

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

*Halbjahresbericht vom 30.06.2026*

**Aktueller Vermögenswert**

| <b>Aktueller Vermögenswert</b>                                                                                                                                   | <i>Fondswährung des OGAW: EUR</i> | <b>Betrag zum periodischen Rechnungsschluss</b> |
|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-----------------------------------|-------------------------------------------------|
| 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 |                                   | 6 540 510 414,50                                |
| b) Bankguthaben                                                                                                                                                  |                                   | 774 390 680,08                                  |
| c) Sonstige Aktiva des OGAW                                                                                                                                      |                                   | 978 046 766,97                                  |
| d) Aktiva des OGAW gesamt (Summe a+b+c)                                                                                                                          |                                   | <b>8 292 947 861,55</b>                         |
| e) Passiva                                                                                                                                                       |                                   | -36 603 674,15                                  |
| f) Nettoinventarwert (Summe d+e = OGAW-Nettovermögen)                                                                                                            |                                   | <b>8 256 344 187,40</b>                         |

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

| <b>Anteile oder Aktien</b> | <b>Anzahl der Anteile oder Aktien in Umlauf</b> | <i>Währung<br/>Anteile<br/>oder<br/>Aktien</i> | <b>Nettoinventarwert pro Anteil oder Aktie (Liquidationswert)</b> |
|----------------------------|-------------------------------------------------|------------------------------------------------|-------------------------------------------------------------------|
| I1 AKTIEN / FR0010089649   | 261 143,618                                     | EUR                                            | 27 536,59                                                         |
| P AKTIEN / FR0010540385    | 4 463 854,81                                    | EUR                                            | 118,476                                                           |
| I2 AKTIEN / FR001400OU77   | 51 519,00                                       | EUR                                            | 10 409,17                                                         |
| I3 AKTIEN / FR001400ZAY6   | 20,00                                           | EUR                                            | 10 239,88                                                         |

## 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.                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                        | 79,22         | 78,87          |
| 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                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                        | 10,58         | 10,53          |

## Verteilung der Anlagewerte nach Währung sortiert

| Währungen (die 10 wichtigsten Währungen) | Betrag<br>In der Fondswährung des<br>OGAW | Prozentsatz   |                |
|------------------------------------------|-------------------------------------------|---------------|----------------|
|                                          | EUR                                       | Nettovermögen | Gesamtvermögen |
| EUR                                      | 6 540 510 414,50                          | 79,22         | 78,87          |
| -                                        | -                                         | -             | -              |
| -                                        | -                                         | -             | -              |
| -                                        | -                                         | -             | -              |
| -                                        | -                                         | -             | -              |
| -                                        | -                                         | -             | -              |
| -                                        | -                                         | -             | -              |
| -                                        | -                                         | -             | -              |
| -                                        | -                                         | -             | -              |
| -                                        | -                                         | -             | -              |
| Sonstige Währungen                       | -                                         | -             | -              |
| <b>Gesamt</b>                            | <b>6 540 510 414,50</b>                   | <b>79,22</b>  | <b>78,87</b>   |

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

| Land (die 10 wichtigsten Länder) | Prozentsatz   |                |
|----------------------------------|---------------|----------------|
|                                  | Nettovermögen | Gesamtvermögen |
| Frankreich                       | 31,66         | 31,52          |
| Vereinigtes Königreich           | 10,84         | 10,80          |
| Niederlande                      | 8,89          | 8,85           |
| Kanada                           | 6,44          | 6,41           |
| Deutschland                      | 6,14          | 6,11           |
| Vereinigte Staaten               | 3,22          | 3,20           |
| Luxemburg                        | 2,61          | 2,60           |
| Belgien                          | 1,89          | 1,88           |
| Australien                       | 1,85          | 1,85           |
| Spanien                          | 1,83          | 1,82           |
| Sonstige Länder                  | 3,85          | 3,83           |
| <b>Gesamt</b>                    | <b>79,22</b>  | <b>78,87</b>   |

## Verteilung der Anlagewerte nach Wirtschaftssektor sortiert

| Wirtschaftssektor <i>(die 10 wichtigsten Sektoren)</i> | Prozentsatz   |                |
|--------------------------------------------------------|---------------|----------------|
|                                                        | Nettovermögen | Gesamtvermögen |
| Bankwesen                                              | 35,71         | 35,55          |
| Finanzexperte                                          | 14,46         | 14,40          |
| Immobiliendienstleistungen                             | 2,62          | 2,61           |
| Konventionelle Stromerzeugung                          | 2,57          | 2,56           |
| Schwerbau                                              | 1,83          | 1,82           |
| Diversifizierte Industriezweige                        | 1,81          | 1,80           |
| Wasserwirtschaft                                       | 1,63          | 1,62           |
| Elektrische Komponenten                                | 1,46          | 1,46           |
| Einzel- und Großhandel – Lebensmittel                  | 1,38          | 1,37           |
| Pharmazeutische Industrie                              | 1,34          | 1,33           |
| Sonstige Sektoren                                      | 14,41         | 14,35          |
| <b>Gesamt</b>                                          | <b>79,22</b>  | <b>78,87</b>   |

## Verteilung der sonstigen Anlagewerte, nach Art sortiert

| Art der Vermögenswerte                                                           | Prozentsatz   |                |
|----------------------------------------------------------------------------------|---------------|----------------|
|                                                                                  | Nettovermögen | Gesamtvermögen |
| <b>Anteile an OGA</b>                                                            | <b>10,58</b>  | <b>10,53</b>   |
| - OGAW und Äquivalente aus anderen Mitgliedstaaten der Europäischen Union        | 10,58         | 10,53          |
| - AIF und entsprechende Fonds aus anderen Mitgliedstaaten der Europäischen Union | -             | -              |
| - Sonstige OGA und Investmentfonds                                               | -             | -              |
| <b>Sonstige Vermögenswerte</b>                                                   | <b>-</b>      | <b>-</b>       |
| <b>Gesamt</b>                                                                    | <b>10,58</b>  | <b>10,53</b>   |

**Bewegungen in der Zusammensetzung des Wertpapierportfolios im Berichtszeitraum**

| Elemente des Wertpapierportfolios                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                 | Bewegungen<br>(als Betrag) |                                |
|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|----------------------------|--------------------------------|
|                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                   | Erwerb                     | Veräußerung /<br>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.                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                           | 17 339 900 927,53          | 16 365 569 430,86              |
| 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                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                        | 1 986 665 496,74           | 1 859 147 555,08               |
| <b>Gesamt im Berichtszeitraum</b>                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                 | <b>19 326 566 424,27</b>   | <b>18 224 716 985,94</b>       |

**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/Aktien | Art | Nettobetrag je Anteil | Steuer gut-schrift je Anteil | Bruttobetrag je Anteil |
|-------|------------------------------|------------------------|-----|-----------------------|------------------------------|------------------------|
| -     | -                            | -                      | -   | -                     | -                            | -                      |
| -     | -                            | -                      | -   | -                     | -                            | -                      |
| -     | -                            | -                      | -   | -                     | -                            | -                      |
| -     | -                            | -                      | -   | -                     | -                            | -                      |
| -     | -                            | -                      | -   | -                     | -                            | -                      |

## Informationen über Performancegebühren (in EUR)

| Performancegebühr (variable Kosten): Betrag und Prozentsatz der Kosten über den Zeitraum | Betrag | % |
|------------------------------------------------------------------------------------------|--------|---|
| Anteilsklasse:                                                                           |        |   |
| I1 AKTIEN / FR0010089649                                                                 | -      | - |
| P AKTIEN / FR0010540385                                                                  | -      | - |
| I2 AKTIEN / FR001400OU77                                                                 | -      | - |
| I3 AKTIEN / FR001400ZAY6                                                                 | -      | - |

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

Der Sicav hat im Berichtszeitraum keine Rückkaufdeckelungen vorgenommen.

## Liquiditätsmanagement

Die Verwaltungsgesellschaft wendet eine Richtlinie zum Liquiditätsrisikomanagement an, die darauf abzielt, eine faire Behandlung der Anteilhaber zu gewährleisten und die Fähigkeit des Sicav sicherzustellen, Rücknahmeanträgen sowohl unter normalen als auch unter angespannten Marktbedingungen nachzukommen.

Der Sicav kann gemäß seinen aufsichtsrechtlichen Unterlagen Instrumente des Liquiditätsmanagements (Liquidity Management Tools – LMT) einsetzen, insbesondere Mechanismen zur Steuerung von Rücknahmen (wie Swing Pricing, Gates oder ADL).

Die Einzelheiten zur Funktionsweise, Aktivierung und Kalibrierung dieser Instrumente sind im Verkaufsprospekt des Sicav beschrieben.

### In Artikel 10 vorgesehene Ausnahmeregelung:

Dieser Artikel gestattet ausnahmsweise die Annahme von Vermögenswerten im Rahmen einer Pensionsgeschäftsvereinbarung (Repo), die diese Merkmale nicht erfüllen (z. B. Wertpapiere mit einer Restlaufzeit von mehr als 397 Tagen), sofern:

- die Vereinbarung zeitlich befristet ist und durch hochwertige Vermögenswerte besichert wird;
- der Geldmarktfonds (MMF) Liquidität und Sicherheit wahrt.

Im Berichtszeitraum hat die SICAV im Rahmen von Pensionsgeschäftsvereinbarungen nicht von der in Artikel 10 der Verordnung (EU) 2017/1131 vorgesehenen Ausnahmeregelung Gebrauch gemacht.

### Informationen zu den Finanzierungstransaktionen mit Wertpapieren und Gesamtrenditeswaps (TRS) am 30/06/2026:

Der Fonds 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 Gesamttrenditeswaps jeweils einzeln und aufgeschlüsselt nach den folgenden Kategorien :**

|                                                                                                                                                                                                                                                                                                           | Finanzierungstransaktionen<br>mit Wertpapieren | Gesamttrenditeswap |
|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|------------------------------------------------|--------------------|
| Art und Qualität der Sicherheiten (kollateral)                                                                                                                                                                                                                                                            | Keine                                          | Keine              |
| 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 Gesamttrenditeswaps, 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<br>mit Wertpapieren | Gesamttrenditeswap |
|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|------------------------------------------------|--------------------|
| 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 Gesamttrenditeswaps 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<br>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 30.06.2026

| Wert-Code                 | Wertelabel                            | Status Wert | Menge         | Wert Markt    | Notierungs-<br>währung | %Nettove-<br>rmögen |
|---------------------------|---------------------------------------|-------------|---------------|---------------|------------------------|---------------------|
| <b>Valeurs mobilières</b> |                                       |             |               |               |                        |                     |
| <b>Obligation</b>         |                                       |             |               |               |                        |                     |
| XS3045692129              | ABN AMRO BANK NV FRN 09/04/2027       | PROPRE      | 15 000 000,00 | 15 113 075,00 | EUR                    | 0,18                |
| XS3009627939              | ABN AMRO BANK NV FRN 25/02/2027       | PROPRE      | 32 600 000,00 | 32 720 457,00 | EUR                    | 0,40                |
| XS2487054004              | ABN AMRO BANK NV 2.375% 01/06/2027    | PROPRE      | 11 000 000,00 | 10 987 976,85 | EUR                    | 0,13                |
| FR0013505625              | AEROPORTS DE PARIS 2.125% 02/10/2026  | PROPRE      | 10 000 000,00 | 10 143 573,97 | EUR                    | 0,12                |
| FR0014000457              | ALD SA 3.875% 22/02/2027              | PROPRE      | 20 000 000,00 | 20 430 980,82 | EUR                    | 0,25                |
| XS3084345167              | AMERICAN HONDA FINANCE FRN 28/05/2027 | PROPRE      | 10 000 000,00 | 10 034 866,67 | EUR                    | 0,12                |
| XS2384269101              | AYVENS BANK N.V. 0.25% 07/09/2026     | PROPRE      | 2 000 000,00  | 1 995 654,79  | EUR                    | 0,02                |
| FR0014015EN7              | BANQ FED CRD MUTUEL 14/01/2028        | PROPRE      | 20 000 000,00 | 20 117 225,56 | EUR                    | 0,24                |
| FR001400SJ03              | BANQUE FED CRED MUTUEL FRN 12/09/2026 | PROPRE      | 20 000 000,00 | 20 036 470,00 | EUR                    | 0,24                |
| XS3351236206              | BARCLAYS BANK PLC FRN 12/05/2028      | PROPRE      | 40 000 000,00 | 40 146 560,00 | EUR                    | 0,49                |
| XS3386020732              | BARCLAYS BANK PLC FRN 12/06/2028      | PROPRE      | 35 000 000,00 | 35 112 550,20 | EUR                    | 0,43                |
| XS3405674980              | BARCLAYS BANK PLC FRN 17/06/2028      | PROPRE      | 25 450 000,00 | 25 491 554,90 | EUR                    | 0,31                |
| BE6355573369              | BELFIUS BANK SA NV FRN 17/09/2026     | PROPRE      | 20 000 000,00 | 20 025 272,78 | EUR                    | 0,24                |
| XS3178628494              | BMW FINANCE NV FRN 11/09/2027         | PROPRE      | 13 000 000,00 | 13 020 885,58 | EUR                    | 0,16                |
| XS3120975753              | BMW FINANCE NV FRN 15/07/2027         | PROPRE      | 5 000 000,00  | 5 027 247,78  | EUR                    | 0,06                |
| DE000A4D6AJ5              | BMW US CAPITAL LLC FRN 29/01/2027     | PROPRE      | 10 000 000,00 | 10 040 144,44 | EUR                    | 0,12                |
| FR0014018263              | BNP PARIBAS FRN 24/04/2028            | PROPRE      | 20 000 000,00 | 20 088 004,44 | EUR                    | 0,24                |
| FR0014007LL3              | BPCE SA VAR 14/01/2028                | PROPRE      | 10 000 000,00 | 9 905 876,71  | EUR                    | 0,12                |
| XS3277822071              | CAISS DESJARDINS FRN 21/01/2028       | PROPRE      | 20 000 000,00 | 20 118 866,67 | EUR                    | 0,24                |
| FR0128670090              | CAISSE FED OCEAN FRN 03/07/2026       | PROPRE      | 10 000 000,00 | 10 058 683,33 | EUR                    | 0,12                |
| XS2864386441              | CANADIAN IMPERIAL BANK FRN 17/07/2026 | PROPRE      | 30 000 000,00 | 30 175 516,67 | EUR                    | 0,37                |
| XS3281863574              | CANADIAN IMPERIAL BANK FRN 18/01/2028 | PROPRE      | 25 000 000,00 | 25 141 081,94 | EUR                    | 0,30                |
| XS3420476452              | CANADIAN IMPERIAL BANK FRN 23/06/2028 | PROPRE      | 36 440 000,00 | 36 462 562,43 | EUR                    | 0,44                |
| XS3129369503              | CANADIAN IMPERIAL BANK FRN 23/07/2027 | PROPRE      | 30 000 000,00 | 30 157 386,67 | EUR                    | 0,37                |
| XS3113282712              | CANADIAN IMPERIAL BANK VAR 10/07/2026 | PROPRE      | 30 000 000,00 | 30 146 566,50 | EUR                    | 0,37                |
| FR0014012SC7              | CAPGEMINI SE FRN 25/09/2027           | PROPRE      | 27 000 000,00 | 27 001 470,00 | EUR                    | 0,33                |

# Swiss Life Funds (F) ESG Money Market Euro

| Wert-Code    | Wertelabel                                | Status Wert | Menge         | Wert Markt    | Notierungs-<br>währung % | Nettove-<br>rmögen |
|--------------|-------------------------------------------|-------------|---------------|---------------|--------------------------|--------------------|
| XS3090072391 | CATERPILLAR FINL SERVICE FRN 10/06/2027   | PROPRE      | 37 500 000,00 | 37 617 062,50 | EUR                      | 0,46               |
| XS3300372029 | CATERPILLAR FINL SERVICE FRN 25/02/2028   | PROPRE      | 30 000 000,00 | 30 081 450,00 | EUR                      | 0,36               |
| XS2982340254 | CENTRAL BANKS OF SAVINGS FRN 22/01/2027   | PROPRE      | 20 000 000,00 | 20 161 653,33 | EUR                      | 0,24               |
| XS2723549528 | CIE DE SAINT GOBAIN SA 3.75% 29/11/2026   | PROPRE      | 5 600 000,00  | 5 741 923,95  | EUR                      | 0,07               |
| XS3085615345 | COCA COLA EUROPACIFIC FRN 03/06/2027      | PROPRE      | 10 000 000,00 | 10 032 487,50 | EUR                      | 0,12               |
| XS3303514031 | COCA COLA EUROPACIFIC FRN 26/02/2028      | PROPRE      | 11 000 000,00 | 11 032 602,78 | EUR                      | 0,13               |
| XS3352082344 | DANAHER CORP FRN 29/04/2028               | PROPRE      | 12 000 000,00 | 12 071 114,00 | EUR                      | 0,15               |
| FR00140127V8 | DANONE SA FRN 08/09/2027                  | PROPRE      | 16 000 000,00 | 16 028 116,44 | EUR                      | 0,19               |
| DE000A460NY9 | DBOERS FLOAT 11/05/27                     | PROPRE      | 11 400 000,00 | 11 437 070,27 | EUR                      | 0,14               |
| XS2932830958 | DSV FINANCE BV FRN 06/11/2026             | PROPRE      | 25 600 000,00 | 25 725 312,00 | EUR                      | 0,31               |
| XS2932831766 | DSV FINANCE BV 2.875% 06/11/2026          | PROPRE      | 42 400 000,00 | 43 211 071,34 | EUR                      | 0,52               |
| FR0013213295 | ELECTRICITE DE FRANCE SA 1.00% 13/10/2026 | PROPRE      | 10 000 000,00 | 10 029 532,88 | EUR                      | 0,12               |
| FR0014016LW1 | ELECTRICITE 2.343% 04/03/2028             | PROPRE      | 16 000 000,00 | 16 039 073,78 | EUR                      | 0,19               |
| XS2972906064 | FED CAISSES DESJARDINS FRN 14/01/2027     | PROPRE      | 58 400 000,00 | 58 821 284,62 | EUR                      | 0,71               |
| XS3363263115 | GOLDMAN SACHS FIN C INTL FRN 28/05/2028   | PROPRE      | 40 000 000,00 | 40 186 177,78 | EUR                      | 0,49               |
| XS2406914346 | HIGHLAND HOLDINGS SARL 0.318% 15/12/2026  | PROPRE      | 34 199 000,00 | 33 891 083,45 | EUR                      | 0,41               |
| XS3289845631 | IBM CORP FRN 03/02/2028                   | PROPRE      | 5 000 000,00  | 5 021 029,58  | EUR                      | 0,06               |
| XS2697966690 | ING BANK NV FRN 02/10/2026                | PROPRE      | 6 000 000,00  | 6 048 248,50  | EUR                      | 0,07               |
| XS3371718266 | ING BANK NV FRN 12/05/2028                | PROPRE      | 36 000 000,00 | 36 176 262,00 | EUR                      | 0,44               |
| XS3299556996 | KBC IFIMA SA FRN 24/02/2028               | PROPRE      | 22 500 000,00 | 22 565 812,50 | EUR                      | 0,27               |
| XS3308585242 | KONINKIJE AHOLD DLHAIZE FRN 12/03/2028    | PROPRE      | 14 200 000,00 | 14 233 419,70 | EUR                      | 0,17               |
| XS2989575589 | LEASYS SPA FRN 29/01/2027                 | PROPRE      | 25 000 000,00 | 25 151 819,44 | EUR                      | 0,30               |
| FR0129628386 | LEGRAND FRANCE SA FRN 03/03/2028          | PROPRE      | 8 500 000,00  | 8 518 668,13  | EUR                      | 0,10               |
| FR0129363463 | LEGRAND FRANCE SA FRN 06/10/2027          | PROPRE      | 16 000 000,00 | 16 096 773,33 | EUR                      | 0,19               |
| FR0129762094 | LEGRAND FRANCE SA FRN 23/06/2028          | PROPRE      | 20 000 000,00 | 20 011 227,78 | EUR                      | 0,24               |
| XS3370292644 | LINDE PLC FRN 13/05/2028                  | PROPRE      | 22 400 000,00 | 22 502 218,67 | EUR                      | 0,27               |
| FR00140159W9 | L'OREAL SA FRN 12/01/2028                 | PROPRE      | 15 000 000,00 | 15 072 475,00 | EUR                      | 0,18               |
| FR0014014A20 | L'OREAL SA FRN 19/11/2027                 | PROPRE      | 15 400 000,00 | 15 437 226,93 | EUR                      | 0,19               |
| XS2963566380 | MACQUARIE BANK LTD FRN 18/12/2026         | PROPRE      | 25 000 000,00 | 25 057 358,33 | EUR                      | 0,30               |
| XS3233868119 | MACQUARIE BANK LTD FRN 19/11/2027         | PROPRE      | 20 000 000,00 | 20 075 046,67 | EUR                      | 0,24               |
| XS3103548056 | MACQUARIE BANK LTD FRN 25/06/2027         | PROPRE      | 25 000 000,00 | 25 048 937,50 | EUR                      | 0,30               |

# Swiss Life Funds (F) ESG Money Market Euro

| Wert-Code    | Wertelabel                               | Status Wert | Menge         | Wert Markt    | Notierungs- währung | %Nettove rmögen |
|--------------|------------------------------------------|-------------|---------------|---------------|---------------------|-----------------|
| XS3278767911 | MACQUARIE BANK LTD VAR 22/01/2027        | PROPRE      | 25 000 000,00 | 25 104 006,25 | EUR                 | 0,30            |
| XS3429235933 | MACQUARIE BK LTD FRN 02/07/2028          | PROPRE      | 20 000 000,00 | 19 998 800,00 | EUR                 | 0,24            |
| XS2105735935 | MACQUARIE GROUP LTD 0.625% 03/02/2027    | PROPRE      | 12 755 000,00 | 12 635 193,86 | EUR                 | 0,15            |
| DE000A4EUY77 | MERCEDES BENZ INT FINCE FRN 19/05/2028   | PROPRE      | 40 000 000,00 | 40 115 093,33 | EUR                 | 0,49            |
| XS3076324030 | MET LIFE GLOB FRN 21/05/2027             | PROPRE      | 13 300 000,00 | 13 360 130,78 | EUR                 | 0,16            |
| XS3280338107 | NATIONAL BANK CANADA FRN 23/01/2028      | PROPRE      | 32 000 000,00 | 32 156 821,33 | EUR                 | 0,39            |
| XS3181623797 | NATIONAL BANK OF CANADA FRN 15/09/2027   | PROPRE      | 15 000 000,00 | 15 025 168,75 | EUR                 | 0,18            |
| XS3253240827 | NATIONAL BANK OF CANADA FRN 16/12/2027   | PROPRE      | 30 000 000,00 | 30 048 866,67 | EUR                 | 0,36            |
| XS3120962850 | NATIONAL BANK OF CANADA VAR 07/08/2026   | PROPRE      | 30 000 000,00 | 30 104 007,00 | EUR                 | 0,36            |
| XS3273007768 | NATIONAL BANK OF CANADA VAR 12/02/2027   | PROPRE      | 40 000 000,00 | 40 116 400,22 | EUR                 | 0,49            |
| XS3296848735 | NATIONAL BANK OF CANADA 13/02/2028       | PROPRE      | 30 000 000,00 | 30 107 560,00 | EUR                 | 0,36            |
| XS3068753451 | NATIONWIDE BLDG SOCIETY FRN 09/05/2027   | PROPRE      | 20 000 000,00 | 20 118 008,89 | EUR                 | 0,24            |
| XS2710354544 | NATIONWIDE BLDG SOCIETY 4.50% 01/11/2026 | PROPRE      | 30 000 000,00 | 31 077 669,86 | EUR                 | 0,38            |
| XS3106532412 | NATWEST MARKETS NV FRN 30/06/2027        | PROPRE      | 8 000 000,00  | 8 012 400,00  | EUR                 | 0,10            |
| XS3429326815 | NATWEST MARKETS NV FRN 30/06/2028        | PROPRE      | 12 500 000,00 | 12 503 875,00 | EUR                 | 0,15            |
| XS3072253019 | NATWEST MARKETS PLC FRN 14/05/2027       | PROPRE      | 15 000 000,00 | 15 087 030,83 | EUR                 | 0,18            |
| XS2906229138 | NATWEST MARKETS PLC FRN 25/09/2026       | PROPRE      | 20 000 000,00 | 20 020 888,33 | EUR                 | 0,24            |
| XS3196552981 | NATWEST MARKETS PLC FRN 30/09/2027       | PROPRE      | 15 000 000,00 | 15 014 100,00 | EUR                 | 0,18            |
| XS3232920275 | NOVO NORDISK FINANCE NL FRN 20/11/2027   | PROPRE      | 5 250 000,00  | 5 260 526,10  | EUR                 | 0,06            |
| XS3002552134 | NOVO NORDISK FINANCE NL FRN 27/05/2027   | PROPRE      | 65 682 000,00 | 65 860 976,15 | EUR                 | 0,80            |
| XS3002812066 | OP CORPORATE BANK PLC FRN 19/05/2027     | PROPRE      | 20 000 000,00 | 20 086 813,33 | EUR                 | 0,24            |
| FR001400DAO4 | ORANO SA 5.375% 15/05/2027               | PROPRE      | 3 600 000,00  | 3 681 122,30  | EUR                 | 0,04            |
| FR0014013XK8 | PERNOD RICARD SA FRN 04/11/2027          | PROPRE      | 20 000 000,00 | 20 084 351,67 | EUR                 | 0,24            |
| XS2982074358 | ROYAL BANK OF CANADA FRN 04/08/2026      | PROPRE      | 19 600 000,00 | 19 681 440,18 | EUR                 | 0,24            |
| XS2931921113 | ROYAL BANK OF CANADA FRN 04/11/2026      | PROPRE      | 55 000 000,00 | 55 248 208,89 | EUR                 | 0,67            |
| XS3031467171 | ROYAL BANK OF CANADA FRN 24/03/2027      | PROPRE      | 55 700 000,00 | 55 816 440,85 | EUR                 | 0,68            |
| XS3373518086 | ROYAL BANK OF CANADA VAR 13/05/2027      | PROPRE      | 29 600 000,00 | 29 674 820,91 | EUR                 | 0,36            |
| FR001400Y1H8 | SANOFI FRN 11/03/2027                    | PROPRE      | 3 300 000,00  | 3 307 328,48  | EUR                 | 0,04            |
| XS3393867224 | SAP SE FRN 03/06/2028                    | PROPRE      | 21 600 000,00 | 21 670 383,60 | EUR                 | 0,26            |
| FR0014012CL2 | SCHNEIDER ELECTRIC SE FRN 02/09/2027     | PROPRE      | 24 000 000,00 | 24 046 042,67 | EUR                 | 0,29            |
| XS3078501767 | SIEMENS FINANCIERINGSMAT FRN 27/05/2027  | PROPRE      | 5 000 000,00  | 5 016 874,44  | EUR                 | 0,06            |

# Swiss Life Funds (F) ESG Money Market Euro

| Wert-Code                       | Wertelabel                                | Status Wert | Menge         | Wert Markt              | Notierungs-<br>währung | %Nettove-<br>rmögen |
|---------------------------------|-------------------------------------------|-------------|---------------|-------------------------|------------------------|---------------------|
| XS2616008541                    | SIKA CAPITAL BV 3.75% 03/11/2026          | PROPRE      | 14 120 000,00 | 14 504 696,50           | EUR                    | 0,18                |
| FR0014006XA3                    | SOCIETE GENERALE VAR 02/12/2027           | PROPRE      | 5 900 000,00  | 5 871 124,75            | EUR                    | 0,07                |
| FR001400KZP3                    | SOCIETE GENERALE 4.25% 28/09/2026         | PROPRE      | 22 500 000,00 | 23 313 612,33           | EUR                    | 0,28                |
| XS2919743927                    | STANDARD CHARTERED BANK FRN 15/10/2026    | PROPRE      | 20 000 000,00 | 20 113 146,67           | EUR                    | 0,24                |
| XS3245582419                    | SWEDBANK AB FRN 03/12/2027                | PROPRE      | 25 000 000,00 | 25 055 218,75           | EUR                    | 0,30                |
| XS3099153051                    | SWISSCOM FINANCE FRN 30/06/2027           | PROPRE      | 14 400 000,00 | 14 404 320,00           | EUR                    | 0,17                |
| XS2898732289                    | TORONTO DOMINION BANK FRN 10/09/2027      | PROPRE      | 3 900 000,00  | 3 918 245,50            | EUR                    | 0,05                |
| XS3391754549                    | TOYOTA FINANCE AUSTRALIA FRN 01/06/2028   | PROPRE      | 25 000 000,00 | 25 052 825,69           | EUR                    | 0,30                |
| XS3239180071                    | UBS AG LONDON FRN 21/11/2027              | PROPRE      | 20 000 000,00 | 20 081 035,56           | EUR                    | 0,24                |
| FR0014000UC8                    | UNIBAIL RODAMCO WESTFLD 0.625% 04/05/2027 | PROPRE      | 18 000 000,00 | 17 681 868,49           | EUR                    | 0,21                |
| IT0005717902                    | UNICREDIT SPA FRN 25/06/2028              | PROPRE      | 42 000 000,00 | 42 018 655,00           | EUR                    | 0,51                |
| XS3177018457                    | UNILEVER CAPITAL CORP FRN 05/09/2027      | PROPRE      | 25 000 000,00 | 25 029 253,47           | EUR                    | 0,30                |
| FR0014016QP4                    | VILOGIA SA HLM FRN 09/03/2028             | PROPRE      | 31 500 000,00 | 31 489 799,25           | EUR                    | 0,38                |
| XS3026747876                    | VOLVO TREASURY AB FRN 17/03/2027          | PROPRE      | 30 000 000,00 | 30 058 225,83           | EUR                    | 0,36                |
| DE000A2R8ND3                    | VONOVIA FINANCE BV 0.625% 07/10/2027      | PROPRE      | 4 000 000,00  | 3 905 099,18            | EUR                    | 0,05                |
| XS3344378339                    | VONOVIA SE FRN 20/04/2028                 | PROPRE      | 40 000 000,00 | 40 258 691,11           | EUR                    | 0,49                |
| <b>Total Obligation</b>         |                                           |             |               | <b>2 271 621 221,13</b> |                        | <b>27,51</b>        |
| <b>O.P.C.V.M.</b>               |                                           |             |               |                         |                        |                     |
| FR0007045109                    | ARKEA SUPPORT MONETAIRE FCP               | PROPRE      | 21 000,00     | 244 965 840,00          | EUR                    | 2,97                |
| FR0013067790                    | BFT AUREUS ISR FCP                        | PROPRE      | 29 000,00     | 317 378 610,00          | EUR                    | 3,84                |
| FR0010216804                    | BNP PARIBAS INVEST 3M SUSTAINABLE FCP     | PROPRE      | 460,00        | 296 597 361,58          | EUR                    | 3,59                |
| FR0013113222                    | CANDRIAM MONETAIRE SICAV                  | PROPRE      | 100,00        | 11 049 700,00           | EUR                    | 0,13                |
| FR0013368065                    | CM AM MONEPLUS FCP                        | PROPRE      | 25,00         | 2 956 012,50            | EUR                    | 0,04                |
| FR0010885236                    | OSTRUM SRI MONEY PLUS FCP                 | PROPRE      | 5,00          | 568 832,35              | EUR                    | 0,01                |
| <b>Total O.P.C.V.M.</b>         |                                           |             |               | <b>873 516 356,43</b>   |                        | <b>10,58</b>        |
| <b>Total Valeurs mobilières</b> |                                           |             |               | <b>3 145 137 577,56</b> |                        | <b>38,09</b>        |
| <b>Swap de Taux</b>             |                                           |             |               |                         |                        |                     |
| SWAP04353527                    | 2559414192#\$_2026092                     | PROPRE      | 22 500 000,00 | -295 517,92             | EUR                    | -0,00               |
| SWAP04441631                    | 2587976702#\$_2026110                     | PROPRE      | 42 400 000,00 | -53 778,81              | EUR                    | -0,00               |
| SWAP04590827                    | 2640443342                                | PROPRE      | 5 600 000,00  | 3 241,24                | EUR                    | 0,00                |
| SWAP04694976                    | 2767362612                                | PROPRE      | 30 000 000,00 | 115 262,61              | EUR                    | 0,00                |

# Swiss Life Funds (F) ESG Money Market Euro

| Wert-Code                     | Wertelabel           | Status Wert | Menge          | Wert Markt          | Notierungs-<br>währung | %Nettome-<br>rmögen |
|-------------------------------|----------------------|-------------|----------------|---------------------|------------------------|---------------------|
| SWAP04761573                  | 2847435262           | PROPRE      | 25 000 000,00  | 167 270,43          | EUR                    | 0,00                |
| SWAP04825947                  | 2922140392           | PROPRE      | 11 000 000,00  | 54 131,26           | EUR                    | 0,00                |
| SWAP04923396                  | 3014287852           | PROPRE      | 12 000 000,00  | 34 162,99           | EUR                    | 0,00                |
| SWAP04943111                  | 3022824912           | PROPRE      | 5 900 000,00   | 10 204,70           | EUR                    | 0,00                |
| SWAP04947284                  | 3028645952           | PROPRE      | 40 000 000,00  | 97 060,12           | EUR                    | 0,00                |
| SWAP04947544                  | 3030821072           | PROPRE      | 12 755 000,00  | 34 204,65           | EUR                    | 0,00                |
| SWAP04976263                  | 3037751222           | PROPRE      | 40 000 000,00  | 101 229,86          | EUR                    | 0,00                |
| SWAP04988897                  | 3062474182           | PROPRE      | 8 000 000,00   | 22 388,18           | EUR                    | 0,00                |
| SWAP05019517                  | 3130746812           | PROPRE      | 20 000 000,00  | -19 985,25          | EUR                    | -0,00               |
| SWAP05019520                  | 3130955642           | PROPRE      | 30 000 000,00  | -27 000,98          | EUR                    | -0,00               |
| SWAP05020039                  | 3139001562           | PROPRE      | 28 000 000,00  | -10 910,06          | EUR                    | -0,00               |
| SWAP05020041                  | 3139261592           | PROPRE      | 20 000 000,00  | -5 333,33           | EUR                    | -0,00               |
| SWAP05020038                  | 3139344452           | PROPRE      | 20 000 000,00  | 1 881,42            | EUR                    | 0,00                |
| SWAP05025199                  | 3143621812           | PROPRE      | 30 000 000,00  | -17 195,48          | EUR                    | -0,00               |
| SWAP05027225                  | 3145885212           | PROPRE      | 4 000 000,00   | -3 431,94           | EUR                    | -0,00               |
| SWAP05028269                  | 3147059742           | PROPRE      | 16 000 000,00  | -13 085,44          | EUR                    | -0,00               |
| SWAP05030358                  | 3157247962           | PROPRE      | 50 000 000,00  | -44 547,51          | EUR                    | -0,00               |
| SWAP05030356                  | 3157289652           | PROPRE      | 25 000 000,00  | -21 777,43          | EUR                    | -0,00               |
| SWAP05033046                  | 3173824192           | PROPRE      | 10 000 000,00  | -12 092,07          | EUR                    | -0,00               |
| SWAP05034189                  | 3180235552           | PROPRE      | 40 000 000,00  | -15 976,55          | EUR                    | -0,00               |
| SWAP05034777                  | 3195722172           | PROPRE      | 40 000 000,00  | -53 114,98          | EUR                    | -0,00               |
| SWAP05034879                  | 3200664372           | PROPRE      | 18 000 000,00  | -13 577,19          | EUR                    | -0,00               |
| <b>Total Swap de Taux</b>     |                      |             |                | <b>33 712,52</b>    |                        | <b>0,00</b>         |
| <b>Liquidites</b>             |                      |             |                |                     |                        |                     |
| <b>APPELS DE MARGES</b>       |                      |             |                |                     |                        |                     |
|                               | APPEL DE MARGE EUR   | PROPRE      | -33 712,47     | -33 712,47          | EUR                    | -0,00               |
| <b>Total APPELS DE MARGES</b> |                      |             |                | <b>-33 712,47</b>   |                        | <b>-0,00</b>        |
| <b>AUTRES</b>                 |                      |             |                |                     |                        |                     |
|                               | PROV INTCREDIPTDEPCE | PROPRE      | 1 144 519,28   | 1 144 519,28        | EUR                    | 0,01                |
| <b>Total AUTRES</b>           |                      |             |                | <b>1 144 519,28</b> |                        | <b>0,01</b>         |
| <b>BANQUE OU ATTENTE</b>      |                      |             |                |                     |                        |                     |
|                               | ACH DIFF TITRES EUR  | PROPRE      | -34 920 599,40 | -34 920 599,40      | EUR                    | -0,42               |

# Swiss Life Funds (F) ESG Money Market Euro

| Wert-Code                        | Wertelabel                                        | Status Wert | Menge          | Wert Markt            | Notierungs-<br>währung | %Nettome-<br>rmögen |
|----------------------------------|---------------------------------------------------|-------------|----------------|-----------------------|------------------------|---------------------|
|                                  | BANQUE EUR BNP                                    | PROPRE      | -34 213,74     | -34 213,74            | EUR                    | -0,00               |
|                                  | BANQUE EUR SWISSLIFE                              | PROPRE      | 774 390 679,97 | 774 390 679,97        | EUR                    | 9,38                |
|                                  | BANQUE GBP SWISSLIFE                              | PROPRE      | 0,01           | 0,01                  | GBP                    | 0,00                |
|                                  | BANQUE USD SWISSLIFE                              | PROPRE      | 0,12           | 0,10                  | USD                    | 0,00                |
| <b>Total BANQUE OU ATTENTE</b>   |                                                   |             |                | <b>739 435 866,94</b> |                        | <b>8,96</b>         |
| <b>DEPOSIT DE GARANTIE</b>       |                                                   |             |                |                       |                        |                     |
|                                  | DEPOSIT OTC VERSE                                 | PROPRE      | 1 742 715,45   | 1 742 715,45          | EUR                    | 0,02                |
| <b>Total DEPOSIT DE GARANTIE</b> |                                                   |             |                | <b>1 742 715,45</b>   |                        | <b>0,02</b>         |
| <b>DEPOTS A TERME</b>            |                                                   |             |                |                       |                        |                     |
|                                  | DEP EUR 0.3 01/09/26                              | PROPRE      | 50 000 000,00  | 50 941 660,82         | EUR                    | 0,62                |
|                                  | DEP EUR 0.3 11/06/27                              | PROPRE      | 50 000 000,00  | 50 060 477,53         | EUR                    | 0,61                |
| <b>Total DEPOTS A TERME</b>      |                                                   |             |                | <b>101 002 138,35</b> |                        | <b>1,22</b>         |
| <b>FRAIS DE GESTION</b>          |                                                   |             |                |                       |                        |                     |
|                                  | PRCOMGESTFIN                                      | PROPRE      | -727 088,86    | -727 088,86           | EUR                    | -0,01               |
|                                  | PRCOMGESTFIN                                      | PROPRE      | -230 350,48    | -230 350,48           | EUR                    | -0,00               |
|                                  | PRCOMGESTFIN                                      | PROPRE      | -50 360,74     | -50 360,74            | EUR                    | -0,00               |
|                                  | PRCOMGESTFIN                                      | PROPRE      | -23,52         | -23,52                | EUR                    | -0,00               |
| <b>Total FRAIS DE GESTION</b>    |                                                   |             |                | <b>-1 007 823,60</b>  |                        | <b>-0,01</b>        |
| <b>Total Liquidites</b>          |                                                   |             |                | <b>842 283 703,95</b> |                        | <b>10,20</b>        |
| <b>Creances negociables</b>      |                                                   |             |                |                       |                        |                     |
| <b>Interets postcomptes.</b>     |                                                   |             |                |                       |                        |                     |
| FR0129550374                     | AXA BANQUE OISEST +0.24% 14/07/2026               | PROPRE      | 40 000 000,00  | 40 411 278,22         | EUR                    | 0,49                |
| FR0129550366                     | AXA BANQUE OISEST .24% 20/07/2026                 | PROPRE      | 40 000 000,00  | 40 411 561,22         | EUR                    | 0,49                |
| FR0129548725                     | AXA BANQUE OISEST+0.42% 09/07/2027                | PROPRE      | 22 000 000,00  | 22 252 765,88         | EUR                    | 0,27                |
| FR0129411957                     | BANQUE PALATINE OISEST+0.33% 25/09/2026           | PROPRE      | 40 000 000,00  | 40 711 249,34         | EUR                    | 0,49                |
| FR0129620821                     | BANQUE PALATINE OISEST+0.35% 11/02/2027           | PROPRE      | 40 000 000,00  | 40 366 993,33         | EUR                    | 0,49                |
| FR0129406643                     | BANQUE PALATINE SA OISEST+0.33% 17/09/2026        | PROPRE      | 16 000 000,00  | 16 292 675,24         | EUR                    | 0,20                |
| XS3244862242                     | BARCLAYS BANK PLC LONDON OISEST +0.35% 26/11/2026 | PROPRE      | 40 000 000,00  | 40 552 092,00         | EUR                    | 0,49                |
| FR0129382588                     | BPCE OISEST+0.31% 26/08/2026                      | PROPRE      | 20 000 000,00  | 20 390 801,66         | EUR                    | 0,25                |
| FR0129727832                     | BRED BANQUE POPULAIRE OISEST+0.37% 06/05/2027     | PROPRE      | 40 000 000,00  | 40 130 694,66         | EUR                    | 0,49                |
| FR0129517969                     | CAISSE FED OCEAN OISEST +0.31% 27/08/2026         | PROPRE      | 20 000 000,00  | 20 274 016,17         | EUR                    | 0,25                |
| FR0129416386                     | CAISSE FEDERALE OCEAN OISEST+0.33% 08/10/2026     | PROPRE      | 20 000 000,00  | 20 340 397,39         | EUR                    | 0,25                |
| FR0129317246                     | CAISSE REGIONALE DE OISEST +0.32% 11/09/2026      | PROPRE      | 10 000 000,00  | 10 186 454,64         | EUR                    | 0,12                |

# Swiss Life Funds (F) ESG Money Market Euro

| Wert-Code                          | Wertelabel                                      | Status Wert | Menge         | Wert Markt            | Notierungs- währung | %Nettove rmögen |
|------------------------------------|-------------------------------------------------|-------------|---------------|-----------------------|---------------------|-----------------|
| FR0129717932                       | CAISSE REGIONALE DE OISEST+0.36% 25/06/2027     | PROPRE      | 15 000 000,00 | 15 006 354,75         | EUR                 | 0,18            |
| FR0129317360                       | CRED AG LEASING FACTOR OISEST +0.36% 01/10/2026 | PROPRE      | 32 000 000,00 | 32 563 754,40         | EUR                 | 0,39            |
| FR0129717833                       | CREDIT AG LEASING OISEST+0.38% 31/05/2027       | PROPRE      | 30 000 000,00 | 30 077 802,50         | EUR                 | 0,36            |
| FR0129451326                       | CREDIT AGRICOLE LEASING OISEST+0.35% 31/12/2026 | PROPRE      | 40 000 000,00 | 40 420 430,33         | EUR                 | 0,49            |
| FR0129546802                       | CREDIT LYONNAIS OISEST+0.265% 31/07/2026        | PROPRE      | 50 000 000,00 | 50 549 365,42         | EUR                 | 0,61            |
| FR0129546794                       | CREDIT LYONNAIS OISEST+0.35% 31/12/2026         | PROPRE      | 50 000 000,00 | 50 570 871,67         | EUR                 | 0,61            |
| FR0129790111                       | DANNONE OISEST +0.345% 11/06/2027               | PROPRE      | 15 000 000,00 | 15 013 479,17         | EUR                 | 0,18            |
| XS3430670201                       | HSBC BANK PLC OISEST +.36% 28/06/2027           | PROPRE      | 20 000 000,00 | 20 002 824,56         | EUR                 | 0,24            |
| FR0129384527                       | LA BANQUE POSTALE OISEST + 0.31% 17/11/2026     | PROPRE      | 30 000 000,00 | 30 429 097,58         | EUR                 | 0,37            |
| FR0129763365                       | LEGRAND OISEST+0.30% 17/12/2026                 | PROPRE      | 42 000 000,00 | 42 040 542,60         | EUR                 | 0,51            |
| XS3176790098                       | LLOYDS BANK CORP OISEST+0.30% 03/09/2026        | PROPRE      | 20 000 000,00 | 20 378 033,34         | EUR                 | 0,25            |
| XS3278669745                       | MIZUHO INTERNATIONAL OISEST +0.32% 18/01/2027   | PROPRE      | 40 000 000,00 | 40 411 542,67         | EUR                 | 0,49            |
| XS3421987085                       | NATIONAL BANK OF CANADA OISEST+0.37% 17/06/2027 | PROPRE      | 20 000 000,00 | 20 017 014,00         | EUR                 | 0,24            |
| XS3302885317                       | ROYAL BANK OF CANADA OISEST +0.325% 17/02/2027  | PROPRE      | 25 000 000,00 | 25 070 296,87         | EUR                 | 0,30            |
| FR0129671568                       | SOCIETE GENERALE OISEST + 0.45% 13/09/2027      | PROPRE      | 30 000 000,00 | 30 210 358,33         | EUR                 | 0,37            |
| FR0129705846                       | SOCIETE GENERALE OISEST+0.37% 03/05/2027        | PROPRE      | 30 000 000,00 | 30 115 544,67         | EUR                 | 0,36            |
| FR0129520880                       | SOCRAM BANQUE OISEST + 0.46% 30/11/2026         | PROPRE      | 5 000 000,00  | 5 071 109,89          | EUR                 | 0,06            |
| XS3245690816                       | TORONTO DOMINION BANK OISEST+0.34% 18/12/2026   | PROPRE      | 30 000 000,00 | 30 418 752,50         | EUR                 | 0,37            |
| XS3405454946                       | UBS AG OISEST +.35% 04/06/2027                  | PROPRE      | 40 000 000,00 | 40 054 730,00         | EUR                 | 0,49            |
| FR0129727709                       | VEOLIA ENVIRONMENT OISEST+0.305% 09/11/2026     | PROPRE      | 40 000 000,00 | 40 137 435,67         | EUR                 | 0,49            |
| <b>Total Interets postcomptes.</b> |                                                 |             |               | <b>960 880 320,67</b> |                     | <b>11,64</b>    |
| <b>Interets precomptes.</b>        |                                                 |             |               |                       |                     |                 |
| FR0129728392                       | ACHMEA BANK NV ZCP 11/05/2027                   | PROPRE      | 25 000 000,00 | 24 416 150,19         | EUR                 | 0,30            |
| XS3422036981                       | AKZO NOBEL N.V. ZCP 22/09/2026                  | PROPRE      | 32 000 000,00 | 31 818 336,41         | EUR                 | 0,39            |
| FR0129807527                       | ALSTOM ZCP 03/07/2026                           | PROPRE      | 17 000 000,00 | 16 997 661,07         | EUR                 | 0,21            |
| FR0129805836                       | ALSTOM ZCP 15/07/2026                           | PROPRE      | 50 000 000,00 | 49 954 935,69         | EUR                 | 0,61            |
| FR0129809333                       | ALTEN ZCP 27/07/2026                            | PROPRE      | 10 000 000,00 | 9 982 238,09          | EUR                 | 0,12            |
| XS3372721699                       | AVERY DENNISON TREAS ZCP 07/07/2026             | PROPRE      | 40 000 000,00 | 39 984 001,90         | EUR                 | 0,48            |
| FR0129806362                       | AVRIL ZCP 16/09/2026                            | PROPRE      | 36 000 000,00 | 35 786 466,92         | EUR                 | 0,43            |
| FR0129709012                       | AVRIL ZCP 27/07/2026                            | PROPRE      | 14 000 000,00 | 13 972 331,31         | EUR                 | 0,17            |
| FR0129654390                       | BANCO BILBAO VICAY ZCP 04/03/2027               | PROPRE      | 40 000 000,00 | 39 261 796,27         | EUR                 | 0,48            |

# Swiss Life Funds (F) ESG Money Market Euro

| Wert-Code    | Wertelabel                                    | Status Wert | Menge         | Wert Markt    | Notierungs-<br>währung | %Nettove-<br>rmögen |
|--------------|-----------------------------------------------|-------------|---------------|---------------|------------------------|---------------------|
| FR0129761849 | BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARI ZCP 02/06/2027 | PROPRE      | 34 000 000,00 | 33 122 199,79 | EUR                    | 0,40                |
| FR0129500825 | BANCO BILBAO VIZCAYA ZCP 18/11/2026           | PROPRE      | 40 000 000,00 | 39 603 292,13 | EUR                    | 0,48                |
| XS3374290685 | BANCO SANTANDER SA ZCP 07/05/2027             | PROPRE      | 50 000 000,00 | 48 849 972,14 | EUR                    | 0,59                |
| FR0129629368 | BANQUE NOMUR FRANCE ZCP 11/03/2027            | PROPRE      | 8 400 000,00  | 8 233 559,79  | EUR                    | 0,10                |
| XS3277020254 | BAYER AG ZCP 30/11/2026                       | PROPRE      | 50 000 000,00 | 49 415 803,94 | EUR                    | 0,60                |
| XS3277017466 | BAYER AKTIENGESELLS ZCP 04/12/2026            | PROPRE      | 8 000 000,00  | 7 903 786,45  | EUR                    | 0,10                |
| XS3148147898 | BAYER AKTIENGESELLS ZCP 06/08/26              | PROPRE      | 9 000 000,00  | 8 977 163,88  | EUR                    | 0,11                |
| XS3136322537 | BAYER AKTIENGESELLSCHAFT ZCP 23/07/2026       | PROPRE      | 50 000 000,00 | 49 924 445,65 | EUR                    | 0,60                |
| FR0129547073 | BCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA ZCP 06/01/2027  | PROPRE      | 40 000 000,00 | 39 461 725,74 | EUR                    | 0,48                |
| FR0129809234 | BONDUELLE ZCP 27/07/2026                      | PROPRE      | 8 000 000,00  | 7 984 931,12  | EUR                    | 0,10                |
| FR0129780377 | CA CONSUMER FINANCE ZCP 01/06/2027            | PROPRE      | 40 000 000,00 | 38 999 395,82 | EUR                    | 0,47                |
| FR0129809465 | CA CONSUMER FINANCE ZCP 04/01/2027            | PROPRE      | 20 000 000,00 | 19 730 496,55 | EUR                    | 0,24                |
| FR0129316321 | CA CONSUMER FINANCE ZCP 29/07/2027            | PROPRE      | 25 000 000,00 | 24 222 137,02 | EUR                    | 0,29                |
| FR0129789840 | CA CONSUMER FINANCE ZCP 31/12/2026            | PROPRE      | 25 000 000,00 | 24 672 158,96 | EUR                    | 0,30                |
| FR0129681443 | CDC HABITAT SOCIAL ZCP 07/10/2026             | PROPRE      | 17 000 000,00 | 16 880 554,43 | EUR                    | 0,20                |
| FR0129681450 | CDC HABITAT SOCIAL ZCP 09/11/2026             | PROPRE      | 25 000 000,00 | 24 760 098,77 | EUR                    | 0,30                |
| FR0129582039 | CDC HABITAT SOCIAL ZCP 19/02/2027             | PROPRE      | 20 000 000,00 | 19 641 227,44 | EUR                    | 0,24                |
| FR0129447746 | CDC HABITAT ZCP 17/09/2026                    | PROPRE      | 20 000 000,00 | 19 890 709,94 | EUR                    | 0,24                |
| DE000CZ456W6 | COMMERZBANK AG ZCP 05/01/2027                 | PROPRE      | 40 000 000,00 | 39 460 708,45 | EUR                    | 0,48                |
| DE000CZ46A86 | COMMERZBANK AG ZCP 09/06/2027                 | PROPRE      | 40 000 000,00 | 38 966 394,49 | EUR                    | 0,47                |
| DE000CZ46AR5 | COMMERZBANK AG ZCP 20/04/2027                 | PROPRE      | 28 000 000,00 | 27 387 858,21 | EUR                    | 0,33                |
| DE000CZ459X8 | COMMERZBANK AG ZCP 25/02/2027                 | PROPRE      | 30 000 000,00 | 29 466 732,32 | EUR                    | 0,36                |
| FR0129810018 | COMPAGNIE GENERALE ZCP 30/06/2027             | PROPRE      | 14 000 000,00 | 13 609 454,55 | EUR                    | 0,16                |
| FR0129716256 | COVIVIO HOTLES ZCP 26/08/2026                 | PROPRE      | 25 000 000,00 | 24 904 255,06 | EUR                    | 0,30                |
| FR0129716090 | COVIVIO IMMOBILIEN FINANCE AG ZCP 22/07/2026  | PROPRE      | 20 000 000,00 | 19 971 192,87 | EUR                    | 0,24                |
| FR0129784130 | COVIVIO IMMOBILIEN FINANCE AG ZCP 24/08/2026  | PROPRE      | 25 000 000,00 | 24 907 388,67 | EUR                    | 0,30                |
| FR0129681591 | COVIVIO ZCP 11/08/2026                        | PROPRE      | 15 000 000,00 | 14 958 149,56 | EUR                    | 0,18                |
| FR0129716645 | COVIVO IMMOBILE ZCP 01/09/2026                | PROPRE      | 15 000 000,00 | 14 935 597,91 | EUR                    | 0,18                |
| XS3411893228 | DANAHER CORPORATION ZCP 14/09/2026            | PROPRE      | 21 700 000,00 | 21 587 371,49 | EUR                    | 0,26                |
| XS3420466909 | DANAHER CORPORATION ZCP 22/09/2026            | PROPRE      | 20 000 000,00 | 19 885 176,96 | EUR                    | 0,24                |
| XS3402929791 | DEUTSCHE BANK AG LDN ZCP 03/06/2927           | PROPRE      | 27 000 000,00 | 26 316 100,43 | EUR                    | 0,32                |

# Swiss Life Funds (F) ESG Money Market Euro

| Wert-Code    | Wertelabel                                    | Status Wert | Menge          | Wert Markt    | Notierungs- währung | %Nettovermögen |
|--------------|-----------------------------------------------|-------------|----------------|---------------|---------------------|----------------|
| XS3294959575 | DEUTSCHE BANK AG ZCP 05/02/2027               | PROPRE      | 20 000 000,00  | 19 685 615,63 | EUR                 | 0,24           |
| XS3405658868 | DEUTSCHE BANK AG ZCP 07/06/2027               | PROPRE      | 30 000 000,00  | 29 228 854,32 | EUR                 | 0,35           |
| XS3348861827 | DEUTSCHE BANK AG ZCP 13/04/2027               | PROPRE      | 20 000 000,00  | 19 574 950,73 | EUR                 | 0,24           |
| XS3214411814 | DEUTSCHE BANK AG ZCP 16/10/2026               | PROPRE      | 20 000 000,00  | 19 853 183,20 | EUR                 | 0,24           |
| FR0129781599 | ELECTRICITE DE FRANCE ZCP 01/07/2026          | PROPRE      | 11 000 000,00  | 11 000 000,00 | EUR                 | 0,13           |
| FR0129631869 | ELECTRICITE DE FRANCE ZCP 12/11/2026          | PROPRE      | 40 000 000,00  | 39 623 801,58 | EUR                 | 0,48           |
| FR0129805430 | ENGIE SA ZCP 03/07/2026                       | PROPRE      | 100 000 000,00 | 99 986 732,82 | EUR                 | 1,21           |
| FR0129728533 | ESSILORLUXOTTICA ZCP 01/07/2026               | PROPRE      | 30 000 000,00  | 30 000 000,00 | EUR                 | 0,36           |
| XS3435292100 | FISERV INC ZCP 03/09/2026                     | PROPRE      | 15 000 000,00  | 14 931 531,22 | EUR                 | 0,18           |
| XS3402802451 | FISERV INC ZCP 06/08/2026                     | PROPRE      | 20 000 000,00  | 19 948 675,93 | EUR                 | 0,24           |
| XS3373331092 | FISERV INC ZCP 09/07/2026                     | PROPRE      | 46 000 000,00  | 45 974 636,00 | EUR                 | 0,56           |
| XS3348745756 | GOLDMAN SACHS - STEP COMPLIANT ZCP 13/04/2027 | PROPRE      | 30 000 000,00  | 29 360 791,94 | EUR                 | 0,36           |
| XS3355997480 | GOLDMAN SACHS INTER ZCP 21/01/2027            | PROPRE      | 20 000 000,00  | 19 702 831,67 | EUR                 | 0,24           |
| XS3306597009 | GOLDMAN SACHS INTER ZCP 23/02/2027            | PROPRE      | 30 000 000,00  | 29 476 888,00 | EUR                 | 0,36           |
| XS3359558627 | GOLDMAN SACHS INTER ZCP 23/04/2027            | PROPRE      | 30 000 000,00  | 29 335 631,11 | EUR                 | 0,36           |
| XS3276144014 | GOLDMAN SACHS INTERNATIONAL CDN 13/01/2027    | PROPRE      | 40 000 000,00  | 39 432 681,41 | EUR                 | 0,48           |
| XS3408977141 | HEWLETT PACKARD INT ZCP 09/06/2027            | PROPRE      | 18 000 000,00  | 17 532 041,22 | EUR                 | 0,21           |
| XS3114910915 | HEWLETT-PACKARD INTL BANK DAC ZCP 06/07/2026  | PROPRE      | 15 000 000,00  | 14 994 957,23 | EUR                 | 0,18           |
| FR0129716264 | ITM ENTREPRISES SA ZCP 27/08/2026             | PROPRE      | 40 000 000,00  | 39 836 878,13 | EUR                 | 0,48           |
| FR0129713717 | ITM ENTREPRISES SA ZCP 31/07/2026             | PROPRE      | 40 000 000,00  | 39 914 076,14 | EUR                 | 0,48           |
| XS3420460290 | ITT INDUSTRIES LUXE ZCP 17/07/2026            | PROPRE      | 45 000 000,00  | 44 951 601,65 | EUR                 | 0,54           |
| XS3422258619 | ITT INDUSTRIES LUXE ZCP 21/08/2026            | PROPRE      | 45 000 000,00  | 44 836 646,59 | EUR                 | 0,54           |
| XS3425658831 | ITT INDUSTRIES LUXEMBOURG S. ZCP 20/08/2026   | PROPRE      | 18 000 000,00  | 17 935 995,30 | EUR                 | 0,22           |
| FR0129709533 | LOC D EQUIPEMENTS ZCP 28/04/2027              | PROPRE      | 16 000 000,00  | 15 639 061,53 | EUR                 | 0,19           |
| FR0129580116 | LOC D EQUIPMENTS CIE GLE DE ZCP 27/01/2027    | PROPRE      | 10 200 000,00  | 10 044 090,78 | EUR                 | 0,12           |
| FR0129783942 | L'OCCITANE INTERNATIONAL S.A. ZCP 19/10/2026  | PROPRE      | 22 000 000,00  | 21 821 386,11 | EUR                 | 0,26           |
| FR0129681369 | L'OCCITANE INTERNATIONAL ZCP 25/09/2026       | PROPRE      | 30 000 000,00  | 29 813 306,75 | EUR                 | 0,36           |
| FR0129599322 | LOC.D'EQUIPEMENTS ZCP 09/02/2027              | PROPRE      | 25 000 000,00  | 24 594 256,64 | EUR                 | 0,30           |
| XS3415270316 | LSEG NETHERLANDS ZCP 15/12/2026               | PROPRE      | 40 000 000,00  | 39 508 164,65 | EUR                 | 0,48           |
| FR0129783306 | MERSEN ZCP 28/07/2026                         | PROPRE      | 10 000 000,00  | 9 981 440,79  | EUR                 | 0,12           |
| DE000A5JCG83 | METRO AG ZCP 22/09/2026                       | PROPRE      | 20 000 000,00  | 19 875 555,68 | EUR                 | 0,24           |

# Swiss Life Funds (F) ESG Money Market Euro

| Wert-Code                         | Wertelabel                                   | Status Wert | Menge         | Wert Markt              | Notierungs-<br>währung | %Nettove-<br>rmögen |
|-----------------------------------|----------------------------------------------|-------------|---------------|-------------------------|------------------------|---------------------|
| XS3418584960                      | NEINEKEN NV ZCP 02/07/2026                   | PROPRE      | 10 000 000,00 | 9 999 301,25            | EUR                    | 0,12                |
| XS3273285653                      | NOMURA BANK INTERNATIONAL PLC ZCP 13/07/2026 | PROPRE      | 40 000 000,00 | 39 967 886,16           | EUR                    | 0,48                |
| FR0129764389                      | ORANO SA ZCP 21/09/2026                      | PROPRE      | 32 000 000,00 | 31 814 888,65           | EUR                    | 0,39                |
| FR0129783256                      | PR FINANCE SA ZCP 06/07/2026                 | PROPRE      | 40 000 000,00 | 39 986 877,70           | EUR                    | 0,48                |
| XS3298838171                      | QATAR NATIONAL BANK ZCP 12/08/2026           | PROPRE      | 30 000 000,00 | 29 913 383,92           | EUR                    | 0,36                |
| XS3425665703                      | RELX FINANCE B V ZCP 24/07/2026              | PROPRE      | 17 000 000,00 | 16 974 360,34           | EUR                    | 0,21                |
| XS3427406346                      | RELX FINANCE BV ZCP 25/08/2026               | PROPRE      | 40 000 000,00 | 39 853 757,77           | EUR                    | 0,48                |
| FR0129784601                      | ROQUETTE FRERES ZCP 29/07/2026               | PROPRE      | 10 000 000,00 | 9 979 440,79            | EUR                    | 0,12                |
| XS3322570212                      | SANTANDER CONSUMER ZCP 15/03/2027            | PROPRE      | 40 000 000,00 | 39 241 920,48           | EUR                    | 0,48                |
| FR0129705085                      | SCHNEIDER ELECTRIC SE ZCP 20/10/2026         | PROPRE      | 20 000 000,00 | 19 847 659,80           | EUR                    | 0,24                |
| FR0129704930                      | SEB SA ZCP 20/07/2026                        | PROPRE      | 20 000 000,00 | 19 974 779,75           | EUR                    | 0,24                |
| XS3364820202                      | SGS FINANCE ZCP 29/09/2026                   | PROPRE      | 40 000 000,00 | 39 739 436,07           | EUR                    | 0,48                |
| XS3412543962                      | SSE PLC ZCP 14/09/2026                       | PROPRE      | 40 000 000,00 | 39 794 782,04           | EUR                    | 0,48                |
| XS3349813983                      | SSE PLC ZCP 15/07/2026                       | PROPRE      | 20 000 000,00 | 19 981 677,86           | EUR                    | 0,24                |
| BE6369206899                      | SUMITOMO MITSUI BANKING CORP ZCP 06/07/2026  | PROPRE      | 40 000 000,00 | 39 987 096,49           | EUR                    | 0,48                |
| BE6375206750                      | SYENSQO NV ZCP 24/08/2026                    | PROPRE      | 25 000 000,00 | 24 904 382,00           | EUR                    | 0,30                |
| BE6374732863                      | SYENSQO SA NV ZCP 03/09/2026                 | PROPRE      | 40 000 000,00 | 39 814 533,50           | EUR                    | 0,48                |
| BE6374771283                      | SYENSQO SA NV ZCP 08/09/2026                 | PROPRE      | 18 000 000,00 | 17 910 327,82           | EUR                    | 0,22                |
| BE6374869293                      | SYENSQO SA ZCP 15/09/2026                    | PROPRE      | 13 000 000,00 | 12 929 241,26           | EUR                    | 0,16                |
| XS3423989105                      | THE BRITISH LAND CO PLC ZCP 06/07/2026       | PROPRE      | 50 000 000,00 | 49 983 718,14           | EUR                    | 0,61                |
| XS3418748318                      | THE BRITISH LAND CO PLC ZCP 18/09/2026       | PROPRE      | 50 000 000,00 | 49 727 740,15           | EUR                    | 0,60                |
| XS3229427961                      | UBS EUROPE SE ZCP 09/11/2026                 | PROPRE      | 20 000 000,00 | 19 816 072,24           | EUR                    | 0,24                |
| XS3277146513                      | UBS EUROPE SE ZCP 15/10/2026                 | PROPRE      | 20 000 000,00 | 19 854 588,98           | EUR                    | 0,24                |
| FR0129762615                      | UNIVERSAL MUSIC GRO ZCP 20/07/2026           | PROPRE      | 40 000 000,00 | 39 949 600,09           | EUR                    | 0,48                |
| FR0129762698                      | UNIVERSAL MUSIC GROUP N.V ZCP 20/08/2026     | PROPRE      | 40 000 000,00 | 39 863 090,44           | EUR                    | 0,48                |
| FR0129780203                      | VEOLIA ENVIRONMENT ZCP 30/11/2026            | PROPRE      | 30 000 000,00 | 29 678 641,96           | EUR                    | 0,36                |
| FR0129807642                      | VEOLIA ENVIRONNEMENT ZCP 06/07/2026          | PROPRE      | 30 000 000,00 | 29 989 972,99           | EUR                    | 0,36                |
| FR0129671329                      | VEOLIA ENVIRONNEMENT ZCP 12/03/2027          | PROPRE      | 35 000 000,00 | 34 332 171,42           | EUR                    | 0,42                |
| <b>Total Interets precomptes.</b> |                                              |             |               | <b>2 795 011 553,19</b> |                        | <b>33,85</b>        |
| <b>Taux revisable</b>             |                                              |             |               |                         |                        |                     |
| FR0128809862                      | ALLIANZ BANQUE E3R+0.4% 1609/2026            | PROPRE      | 10 000 000,00 | 10 013 362,89           | EUR                    | 0,12                |

# Swiss Life Funds (F) ESG Money Market Euro

| Wert-Code                                               | Wertelabel                                         | Status Wert | Menge         | Wert Markt              | Notierungs-<br>währung % | Nettove-<br>rmögen |
|---------------------------------------------------------|----------------------------------------------------|-------------|---------------|-------------------------|--------------------------|--------------------|
| FR0128865484                                            | ALLIANZ BANQUE E3R+0.4% 21/10/2026                 | PROPRE      | 10 000 000,00 | 10 053 074,00           | EUR                      | 0,12               |
| FR0128691252                                            | ALLIANZ BANQUE E3R+0.41% 08/07/2026                | PROPRE      | 10 000 000,00 | 10 058 784,64           | EUR                      | 0,12               |
| FR0129706786                                            | ALLIANZ BANQUE SA E3R + 0.38% 24/04/2028           | PROPRE      | 10 000 000,00 | 10 046 099,75           | EUR                      | 0,12               |
| FR0129386407                                            | ALLIANZ BANQUE SA E3R+0.38% 02/09/2027             | PROPRE      | 10 000 000,00 | 10 013 603,33           | EUR                      | 0,12               |
| FR0129031151                                            | ALLIANZ BANQUE SA E3R+0.38% 03/02/2027             | PROPRE      | 10 000 000,00 | 10 038 653,36           | EUR                      | 0,12               |
| FR0129515351                                            | AXA BANQUE E3R+0.39% 26/11/2027                    | PROPRE      | 40 000 000,00 | 40 127 682,00           | EUR                      | 0,49               |
| FR0129106904                                            | BANQUE STELLANTIS E3M+0.48% 19/03/2027             | PROPRE      | 25 000 000,00 | 25 043 299,80           | EUR                      | 0,30               |
| FR0128719368                                            | BANQUE STELLANTIS FRANCE E3R+0.35% 22/07/2026      | PROPRE      | 10 000 000,00 | 10 050 156,75           | EUR                      | 0,12               |
| FR0128866219                                            | BANQUE STELLANTIS FRANCE E3R+0.50% 21/10/2026      | PROPRE      | 15 000 000,00 | 15 087 091,33           | EUR                      | 0,18               |
| FR0129255339                                            | CA CONSUMER FINANCE E3R+0.44% 16/06/2027           | PROPRE      | 16 000 000,00 | 16 026 313,33           | EUR                      | 0,19               |
| FR0129728269                                            | CAISSE FED OCEAN E3R +0.39% 11/05/2028             | PROPRE      | 20 000 000,00 | 20 066 658,89           | EUR                      | 0,24               |
| FR0129546760                                            | CAISSE FEDERALE DU CREDIT M E3R + 0.38% 06/01/2028 | PROPRE      | 25 000 000,00 | 25 160 725,27           | EUR                      | 0,30               |
| FR0128765965                                            | CARREFOUR BANQUE E3R+0.58% 18/09/2026              | PROPRE      | 25 000 000,00 | 25 033 130,42           | EUR                      | 0,30               |
| FR0128766799                                            | CARREFOUR BANQUE E3R+0.6% 14/10/2026               | PROPRE      | 35 000 000,00 | 35 225 411,67           | EUR                      | 0,43               |
| FR0129548881                                            | EIFFAGE E3R +0.70% 07/01/2028                      | PROPRE      | 8 000 000,00  | 8 053 872,00            | EUR                      | 0,10               |
| FR0129581148                                            | EIFFAGE E3R+0.67% 28/01/2028                       | PROPRE      | 32 000 000,00 | 32 155 315,56           | EUR                      | 0,39               |
| FR0129755759                                            | EIFFAGE E3R+0.70% 19/05/2028                       | PROPRE      | 30 000 000,00 | 30 102 165,00           | EUR                      | 0,36               |
| FR0128931708                                            | EIFFAGE E3R+0.90% 13/11/2026                       | PROPRE      | 40 000 000,00 | 40 194 787,78           | EUR                      | 0,49               |
| FR0129572063                                            | EIFFAGE SA E3R+0.67% 19/01/2028                    | PROPRE      | 40 000 000,00 | 40 221 363,00           | EUR                      | 0,49               |
| FR0129207868                                            | ELECTRICITE DE FRANCE E3R+0.6% 19/05/2027          | PROPRE      | 40 000 000,00 | 40 088 759,78           | EUR                      | 0,49               |
| FR0129362879                                            | SEB SA E3R + 0.75% 03/09/2027                      | PROPRE      | 20 000 000,00 | 20 056 169,89           | EUR                      | 0,24               |
| FR0129544450                                            | SOCRAM BANQUE E3R +0.50% 16/07/2027                | PROPRE      | 5 000 000,00  | 5 026 826,95            | EUR                      | 0,06               |
| FR0129520872                                            | SOCRAM BANQUE E3R+0.50% 28/05/2027                 | PROPRE      | 5 000 000,00  | 5 012 974,34            | EUR                      | 0,06               |
| XS2899604818                                            | STANDARD CHARTERED E3R+0.45% 09/09/2026            | PROPRE      | 20 000 000,00 | 20 041 037,78           | EUR                      | 0,24               |
| <b>Total Taux revisable</b>                             |                                                    |             |               | <b>512 997 319,51</b>   |                          | <b>6,21</b>        |
| <b>Total Creances negociables</b>                       |                                                    |             |               | <b>4 268 889 193,37</b> |                          | <b>51,70</b>       |
| <b>Total SWISS LIFE FUNDS (F) ESG MONEY MARKET EURO</b> |                                                    |             |               | <b>8 256 344 187,40</b> |                          | <b>100,00</b>      |

*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](http://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