATIVE DU CRED OIEST+0.3% 01/04/2025	PROPRE	50 000 000,00	50 390 855,83	EUR	0,75

Swiss Life Funds (F) ESG Money Market Euro

Wert-Code	Wertelabel	Status Wert	Menge	Wert Markt	Notierungs- währung	%Nettove- rmögen
FR0128207208	BANQUE PALATINE SA ESTR+0.35% 27/09/2024	PROPRE	42 000 000,00	43 390 646,72	EUR	0,64
FR0128664127	BFCM OISEST+0.32% 20/06/2025	PROPRE	10 000 000,00	10 012 473,39	EUR	0,15
FR0128350214	BRED BANQUE POPULAIRE ESTR+0.26% 06/09/2024	PROPRE	45 000 000,00	46 094 144,00	EUR	0,68
FR0128662535	BRED BANQUE POPULAIRE OISEST+0.13% 17/09/2024	PROPRE	35 000 000,00	35 050 936,47	EUR	0,52
FR0128662550	BRED BANQUE POPULAIRE OISEST+0.27% 19/05/2025	PROPRE	40 000 000,00	40 057 922,66	EUR	0,60
FR0127713057	CA CONSUMER FINANCE ESTRCAP+0.78% 07/11/2024	PROPRE	25 000 000,00	25 796 432,50	EUR	0,38
FR0128659218	CAISSE FED MAINE ANJOU OISEST+0.19% 09/12/2024	PROPRE	20 000 000,00	20 052 411,17	EUR	0,30
FR0128666619	CAISSE FED MAINE ANJOU OISEST+0.25% 31/03/2025	PROPRE	5 000 000,00	5 001 630,00	EUR	0,07
FR0128104157	CRCAM ATLANTIQUE ESTR+0.33% 30/08/2024	PROPRE	30 000 000,00	31 082 668,00	EUR	0,46
FR0127954248	CRED AGRICOLE LEASING FT ESTRCAP+0.365% 05/07/2024	PROPRE	15 000 000,00	15 639 098,67	EUR	0,23
BE6348363043	KBC BANK NV ESTR+0.26% 13/09/2024	PROPRE	42 000 000,00	42 987 785,87	EUR	0,64
FR0128203074	LA CAISS FEDERALE CRDT DU ESTRCAP+0.37% 25/10/2024	PROPRE	15 000 000,00	15 452 057,16	EUR	0,23
XS2651634243	LLOYDS BANK PLC ESTR+0.41% 10/07/2024	PROPRE	24 000 000,00	25 020 261,80	EUR	0,37
FR0128659911	MAINE ANJ BAS NOR CSE FDAL OISEST+0.25% 10/03/2025	PROPRE	12 000 000,00	12 027 856,50	EUR	0,18
XS2750349917	MIZUHO INTERNATIONAL PLC ESTR+0.21% 15/07/2024	PROPRE	42 000 000,00	42 809 107,60	EUR	0,64
FR0128561604	NATIXIS OISEST+0.31% 17/03/2025	PROPRE	48 000 000,00	48 422 360,67	EUR	0,72
FR0128104264	NORD EST CAISSE REGIONALE DE ESTR+0.32% 11/09/2024	PROPRE	10 000 000,00	10 346 823,44	EUR	0,15
FR0128104074	NORMANDIE SEINE ESTRCAP+0.31% 15/07/2024	PROPRE	10 000 000,00	10 368 906,89	EUR	0,15
XS2796586712	QATAR NATIONAL BANK ESTRCAP+0.40% 30/09/2024	PROPRE	30 000 000,00	30 342 349,92	EUR	0,45
FR0128348374	SOCIETE GENERALE ESTR+0.33% 02/12/2024	PROPRE	32 000 000,00	32 817 594,67	EUR	0,49
FR0128348382	SOCIETE GENERALE ESTR+0.47% 02/06/2025	PROPRE	30 000 000,00	30 123 811,33	EUR	0,45
FR0128357193	SOCIETE GENERALE ESTR+0.50% 23/06/2025	PROPRE	40 000 000,00	40 082 881,22	EUR	0,60
XS2739639289	TORONTO DOMINION BANK OISEST+0.325% 19/12/2024	PROPRE	20 000 000,00	20 459 483,83	EUR	0,30
FR0128615103	VEOLIA ENVIRONMENT OISEST+0.30% 13/06/2025	PROPRE	24 000 000,00	24 039 930,07	EUR	0,36
Total Interets postcomptes.				737 923 295,97		10,96
Interets precomptes.						
XS2803397848	AKZO NOBEL N V ZCP 11/07/2024	PROPRE	24 000 000,00	23 975 873,41	EUR	0,36
XS2826695954	AKZO NOBEL NV ZCP 20/09/2024	PROPRE	42 000 000,00	41 640 614,30	EUR	0,62
XS2809678316	AKZO NOBEL NV ZCP 22/07/2024	PROPRE	40 000 000,00	39 914 823,16	EUR	0,59
FR0128459395	ALSTOM SA ZCP 30/09/2024	PROPRE	27 200 000,00	26 918 502,86	EUR	0,40
FR0128613884	ALSTOM ZCP 17/07/2024	PROPRE	22 000 000,00	21 961 725,85	EUR	0,33

Swiss Life Funds (F) ESG Money Market Euro

Wert-Code	Wertelabel	Status Wert	Menge	Wert Markt	Notierungs- währung %	Nettove rmögen
FR0128614825	ALSTOM ZCP 26/08/2024	PROPRE	42 000 000,00	41 744 143,31	EUR	0,62
XS2842055027	AMCOR UK FINANCE PLC ZCP 10/07/2024	PROPRE	20 000 000,00	19 980 852,13	EUR	0,30
XS2852018022	AMCOR UK FINANCE PLC ZCP 27/08/2024	PROPRE	10 000 000,00	9 942 325,15	EUR	0,15
XS2853492069	AVERY DANNISON ZCP 29/07/2024	PROPRE	12 500 000,00	12 463 104,54	EUR	0,19
XS2836714290	AVERY DENNISON TREASURY MANAGE ZCP 03/07/2024	PROPRE	30 000 000,00	29 993 757,32	EUR	0,45
BE6350063556	BRIDGESTONE EUROPE NV ZCP 26/08/2024	PROPRE	40 000 000,00	39 762 082,01	EUR	0,59
FR0128563899	CA CONSUMER FINANCE ZCP 16/04/2025	PROPRE	40 000 000,00	38 850 182,95	EUR	0,58
XS2824049238	CARLSBERG BREWERIES ZCP 11/09/2024	PROPRE	30 000 000,00	29 769 832,75	EUR	0,44
FR0128663533	CARREFOUR ZCP 20/09/2024	PROPRE	30 000 000,00	29 744 100,21	EUR	0,44
XS2853495245	COCA COLA EUROPACI ZCP 04/07/2024	PROPRE	40 000 000,00	39 987 692,74	EUR	0,59
XS2820497324	COCA COLA EUROPEAN ZCP 09/07/2024	PROPRE	16 000 000,00	15 986 937,99	EUR	0,24
FR0128665942	COMPAGNIE GENERALE DE LOCATION ZCP 27/11/2024	PROPRE	10 200 000,00	10 044 577,18	EUR	0,15
FR0128655158	COMPAGNIE GENERALE DE ZCP 31/01/2025	PROPRE	24 000 000,00	23 475 349,72	EUR	0,35
FR0128357912	COMPAGNIE GENERALE ZCP 27/09/2024	PROPRE	14 000 000,00	13 869 623,90	EUR	0,21
FR0128636794	COVIVIO HOTELS SCA ZCP 01/07/2024	PROPRE	25 000 000,00	25 000 000,00	EUR	0,37
FR0128507086	COVIVIO HOTELS SCA ZCP 08/07/2024	PROPRE	16 000 000,00	15 988 355,51	EUR	0,24
FR0128567791	COVIVIO HOTELS SCA ZCP 29/08/2024	PROPRE	16 000 000,00	15 900 504,90	EUR	0,24
FR0128638121	COVIVIO HOTELS ZCP 13/09/2024	PROPRE	22 000 000,00	21 828 095,88	EUR	0,32
FR0128666999	COVIVO HOTELS ZCP 01/10/2024	PROPRE	17 000 000,00	16 835 753,60	EUR	0,25
FR0128503796	DANONE SA ZCP 08/07/2024	PROPRE	16 000 000,00	15 988 729,33	EUR	0,24
FR0128664481	DANONE ZCP 23/12/2024	PROPRE	15 000 000,00	14 734 565,48	EUR	0,22
XS2845614739	DH EUROPE FINANCE ZCP 17/07/2024	PROPRE	15 000 000,00	14 975 084,04	EUR	0,22
XS2820609142	DXC CAPITAL FUNDING ZCP 10/07/2024	PROPRE	15 000 000,00	14 985 337,82	EUR	0,22
FR0128638915	EDENRED ZCP 27/09/2024	PROPRE	15 000 000,00	14 861 459,50	EUR	0,22
FR0128614775	ELECTRICITE DE FRANCE ZCP 10/07/2024	PROPRE	24 000 000,00	23 978 090,71	EUR	0,36
XS2834246931	ENEL FINANCE INTERNATIONAL NV ZCP 29/07/2024	PROPRE	35 000 000,00	34 894 245,86	EUR	0,52
FR0128461185	ENGIE ZCP 02/07/2024	PROPRE	105 000 000,00	104 988 942,18	EUR	1,56
FR0128661495	FRANCE D ZCP 13/09/2024	PROPRE	15 000 000,00	14 871 017,87	EUR	0,22
XS2800557279	HEWLETT PACKARD INT CDN 03/04/2025	PROPRE	12 000 000,00	11 659 728,74	EUR	0,17
XS2820610314	HEWLETT PACKARD INTERNATIONAL ZCP 09/05/2025	PROPRE	35 000 000,00	33 907 405,32	EUR	0,50
XS2794652029	HEWLETT PACKARD INTL BANK ZCP 24/03/2025	PROPRE	15 000 000,00	14 594 369,04	EUR	0,22

Swiss Life Funds (F) ESG Money Market Euro

Wert-Code	Wertelabel	Status Wert	Menge	Wert Markt	Notierungs- währung %	Nettove rmögen
XS2843274973	HEWLWTT PACKARD INT ZCP 11/06/2025	PROPRE	23 000 000,00	22 212 876,82	EUR	0,33
XS2841150662	IBERDROLA INTERNATI ZCP 10/07/2024	PROPRE	40 000 000,00	39 963 135,14	EUR	0,59
XS2843011888	IBERDROLA INTERNATIONAL ZCP 19/07/2024	PROPRE	30 000 000,00	29 944 876,55	EUR	0,44
XS2850508479	IBERDROLA INTERNATIONAL ZCP 23/09/2024	PROPRE	20 000 000,00	19 824 913,84	EUR	0,29
FR0128638626	ITM ENTREPRISES SA ZCP 24/07/2024	PROPRE	35 000 000,00	34 910 819,45	EUR	0,52
FR0128568302	ITM ENTREPRISES ZCP 08/07/2024	PROPRE	35 000 000,00	34 973 136,83	EUR	0,52
FR0128661313	JYSKE BANK ZCP 04/07/2024	PROPRE	60 000 000,00	59 981 825,72	EUR	0,89
BE6347356642	KBC GROUP NV CDN 18/10/2024	PROPRE	50 000 000,00	49 405 826,86	EUR	0,73
FR0128664937	KERING FINANCE ZCP 25/11/2024	PROPRE	55 000 000,00	54 177 019,12	EUR	0,80
FR0128638352	L OCCITANE INTERNATIONAL ZCP 17/09/2024	PROPRE	22 000 000,00	21 808 177,76	EUR	0,32
XS2847703233	LAND SECURITIES P L C ZCP 25/07/2024	PROPRE	15 000 000,00	14 963 030,00	EUR	0,22
XS2841940807	LAND SECURITIES PLC ZCP 11/07/2024	PROPRE	28 000 000,00	27 971 693,20	EUR	0,42
FR0128607241	LOC D EQUIPMENTS CIE GLE DE ZCP 06/11/2024	PROPRE	25 000 000,00	24 666 882,55	EUR	0,37
FR0128658889	LOC D EQUIPMENTS COMPA GENE DE ZCP 06/06/2025	PROPRE	22 000 000,00	21 267 121,85	EUR	0,32
XS2853498264	LSEG NETHERLANDS BV ZCP 27/08/2024	PROPRE	30 000 000,00	29 819 115,15	EUR	0,44
XS2846850910	MIZUHO BANK LTD ZCP 18/09/2024	PROPRE	35 000 000,00	34 714 066,94	EUR	0,52
XS2837736474	NATWEST MARKETS NV ZCP 03/06/2025	PROPRE	40 000 000,00	38 695 721,63	EUR	0,57
FR0128609353	NEXITY ZCP 15/07/2024	PROPRE	10 000 000,00	9 983 426,32	EUR	0,15
XS2841213841	NOMURA BANK INTERNA ZCP 10/10/2024	PROPRE	50 000 000,00	49 468 339,05	EUR	0,73
XS2734745362	NOMURA BANK INTERNA ZCP 13/09/2024	PROPRE	60 000 000,00	59 514 428,95	EUR	0,88
FR0128662600	PERNOD RICARD FINANCE SA ZCP 17/10/2024	PROPRE	12 000 000,00	11 865 964,68	EUR	0,18
XS2847690158	RELX INVESTMENTS ZCP 03/07/2024	PROPRE	24 000 000,00	23 994 920,17	EUR	0,36
FR0128660182	RTE RESEAU DE TRANS ZCP 10/09/2024	PROPRE	8 000 000,00	7 941 108,04	EUR	0,12
XS2662654339	SANTANDER CONSUMER BANK ZCP 29/07/2024	PROPRE	32 000 000,00	31 900 944,32	EUR	0,47
XS2785683850	SANTANDER CONSUMER ZCP 11/03/2025	PROPRE	30 000 000,00	29 207 623,69	EUR	0,43
XS2676393296	SANTANDER CONSUMER ZCP 28/08/2024	PROPRE	30 000 000,00	29 807 835,82	EUR	0,44
XS2845612527	SGS NEDERLAND HOLDING B V ZCP 17/10/2024	PROPRE	34 000 000,00	33 586 829,15	EUR	0,50
XS2802740899	SGS NEDERLAND HOLDING BV ZCP 10/07/2024	PROPRE	36 000 000,00	35 964 640,78	EUR	0,53
XS2833333458	SGS NEDERLAND HOLDING BV ZCP 29/08/2024	PROPRE	50 000 000,00	49 669 799,20	EUR	0,74
XS2842067030	SNAM SPA ZCP 11/10/2024	PROPRE	28 000 000,00	27 700 472,56	EUR	0,41
XS2825596682	SNAM SPA ZCP 16/05/2025	PROPRE	24 000 000,00	23 240 400,09	EUR	0,35

Swiss Life Funds (F) ESG Money Market Euro

Wert-Code	Wertelabel	Status Wert	Menge	Wert Markt	Notierungs- währung	%Nettove- rmögen
FR0128352186	SONEPAR SA ZCP 10/12/2024	PROPRE	35 000 000,00	34 349 837,11	EUR	0,51
XS2838519747	STANLEY BLACK AND DECKER INC ZCP 03/07/2024	PROPRE	16 000 000,00	15 996 572,92	EUR	0,24
FR0128462654	SVENSKA HANDELSBANKEN AB ZCP 15/10/2024	PROPRE	35 000 000,00	34 617 957,35	EUR	0,51
FR0128460419	THALES ZCP 15/07/2024	PROPRE	20 000 000,00	19 971 278,64	EUR	0,30
FR0128654995	UNIVERSAL MUSCI GROUP NV ZCP 30/08/2024	PROPRE	20 000 000,00	19 872 134,16	EUR	0,30
FR0128633981	UNIVERSAL MUSIC N V GROUP ZCP 29/11/2024	PROPRE	33 180 000,00	32 654 169,23	EUR	0,49
Total Interets precomptes.				2 060 626 708,90		30,61
Taux revisable						
FR0127006031	ALLIANZ BANQUE E3R+0.27% 27/08/2024	PROPRE	10 000 000,00	10 040 704,92	EUR	0,15
FR0127654574	ALLIANZ BANQUE E3R+0.31% 17/10/2024	PROPRE	10 000 000,00	10 090 629,33	EUR	0,15
FR0128569649	ALLIANZ BANQUE E3R+0.38% 24/04/2026	PROPRE	10 000 000,00	10 087 423,16	EUR	0,15
FR0127009738	ALLIANZ BANQUE SA E3R+0.28% 13/09/2024	PROPRE	10 000 000,00	10 021 696,28	EUR	0,15
FR0127715219	ALLIANZ BANQUE SA E3R+0.31% 14/11/2024	PROPRE	10 000 000,00	10 059 630,00	EUR	0,15
FR0127485862	ALLIANZ BANQUE SA E3R+0.43% 08/07/2024	PROPRE	15 000 000,00	15 151 925,67	EUR	0,23
FR0127560706	AXA BANQUE E3R+0.18% 09/08/2024	PROPRE	28 000 000,00	28 163 349,05	EUR	0,42
FR0127584086	AXA BANQUE E3R+0.26% 09/09/2024	PROPRE	30 000 000,00	30 071 070,83	EUR	0,45
FR0128200781	BANQUE STELLANTIS FRANCE E3R+0.52 19/03/2025	PROPRE	25 000 000,00	25 054 996,45	EUR	0,37
FR0127439869	CA CONSUMER FINANCE E3R+0.43% 16/06/2025	PROPRE	20 000 000,00	20 069 516,67	EUR	0,30
FR0127533760	CARREFOUR BANQUE E3R+0.65% 11/10/2024	PROPRE	40 000 000,00	40 440 758,00	EUR	0,60
FR0127688531	CARREFOUR BANQUE E3R+0.65% 20/09/2024	PROPRE	25 000 000,00	25 048 512,78	EUR	0,37
FR0127587618	EIFFAGE E3R+1% 16/09/2024	PROPRE	30 000 000,00	30 059 116,75	EUR	0,45
FR0127716217	EIFFAGE E3R+1.1% 15/11/2024	PROPRE	38 000 000,00	38 371 249,66	EUR	0,57
FR0127815886	EIFFAGE E3R+1.2% 20/01/2025	PROPRE	24 000 000,00	24 246 088,27	EUR	0,36
FR0128193895	LA CAISS FEDERALE CRDT DU E3R+0.45% 05/09/2025	PROPRE	10 000 000,00	10 037 699,88	EUR	0,15
FR0128359033	LA CAISS FEDERALE CRDT DU E3R+0.50% 02/01/2026	PROPRE	25 000 000,00	25 316 750,00	EUR	0,38
FR0128190743	LA CAISS FEDERALE CRDT DU E3R+0.51% 29/08/2025	PROPRE	20 000 000,00	20 090 087,78	EUR	0,30
FR0127562785	ORANGE BANK E3R+0.75% 19/08/2024	PROPRE	20 000 000,00	20 114 901,89	EUR	0,30
FR0127592246	ORANGE BANK E3R+0.75% 23/09/2024	PROPRE	10 000 000,00	10 014 542,11	EUR	0,15
FR0127578856	ORANGE BANK SA E3R+0.75% 23/08/2024	PROPRE	10 000 000,00	10 053 782,30	EUR	0,15
FR0127847764	SEB SA E3R+0.90% 03/04/2025	PROPRE	21 000 000,00	21 248 784,67	EUR	0,32
FR0127714220	SOCRAM BANQUE E3R+0.65% 08/11/2024	PROPRE	10 000 000,00	10 079 730,83	EUR	0,15

Swiss Life Funds (F) ESG Money Market Euro

Wert-Code	Wertelabel	Status Wert	Menge	Wert Markt	Notierungs- währung %	Nettove- rmögen
FR0127736587	SOCRAM BANQUE E3R+0.65% 22/11/2024	PROPRE	10 000 000,00	10 057 853,78	EUR	0,15
FR0128345149	SOCRAM BANQUE E3R+0.7% 28/11/2025	PROPRE	10 000 000,00	10 061 773,62	EUR	0,15
Total Taux revisable				474 052 574,68		7,04
Total Creances negociables				3 272 602 579,55		48,61
Total Swiss Life Funds (F) ESG Money Market Euro				6 731 736 816,21		100,00

*Wir ermöglichen Kunden,
nach ihren eigenen
Vorstellungen zu leben.*

Swiss Life Asset Managers France
153, rue Saint-Honoré
75001 Paris

Sitz:
Tour la Marseillaise
2 bis, boulevard Euroméditerranée
Quai d'Arenc - CS 50575
13236 Marseille Cedex 02

fr.swisslife-am.com

Société Anonyme mit einem
Gesellschaftskapital von 671 167 €
499 320 059 R.C.S. Marseille
Portfolioverwaltungsgesellschaft
AMF-Zulassung Nr. GP 07000055
Gewerbeausweis Nr. A12-5387
Garantiekasse CEGC
16, rue Hoche, Tour Kupka B, TSA 39999,
92919 La Défense Cedex