

Swiss Life iFunds (CH)

Vertraglicher Umbrella-Fonds schweizerischen Rechts
der Art «Übrige Fonds für traditionelle Anlagen»

für qualifizierte Anleger

Mit den Teilvermögen

Swiss Life iFunds (CH) Equity Switzerland Small & Mid Cap (CHF)

Swiss Life iFunds (CH) Bond Swiss Francs Foreign (CHF)

Swiss Life iFunds (CH) Bond Global Government + (CHF hedged)

Swiss Life iFunds (CH) Bond Global Corporates (CHF hedged)

Swiss Life iFunds (CH) Bond Swiss Francs Domestic (CHF)

Swiss Life iFunds (CH) Equity Switzerland (CHF)

Swiss Life iFunds (CH) Bond Global Corporates Short Term
(CHF hedged)

Swiss Life iFunds (CH) Bond Global Aggregate (CHF hedged)

Geprüfter Jahresbericht per 30. September 2024

Geprüfter Jahresbericht per 30. September 2024

Inhaltsverzeichnis	Seite	ISIN
Organisation	3	
Mitteilung an die Anleger	5	
Aktive Anlageverstösse	13	
Kurzbericht der kollektivanlagengesetzlichen Prüfgesellschaft	14	
Swiss Life iFunds (CH) Equity Switzerland Small & Mid Cap (CHF)	16	I-A1/ I-A2/ CH0023989467 CH1197235372
Swiss Life iFunds (CH) Bond Swiss Francs Foreign (CHF)	22	I-A1/ I-A2/ CH0023989582 CH0219870471
Swiss Life iFunds (CH) Bond Global Government + (CHF hedged)	32	I-A1/ I-A2/ I-A3/ CH0023989624 CH0324001301 CH0384999642
Swiss Life iFunds (CH) Bond Global Corporates (CHF hedged)	45	I-A1/ I-A2/ CH0114218610 CH0219870703
Swiss Life iFunds (CH) Bond Swiss Francs Domestic (CHF)	61	I-A1/ I-A2/ CH0023989764 CH0324001053
Swiss Life iFunds (CH) Equity Switzerland (CHF)	74	I-A1/ CH0108009199
Swiss Life iFunds (CH) Bond Global Corporates Short Term (CHF hedged)	80	I-A0 AST I-A1/ I-A2/ I-A2 Cap/ CH1291247638 CH0219870430 CH0219870455 CH0407409843
Swiss Life iFunds (CH) Bond Global Aggregate (CHF hedged)	96	I-A1/ I-A2/ CH1232663679 CH1232663687
Anhang zu Ergänzende Angaben	111	
Sonstige Informationen	116	

Verkaufsrestriktionen

Bei der Ausgabe und Rücknahme von Anteilen dieses Umbrella-Fonds im Ausland kommen die dort geltenden Bestimmungen zur Anwendung.

- a) Für folgende Länder liegt eine Bewilligung für die Vertriebstätigkeit vor: - Schweiz
- b) Anteile dieses Umbrella-Fonds dürfen US-Personen weder angeboten, verkauft noch ausgeliefert werden.

US-Person bedeutet:

- (i) ein US-amerikanischer Staatsbürger (inklusive doppelter oder mehrfacher Staatsbürgerschaft);
- (ii) eine in den USA wohnhafte Person (Resident Alien, der eine Green Card besitzt oder den «Substantial Presence Test» besteht);
- (iii) eine Personengesellschaft oder eine Gesellschaft in den USA oder unter US-Recht oder dem Recht eines US-Bundesstaates;
- (iv) einen Nachlass eines Erblassers, der US-Staatsbürger oder in den USA wohnhaft ist;
- (v) einen Trust, wenn (x) ein US-Gericht gemäss geltendem Gesetz Anordnungen oder Urteile bezüglich wesentlicher Aspekte der Trust-Verwaltung treffen kann und (y) eine oder mehrere US-Personen die Befugnis haben, die wesentlichen Entscheidungen des Trusts zu kontrollieren;
- (vi) eine Person, die dem US-amerikanischen Steuerrecht aus anderen Gründen unterliegt (u. a. doppelter Wohnsitz, Ehepartner mit gemeinsamer Einreichung, Verzicht auf US-Staatsbürgerschaft oder langfristige, dauerhafte Niederlassung in den USA).

Dieser Absatz und die hier verwendeten Begriffe sind in Übereinstimmung mit dem US Internal Revenue Code auszulegen.

Die Fondsleitung und die Depotbank können gegenüber natürlichen oder juristischen Personen in bestimmten Ländern und Gebieten den Verkauf, die Vermittlung oder Übertragung von Anteilen untersagen oder beschränken.

Internetadresse

www.swisslife-am.com

Organisation

Fondsleitung

Swiss Life Asset Management AG
General-Guisan-Quai 40
8002 Zürich

Verwaltungsrat

Präsident

Stefan Mächler

Group CIO und Mitglied der Konzernleitung der Swiss Life-Gruppe, mit Verwaltungsratsmandaten innerhalb der Swiss Life-Gruppe, Präsident des Verwaltungsrats der Ina Invest AG und Mitglied des Verwaltungsrates der Fisch Asset Management AG

Mitglieder

Lorenzo Kyburz

Swiss Life Investment Management Holding AG, mit einem Verwaltungsratsmandat innerhalb der Swiss Life-Gruppe

Dr. Rolf Aeberli

Head Corporate Mandates Swiss Life AG, mit Verwaltungsratsmandaten innerhalb der Swiss Life-Gruppe, Präsident des Verwaltungsrates der First Swiss Mobility 2022-1 AG, der First Swiss Mobility 2023-1 AG, der First Swiss Mobility 2023-2 AG und der RWA Consulting AG

Geschäftsleitung

Robin van Berkel

CEO, mit Verwaltungsratsmandaten innerhalb der Swiss Life-Gruppe

Daniel Berner

Stellvertretender CEO, Bereichsleiter Securities

Paolo di Stefano

Bereichsleiter Real Estate, mit Verwaltungsratsmandaten innerhalb der Swiss Life-Gruppe

Christoph Gisler

Bereichsleiter Infrastructure Equity, mit Verwaltungsratsmandaten innerhalb der Swiss Life-Gruppe

Jan Grunow

Bereichsleiter Operations, mit einem Stiftungsratsmandat innerhalb der Swiss Life-Gruppe

Mark Fehlmann

Bereichsleiter Sales & Marketing, mit einem Verwaltungsratsmandat innerhalb der Swiss Life-Gruppe

Depotbank

UBS Switzerland AG, Zürich
Bahnhofstrasse 45
8001 Zürich

Prüfgesellschaft

PricewaterhouseCoopers AG
Birchstrasse 160, 8050 Zürich

Übertragung der Anlageentscheide

Swiss Life iFunds (CH) Equity Switzerland Small & Mid Cap (CHF)
Privatbank Von Graffenried AG, Bern

Swiss Life iFunds (CH) Equity Switzerland (CHF)
Pictet Asset Management SA, Carouge (GE)

Übertragung der Fondsadministration

Folgende Teilaufgaben sind an die UBS Fund Management (Switzerland) AG, Aeschenvorstadt 1, 4051 Basel, übertragen: Buchhaltung, Steuern, Berechnung von Vergütungen, NAV-Berechnung, Kursinformationen, Kontrolle der Einhaltung der reglementarischen Anlagerichtlinien und Erstellen von Halbjahres- und Jahresberichten. Die UBS Fund Management (Switzerland) AG ist als Fondsleitung von Wertschriften-, Spezial- und Immobilienfonds seit ihrer Gründung im Jahre 1959 im Fondsgeschäft tätig und bietet Dienstleistungen im administrativen Bereich für Kollektivanlagen an.

Die genaue Ausführung des Auftrages regelt ein zwischen der Fondsleitung Swiss Life Asset Management AG und der UBS Fund Management (Switzerland) AG abgeschlossener Vertrag.

Weiterdelegation

Die Administration des Anlagefonds, insbesondere Führung der Buchhaltung, Berechnung der Nettoinventarwerte, Steuerabrechnungen, Betrieb der IT-Systeme sowie Erstellung der Rechenschaftsberichte, ist an Northern Trust Global Services SE, Leudelange, Luxembourg, Zweigniederlassung Basel, weiterdelegiert. Die genaue Ausführung dieser Arbeiten ist in einem zwischen UBS Fund Management (Switzerland) AG und Northern Trust Global Services SE, Leudelange, Luxembourg, Zweigniederlassung Basel abgeschlossenen Vertrag geregelt.

Übertragung weiterer Teilaufgaben

Die interne Revision ist an das Konzernrevisorat der Swiss Life-Gruppe übertragen. Weitere Teilaufgaben im Bereich Legal & Compliance und Risk Management sind an die Swiss Life Investment Management Holding AG übertragen. IT-Infrastrukturdienstleistungen, Applikationsentwicklung und -betrieb sowie IT-Risk Management und IT-Security sind an die Swiss Life Investment Management Holding AG und an die Swiss Life AG übertragen. Die Beauftragten zeichnen sich aus durch ihre langjährige Erfahrung in den übertragenen Bereichen. Die genaue Ausführung der Aufträge regeln zwischen der Fondsleitung Swiss Life Asset Management AG und den Beauftragten abgeschlossene Verträge.

Zahlstelle

UBS Switzerland AG
Bahnhofstrasse 45
8001 Zürich

Mitteilung an die Anleger

Änderungen des Fondsvertrages

Der Fondsvertrag des «Swiss Life iFunds (CH)» wurde zweimal geändert. Die erste Publikation wurde am 11. März 2024 auf Swiss Fund Data veröffentlicht. Die Änderungen wurden von der FINMA am 29. April 2024 genehmigt. Der angepasste Fondsvertrag ist am 30. April 2024 in Kraft getreten. Die zweite Publikation wurde am 30. September 2024 auf Swiss Fund Data veröffentlicht. Die Änderungen wurden von der FINMA am 21. November 2024 genehmigt. Der angepasste Fondsvertrag ist am 25. November 2024 in Kraft getreten. Anschliessend finden Sie die erschienenen Mitteilungen.

Der Fondsvertrag ist bei der Fondsleitung sowie am Hauptsitz und an den Niederlassungen der Depotbank kostenlos erhältlich.

Bundesgesetz über die kollektiven Kapitalanlagen (KAG) vom 23. Juni 2006, Art. 27 Abs. 2 KAG

Swiss Life iFunds (CH)

Vertraglicher Umbrella-Fonds schweizerischen Rechts der Art «Übrige Fonds für traditionelle Anlagen» mit den Teilvermögen

Swiss Life iFunds (CH) Equity Switzerland Small & Mid Cap (CHF)

Swiss Life iFunds (CH) Equity ESG Global ex Switzerland (CHF)

Swiss Life iFunds (CH) Bond Swiss Francs Foreign (CHF)

Swiss Life iFunds (CH) Bond Global Government + (CHF hedged)

Swiss Life iFunds (CH) Bond Global Corporates (CHF hedged)

Swiss Life iFunds (CH) Bond Swiss Francs Domestic (CHF)

Swiss Life iFunds (CH) Equity Switzerland (CHF)

Swiss Life iFunds (CH) Bond Global Corporates Short Term (CHF hedged)

Swiss Life iFunds (CH) Bond Global Aggregate (CHF hedged)

Swiss Life Asset Management AG, Zürich, als Fondsleitung, und UBS Switzerland AG, Zürich, als Depotbank, beabsichtigen gemäss Art. 27 des Bundesgesetzes über die kollektiven Kapitalanlagen vom 23. Juni 2006 (KAG) die nachfolgend erwähnten Änderungen im Fondsvertrag des oben aufgeführten Umbrella-Fonds vorzunehmen. Die vorgesehenen Änderungen betreffen insbesondere

den Kreis der Anleger, die Einschränkung des Anlegerkreises der Anteilsklasse I-A 1 und I-A 1 Cap, die Einführung der Möglichkeit für die Fondsleitung für die definierten Teilvermögen unter bestimmten Umständen die Rücknahmen zu beschränken (Gating), die Anpassung der Bestimmungen der Vergütungen und Nebenkosten zu Lasten des Vermögens der Teilvermögen sowie die Auszahlungsperiodizität der Verwaltungskommission. Daneben werden Anpassungen formeller Art vorgenommen.

Die Anleger des oben erwähnten Umbrella-Fonds werden hiermit über die nachfolgenden Änderungen des Fondsvertrages informiert:

§ 5 Die Anleger

Der Kreis der Anleger wird umformuliert und damit insgesamt weiter gefasst, sodass § 5 Ziff. 1 neu wie folgt lautet: «Der Kreis der Anleger aller Teilvermögen ist beschränkt auf qualifizierte Anleger gemäss Art. 10 Abs. 3 und 3ter KAG in Verbindung mit Art. 4 Abs. 3-5 und Art. 5 Abs. 1 und Abs. 4 FIDLEG.»

§ 6 Anteile und Anteilsklassen

Der Anlegerkreis der Anteilsklassen I-A 1 und I-A 1 Cap wird eingeschränkt, als dieser um den folgenden Satz ergänzt wird: «Nicht für diese Anteilsklasse qualifiziert ist der Umbrella-Fonds «Swiss Life Funds III (CH)» mit seinen Teilvermögen.» Die in § 6 Ziff. 4 lautet neu: «Anteilsklasse I-A 1 und I-A 1 Cap: Anteile dieser Anteilsklassen stehen nur qualifizierten Anlegern gemäss § 5 Ziff. 1 des Fondsvertrages offen, welche mit der Swiss Life Asset Management AG oder mit einer anderen zur Swiss Life-Gruppe gehörenden Unternehmung einen Vermögensverwaltungsvertrag oder einen anderen entgeltlichen Finanzdienstleistungsvertrag abgeschlossen haben. Ausgeschlossen sind qualifizierte Anleger gemäss Art. 10 Abs. 3ter KAG. Nicht für diese Anteilsklasse qualifiziert ist der Umbrella-Fonds «Swiss Life Funds III (CH)» mit seinen Teilvermögen.»

§ 19 Ausgabe und Rücknahme von Anteilen

Die Bestimmungen in § 19 Ziff. 3 werden abgeändert. Die in § 19 Ziff. 3 lautet neu wie folgt:

«Der Ausgabe- und Rücknahmepreis der Anteile basiert auf dem am Bewertungstag gestützt auf die Schlusskurse des Vortages gemäss § 18 berechneten Nettoinventarwert je Anteil der entsprechenden Anteilsklasse. Bei der Ausgabe und Rücknahme von Anteilen kann zum

Nettoinventarwert eine Ausgabekommission gemäss § 20 zugeschlagen resp. eine Rücknahmekommission gemäss § 20 vom Nettoinventarwert abgezogen werden.

Für alle Teilvermögen mit Ausnahme der Teilvermögen Swiss Life iFunds (CH) Equity Switzerland (CHF) und Swiss Life iFunds (CH) Equity ESG Global ex Switzerland (CHF) gilt: Die Nebenkosten für den An- und Verkauf der Anlagen (Geld-/Briefspannen, marktübliche Courtagen, Kommissionen, Abrechnungs- und Abwicklungskosten, Bankspesen, Steuern und Abgaben), sowie die Kosten für die Überprüfung der Aufrechterhaltung von Qualitätsstandards bei physischen Anlagen, die den Teilvermögen aus der Anlage des einbezahlten Betrags bzw. aus dem Verkauf eines gekündigten Anteil entsprechenden Teils der Anlage erwachsen, werden gemäss der Swinging Single Pricing-Methode (vgl. § 18 Ziff. 7) belastet. Die Berücksichtigung dieser Nebenkosten entfällt, falls die Fondsleitung einer Ein- oder Auszahlung in Anlagen statt in bar gemäss § 19 Ziff. 8 gestattet sowie beim Wechsel zwischen Anteilklassen innerhalb eines Teilvermögens.»

Aufgrund der Änderung der Bestimmungen in § 19 Ziff. 3 wird eine neue Ziffer in § 19 Ziff. 4 eingefügt:

«Für die Teilvermögen Swiss Life iFunds (CH) Equity Switzerland (CHF) und Swiss Life iFunds (CH) Equity ESG Global ex Switzerland (CHF) gilt: Die Nebenkosten für den An- und Verkauf der Anlagen einschliesslich Absicherungsgeschäften (Geld-/Briefspannen, marktübliche Courtagen, Kommissionen, Abrechnungs- und Abwicklungskosten, Bankspesen, Steuern und Abgaben) sowie die Kosten für die Überprüfung und Aufrechterhaltung von Qualitätsstandards bei physischen Anlagen von maximal 2%, die aus der Anlage des einbezahlten Betrages bzw. aus dem Verkauf eines dem gekündigten Anteil entsprechenden Teils der Anlagen im Durchschnitt erwachsen, werden als Verwässerungsschutz den ein- bzw. aussteigenden Anlegern zugunsten des entsprechenden Teilvermögens belastet (Ausgabe- und Rücknahmegebühr). Dabei kann in dem Umfang auf die Erhebung einer Ausgabe- und Rücknahmegebühr zugunsten des entsprechenden Teilvermögens verzichtet werden, sofern Ausgaben und Rücknahmen an einem Bankwerktag gegeneinander aufgerechnet werden können, so dass beim entsprechenden Teilvermögen lediglich auf dem sich aus der Differenz zwischen Ausgaben und Rücknahmen ergebenden Nettoinvestitions- bzw. Nettodesinvestitionsbedarf Ausgabe- bzw. Rücknahmegebühren erhoben werden. Werden auf diese Weise Ausgabegebühren aus einem Nettoinvestitionsbedarf erhoben, sind die zeichnenden Anleger am jeweiligen Bankwerktag untereinander gleich zu behandeln. Entsprechend sind bei der Erhebung von Rücknahmegebühren aus einem Nettodesinvestitionsbedarf des entsprechenden Teilvermögens die zurückgebenden Anleger am jeweiligen Bankwerktag untereinander gleich zu behandeln.

Die Fondsleitung kann, anstelle der vorstehend erwähnten durchschnittlichen Nebenkosten bei der Belastung auch die tatsächliche Höhe der Nebenkosten berücksich-

tigen, sofern dies unter Berücksichtigung der relevanten Umstände (z.B. Höhe des Betrags, allgemeine Marktsituation, spezifische Marktsituation für die betreffende Anlageklasse) im Ermessen der Fondsleitung angemessen erscheint. Die Belastung kann in einem solchen Fall höher oder tiefer als die durchschnittlichen Nebenkosten ausfallen.

In den in Ziff. 6 genannten sowie in sonstigen ausserordentlichen Fällen kann, sofern dies nach Ansicht der Fondsleitung im Interesse der Gesamtheit der Anleger geboten ist, zudem der Höchstwert von 2% des Nettoinventarwerts überschritten werden. Die Fondsleitung teilt den Entscheid über die Überschreitung unverzüglich der Prüfgesellschaft, der Aufsichtsbehörde sowie in angemessener Weise den bestehenden und neuen Anlegern mit.

Die Erhebung einer Ausgabe- und Rücknahmegebühr entfällt, falls die Fondsleitung einer Ein- und Auszahlung in Sachwerten statt in bar gemäss Ziff. 9 gestattet sowie bei einem Wechsel zwischen Anteilklassen innerhalb eines Teilvermögens.»

Betreffend die Rücknahmemöglichkeiten der Anleger wird die Möglichkeit der Fondsleitung eingeführt, unter bestimmten Umständen die Rücknahmeanträge herabzusetzen (Gating), sodass die neu eingefügte § 19 Ziff. 10 wie folgt lautet:

«Die Fondsleitung behält sich das Recht vor, unter den in Ziff. 6 genannten und vergleichbaren ausserordentlichen Umständen und im Interesse der im entsprechenden Teilvermögen verbleibenden Anleger, bei sämtlichen Rücknahmeanträgen die Rücknahmen zu beschränken (Gating). Unter diesen Umständen kann die Fondsleitung entscheiden, alle Rücknahmeanträge proportional und im gleichen Verhältnis zu kürzen. Der verbleibende Teil der Rücknahmeanträge ist als für den nächsten Bewertungstag eingegangen zu betrachten und wird zu den an diesem Tag geltenden Bedingungen abgewickelt. Die Fondsleitung sorgt dafür, dass keine bevorzugte Behandlung aufgeschobener Rücknahmeanträge stattfindet.

Die Massnahme (Gating) kann ausschliesslich beim Teilvermögen «Swiss Life iFunds (CH) Equity Switzerland Small & Mid Cap (CHF)», an welchem die Gesamtsumme der Rücknahmen netto CHF 20 Mio. des Vermögens des Teilvermögens übersteigt, bei den Teilvermögen «Swiss Life iFunds (CH) Bond Swiss Francs Domestic (CHF)» und «Swiss Life iFunds (CH) Bond Swiss Francs Foreign (CHF)», an welchen die Gesamtsumme der Rücknahmen netto CHF 40 Mio. des Vermögens des Teilvermögens übersteigt, bei den Teilvermögen «Swiss Life iFunds (CH) Equity ESG Global ex Switzerland (CHF)», «Swiss Life iFunds (CH) Bond Global Government + (CHF hedged)», «Swiss Life iFunds (CH) Bond Global Corporates (CHF hedged)», «Swiss Life iFunds (CH) Equity Switzerland (CHF)», «Swiss Life iFunds (CH) Bond Global Corporates Short Term (CHF hedged)» und «Swiss Life iFunds (CH) Bond Global Aggregate (CHF hedged)», an welchen die

Gesamtsumme der Rücknahmen netto CHF 150 Mio. des Vermögens des Teilvermögens übersteigt, zur Anwendung kommen.

Die Fondsleitung teilt den Entscheid über die Anwendung sowie die Aufhebung des Gatings unverzüglich der Prüfgesellschaft, der Aufsichtsbehörde sowie in angemessener Weise den Anlegern mit.»

§ 21 Vergütungen und Nebenkosten zu Lasten des Vermögens der Teilvermögen

Die Bestimmungen der Vergütungen an die Fondsleitung zu Lasten des Vermögens der Teilvermögen in § 21 Ziff. 1 Bst. a werden genauer erläutert. Die in § 21 Ziff. 1 Bst. a lautet neu:

«Für die Leitung und die Vermögensverwaltung in Bezug auf die Teilvermögen stellt die Fondsleitung zulasten der Teilvermögen eine Kommission in Rechnung, die pro rata temporis bei jeder Berechnung des Nettoinventarwertes dem Vermögen des entsprechenden Teilvermögens belastet und jeweils am Quartalsende ausbezahlt wird (Verwaltungskommission). Die Höhe der Verwaltungskommission ist für jedes Teilvermögen im Besonderen Teil detailliert geregelt.»

Weiter werden die Bestimmungen der Vergütungen und Nebenkosten zu Lasten des Vermögens der Teilvermögen in § 21 Ziff. 2 insbesondere entsprechend den zum 1. März 2024 revidierten Bestimmungen der Verordnung über die kollektiven Kapitalanlagen (KKV) angepasst und lauten nunmehr wie folgt:

«Fondsleitung und Depotbank haben ausserdem Anspruch auf Ersatz der folgenden Auslagen, die ihnen in Ausführung des Fondsvertrages entstanden sind:

- a) Kosten im Zusammenhang mit dem An- und Verkauf von Anlagen einschliesslich Absicherungsgeschäften, namentlich marktübliche Courtagen, Kommissionen, Abrechnungs- und Abwicklungskosten, Bankspesen, Steuern und Abgaben, sowie Kosten für die Überprüfung und Aufrechterhaltung von Qualitätsstandards bei physischen Anlagen;
- b) Abgaben der Aufsichtsbehörde für die Gründung, Änderung, Liquidation, Fusion oder Vereinigung des Umbrella-Fonds bzw. der Teilvermögen;
- c) Jahresgebühr der Aufsichtsbehörde;
- d) Honorare der Prüfgesellschaft für die Prüfung sowie für Bescheinigungen im Rahmen der Gründung, Änderungen, Liquidation, Fusion oder Vereinigungen des Umbrella-Fonds bzw. der Teilvermögen;
- e) Honorare für Rechts- und Steuerberater im Zusammenhang mit der Gründung, Änderungen, Liquidation, Fusion oder Vereinigung des Umbrella-Fonds bzw. der

Teilvermögen sowie der allgemeinen Wahrnehmung der Interessen des Umbrella-Fonds bzw. der Teilvermögen und seiner Anleger;

- f) Kosten für die Publikation des Nettoinventarwertes des Umbrella-Fonds bzw. der Teilvermögen sowie sämtliche Kosten für Mitteilungen an die Anleger, die nicht einem Fehlverhalten der Fondsleitung zuzuschreiben sind, einschliesslich der Übersetzungskosten;
- g) Kosten für den Druck und die Übersetzung juristischer Dokumente sowie Jahresberichte des Umbrella-Fonds bzw. der Teilvermögen;
- h) Kosten für eine allfällige Eintragung des Umbrella-Fonds bzw. der Teilvermögen bei einer ausländischen Aufsichtsbehörde, namentlich von der ausländischen Aufsichtsbehörde erhobene Kommissionen, Übersetzungskosten sowie die Entschädigung des Vertreters oder der Zahlstelle im Ausland;
- i) Kosten im Zusammenhang mit der Ausübung von Stimmrechten oder Gläubigerrechten durch den Umbrella-Fonds bzw. der Teilvermögen, einschliesslich der Honorarkosten für externe Berater;
- j) Kosten und Honorare im Zusammenhang mit im Namen des Umbrella-Fonds bzw. der Teilvermögen eingetragenen geistigen Eigentum oder mit Nutzungsrechten des Umbrella-Fonds bzw. der Teilvermögen;
- k) alle Kosten, die durch die Ergreifung ausserordentlicher Schritte zur Wahrung der Anlegerinteressen durch die Fondsleitung, den Vermögensverwalter kollektiver Kapitalanlagen oder die Depotbank verursacht werden;
- l) Kosten für die Registrierung oder Verlängerung des Identifikators eines Rechtsträgers (Legal Entity Identifier) bei in- und ausländischen Registrierungsstellen;
- m) Kosten und Gebühren im Zusammenhang mit der Kotierung des Umbrella-Fonds bzw. der Teilvermögen;
- n) Kosten und Gebühren für den Einkauf und die Nutzung von Daten und Datenlizenzen, soweit sie dem Umbrella-Fonds bzw. den Teilvermögen zugerechnet werden können und keine Recherchekosten darstellen;
- o) Kosten und Gebühren für die Nutzung und Überprüfung unabhängiger Label.»

Zudem wird neu in § 21 Ziff. 4 klargestellt, dass die Fondsleitung keine Retrozessionen oder Rabatte bezahlt. Die neu formulierten Bestimmungen lauten nunmehr wie folgt:

«Die Fondsleitung und deren Beauftragte bezahlen weder Retrozessionen zur Entschädigung der Vertriebstätigkeit von Fondsanteilen noch Rabatte, um die auf den Anleger

entfallenden, dem Vermögen des Teilvermögens belasteten Gebühren und Kosten zu reduzieren.»

§§ 36A, 37B, 36C, 36D, 36E, 36F, 36G, 36H, 37I Verwaltungs- und Depotbankkommission

Die Verwaltungskommission wird nunmehr jeweils am Quartalsende und nicht wie bisher am Monatsende dem Vermögen des jeweiligen Teilvermögens belastet und ausbezahlt.

Daneben werden im gesamten Fondsvertrag Anpassungen des Wortlauts vorgenommen, die keine inhaltlichen Auswirkungen haben.

In Übereinstimmung mit Art. 41 Abs. 1 und Abs. 2^{bis} i.V.m. Art. 35a Abs. 1 und 2 der Verordnung über die kollektiven Kapitalanlagen (KKV) werden die Anleger darüber informiert, dass sich die Prüfung und Feststellung der Gesetzeskonformität der Änderungen des Fondsvertrages durch die Eidgenössische Finanzmarktaufsicht FINMA auf die Bestimmungen gemäss Art. 35a Abs. 1 lit. a - g KKV erstreckt.

Dieser Publikationstext wird am 11. März 2024 auf der elektronischen Plattform der Swiss Fund Data AG (www.swissfunddata.ch) veröffentlicht.

Anleger, welche gegen die vorgesehenen Änderungen des Fondsvertrags Einwendung erheben wollen, müssen dies innert 30 Tagen seit der Publikation gegenüber der Aufsichtsbehörde (Eidgenössische Finanzmarktaufsicht FINMA, Laupenstrasse 27, 3003 Bern) geltend machen (Art. 27 Abs. 3 KAG). Den bestehenden Anlegern steht zudem das Recht zu, die Auszahlung ihrer Anteile zu verlangen.

Die Vertragsänderungen im Wortlaut, der Fondsvertrag mit Anhang sowie der Jahresbericht können bei der Fondsleitung, der Depotbank und jedem Vertreiber kostenlos bezogen werden.

Zürich, 11. März 2024

Die Fondsleitung

Swiss Life Asset Management AG, General-Guisan-Quai 40, 8002 Zürich

Die Depotbank

UBS Switzerland AG, Bahnhofstrasse 45, 8001 Zürich

Bundesgesetz über die kollektiven Kapitalanlagen (KAG) vom 23. Juni 2006, Art. 27 Abs. 2 KAG

Swiss Life iFunds (CH)

Vertraglicher Umbrella-Fonds schweizerischen Rechts der Art «Übrige Fonds für traditionelle Anlagen» für qualifizierte Anleger mit den Teilvermögen

Swiss Life iFunds (CH) Equity Switzerland Small & Mid Cap (CHF)

Swiss Life iFunds (CH) Equity ESG Global ex Switzerland (CHF)

Swiss Life iFunds (CH) Bond Swiss Francs Foreign (CHF)

Swiss Life iFunds (CH) Bond Global Government + (CHF hedged)

Swiss Life iFunds (CH) Bond Global Corporates (CHF hedged)

Swiss Life iFunds (CH) Bond Swiss Francs Domestic (CHF)

Swiss Life iFunds (CH) Equity Switzerland (CHF)

Swiss Life iFunds (CH) Bond Global Corporates Short Term (CHF hedged)

Swiss Life iFunds (CH) Bond Global Aggregate (CHF hedged)

Swiss Life Asset Management AG, Zürich, als Fondsleitung, und UBS Switzerland AG, Zürich, als Depotbank, beabsichtigen gemäss Art. 27 des Bundesgesetzes über die kollektiven Kapitalanlagen vom 23. Juni 2006 (KAG) die nachfolgend erwähnten Änderungen im Fondsvertrag des oben aufgeführten Umbrella-Fonds vorzunehmen. Die vorgesehenen Änderungen betreffen insbesondere die Umsetzung der AMAS-Selbstregulierung zur Transparenz und Offenlegung bei Kollektivvermögen mit Nachhaltigkeitsbezug, die Angleichung des Wortlautes an das Kollektivanlagengesetz (KAG) und an die Kollektivanlageverordnung (KKV) in der Fassung vom 1. März 2024. Daneben werden im gesamten Fondsvertrag Anpassungen formeller Art vorgenommen.

Die Anleger des oben erwähnten Umbrella-Fonds bzw. der Teilvermögen werden hiermit über die nachfolgenden Änderungen des Fondsvertrages informiert:

§ 8 Anlagepolitik

Die Bestimmung in § 8 Ziff. 12 wird dem Wortlaut des Art. 78a KAG angeglichen. § 8 Ziff. 12 lautet neu:

«12. Die Fondsleitung stellt eine den Anlagen, der Anlagepolitik, der Risikoverteilung, dem Anlegerkreis und der Rücknahmefrequenz angemessene Liquidität sicher.»

§ 18 Berechnung des Nettoinventarwertes

In § 18 Ziff. 7 werden die Umstände, bei welchen die Fondsleitung die tatsächliche Höhe der Nebenkosten anstelle der durchschnittlichen Nebenkosten berücksichtigen kann, angepasst. § 18 Ziff. 7 lautet neu:

7. Für alle Teilvermögen mit Ausnahme der Teilvermögen Swiss Life iFunds (CH) Equity Switzerland (CHF) und Swiss Life iFunds (CH) Equity ESG Global ex Switzerland (CHF) gilt: Falls an einem Bewertungstag die Summe der Zeichnungen und Rücknahmen von Anteilen eines Teilvermögens zu einem Nettovermögenszufluss bzw. -abfluss führt, wird der Nettoinventarwert des entsprechenden Teilvermögens erhöht bzw. reduziert (Swinging Single Pricing). Die maximale Anpassung beläuft sich auf 2% des Nettoinventarwertes. Berücksichtigt werden die Nebenkosten (Geld/Briefspannen, marktübliche Courtagen, Kommissionen, Steuern und Abgaben) sowie die Kosten für die Überprüfung und Aufrechterhaltung von Qualitätsstandards bei physischen Anlagen, die aus der Anlage des einbezahlten Betrags bzw. aus dem Verkauf eines dem gekündigten Anteil entsprechenden Teils der Anlagen erwachsen. Die Anpassung führt zu einer Erhöhung des Nettoinventarwertes, wenn die Nettobewegung zu einem Anstieg der Anzahl Anteile des Anlagefonds führt. Die Anpassung resultiert in einer Verminderung des Nettoinventarwertes, wenn die Nettobewegung einen Rückgang der Anzahl der Anteile des entsprechenden Teilvermögens bewirkt. Die Berücksichtigung dieser Nebenkosten entfällt, falls die Fondsleitung einer Ein- oder Auszahlung in Anlagen statt in bar gemäss § 19 Ziff. 8 gestattet sowie beim Wechsel zwischen Anteilklassen innerhalb des Teilvermögens. Der unter Anwendung des Swinging Single Pricing ermittelte Nettoinventarwert ist somit ein gemäss Satz 1 dieser Ziffer modifizierter Nettoinventarwert.

Die Fondsleitung berücksichtigt grundsätzlich die durchschnittlichen Nebenkosten. Bei der Anpassung des Nettoinventarwertes kann sie jedoch auch die tatsächliche Höhe der Nebenkosten berücksichtigen, sofern dies unter Berücksichtigung der relevanten Umstände (**z.B. Höhe des Betrags, allgemeine Marktsituation, usw.**) im Ermessen der Fondsleitung angemessen erscheint. Die Anpassung kann in einem solchen Fall höher oder tiefer als die durchschnittlichen Nebenkosten ausfallen.

In den in § 19 Ziff. 5 genannten sowie in sonstigen ausserordentlichen Fällen kann, sofern dies nach Ansicht der Fondsleitung im Interesse der Gesamtheit der Anleger geboten ist, zudem der Höchstwert von 2% des Nettoinventarwertes überschritten werden. Die Fondsleitung teilt den Entscheid über die Überschreitung unverzüglich der Prüfgesellschaft, der Aufsichtsbehörde sowie in angemessener Weise den bestehenden und neuen Anlegern mit.»

§ 19 Ausgabe und Rücknahme von Anteilen

In § 19 Ziff. 4 werden die Umstände, bei welchen die Fondsleitung die tatsächliche Höhe der Nebenkosten anstelle der durchschnittlichen Nebenkosten berücksichtigen kann, ebenfalls angepasst. § 19 Ziff. 4 lautet neu:

- «4. Für die Teilvermögen Swiss Life iFunds (CH) Equity Switzerland (CHF) und Swiss Life iFunds (CH) Equity ESG Global ex Switzerland (CHF) gilt: Die Nebenkosten für den An- und Verkauf der Anlagen einschliesslich Absicherungsgeschäften (Geld-/Briefspannen, marktübliche Courtagen, Kommissionen, Abrechnungs- und Abwicklungskosten, Bankspesen, Steuern und Abgaben) sowie die Kosten für die Überprüfung und Aufrechterhaltung von Qualitätsstandards bei physischen Anlagen von maximal 2%, die aus der Anlage des einbezahlten Betrages bzw. aus dem Verkauf eines dem gekündigten Anteil entsprechenden Teils der Anlagen im Durchschnitt erwachsen, werden als Verwässerungsschutz den ein- bzw. aussteigenden Anlegern zugunsten des entsprechenden Teilvermögens belastet (Ausgabe- und Rücknahmegebühr). Dabei kann in dem Umfang auf die Erhebung einer Ausgabe- und Rücknahmegebühr zugunsten des entsprechenden Teilvermögens verzichtet werden, sofern Ausgaben und Rücknahmen an einem Bankwerktag gegeneinander aufgerechnet werden können, so dass beim entsprechenden Teilvermögen lediglich auf dem sich aus der Differenz zwischen Ausgaben und Rücknahmen ergebenden Nettoinvestitions- bzw. Nettodesinvestitionsbedarf Ausgabe- bzw. Rücknahmegebühren erhoben werden. Werden auf diese Weise Ausgabegebühren aus einem Nettoinvestitionsbedarf erhoben, sind die zeichnenden Anleger am jeweiligen Bankwerktag untereinander gleich zu behandeln. Entsprechend sind bei der Erhebung von Rücknahmegebühren aus einem Nettodesinvestitionsbedarf des entsprechenden Teilvermögens die zurückgebenden Anleger am jeweiligen Bankwerktag untereinander gleich zu behandeln.

Die Fondsleitung kann, anstelle der vorstehend erwähnten durchschnittlichen Nebenkosten bei der Belastung auch die tatsächliche Höhe der Nebenkosten berücksichtigen, sofern dies unter Berücksichtigung der relevanten Umstände (**z.B. Höhe des Betrags, allgemeine Marktsituation, usw.**) im Ermessen der Fondsleitung angemessen erscheint. Die Belastung kann in einem solchen Fall höher oder tiefer als die durchschnittlichen Nebenkosten ausfallen.

In den in Ziff. 6 genannten sowie in sonstigen ausserordentlichen Fällen kann, sofern dies nach Ansicht der Fondsleitung im Interesse der Gesamtheit der Anleger geboten ist, zudem der Höchstwert von 2% des Nettoinventarwertes überschritten werden. Die Fondsleitung teilt den Entscheid über die Überschreitung

unverzüglich der Prüfgesellschaft, der Aufsichtsbehörde sowie in angemessener Weise den bestehenden und neuen Anlegern mit.

Die Erhebung einer Ausgabe- und Rücknahmegebühr entfällt, falls die Fondsleitung einer Ein- und Auszahlung in Sachwerten statt in bar gemäss Ziff. 9 gestattet sowie bei einem Wechsel zwischen Anteilklassen innerhalb eines Teilvermögens.

§ 21 Vergütungen und Nebenkosten zu Lasten des Vermögens der Teilvermögen

Die Bestimmungen zu den Vergütungen und Nebenkosten zu Lasten des Vermögens der Teilvermögen werden dem Wortlaut des Art. 37 Abs. 2 KKV angeglichen. § 21 Ziff. 2 lautet neu wie folgt:

«2. Fondsleitung und Depotbank haben ausserdem Anspruch auf Ersatz der folgenden Auslagen, die ihnen in Ausführung des Fondsvertrages entstehen:

- a) Kosten im Zusammenhang mit dem An- und Verkauf von Anlagen einschliesslich Absicherungsgeschäften, (Geld-/Briefspannen, marktübliche Courtagen, Kommissionen, Abrechnungs- und Abwicklungskosten, Bankspesen, Steuern und Abgaben) sowie Kosten für die Überprüfung und Aufrechterhaltung von Qualitätsstandards bei physischen Anlagen;
- b) Abgaben der Aufsichtsbehörde für die Gründung, Änderung, Liquidation, Fusion oder Vereinigung des Umbrella-Fonds bzw. der Teilvermögen;
- c) Jahresgebühr der Aufsichtsbehörde;
- d) Honorare der Prüfgesellschaft für die Prüfung sowie für Bescheinigungen im Rahmen von Gründungen, Änderungen, Liquidation, Fusion oder Vereinigungen des Umbrella-Fonds bzw. der Teilvermögen;
- e) Honorare für Rechts- und Steuerberater im Zusammenhang mit Gründungen, Änderungen, Liquidationen, Fusionen oder Vereinigung des Umbrella-Fonds bzw. der Teilvermögen sowie der allgemeinen Wahrnehmung der Interessen des Umbrella-Fonds bzw. der Teilvermögen und seiner Anleger;
- f) Kosten für die Publikation des Nettoinventarwertes des Umbrella-Fonds bzw. der Teilvermögen sowie sämtliche Kosten für Mitteilungen an die Anleger einschliesslich der Übersetzungskosten, die nicht einem Fehlverhalten der Fondsleitung zuzuschreiben sind;
- g) Kosten für den Druck und die Übersetzung juristischer Dokumente sowie Jahresberichte des Umbrella-Fonds bzw. der Teilvermögen;

h) Kosten für eine allfällige Eintragung des Umbrella-Fonds bzw. der Teilvermögen bei einer ausländischen Aufsichtsbehörde, namentlich von der ausländischen Aufsichtsbehörde erhobene Kommissionen, Übersetzungskosten sowie die Entschädigung des Vertreters oder der Zahlstelle im Ausland;

i) Kosten im Zusammenhang mit der Ausübung von Stimmrechten oder Gläubigerrechten durch den Umbrella-Fonds bzw. der Teilvermögen, einschliesslich der Honorarkosten für externe Berater;

j) Kosten und Honorare im Zusammenhang mit im Namen des Umbrella-Fonds bzw. der Teilvermögen eingetragenen geistigen Eigentum oder mit Nutzungsrechten des Umbrella-Fonds bzw. der Teilvermögen;

k) alle Kosten, die durch die Ergreifung ausserordentlicher Schritte zur Wahrung der Anlegerinteressen durch die Fondsleitung, den Vermögensverwalter kollektiver Kapitalanlagen oder die Depotbank verursacht werden;

l) Kosten für die Registrierung oder Verlängerung des Identifikators eines Rechtsträgers (Legal Entity Identifier) bei in- und ausländischen Registrierungsstellen;

m) Kosten und Gebühren im Zusammenhang mit der Kotierung des Umbrella-Fonds bzw. der Teilvermögen;

n) Kosten und Gebühren für den Einkauf und die Nutzung von Daten und Datenlizenzen, soweit sie dem Umbrella-Fonds bzw. den Teilvermögen zugerechnet werden können und keine Recherchekosten darstellen;

o) Kosten und Gebühren für die Nutzung und Überprüfung unabhängiger Label.

Bei Teilnahme an Sammelklagen im Interesse der Anleger darf die Fondsleitung die daraus entstehenden Kosten Dritter (z.B. Anwalts- und Depotbankkosten) dem Vermögen der Teilvermögen belasten. Zusätzlich kann die Fondsleitung sämtliche administrativen Aufwände dem Vermögen der Teilvermögen belasten, sofern diese nachweisbar sind und im Rahmen der Berechnung und Offenlegung der TER der Teilvermögen ausgewiesen bzw. berücksichtigt werden.»

§ 26 Vereinigung

In § 26 Ziff. 2 Bst. c wird die Bestimmung zu den Nebenkosten für den An- und Verkauf von Anlagen angepasst und ergänzt. § 26 Ziff. 2 Bst. c lautet neu wie folgt:

«2. Teilvermögen bzw. Anlagefonds können nur vereinigt werden, sofern:

- a) [keine Änderungen]
- b) [keine Änderungen]
- c) die entsprechenden Fondsverträge bezüglich folgender Bestimmungen grundsätzlich übereinstimmen:
 - die Anlagepolitik, die Anlagetechniken, die Risikoverteilung sowie die mit der Anlage verbundenen Risiken;
 - die Verwendung des Nettoertrags und der Kapitalgewinne aus der Veräusserung von Sachen und Rechten;
 - die Art, die Höhe und die Berechnung aller Vergütungen, die Ausgabe- und Rücknahmekommissionen sowie die Nebenkosten für den An- und Verkauf von Anlagen einschliesslich Absicherungsgeschäften (Geld-/Briefspannen, marktübliche Courtagen, Kommissionen, Abrechnungs- und Abwicklungskosten, Steuern und Abgaben) sowie Kosten für die Überprüfung und Aufrechterhaltung von Qualitätsstandards bei physischen Anlagen, die dem Fondsvermögen bzw. dem Vermögen des Teilvermögens oder den Anlegern belastet werden dürfen;
 - die Rücknahmebedingungen;
 - die Laufzeit des Vertrages und die Voraussetzungen der Auflösung;
- d) [keine Änderungen]
- e) [keine Änderungen]

Vorbehalten bleiben die Bestimmungen gemäss § 21 Ziff. 2 Bst. b, d und e.»

§ 31B Anlegerkreis

Die Bestimmungen zum Anlegerkreis in § 31B Bst. a und b zu den Doppelbesteuerungsabkommen Schweiz-USA und Schweiz-Japan für das Teilvermögen «Swiss Life iFunds (CH) Equity ESG Global ex Switzerland (CHF)» werden angepasst. § 31 Bst. a und b lauten neu:

«Der Kreis der Anleger ist beschränkt auf Anleger mit Domizil in der Schweiz, die sowohl

- a) unter dem Doppelbesteuerungsabkommen Schweiz-USA in der gemäss Protokoll vom 23. September 2009 geänderten Fassung und in Kraft per 20. September 2019 (DBA CH-USA) sowie gemäss der Verständigungsvereinbarung vom 16. April / 6. Mai 2021 in Verbindung mit Art. 10 Abs. 3 DBA CH-USA Anspruch auf die vollständige Entlastung von der US-Quellensteuer auf US-Dividenden haben (0% Quellensteuersatz) als auch

- b) unter dem Doppelbesteuerungsabkommen Schweiz-Japan vom 19. Januar 1971 (DBA CH-JP) sowie des Briefwechsels vom 21. Mai 2010 zwischen dem Schweizerischen Bundesrat und der Regierung von Japan betreffend das Abkommen zur Vermeidung der Doppelbesteuerung auf dem Gebiete der Steuern vom Einkommen, in der aktuellen bzw. gültigen Fassung, Anspruch auf die vollständige Entlastung von der japanischen Quellensteuer auf japanische Dividenden haben (0% Quellensteuersatz).»

§ 33B Anlageziel und Anlagepolitik

Die Bestimmung in § 33B Ziff. 1 für das Teilvermögen «Swiss Life iFunds (CH) Equity ESG Global ex Switzerland (CHF)» wird umformuliert. § 33B Ziff. 1 lautet neu:

- «1. Das Anlageziel dieses Teilvermögens besteht darin, einen angemessenen Anlageertrag in der Rechnungseinheit mittels Abbildung der im Anhang genannten Benchmark zu erreichen.»

Weiter berücksichtigt das Teilvermögen «Swiss Life iFunds (CH) Equity ESG Global ex Switzerland (CHF)» neu die nachhaltigen Anlageansätze «**Ausschlüsse**» und «**Best-in-Class/Positive-Screening**». Die Bestimmungen in § 33B Ziff. 1 und 2 werden daher angepasst und lauten neu wie folgt:

- «2. Die Benchmark misst unter Berücksichtigung der ESG-Kriterien die Entwicklung von Beteiligungswertpapieren und -rechten von Unternehmen weltweit, die in der Benchmark enthalten sind und über ein gemäss der Indexmethodologie standardisiertes Nachhaltigkeitsprofil verfügen. Dadurch sollen nachhaltig wirtschaftende Unternehmen und somit eine langfristige, nachhaltige Ausrichtung der globalen Wirtschaft gefördert werden. Das Teilvermögen strebt durch die Nachbildung der Benchmark, deren Methodologie unter anderem die in Ziff. 7.3.1 des Anhangs beschriebenen Nachhaltigkeitsansätze «**Ausschlüsse**» und «**Best-in-Class/Positive-Screening-Ansatz**» eine insgesamt nachhaltige Anlage des Vermögens dieses Teilvermögens an:

- a) Ausschlüsse: Von der Benchmark ausgeschlossen werden Unternehmen

- mit einem Umsatz aus kontroverser Geschäftstätigkeit von mehr als 0% bis 15% je nach Geschäftsfeld (namentlich kontroverse und konventionelle Kriegswaffen, zivile Schusswaffen, Tabak, Alkohol, Glücksspiel, Kernenergie, Förderung fossiler Brennstoffe und Kraftwerkskohle-basierte Energie) und
- welche aufgrund ihrer Geschäftstätigkeiten und -praktiken, Produkte oder Dienstleistungen in einem konsistenten Bewertungsrahmen als Unternehmen mit

schweren ESG-Kontroversen (Kontroversen Rating ist <3, auf einer Skala von 0 = sehr schwer bis 10 = keine Kontroversen) eingestuft werden.

- b) Best-in-Class/Positive-Screening-Ansatz: In die Benchmark werden ausschliesslich Unternehmen aufgenommen die ein Mindest-ESG-Rating von BB auf einer ESG-Rating Skala von führend (AAA, AA), über durchschnittlich (A, BBB, BB), bis rückständig (B, CCC) aufweisen (Positive-Screening). In die Benchmark aufgenommen wird sodann nur die Hälfte vom kumulierten Indexgewicht der verbleibenden Unternehmen pro Sektor im Stammindex mit den jeweils besten ESG-Ratings (Best-in-Class-Ansatz).

Mindestens 75% (nach Abzug der flüssigen Mittel) des Vermögens des Teilvermögens werden direkt oder indirekt in Gesellschaften investiert, die in der vorgenannten Benchmark enthalten sind, oder von denen aufgrund der für die Benchmark vorgesehenen Aufnahmekriterien mit grosser Wahrscheinlichkeit zu erwarten ist, dass die Gesellschaften in die Benchmark aufgenommen werden.

Die übrigen Anlagen innerhalb des Teilvermögens, die sich nicht an einer Benchmark orientieren, wenden keine ESG-Ansätze an. Eine Anwendung von ESG-Ansätzen ist für diese Anlagen nicht möglich aufgrund mangelnder Datengrundlage und methodischen Schwierigkeiten, die angesichts der besonderen Eigenschaften dieser Anlagen, insbesondere der Geldmarktfonds und Geldmarktinstrumente, vorkommen.»

§ 32G Anlageziel und Anlagepolitik

Die Bestimmung in § 32G Ziff. 1 für das Teilvermögen «Swiss Life iFunds (CH) Equity Switzerland (CHF)» wird umformuliert. § 32G Ziff. 1 lautet neu:

«1. Das Anlageziel dieses Teilvermögens besteht darin, einen angemessenen Anlageertrag in der Rechnungseinheit mittels Abbildung der im Anhang genannten Benchmark zu erreichen.»

Daneben werden im gesamten Fondsvertrag des oben aufgeführten Umbrella-Fonds Anpassungen des Wortlauts vorgenommen, welche keine inhaltlichen Auswirkungen haben.

In Übereinstimmung mit Art. 41 Abs. 1 und Abs. 2bis i.V.m. Art. 35a Abs. 1 und 2 der Verordnung über die kollektiven Kapitalanlagen (KKV) werden die Anleger darüber informiert, dass sich die Prüfung und die Feststellung der Gesetzeskonformität der Änderungen des Fondsvertrages durch die Eidgenössische Finanzmarktaufsicht FINMA auf die Bestimmungen gemäss Art. 35a Abs. 1 lit. a–g KKV erstreckt. Damit unterliegen die aufgeführten Änderungen der Prüfung und der Feststellung der Gesetzeskonformität durch die FINMA, ausser § 18, § 19, § 21 und § 26.

Dieser Publikationstext wird am 30. September 2024 auf der elektronischen Plattform der Swiss Fund Data AG (www.swissfunddata.ch) veröffentlicht.

Anleger, welche gegen die vorgesehenen Änderungen des Fondsvertrags Einwendung erheben wollen, müssen dies innert 30 Tagen seit der Publikation gegenüber der Aufsichtsbehörde (Eidgenössische Finanzmarktaufsicht FINMA, Laupenstrasse 27, 3003 Bern) geltend machen (Art. 27 Abs. 3 KAG). Den bestehenden Anlegern steht zudem das Recht zu, die Auszahlung ihrer Anteile zu verlangen.

Die Vertragsänderungen im Wortlaut, der Fondsvertrag mit Anhang sowie der Jahresbericht können bei der Fondsleitung, der Depotbank und jedem Vertreter kostenlos bezogen werden.

Zürich, 30. September 2024

Die Fondsleitung

Swiss Life Asset Management AG, General-Guisan-Quai 40, 8002 Zürich

Die Depotbank

UBS Switzerland AG, Bahnhofstrasse 45, 8001 Zürich

Aktive Anlageverstösse

Aktive Verletzung im Teilvermögen Swiss Life iFunds (CH) Equity Switzerland (CHF) im Zeitraum vom 02.07.2024 bis zum 03.07.2024

Gemäss § 14 Ziffer 2 des Fondsvertrags ist eine Kreditaufnahme vorübergehend und kurzfristig zur Sicherstellung des Anteilsverkehrs sowie zur Regelung technischer Limitenüberschreitungen von maximal 10 Prozent des Nettofondvermögens gestattet. Jedoch ist es nicht gestattet einen Kredit und damit eine strategische Hebelwirkung zu erzielen.

Aufgrund von Kauftransaktionen per Handelstag 02. Juli 2024, die aufgrund einer falschen Annahme seitens des Portfoliomanagements getätigt wurden, war das Teilvermögen in der genannten Periode um 0,32 Prozent des Nettofondvermögens überinvestiert, was eine Hebelwirkung und valutarische Kreditaufnahme zur Folge hatte. Unter Berücksichtigung der getätigten Transaktionen zur Rückführung der aktiven Anlagegrenzverletzung per Handelstag 04. Juli 2024, ist dem Teilvermögen gesamthaft ein Gewinn in Höhe von CHF 2 181.80 entstanden, der im Teilvermögen verblieben ist.

Kurzbericht der kollektivanlagengesetzlichen Prüfgesellschaft

an den Verwaltungsrat der Fondsleitung Swiss Life Asset Management AG, Zürich

Kurzbericht zur Prüfung der Jahresrechnung

Prüfungsurteil

Wir haben die Jahresrechnung des Umbrella-Fonds Swiss Life iFunds (CH) mit den Teilvermögen

Swiss Life iFunds (CH) Equity Switzerland Small & Mid Cap (CHF)
Swiss Life iFunds (CH) Bond Swiss Francs Foreign (CHF)
Swiss Life iFunds (CH) Bond Global Government + (CHF hedged)
Swiss Life iFunds (CH) Bond Global Corporates (CHF hedged)
Swiss Life iFunds (CH) Bond Swiss Francs Domestic (CHF)
Swiss Life iFunds (CH) Equity Switzerland (CHF)
Swiss Life iFunds (CH) Bond Global Corporates Short Term (CHF hedged)
Swiss Life iFunds (CH) Bond Global Aggregate (CHF hedged)

– bestehend aus der Vermögensrechnung zum 30. September 2024, der Erfolgsrechnung für das dann endende Jahr, den Angaben über die Verwendung des Erfolges und die Offenlegung der Kosten sowie den weiteren Angaben gemäss Art. 89 Abs. 1 Bst. b–h des schweizerischen Kollektivanlagengesetzes (KAG) – geprüft.

Nach unserer Beurteilung entspricht die beigelegte Jahresrechnung dem schweizerischen Kollektivanlagengesetz, den dazugehörigen Verordnungen sowie dem Fondsvertrag und dem Anhang.

Grundlage für das Prüfungsurteil

Wir haben unsere Abschlussprüfung in Übereinstimmung mit dem schweizerischen Gesetz und den Schweizer Standards zur Abschlussprüfung (SA-CH) durchgeführt. Unsere Verantwortlichkeiten nach diesen Vorschriften und Standards sind im Abschnitt «Verantwortlichkeiten der kollektivanlagengesetzlichen Prüfgesellschaft für die Prüfung der Jahresrechnung» unseres Berichts weitergehend beschrieben. Wir sind vom Umbrella-Fonds sowie der Fondsleitung unabhängig in Übereinstimmung mit den schweizerischen gesetzlichen Vorschriften und den Anforderungen des Berufsstands, und wir haben unsere sonstigen beruflichen Verhaltenspflichten in Übereinstimmung mit diesen Anforderungen erfüllt.

Wir sind der Auffassung, dass die von uns erlangten Prüfungsnachweise ausreichend und geeignet sind, um als eine Grundlage für unser Prüfungsurteil zu dienen.

Sonstige Informationen

Der Verwaltungsrat der Fondsleitung ist für die sonstigen Informationen verantwortlich. Die sonstigen Informationen umfassen die im Jahresbericht enthaltenen Informationen, aber nicht die Jahresrechnung und unseren dazugehörigen Bericht.

Unser Prüfungsurteil zur Jahresrechnung erstreckt sich nicht auf die sonstigen Informationen, und wir bringen keinerlei Form von Prüfungsschlussfolgerung hierzu zum Ausdruck.

Im Zusammenhang mit unserer Abschlussprüfung haben wir die Verantwortlichkeit, die sonstigen Informationen zu lesen und dabei zu würdigen, ob die sonstigen Informationen wesentliche Unstimmigkeiten zur Jahresrechnung oder unseren bei der Abschlussprüfung erlangten Kenntnissen aufweisen oder anderweitig wesentlich falsch dargestellt erscheinen.

Falls wir auf Grundlage der von uns durchgeführten Arbeiten den Schluss ziehen, dass eine wesentliche falsche Darstellung dieser sonstigen Informationen vorliegt, sind wir verpflichtet, über diese Tatsache zu berichten. Wir haben in diesem Zusammenhang nichts zu berichten.

Verantwortlichkeiten des Verwaltungsrats der Fondsleitung für die Jahresrechnung

Der Verwaltungsrat der Fondsleitung ist verantwortlich für die Aufstellung einer Jahresrechnung in Übereinstimmung mit dem schweizerischen Kollektivanlagengesetz, den dazugehörigen Verordnungen sowie dem Fondsvertrag und dem Anhang und für die internen Kontrollen, die der Verwaltungsrat als notwendig feststellt, um die Aufstellung einer Jahresrechnung zu ermöglichen, die frei von wesentlichen falschen Darstellungen aufgrund von dolosen Handlungen oder Irrtümern ist.

Verantwortlichkeiten der kollektivanlagengesetzlichen Prüfgesellschaft für die Prüfung der Jahresrechnung

Unsere Ziele sind, hinreichende Sicherheit darüber zu erlangen, ob die Jahresrechnung als Ganzes frei von wesentlichen falschen Darstellungen aufgrund von dolosen Handlungen oder Irrtümern ist, und einen Bericht abzugeben, der unser Prüfungsurteil beinhaltet. Hinreichende Sicherheit ist ein hohes Mass an Sicherheit, aber keine Garantie dafür, dass eine in Übereinstimmung mit dem schweizerischen Gesetz und den SA-CH durchgeführte Abschlussprüfung eine wesentliche falsche Darstellung, falls eine solche vorliegt, stets aufdeckt. Falsche Darstellungen können aus dolosen Handlungen oder Irrtümern resultieren und werden als wesentlich gewürdigt, wenn von ihnen einzeln oder insgesamt vernünftigerweise erwartet werden könnte, dass sie die auf der Grundlage dieser Jahresrechnung getroffenen wirtschaftlichen Entscheidungen von Nutzern beeinflussen.

Als Teil einer Abschlussprüfung in Übereinstimmung mit dem schweizerischen Gesetz und den SA-CH üben wir während der gesamten Abschlussprüfung pflichtgemässes Ermessen aus und bewahren eine kritische Grundhaltung. Darüber hinaus:

- identifizieren und beurteilen wir die Risiken wesentlicher falscher Darstellungen in der Jahresrechnung aufgrund von dolosen Handlungen oder Irrtümern, planen und führen Prüfungshandlungen als Reaktion auf diese Risiken durch sowie erlangen Prüfungsnachweise, die ausreichend und geeignet sind, um als Grundlage für unser Prüfungsurteil zu dienen. Das Risiko, dass aus dolosen Handlungen resultierende wesentliche falsche Darstellungen nicht aufgedeckt werden, ist höher als ein aus Irrtümern resultierendes, da dolose Handlungen kollusives Zusammenwirken, Fälschungen, beabsichtigte Unvollständigkeiten, irreführende Darstellungen oder das Ausserkraftsetzen interner Kontrollen beinhalten können.
- gewinnen wir ein Verständnis von dem für die Abschlussprüfung relevanten internen Kontrollsystem, um Prüfungshandlungen zu planen, die unter den gegebenen Umständen angemessen sind, jedoch nicht mit dem Ziel, ein Prüfungsurteil zur Wirksamkeit des internen Kontrollsystems des Umbrella-Fonds abzugeben.
- beurteilen wir die Angemessenheit der angewandten Rechnungslegungsmethoden sowie die Vertretbarkeit der dargestellten geschätzten Werte in der Rechnungslegung und damit zusammenhängenden Angaben.

Wir kommunizieren mit dem Verwaltungsrat der Fondsleitung unter anderem über den geplanten Umfang und die geplante zeitliche Einteilung der Abschlussprüfung sowie über bedeutsame Prüfungsfeststellungen, einschliesslich etwaiger bedeutsamer Mängel im internen Kontrollsystem, die wir während unserer Abschlussprüfung identifizieren.

PricewaterhouseCoopers AG

Andreas Scheibli
Zugelassener Revisionsexperte
Leitender Prüfer

Pascal Zimmermann
Zugelassener Revisionsexperte

Zürich, 22. Januar 2025

Swiss Life iFunds (CH) Equity Switzerland Small & Mid Cap (CHF)

Art übrige Fonds für traditionelle Anlagen

Dreijahresvergleich

	ISIN	30.9.2024	30.9.2023	30.9.2022
Nettofondsvermögen in CHF		298 408 379.97	220 137 903.42	211 438 848.65
Klasse I-A1	CH0023989467			
Nettoinventarwert pro Anteil in CHF		2 524.53	2 259.47	1 986.33
Ausgabe- und Rücknahmepreis pro Anteil in CHF ¹		2 527.56	2 262.18	1 988.71
Anzahl Anteile im Umlauf		118 007.9360	97 248.0000	106 388.0000
Klasse I-A2	CH1197235372			
Nettoinventarwert pro Anteil in CHF		1 145.81	1 025.48	892.53
Ausgabe- und Rücknahmepreis pro Anteil in CHF ¹		1 147.18	1 026.71	893.60
Anzahl Anteile im Umlauf		431.0000	399.0000	131.0000

¹ Siehe Ergänzende Angaben

Performance

	Währung	2023/2024	2022/2023	2021/2022
Klasse I-A1	CHF	13.5%	15.0%	-24.6%
Klasse I-A2	CHF	13.4%	14.9%	-10.8%
Referenzindex:				
SPI EXTRA [®] Total Return ¹	CHF	12.3%	11.3%	-26.4%
SPI EXTRA [®] Total Return ²	CHF	12.3%	11.3%	-10.8%

¹ Referenzindex Performance der Klasse I-A1
² Referenzindex Performance der Klasse I-A2

Die historische Performance stellt keinen Indikator für die laufende oder zukünftige Performance dar.
 Die Performancedaten lassen die bei der Ausgabe und Rücknahme der Anteile erhobenen Kommissionen und Kosten unberücksichtigt.

Struktur des Wertpapierportfolios (ungeprüft)

Aufteilung nach Risikodomizil in % des Gesamtfondsvermögens	
Schweiz	95.64
Total	95.64

Obige Prozentsätze können Rundungsdifferenzen enthalten.

Vermögensrechnung

	30.9.2024	30.9.2023
	CHF	CHF
Verkehrswerte		
Bankguthaben		
– auf Sicht	11 277 092.03	10 922 773.63
Effekten		
– Aktien und andere Beteiligungspapiere	286 221 862.52	207 841 196.62
Sonstige Vermögenswerte	1 780 039.31	1 785 241.34
Gesamtfondsvermögen	299 278 993.86	220 549 211.59
Kurzfristige Bankverbindlichkeiten	-328 549.90	0.00
Andere Verbindlichkeiten	-542 063.99	-411 308.17
Nettofondsvermögen	298 408 379.97	220 137 903.42

Erfolgsrechnung

	1.10.2023-30.9.2024	1.10.2022-30.9.2023
	CHF	CHF
Ertrag		
Erträge der Bankguthaben	132 843.97	120 615.68
Negativzinsen	0.00	-28 192.60
Erträge der Effekten		
– aus Aktien und anderen Beteiligungspapieren	5 061 268.54	5 135 903.02
– aus Gratisaktien	396.66	0.00
Ausgleichszahlungen aus Effektenleihe	130 092.58	134 417.71
Erträge der Effektenleihe	23 504.14	38 786.68
Einkauf in laufende Nettoerträge bei der Ausgabe von Anteilen	98 980.68	91 841.78
Total Ertrag	5 447 086.57	5 493 372.27
Aufwand		
Reglementarische Kommissionsvergütung an die Fondsleitung Klasse I-A1	-1 950 913.71	-1 658 433.21
Reglementarische Kommissionsvergütung an die Fondsleitung Klasse I-A2	-3 610.17	-2 194.90
Reglementarische Kommissionsvergütung an die Depotbank	-17 457.03	-16 828.51
Ausrichtung laufender Nettoerträge bei der Rücknahme von Anteilen	-121 733.94	-286 155.42
Total Aufwand	-2 093 714.85	-1 963 612.04
Nettoertrag	3 353 371.72	3 529 760.23
Realisierte Kapitalgewinne und -verluste	4 989 117.87	1 323 126.84
Realisierter Erfolg	8 342 489.59	4 852 887.07
Nicht realisierte Kapitalgewinne und -verluste	27 818 792.42	26 911 945.81
Gesamterfolg	36 161 282.01	31 764 832.88

Verwendung des Erfolges

	1.10.2023-30.9.2024	1.10.2022-30.9.2023
	CHF	CHF
Nettoertrag des Rechnungsjahres	3 353 371.72	3 529 760.23
Vortrag des Vorjahres	1 152.93	2 857.10
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg	3 354 524.65	3 532 617.33
Zur Ausschüttung an die Anlegerinnen und Anleger vorgesehener Erfolg	-3 350 718.54	-3 531 464.40
Vortrag auf neue Rechnung	3 806.11	1 152.93

Veränderung des Nettofondsvermögens

	1.10.2023-30.9.2024	1.10.2022-30.9.2023
	CHF	CHF
Nettofondsvermögen zu Beginn des Rechnungsjahres	220 137 903.42	211 438 848.65
Ordentliche Jahresausschüttung	-4 207 341.95	-2 586 661.80
Saldo aus dem Anteilverkehr	46 316 536.49	-20 479 116.31
Gesamterfolg	36 161 282.01	31 764 832.88
Nettofondsvermögen am Ende der Berichtsperiode	298 408 379.97	220 137 903.42

Entwicklung der Anteile im Umlauf

	1.10.2023-30.9.2024	1.10.2022-30.9.2023
	Anzahl	Anzahl
Klasse I-A1		
Bestand Anfang Rechnungsjahr	97 248.0000	106 388.0000
Ausgegebene Anteile	30 342.9040	10 907.0000
Zurückgenommene Anteile	-9 582.9680	-20 047.0000
Bestand Ende Berichtsperiode	118 007.9360	97 248.0000

Differenz zwischen den ausgegebenen und zurückgenommenen Anteilen 20 759.9360 -9 140.0000

	Anzahl	Anzahl
Klasse I-A2		
Bestand Anfang Rechnungsjahr	399.0000	131.0000
Ausgegebene Anteile	61.0000	306.0000
Zurückgenommene Anteile	-29.0000	-38.0000
Bestand Ende Berichtsperiode	431.0000	399.0000

Differenz zwischen den ausgegebenen und zurückgenommenen Anteilen 32.0000 268.0000

Ausschüttung für 2023/2024

Klasse I-A1

(Ex-Datum 14.1.2025)

Aufgelaufener Ertrag pro Anteil	CHF	28.3822
Brutto	CHF	28.3500
Abzüglich eidg. Verrechnungssteuer	CHF	-9.9225
Netto pro Anteil (zahlbar ab 16.1.2025)	CHF	18.4275

Klasse I-A2

(Ex-Datum 14.1.2025)

Aufgelaufener Ertrag pro Anteil	CHF	12.0585
Brutto	CHF	12.0500
Abzüglich eidg. Verrechnungssteuer	CHF	-4.2175
Netto pro Anteil (zahlbar ab 16.1.2025)	CHF	7.8325

Inventar des Fondsvermögens

Titel		30.9.2023 Anzahl/ Nominal	Käufe ¹	Verkäufe ²	30.9.2024 Anzahl/ Nominal	Verkehrswert ³ in CHF	in % ³	Davon ausgeliehen Anzahl/Nominal
Effekten, die an einer Börse gehandelt werden								
Inhaberaktien								
Schweiz								
COMET HOLDINGS CHF1 (REGD)*	CHF	16 530	3 700	5 320	14 910	4 972 485	1.66	
DAETWYLER HLDG CHF0.05 (POST SUBDIVISION)*	CHF	12 978	8 049		21 027	3 629 260	1.21	
GALENICA AG CHF0.1*	CHF	77 894	17 400		95 294	7 094 638	2.37	
SENSIRION AG NPV*	CHF	20 816	4 963	2 650	23 129	1 688 417	0.56	
SKAN GROUP AG CHF0.01 (REGD)*	CHF	14 840	19 500		34 340	2 736 898	0.91	
SWATCH GROUP CHF2.25(BR)*	CHF	28 196	8 000	2 000	34 196	6 198 025	2.07	34 196
Total Schweiz						26 319 724	8.79	
Total Inhaberaktien						26 319 724	8.79	
Partizipationsscheine								
Schweiz								
LINDT & SPRUENGLI PTG CERT CHF10*	CHF	1 443	361	110	1 694	18 481 540	6.18	
SCHINDLER-HLDG AG PTG CERT CHF0.10(POST-SUBD)*	CHF	48 200	6 920	3 700	51 420	12 752 160	4.26	
Total Schweiz						31 233 700	10.44	
Total Partizipationsscheine						31 233 700	10.44	
Weitere Aktien								
Schweiz								
ROCHE HLDGS AG GENUSSSCHEINE NPV*	CHF	14 310	5 980		20 290	5 490 474	1.83	
Total Schweiz						5 490 474	1.83	
Total Weitere Aktien						5 490 474	1.83	
Namensaktien								
Schweiz								
ADECCO GROUP AG CHF0.1 (REGD)*	CHF	86 486	60 500		146 986	4 230 257	1.41	
ARBONIA AG CHF4.20 (REGD)*	CHF	291 597	151 847		443 444	5 738 165	1.92	
ARYZIA AG CHF0.02 (REGD)*	CHF	1 336 200	520 000		1 856 200	3 008 900	1.01	
BALOISE-HLDGS CHF0.1(REGD)*	CHF	51 012	7 900	9 250	49 662	8 566 695	2.86	
BARRY CALLEBAUT AG CHF0.02 (REGD)*	CHF	3 761	370		4 131	6 469 146	2.16	3 230
BELIMO HOLDING AG CHF0.05*	CHF	13 717	1 950	2 020	13 647	8 235 965	2.75	
BKW AG CHF2.5*	CHF	32 010	12 600	6 320	38 290	5 873 686	1.96	
BUCHER INDUSTRIES CHF0.20 (REGD)*	CHF	12 610	1 500	3 130	10 980	4 210 830	1.41	10 979
BURCKHARDT COMPRES CHF2.5*	CHF		5 413		5 413	3 280 278	1.10	
BYSTRONIC AG*	CHF	2 742	1 240		3 982	1 381 754	0.46	
CEMBRA MONEY BANK CHF1.00 (REGD)*	CHF	35 271	14 850		50 121	3 957 053	1.32	
CLARIANT CHF1.76 (REGD)*	CHF	255 693		40 300	215 393	2 757 030	0.92	175 449
CREALOGIX HOLDING CHF10(REGD)*	CHF	6 257		6 257				
DKSH HOLDING LTD CHF0.1*	CHF	44 120	6 400		50 520	3 394 944	1.13	
EMMI AG CHF10 (REGD)*	CHF	2 355		830	1 525	1 319 125	0.44	1 366
EMS-CHEMIE HLDG AG CHF0.01(REGD)(POST RECON)*	CHF	4 462			4 462	3 168 020	1.06	
FORBO HLDGS AG CHF0.10(REGD)*	CHF	1 686	810		2 496	2 198 976	0.73	
GALDERMA GROUP AG CHF0.01*	CHF		61 400		61 400	4 826 040	1.61	
GEORG FISCHER AG CHF0.05 (REGD) (POST SPLIT)*	CHF	73 615	32 400	10 000	96 015	6 130 558	2.05	
HELVETIA HOLDING CHF0.02 (REGD) POST SUBD*	CHF	36 420	6 900	4 500	38 820	5 667 720	1.89	
IMPLENIA AG CHF1.02 (REGD)*	CHF	38 750	47 380		86 130	2 726 015	0.91	8 878
INFICON HOLDING AG CHF5(REGD)*	CHF	2 420	830		3 250	3 965 000	1.32	
INTERROLL HLDG AG CHF1 (REGD)*	CHF	1 002	110		1 112	2 852 280	0.95	
JULIUS BAER GRUPPE CHF0.02 (REGD)*	CHF	196 963	43 600	9 800	230 763	11 745 837	3.92	
LINDT & SPRUENGLI CHF100(REGD)*	CHF	16			16	1 724 800	0.58	
MEDMIX AG CHF0.01*	CHF	96 566	12 729	9 600	99 695	1 030 846	0.34	
MOBIMO HLDG AG CHF23.40 (REGD)*	CHF	6 105	3 350		9 455	2 576 488	0.86	932
OC OERLIKON CORP CHF1.00(REGD)*	CHF	187 503			187 503	858 389	0.29	2 722
ORIOR AG CHF4.00*	CHF	27 395	2 455		29 850	1 525 335	0.51	26 783
PSP SWISS PROPERTY CHF0.10 (REGD)*	CHF	33 510	13 300		46 810	5 799 759	1.94	3 441
SANDOZ GROUP AG CHF0.05*	CHF		415 800		415 800	14 665 266	4.90	
SCHAFFNER HLDG AG CHF50(REGD)*	CHF	9 062		9 062				
SCHWEITER TECH SHS*	CHF	1 297		1 297				
SFS GROUP AG CHF0.1*	CHF	18 220	10 900		29 120	3 843 840	1.28	
SGS SA CHF0.04*	CHF	132 350	42 045	2 900	171 495	16 178 838	5.41	
SIEGFRIED HLDG AG CHF27 (REGD)*	CHF	5 714	1 400	785	6 329	7 202 402	2.41	
SIG GROUP AG CHF0.01*	CHF	311 073	160 600	111 000	360 673	6 802 293	2.27	
SOFTWAREONE HLD AG CHF0.01*	CHF	185 124	17 000	2 300	199 824	2 985 371	1.00	
STRAJMANN HLDG CHF0.01 (REGD) (POST SPLIT)*	CHF	97 330	22 280	2 450	117 160	16 197 370	5.41	
SULZER AG CHF0.01*	CHF	32 756	12 550	11 340	33 966	4 700 894	1.57	
SWISSQUOTE GP HLDG CHF0.20 (REGD)*	CHF	15 260	2 400	6 400	11 260	3 427 544	1.15	
TECAN GROUP AG CHF0.10(REGD)*	CHF	12 152	5 780		17 932	4 992 269	1.67	
TEMENOS AG CHF5 (REGD)*	CHF	65 630	29 800		95 430	5 649 456	1.89	
VALIANT HOLDING AG CHF3.30(REGD)*	CHF	22 203			22 203	2 206 978	0.74	
VAT GROUP AG CHF0.10*	CHF	26 285	5 070	2 450	28 905	12 452 274	4.16	
YPSOMED HOLDING AG CHF14.15 (REGD)*	CHF	6 440			6 440	2 653 280	0.89	
Total Schweiz						223 177 965	74.57	
Total Namensaktien						223 177 965	74.57	
Total Effekten, die an einer Börse gehandelt werden						286 221 863	95.64	

Titel	30.9.2023 Anzahl/ Nominal	Käufe ¹	Verkäufe ²	30.9.2024 Anzahl/ Nominal	Verkehrswert ³ in CHF	in % ³	Davon ausgeliehen Anzahl/Nominal
-------	---------------------------------	--------------------	-----------------------	---------------------------------	-------------------------------------	-------------------	--

Effekten, die nicht an einer Börse oder einem andern geregelten Markt gehandelt werden

Namensaktien

Schweiz

SCHAFFNER HLDG AG CHF32.5 (2ND LINE OCT 2023)**	CHF	9 062	9 062				
Total Schweiz						0.00	

Total Namensaktien

0.00

Total Effekten, die nicht an einer Börse oder einem andern geregelten Markt gehandelt werden

0.00

Total Wertschriften

(davon ausgeliehen)					286 221 863	95.64	
					20 807 710	6.95	

Bankguthaben auf Sicht

11 277 092

3.77

Sonstige Vermögenswerte

1 780 039

0.59

Gesamtfondsvermögen

299 278 994

100.00

Kurzfristige Bankverbindlichkeiten

-328 550

Andere Verbindlichkeiten

-542 064

Nettofondsvermögen

298 408 380

Bewertungskategorie

Verkehrswert per
30.9.2024

in %
des Gesamt-
fondsvermögens³

Anlagen bewertet zu den Kursen, die am Hauptmarkt bezahlt werden	286 221 863	95.64
Anlagen bewertet aufgrund von am Markt beobachtbaren Parametern	–	–
Anlagen bewertet mit geeigneten Bewertungsmodellen unter Berücksichtigung der aktuellen Marktgegebenheiten	–	–
Total	286 221 863	95.64

¹ «Käufe» umfassen die Transaktionen: Gratistitel / Käufe / Konversionen / Namensänderungen / «Splits» / Stock-/Wahldividenden / Titelaufteilungen / Überträge / Umbuchungen infolge Redenominierung in Euro / Umtausch zwischen Gesellschaften / Zuteilung aus Bezugs-/Optionsrechten / Zuteilung von Bezugsrechten ab Basisaktien / Sacheinlagen

² «Verkäufe» umfassen die Transaktionen: Auslosungen / Ausbuchung infolge Verfall / Ausübung von Bezugs-/Optionsrechten / «Reverse splits» / Rückzahlungen / Überträge / Umbuchungen infolge Redenominierung in Euro / Umtausch zwischen Gesellschaften / Verkäufe / Sachauslagen

³ Allfällige Abweichungen in den Totalisierungen sind auf Rundungsdifferenzen zurückzuführen

* bewertet zu den Kursen, die am Hauptmarkt bezahlt werden (Art. 88 Abs. 1 KAG)

** bewertet aufgrund von am Markt beobachtbaren Parametern

Ergänzende Angaben

Derivative Finanzinstrumente

Risikomessverfahren Commitment-Ansatz I:
Art. 34 KKV-FINMA

Per Bilanzstichtag waren keine Kontrakte in derivativen Finanzinstrumenten offen.

Pensionsgeschäfte

Die Fondsleitung tätigt für Rechnung des Teilvermögens keine Pensionsgeschäfte.

Vergütung an die Fondsleitung

Verwaltungskommission

- Effektiv erhobene Verwaltungskommission:
 - Klasse I-A1: 0.713625% p.a.;
 - Klasse I-A2: 0.793625% p.a.;
- Maximale erhobene Verwaltungskommission gemäss Fondsvertrag:
 - Klasse I-A1: 0.80% p.a.;
 - Klasse I-A2: 1.00% p.a.;
- Effektiv erhobene Depotbankkommission für alle Klassen: 0.006375% p.a.;
- Maximale erhobene Depotbankkommission für alle Klassen gemäss Fondsvertrag: 0.20% p.a.;

Gebührenteilungsvereinbarungen («commission sharing agreements») und geldwerte Vorteile («soft commissions»)

Die Fondsleitung hat keine Gebührenteilungsvereinbarungen («commission sharing agreements») geschlossen. Die Fondsleitung hat keine Vereinbarungen bezüglich so genannten «soft commissions» geschlossen.

Total Expense Ratio (TER)

Diese Kennziffer wurde gemäss der «Richtlinie zur Berechnung und Offenlegung der Total Expense Ratio (TER) von kollektiven Kapitalanlagen» der Asset Management Association Switzerland (AMAS) in der aktuell gültigen Fassung berechnet und drückt die Gesamtheit derjenigen Kommissionen und Kosten, die laufend dem Fondsvermögen belastet werden (Betriebsaufwand), retrospektiv in einem %-Satz des Fondsvermögens aus.

TER für die letzten 12 Monate:

Klasse I-A1:	0.72%
Klasse I-A2:	0.80%

Ausgabe- und Rücknahmepreis

Falls an einem Bewertungstag die Summe der Zeichnungen und Rücknahmen von Anteilen eines Teilvermögens zu einem Nettovermögenszufluss bzw. -abfluss führt, wird der Nettoinventarwert des entsprechenden Teilvermögens erhöht bzw. reduziert (Swinging Single Pricing). Die maximale Anpassung beläuft sich auf 2% des Nettoinventarwerts. Berücksichtigt werden die Nebenkosten (Geld/Brief-Spannen, marktübliche Courtagen, Kommissionen, Steuern und Abgaben usw.) sowie die Kosten für die Überprüfung und Aufrechterhaltung von Qualitätsstandards bei physischen Anlagen, die aus der Anlage des einbezahlten Betrags bzw. aus dem Verkauf eines dem gekündigten Anteil entsprechenden Teils der Anlagen erwachsen. Die Anpassung führt zu einer Erhöhung des Nettoinventarwerts, wenn die Nettobewegung zu einem Anstieg der Anzahl Anteile des Anlagefonds führt. Die Anpassung resultiert in einer Verminderung des Nettoinventarwerts, wenn die Nettobewegung einen Rückgang der Anzahl der Anteile des entsprechenden Teilvermögens bewirkt. Die Berücksichtigung dieser Nebenkosten entfällt, falls die Fondsleitung einer Ein- oder Auszahlung in Anlagen statt in bar gemäss § 19 Ziff. 8 gestattet sowie beim Wechsel zwischen Anteilsklassen innerhalb des Teilvermögens. Der unter Anwendung des Swinging Single Pricing ermittelte Nettoinventarwert ist somit ein modifizierter Nettoinventarwert.

Die Fondsleitung berücksichtigt grundsätzlich die durchschnittlichen Nebenkosten. Bei der Anpassung des Nettoinventarwertes kann sie jedoch auch die tatsächliche Höhe der Nebenkosten berücksichtigen, sofern dies unter Berücksichtigung der relevanten Umstände (z.B. Höhe des Betrags, allgemeine Marktsituation, spezifische Marktsituation für die betreffende Anlageklasse) im Ermessen der Fondsleitung angemessen erscheint. Die Anpassung kann in einem solchen Fall höher oder tiefer als die durchschnittlichen Nebenkosten ausfallen.

Grundsätze der Bewertung und der Nettoinventarwertberechnung

Siehe Anhang zu Ergänzende Angaben.

Swiss Life iFunds (CH) Bond Swiss Francs Foreign (CHF)

Art übrige Fonds für traditionelle Anlagen

Dreijahresvergleich

	ISIN	30.9.2024	30.9.2023	30.9.2022
Nettofondsvermögen in CHF		472 624 935.44	499 917 193.52	456 161 252.34
Klasse I-A1	CH0023989582			
Nettoinventarwert pro Anteil in CHF		1 009.33	957.78	925.07
Ausgabe- und Rücknahmepreis pro Anteil in CHF ¹		1 012.06	960.37	925.07
Anzahl Anteile im Umlauf		423 239.3630	504 502.5610	486 618.8550
Klasse I-A2	CH0219870471			
Nettoinventarwert pro Anteil in CHF		987.34	936.99	904.85
Ausgabe- und Rücknahmepreis pro Anteil in CHF ¹		990.01	939.52	904.85
Anzahl Anteile im Umlauf		46 019.0000	17 836.0000	6 637.0000

¹ Siehe Ergänzende Angaben

Performance

	Währung	2023/2024	2022/2023	2021/2022
Klasse I-A1	CHF	6.5%	4.0%	-10.7%
Klasse I-A2	CHF	6.2%	3.8%	-10.9%
Referenzindex:				
Swiss Bond Index Foreign AAA – BBB	CHF	6.2%	3.4%	-10.5%

Die historische Performance stellt keinen Indikator für die laufende oder zukünftige Performance dar.
Die Performancedaten lassen die bei der Ausgabe und Rücknahme der Anteile erhobenen Kommissionen und Kosten unberücksichtigt.

Struktur des Wertpapierportfolios (ungeprüft)

Aufteilung nach Risikodomizil in % des Gesamtfondsvermögens	
Frankreich	14.75
Deutschland	14.30
Kanada	11.23
Vereinigte Staaten von Amerika	8.24
Grossbritannien	5.89
Supranational	5.79
Australien	5.38
Spanien	4.05
Südkorea	3.95
Chile	3.57
Übrige	21.89
Total	99.04

Obige Prozentsätze können Rundungsdifferenzen enthalten.

Vermögensrechnung

	30.9.2024	30.9.2023
	CHF	CHF
Verkehrswerte		
Bankguthaben		
– auf Sicht	976 719.37	13 442 798.19
Effekten		
– Obligationen, Wandelobligationen, Optionsanleihen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte	454 604 377.48	491 159 026.27
– Anteile anderer kollektiver Kapitalanlagen	15 311 940.00	5 030 500.00
Derivative Finanzinstrumente	328 604.44	-75 144.28
Sonstige Vermögenswerte	3 205 516.16	2 973 638.54
Gesamtfondsvermögen	474 427 157.45	512 530 818.72
Kurzfristige Bankverbindlichkeiten	-1 695 586.95	-12 506 556.04
Andere Verbindlichkeiten	-106 635.06	-107 069.16
Nettofondsvermögen	472 624 935.44	499 917 193.52

Erfolgsrechnung

	1.10.2023-30.9.2024	1.10.2022-30.9.2023
	CHF	CHF
Ertrag		
Erträge der Bankguthaben	83 559.84	282 462.52
Negativzinsen	0.00	-39 763.44
Erträge der Effekten		
– aus Obligationen, Wandelobligationen, Optionsanleihen und sonstigen Forderungswertpapieren und -rechten	6 953 412.24	4 911 243.99
– aus Anteilen anderer kollektiver Kapitalanlagen	104 623.16	0.00
Ausgleichszahlungen aus Effektenleihe	316 548.65	194 367.01
Erträge der Effektenleihe	50 858.64	46 894.69
Erträge der derivativen Finanzinstrumente	3 330.74	0.00
Einkauf in laufende Nettoerträge bei der Ausgabe von Anteilen	695 926.02	331 985.95
Total Ertrag	8 208 259.29	5 727 190.72
Aufwand		
Passivzinsen	-21 938.66	-6 645.09
Reglementarische Kommissionsvergütung an die Fondsleitung Klasse I-A1	-333 582.83	-338 415.38
Reglementarische Kommissionsvergütung an die Fondsleitung Klasse I-A2	-48 495.59	-34 255.98
Reglementarische Kommissionsvergütung an die Depotbank	-29 981.31	-34 387.63
Sonstige Aufwendungen	-573.67	-264.00
Ausrichtung laufender Nettoerträge bei der Rücknahme von Anteilen	-883 730.10	-217 333.25
Total Aufwand	-1 318 302.16	-631 301.33
Nettoertrag	6 889 957.13	5 095 889.39
Realisierte Kapitalgewinne und -verluste	-1 083 603.30	-14 419 572.57
Realisierter Erfolg	5 806 353.83	-9 323 683.18
Nicht realisierte Kapitalgewinne und -verluste	23 494 750.91	28 047 438.23
Gesamterfolg	29 301 104.74	18 723 755.05

Verwendung des Erfolges

	1.10.2023-30.9.2024	1.10.2022-30.9.2023
	CHF	CHF
Nettoertrag des Rechnungsjahres	6 889 957.13	5 095 889.39
Vortrag des Vorjahres	14 612.31	2 860.62
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg	6 904 569.44	5 098 750.01
Zur Ausschüttung an die Anlegerinnen und Anleger vorgesehener Erfolg	-6 893 008.76	-5 084 137.70
Vortrag auf neue Rechnung	11 560.68	14 612.31

Veränderung des Nettofondsvermögens

	1.10.2023-30.9.2024	1.10.2022-30.9.2023
	CHF	CHF
Nettofondsvermögen zu Beginn des Rechnungsjahres	499 917 193.52	456 161 252.34
Ordentliche Jahresausschüttung	-4 839 516.30	-2 233 426.24
Saldo aus dem Anteilverkehr	-51 753 846.52	27 265 612.37
Gesamterfolg	29 301 104.74	18 723 755.05
Nettofondsvermögen am Ende der Berichtsperiode	472 624 935.44	499 917 193.52

Entwicklung der Anteile im Umlauf

	1.10.2023-30.9.2024	1.10.2022-30.9.2023
	Anzahl	Anzahl
Klasse I-A1		
Bestand Anfang Rechnungsjahr	504 502.5610	486 618.8550
Ausgegebene Anteile	39 872.8020	86 393.0000
Zurückgenommene Anteile	-121 136.0000	-68 509.2940
Bestand Ende Berichtsperiode	423 239.3630	504 502.5610
Differenz zwischen den ausgegebenen und zurückgenommenen Anteilen	-81 263.1980	17 883.7060
Klasse I-A2		
Bestand Anfang Rechnungsjahr	17 836.0000	6 637.0000
Ausgegebene Anteile	36 163.0000	11 496.0000
Zurückgenommene Anteile	-7 980.0000	-297.0000
Bestand Ende Berichtsperiode	46 019.0000	17 836.0000
Differenz zwischen den ausgegebenen und zurückgenommenen Anteilen	28 183.0000	11 199.0000

Ausschüttung für 2023/2024

Klasse I-A1

(Ex-Datum 14.1.2025)

Aufgelaufener Ertrag pro Anteil	CHF	14.9224
Für in der Schweiz domizilierte Anteilinhaber brutto	CHF	14.9000
Abzüglich eidg. Verrechnungssteuer	CHF	-5.2150
Netto pro Anteil (zahlbar ab 16.1.2025)	CHF	9.6850
Für nicht in der Schweiz domizilierte Anteilinhaber mit Bankenerklärung		
Netto pro Anteil (zahlbar ab 16.1.2025)	CHF	14.9000

Klasse I-A2

(Ex-Datum 14.1.2025)

Aufgelaufener Ertrag pro Anteil	CHF	12.7950
Für in der Schweiz domizilierte Anteilinhaber brutto	CHF	12.7500
Abzüglich eidg. Verrechnungssteuer	CHF	-4.4625
Netto pro Anteil (zahlbar ab 16.1.2025)	CHF	8.2875
Für nicht in der Schweiz domizilierte Anteilinhaber mit Bankenerklärung		
Netto pro Anteil (zahlbar ab 16.1.2025)	CHF	12.7500

Titel	30.9.2023 Anzahl/ Nominal	Käufe ¹	Verkäufe ²	30.9.2024 Anzahl/ Nominal	Verkehrswert ³ in CHF	in % ³ 6.87)	Davon ausgeliehen Anzahl/Nominal
Total Wertschriften (davon ausgeliehen)					469 916 317	99.04	
Bankguthaben auf Sicht					976 719	0.21	
Derivative Finanzinstrumente					328 604	0.07	
Sonstige Vermögenswerte					3 205 517	0.68	
Gesamtfondsvermögen					474 427 157	100.00	
Kurzfristige Bankverbindlichkeiten					-1 695 587		
Andere Verbindlichkeiten					-106 635		
Nettofondsvermögen					472 624 935		

Bewertungskategorie	Verkehrswert per 30.9.2024	in % des Gesamt- fondsvermögens ³
Anlagen bewertet zu den Kursen, die am Hauptmarkt bezahlt werden	454 604 377	95.82
Anlagen bewertet aufgrund von am Markt beobachtbaren Parametern	15 640 544	3.29
Anlagen bewertet mit geeigneten Bewertungsmodellen unter Berücksichtigung der aktuellen Marktgegebenheiten	-	-
Total	470 244 921	99.11

¹ «Käufe» umfassen die Transaktionen: Gratistitel / Käufe / Konversionen / Namensänderungen / «Splits» / Stock-/Wahldividenden / Titelaufteilungen / Überträge / Umbuchungen infolge Redenominierung in Euro / Umtausch zwischen Gesellschaften / Zuteilung aus Bezugs-/Optionsrechten / Zuteilung von Bezugsrechten ab Basistiteln / Sacheinlagen
² «Verkäufe» umfassen die Transaktionen: Auslosungen / Ausbuchung infolge Verfall / Ausübung von Bezugs-/Optionsrechten / «Reverse splits» / Rückzahlungen / Überträge / Umbuchungen infolge Redenominierung in Euro / Umtausch zwischen Gesellschaften / Verkäufe / Sachauslagen
³ Allfällige Abweichungen in den Totalisierungen sind auf Rundungsdifferenzen zurückzuführen

* bewertet zu den Kursen, die am Hauptmarkt bezahlt werden (Art. 88 Abs. 1 KAG)
** bewertet aufgrund von am Markt beobachtbaren Parametern

Derivative Finanzinstrumente

Gemäss KKV-FINMA Art. 23

Am Ende der Berichtsperiode offene engagementreduzierende Derivate

Instrument	Nominal	Währung	Gebundene Basiswerte in Obligationen/Aktien in CHF	Wiederbeschaffungswert in CHF	In % des Vermögens
Zinssatz-Swaps/Credit Default Swaps					
LCH/INTEREST RATE SWAP PAY TP 1.77200% 23-28.06.28**	10 000 000	CHF	10 000 000	-509 441	-0.11
LCH/INTEREST RATE TP REC SWAP 23-28.06.28	10 000 000	CHF			
			10 000 000	-509 441	-0.11

Am Ende der Berichtsperiode offene engagementerhöhende Derivate

Instrument	Nominal	Währung	Deckung in CHF	Wiederbeschaffungswert in CHF	In % des Vermögens
Zinssatz-Swaps/Credit Default Swaps					
LCH/INTEREST RATE SWAP REC TP 1.75600% 23-07.07.35**	3 000 000	CHF	3 000 000	366 915	0.08
LCH/INTEREST RATE SWAP PAY TP SARON 23-07.07.35	3 000 000	CHF			
LCH/INTEREST RATE SWAP TP REC 1.83050% 23-03.08.38**	3 000 000	CHF	3 000 000	475 382	0.10
LCH/INTEREST RATE SWAP TP SARON FXON 23-02.08.38	3 000 000	CHF			
			6 000 000	842 297	0.18

Durch derivative Transaktionen gebundene geldnahe Mittel: CHF 6 000 000

Am Ende der Berichtsperiode offene Derivate auf Devisen

Verkauf Währung	Verkauf Betrag	Kauf Währung	Kauf Betrag	Fälligkeit	Wiederbeschaffungswert in CHF	In % des Vermögens
Devisentermingeschäfte**						
GBP	210 000	CHF	232 228	12.11.2024	-4 252	0.00
					-4 252	0.00

Obige Angaben können Rundungsdifferenzen enthalten.

** bewertet aufgrund von am Markt beobachtbaren Parametern

Während der Berichtsperiode getätigte engagementreduzierende Derivate

Instrument	Währung	Käufe/ Kontrakte	Verkäufe/ Kontrakte
Zinssatz-Swaps/Credit Default Swaps			
LCH/INTEREST RATE SWAP TP PAY 1.70000% 23-20.07.30	CHF	-10 000 000	-10 000 000
LCH/INTEREST RATE SWAP REC TP SARON 23-20.07.30	CHF	-10 000 000	-10 000 000

Während der Berichtsperiode getätigte engagementerhöhende Derivate

Instrument	Währung	Nominal
Zinssatz-Swaps/Credit Default Swaps		
LCH/INTEREST RATE SWAP REC TP 1.75600% 23-07.07.35	CHF	3 000 000
LCH/INTEREST RATE SWAP PAY TP SARON 23-07.07.35	CHF	3 000 000
LCH/INTEREST RATE SWAP TP REC 1.83050% 23-03.08.38	CHF	3 000 000
LCH/INTEREST RATE SWAP TP SARON FXON 23-02.08.38	CHF	3 000 000

Während der Berichtsperiode getätigte Derivate auf Devisen

Verkauf Währung	Verkauf Betrag	Kauf Währung	Kauf Betrag	Fälligkeit
Devisentermingeschäfte				
GBP	400 000	CHF	435 690	17.01.2024
GBP	400 000	CHF	430 696	17.04.2024
GBP	250 000	CHF	281 556	12.07.2024
GBP	250 000	CHF	287 727	09.08.2024
GBP	250 000	CHF	273 753	09.09.2024
GBP	210 000	CHF	232 228	12.11.2024

Ergänzende Angaben

Derivative Finanzinstrumente

Risikomessverfahren Commitment-Ansatz I:
Art. 34 KKV-FINMA

Position	Betrag in CHF	in % des Nettofonds- vermögens
Total engagement- erhöhende Positionen	6 821 462.73	1.44%
Total engagement- reduzierende Positionen	9 696 774.91	2.05%

Pensionsgeschäfte

Die Fondsleitung tätigt für Rechnung des Teilvermögens keine Pensionsgeschäfte.

Vergütung an die Fondsleitung

Verwaltungskommission

- Effektiv erhobene Verwaltungskommission:
 - Klasse I-A1: 0.073625% p.a.;
 - Klasse I-A2: 0.263625% p.a.;
- Maximale erhobene Verwaltungskommission gemäss Fondsvertrag:
 - Klasse I-A1: 0.20% p.a.;
 - Klasse I-A2: 0.30% p.a.;
- Effektiv erhobene Depotbankkommission für alle Klassen: 0.006375% p.a.;
- Maximale erhobene Depotbankkommission für alle Klassen gemäss Fondsvertrag: 0.20% p.a.;

Gebührenteilungsvereinbarungen («commission sharing agreements») und geldwerte Vorteile («soft commissions»)

Die Fondsleitung hat keine Gebührenteilungsvereinbarungen («commission sharing agreements») geschlossen. Die Fondsleitung hat keine Vereinbarungen bezüglich so genannten «soft commissions» geschlossen.

Total Expense Ratio (TER)

Diese Kennziffer wurde gemäss der «Richtlinie zur Berechnung und Offenlegung der Total Expense Ratio (TER) von kollektiven Kapitalanlagen» der Asset Management Association Switzerland (AMAS) in der aktuell gültigen Fassung berechnet und drückt die Gesamtheit derjenigen Kommissionen und Kosten, die laufend dem Fondsvermögen belastet werden (Betriebsaufwand), retrospektiv in einem %-Satz des Fondsvermögens aus.

TER für die letzten 12 Monate:

Klasse I-A1:	0.08%
Klasse I-A2:	0.27%

Ausgabe- und Rücknahmepreis

Falls an einem Bewertungstag die Summe der Zeichnungen und Rücknahmen von Anteilen eines Teilvermögens zu einem Nettovermögenszufluss bzw. -abfluss führt, wird der Nettoinventarwert des entsprechenden Teilvermögens erhöht bzw. reduziert (Swinging Single Pricing). Die maximale Anpassung beläuft sich auf 2% des Nettoinventarwerts. Berücksichtigt werden die Nebenkosten (Geld/Brief-Spannen, marktübliche Courtagen, Kommissionen, Steuern und Abgaben usw.) sowie die Kosten für die Überprüfung und Aufrechterhaltung von Qualitätsstandards bei physischen Anlagen, die aus der Anlage des einbezahlten Betrags bzw. aus dem Verkauf eines dem gekündigten Anteil entsprechenden Teils der Anlagen erwachsen. Die Anpassung führt zu einer Erhöhung des Nettoinventarwerts, wenn die Nettobewegung zu einem Anstieg der Anzahl Anteile des Anlagefonds führt. Die Anpassung resultiert in einer Verminderung des Nettoinventarwerts, wenn die Nettobewegung einen Rückgang der Anzahl der Anteile des entsprechenden Teilvermögens bewirkt. Die Berücksichtigung dieser Nebenkosten entfällt, falls die Fondsleitung einer Ein- oder Auszahlung in Anlagen statt in bar gemäss § 19 Ziff. 8 gestattet sowie beim Wechsel zwischen Anteilsklassen innerhalb des Teilvermögens. Der unter Anwendung des Swinging Single Pricing ermittelte Nettoinventarwert ist somit ein modifizierter Nettoinventarwert.

Die Fondsleitung berücksichtigt grundsätzlich die durchschnittlichen Nebenkosten. Bei der Anpassung des Nettoinventarwertes kann sie jedoch auch die tatsächliche Höhe der Nebenkosten berücksichtigen, sofern dies unter Berücksichtigung der relevanten Umstände (z.B. Höhe des Betrags, allgemeine Marktsituation, spezifische Marktsituation für die betreffende Anlageklasse) im Ermessen der Fondsleitung angemessen erscheint. Die Anpassung kann in einem solchen Fall höher oder tiefer als die durchschnittlichen Nebenkosten ausfallen.

Grundsätze der Bewertung und der Nettoinventarwertberechnung

Siehe Anhang zu Ergänzende Angaben.

Umrechnungskurs

GBP 1 = CHF 1.131496

Swiss Life iFunds (CH) Bond Global Government + (CHF hedged)

Art übrige Fonds für traditionelle Anlagen

Dreijahresvergleich

	ISIN	30.9.2024	30.9.2023	30.9.2022
Nettofondsvermögen in CHF		1 274 854 257.19	813 669 898.00	892 046 756.81
Klasse I-A1	CH0023989624			
Nettoinventarwert pro Anteil in CHF		782.29	754.81	786.22
Ausgabe- und Rücknahmepreis pro Anteil in CHF ¹		782.29	756.02	786.22
Anzahl Anteile im Umlauf		1 232 505.5740	782 827.0000	869 158.0000
Klasse I-A2	CH0324001301			
Nettoinventarwert pro Anteil in CHF		826.02	797.07	829.87
Ausgabe- und Rücknahmepreis pro Anteil in CHF ¹		826.02	798.35	829.87
Anzahl Anteile im Umlauf		154 039.0000	71 072.0000	55 247.0000
Klasse I-A3	CH0384999642			
Nettoinventarwert pro Anteil in CHF		860.95	830.73	865.13
Ausgabe- und Rücknahmepreis pro Anteil in CHF ¹		860.95	832.06	865.13
Anzahl Anteile im Umlauf		213 071.6770	199 982.9420	188 241.1420

¹ Siehe Ergänzende Angaben

Performance

	Währung	2023/2024	2022/2023	2021/2022
Klasse I-A1	CHF	5.1%	-2.8%	-12.9%
Klasse I-A2	CHF	4.8%	-3.1%	-13.2%
Klasse I-A3	CHF	5.0%	-2.9%	-13.0%
Referenzindex:				
Bloomberg Global Aggregate Treasuries ex CH in CHF (CHF hedged)	CHF	4.8%	-3.0%	-12.5%

Die historische Performance stellt keinen Indikator für die laufende oder zukünftige Performance dar.
Die Performancedaten lassen die bei der Ausgabe und Rücknahme der Anteile erhobenen Kommissionen und Kosten unberücksichtigt.

Struktur des Wertpapierportfolios (ungeprüft)

Aufteilung nach Risikodomizil in % des Gesamtfondsvermögens	
Japan	22.05
Vereinigte Staaten von Amerika	14.40
Global	9.57
Italien	5.71
China	5.32
Supranational	4.91
Spanien	4.67
Grossbritannien	4.47
Deutschland	3.35
Schweiz	3.21
Übrige	13.98
Total	91.64

Obige Prozentsätze können Rundungsdifferenzen enthalten.

Vermögensrechnung

	30.9.2024	30.9.2023
	CHF	CHF
Verkehrswerte		
Bankguthaben		
– auf Sicht	99 684 090.27	28 328 759.60
Effekten		
– Obligationen, Wandelobligationen, Optionsanleihen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte	1 046 949 346.15	747 018 838.02
– Anteile anderer kollektiver Kapitalanlagen	122 087 303.68	50 305 100.61
Derivative Finanzinstrumente	246 429.42	-16 195 349.06
Sonstige Vermögenswerte	6 792 525.27	4 835 736.78
Gesamtfondsvermögen	1 275 759 694.79	814 293 085.95
Kurzfristige Bankverbindlichkeiten	-292 152.25	-238 723.37
Andere Verbindlichkeiten	-613 285.35	-384 464.58
Nettofondsvermögen	1 274 854 257.19	813 669 898.00

Erfolgsrechnung

	1.10.2023-30.9.2024	1.10.2022-30.9.2023
	CHF	CHF
Ertrag		
Erträge der Bankguthaben	673 502.11	544 852.88
Negativzinsen	0.00	-57 236.84
Erträge der Effekten		
– aus Obligationen, Wandelobligationen, Optionsanleihen und sonstigen Forderungswertpapieren und -rechten	13 173 799.40	10 786 261.92
– aus Anteilen anderer kollektiver Kapitalanlagen	1 134 469.26	0.00
Ausgleichszahlungen aus Effektenleihe	3 346 597.36	1 678 373.19
Erträge der Effektenleihe	162 661.36	207 872.29
Erträge der derivativen Finanzinstrumente	23 997.77	0.00
Einkauf in laufende Nettoerträge bei der Ausgabe von Anteilen	3 566 844.18	455 110.57
Total Ertrag	22 081 871.44	13 615 234.01
Aufwand		
Passivzinsen	-85 472.14	-17 890.98
Reglementarische Kommissionsvergütung an die Fondsleitung Klasse I-A1	-1 058 466.03	-907 014.56
Reglementarische Kommissionsvergütung an die Fondsleitung Klasse I-A2	-397 976.70	-221 891.40
Reglementarische Kommissionsvergütung an die Fondsleitung Klasse I-A3	-429 653.81	-404 562.55
Reglementarische Kommissionsvergütung an die Depotbank	-63 943.48	-61 604.47
Sonstige Aufwendungen	-2 016.00	-1 848.00
Ausrichtung laufender Nettoerträge bei der Rücknahme von Anteilen	713 509.85	-641 392.22
Total Aufwand	-1 324 018.31	-2 256 204.18
Nettoertrag	20 757 853.13	11 359 029.83
Realisierte Kapitalgewinne und -verluste	-44 514 543.69	-23 004 154.10
Realisierter Erfolg	-23 756 690.56	-11 645 124.27
Nicht realisierte Kapitalgewinne und -verluste	80 438 599.66	-11 870 076.33
Gesamterfolg	56 681 909.10	-23 515 200.60

Verwendung des Erfolges

	1.10.2023-30.9.2024	1.10.2022-30.9.2023
	CHF	CHF
Nettoertrag des Rechnungsjahres	20 757 853.13	11 359 029.83
Vortrag des Vorjahres	9 218.12	6 873.50
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg	20 767 071.25	11 365 903.33
Zur Ausschüttung an die Anlegerinnen und Anleger vorgesehener Erfolg	-20 719 661.61	-11 356 685.21
Vortrag auf neue Rechnung	47 409.64	9 218.12

Veränderung des Nettofondsvermögens

	1.10.2023-30.9.2024	1.10.2022-30.9.2023
	CHF	CHF
Nettofondsvermögen zu Beginn des Rechnungsjahres	813 669 898.00	892 046 756.81
Ordentliche Jahresausschüttung	-11 822 351.67	-10 970 693.38
Saldo aus dem Anteilverkehr	416 324 801.76	-43 890 964.83
Gesamterfolg	56 681 909.10	-23 515 200.60
Nettofondsvermögen am Ende der Berichtsperiode	1 274 854 257.19	813 669 898.00

Entwicklung der Anteile im Umlauf

	1.10.2023-30.9.2024	1.10.2022-30.9.2023
	Anzahl	Anzahl
Klasse I-A1		
Bestand Anfang Rechnungsjahr	782 827.0000	869 158.0000
Ausgegebene Anteile	493 475.5740	79 958.0000
Zurückgenommene Anteile	-43 797.0000	-166 289.0000
Bestand Ende Berichtsperiode	1 232 505.5740	782 827.0000
Differenz zwischen den ausgegebenen und zurückgenommenen Anteilen	449 678.5740	-86 331.0000
Klasse I-A2		
Bestand Anfang Rechnungsjahr	71 072.0000	55 247.0000
Ausgegebene Anteile	108 985.0000	45 213.0000
Zurückgenommene Anteile	-26 018.0000	-29 388.0000
Bestand Ende Berichtsperiode	154 039.0000	71 072.0000
Differenz zwischen den ausgegebenen und zurückgenommenen Anteilen	82 967.0000	15 825.0000
Klasse I-A3		
Bestand Anfang Rechnungsjahr	199 982.9420	188 241.1420
Ausgegebene Anteile	17 151.0270	16 885.8880
Zurückgenommene Anteile	-4 062.2920	-5 144.0880
Bestand Ende Berichtsperiode	213 071.6770	199 982.9420
Differenz zwischen den ausgegebenen und zurückgenommenen Anteilen	13 088.7350	11 741.8000

Ausschüttung für 2023/2024

Klasse I-A1

(Ex-Datum 14.1.2025)

Aufgelaufener Ertrag pro Anteil	CHF	13.0837
Für in der Schweiz domizilierte Anteilinhaber brutto	CHF	13.0500
Abzüglich eidg. Verrechnungssteuer	CHF	-4.5675
Netto pro Anteil (zahlbar ab 16.1.2025)	CHF	8.4825
Für nicht in der Schweiz domizilierte Anteilinhaber mit Bankenerklärung		
Netto pro Anteil (zahlbar ab 16.1.2025)	CHF	13.0500

Klasse I-A2

(Ex-Datum 14.1.2025)

Aufgelaufener Ertrag pro Anteil	CHF	11.3809
Für in der Schweiz domizilierte Anteilinhaber brutto	CHF	11.3500
Abzüglich eidg. Verrechnungssteuer	CHF	-3.9725
Netto pro Anteil (zahlbar ab 16.1.2025)	CHF	7.3775
Für nicht in der Schweiz domizilierte Anteilinhaber mit Bankenerklärung		
Netto pro Anteil (zahlbar ab 16.1.2025)	CHF	11.3500

Klasse I-A3

(Ex-Datum 14.1.2025)

Aufgelaufener Ertrag pro Anteil	CHF	13.5555
Für in der Schweiz domizilierte Anteilinhaber brutto	CHF	13.5500
Abzüglich eidg. Verrechnungssteuer	CHF	-4.7425
Netto pro Anteil (zahlbar ab 16.1.2025)	CHF	8.8075
Für nicht in der Schweiz domizilierte Anteilinhaber mit Bankenerklärung		
Netto pro Anteil (zahlbar ab 16.1.2025)	CHF	13.5500

Titel		30.9.2023 Anzahl/ Nominal	Käufe ¹	Verkäufe ²	30.9.2024 Anzahl/ Nominal	Verkehrswert ³ in CHF	in % ³	Davon ausgeliehen Anzahl/Nominal
AMERICA, UNITED STATES OF 1.125000% 20-15.05.40*	USD	8 300 000	6 000 000		14 300 000	7 968 964	0.62	
AMERICA, UNITED STATES OF 1.750000% 21-15.08.41*	USD	3 000 000	7 500 000		10 500 000	6 280 016	0.49	
AMERICA, UNITED STATES OF 3.875000% 23-15.02.43*	USD	7 000 000	2 000 000		9 000 000	7 323 859	0.57	
AMERICA, UNITED STATES OF 2.000000% 15-15.02.25*	USD		25 000 000		25 000 000	20 891 661	1.64	25 000 000
AMERICA, UNITED STATES OF 2.500000% 14-15.05.24*	USD	20 000 000		20 000 000				
AMERICA, UNITED STATES OF 0.500000% 20-31.05.27*	USD	31 500 000		15 000 000	16 500 000	12 836 623	1.01	4 888 000
AMERICA, UNITED STATES OF 0.500000% 20-30.06.27*	USD	30 000 000		10 000 000	20 000 000	15 521 320	1.22	20 000 000
AMERICA, UNITED STATES OF 1.125000% 21-31.08.28*	USD	10 000 000		10 000 000				
AMERICA, UNITED STATES OF 3.500000% 23-15.02.33*	USD	40 000 000	25 000 000		65 000 000	53 875 495	4.22	48 000 000
AMERICA, UNITED STATES OF 4.375000% 23-15.08.26*	USD	17 000 000		17 000 000				
Total USD						183 279 168	14.37	
Total Treasury-Notes, fester Zins						183 279 168	14.37	
Total Effekten, die an einer Börse gehandelt werden						1 018 920 563	79.87	

Effekten, die an einem andern geregelten Markt gehandelt werden

Notes, fester Zins

CAD								
CPPIB CAPITAL INC-REG-S 1.950000% 19-30.09.29*	CAD	2 000 000			2 000 000	1 188 447	0.09	
Total CAD						1 188 447	0.09	
Total Notes, fester Zins						1 188 447	0.09	

Medium-Term Notes, fester Zins

AUD								
CPPIB CAPITAL INC-REG-S 5.200000% 24-04.03.34*	AUD		10 000 000		10 000 000	6 071 407	0.48	
INTERNATIONAL FINANCE CORP-REG-S 3.635000% 18-26.08.33*	AUD		5 000 000		5 000 000	2 736 631	0.21	
Total AUD						8 808 038	0.69	
Total Medium-Term Notes, fester Zins						8 808 038	0.69	

Anleihen, fester Zins

CAD								
VANCOUVER, CITY OF 3.750000% 13-24.10.23*	CAD	700 000		700 000				
YORK, REGIONAL MUNICIPALITY OF 4.050000% 14-01.05.34*	CAD	1 500 000			1 500 000	958 254	0.08	
Total CAD						958 254	0.08	
Total Anleihen, fester Zins						958 254	0.08	
Total Effekten, die an einem andern geregelten Markt gehandelt werden						10 954 738	0.86	

Effekten, die nicht an einer Börse oder einem andern geregelten Markt gehandelt werden

Investmentzertifikate, open end

Global								
SWISS LIFE FUNDS (CH) MONEY MARKET SWISS FRANCS A CAP**	CHF	500 001	696 000		1 196 001	122 087 304	9.57	
Total Global						122 087 304	9.57	
Total Investmentzertifikate, open end						122 087 304	9.57	

Medium-Term Notes, fester Zins

AUD								
CPPIB CAPITAL INC-REG-S 4.400000% 24-15.01.29**	AUD		5 000 000		5 000 000	2 955 705	0.23	
CPPIB CAPITAL INC-REG-S 4.700000% 24-19.07.27**	AUD		2 100 000		2 100 000	1 251 793	0.10	
KOMMUNALBANKEN AS 5.250000% 23-18.04.34**	AUD		11 000 000		11 000 000	6 777 941	0.53	
Total AUD						10 985 439	0.86	
Total Medium-Term Notes, fester Zins						10 985 439	0.86	

Anleihen, fester Zins

AUD								
BNG BANK NV 5.000000% 23-13.03.34**	AUD		7 000 000		7 000 000	4 218 606	0.33	
Total AUD						4 218 606	0.33	
CAD								
NEWFOUNDLAND, PROVINCE OF 3.000000% 15-02.06.26**	CAD	3 000 000			3 000 000	1 870 000	0.15	
Total CAD						1 870 000	0.15	
Total Anleihen, fester Zins						6 088 606	0.48	

Total Effekten, die nicht an einer Börse oder einem andern geregelten Markt gehandelt werden						139 161 349	10.91	
Total Wertschriften						1 169 036 650	91.64	
(davon ausgeliehen)						175 347 804	13.74	
Bankguthaben auf Sicht						99 684 090	7.81	
Derivative Finanzinstrumente						246 429	0.02	
Sonstige Vermögenswerte						6 792 526	0.53	
Gesamtfondsvermögen						1 275 759 695	100.00	
Kurzfristige Bankverbindlichkeiten						-292 152		
Andere Verbindlichkeiten						-613 286		
Nettofondsvermögen						1 274 854 257		

Bewertungskategorie	Verkehrswert per 30.9.2024	in % des Gesamt- fondsvermögens ³
Anlagen bewertet zu den Kursen, die am Hauptmarkt bezahlt werden	1 031 273 019	80.84
Anlagen bewertet aufgrund von am Markt beobachtbaren Parametern	138 010 060	10.82
Anlagen bewertet mit geeigneten Bewertungsmodellen unter Berücksichtigung der aktuellen Marktgegebenheiten	-	-
Total	1 169 283 079	91.66

¹ «Käufe» umfassen die Transaktionen: Gratistitel / Käufe / Konversionen / Namensänderungen / «Splits» / Stock-/Wahldividenden / Titelaufteilungen / Überträge / Umbuchungen infolge Redenominierung in Euro / Umtausch zwischen Gesellschaften / Zuteilung aus Bezugs-/Optionsrechten / Zuteilung von Bezugsrechten ab Basistiteln / Sacheinlagen

² «Verkäufe» umfassen die Transaktionen: Auslosungen / Ausbuchung infolge Verfall / Ausübung von Bezugs-/Optionsrechten / «Reverse splits» / Rückzahlungen / Überträge / Umbuchungen infolge Redenominierung in Euro / Umtausch zwischen Gesellschaften / Verkäufe / Sachauslagen

³ Allfällige Abweichungen in den Totalisierungen sind auf Rundungsdifferenzen zurückzuführen

* bewertet zu den Kursen, die am Hauptmarkt bezahlt werden (Art. 88 Abs. 1 KAG)

** bewertet aufgrund von am Markt beobachtbaren Parametern

Derivative Finanzinstrumente

Gemäss KKV-FINMA Art. 23

Am Ende der Berichtsperiode offene engagementreduzierende Derivate

Instrument	Anzahl Kontrakte	Währung	Gebundene Basiswerte in Obligationen/Aktien in CHF	Variation Margin in CHF	In % des Vermögens
Futures auf Zinsinstrumente/Obligationen					
JAPAN GOVERNMENT 10Y BOND (OSE) FUTURE 13.12.24*	-18	JPY	-15 354 804	-20 169	0.00
			-15 354 804	-20 169	0.00

Am Ende der Berichtsperiode offene engagementreduzierende Derivate

Instrument	Nominal	Währung	Gebundene Basiswerte in Obligationen/Aktien in CHF	Wiederbeschaffungswert in CHF	In % des Vermögens
Zinssatz-Swaps/Credit Default Swaps					
LCH/INTEREST RATE SWAP PAYER TP 3.01430% 23-15.11.48**	8 700 000	EUR	8 393 448	-1 064 504	-0.08
LCH/INTEREST RATE SWAP RECEIVER TP 6MEIB 23-15.11.48	8 700 000	EUR			
			8 393 448	-1 064 504	-0.08

Am Ende der Berichtsperiode offene engagementerhöhende Derivate

Instrument	Anzahl Kontrakte	Währung	Deckung in CHF	Variation Margin in CHF	In % des Vermögens
Futures auf Zinsinstrumente/Obligationen					
EURO BTP ITALY GOVERNMENT FUTURE 06.12.24*	120	EUR	13 722 864	343 439	0.03
EURO-BUND FUTURE 06.12.24*	208	EUR	26 420 081	387 724	0.03
EURO-BOBL FUTURE 06.12.24*	100	EUR	11 302 035	123 329	0.01
EURO-BUXL FUTURE 06.12.24*	22	EUR	2 822 600	62 964	0.00
LONG GILT FUTURE 27.12.24*	212	GBP	23 611 104	-92 126	-0.01
US 10YR ULTRA NOTE FUTURE 19.12.24*	330	USD	32 930 479	126 137	0.01
US ULTRA LONG BOND (CBT) FUTURE 19.12.24*	60	USD	6 736 274	1 582	0.00
US 10YR TREASURY NOTE FUTURE 19.12.24*	985	USD	94 955 919	305 097	0.02
CAN 10YR BOND FUTURE 18.12.24*	320	CAD	24 978 496	187 823	0.02
US 5YR TREASURY NOTE FUTURE 31.12.24*	260	USD	24 099 828	61 685	0.01
AUSTRALIA 10YR BOND FUTURE 16.12.24*	260	AUD	17 710 313	-89 767	-0.01
			279 289 993	1 417 887	0.11

Durch derivative Transaktionen gebundene geldnahe Mittel: CHF 279 289 993

Am Ende der Berichtsperiode offene Derivate auf Devisen

Verkauf Währung	Verkauf Betrag	Kauf Währung	Kauf Betrag	Fälligkeit	Wiederbeschaffungswert in CHF	In % des Vermögens
Devisentermingeschäfte**						
USD	330 000 000	CHF	279 742 980	09.10.2024	1 594 560	0.12
USD	2 000 000	CHF	1 706 680	09.10.2024	20 932	0.00
CNY	569 000 000	USD	80 097 976	21.11.2024	-1 336 360	-0.10
EUR	257 800 000	CHF	244 247 196	21.11.2024	2 449 460	0.19
JPY	38 000 000 000	CHF	224 825 735	21.10.2024	624 367	0.05
GBP	83 000 000	CHF	92 015 460	21.11.2024	-1 337 022	-0.10
AUD	164 800 000	CHF	94 811 879	22.10.2024	-1 446 622	-0.11
AUD	3 200 000	CHF	1 834 618	22.10.2024	-34 479	0.00
EUR	1 950 000	CHF	1 823 946	21.11.2024	-5 013	0.00
USD	7 800 000	CHF	6 595 219	09.10.2024	20 802	0.00
GBP	580 000	CHF	641 876	21.11.2024	-10 467	0.00
CHF	11 612 730	USD	13 700 000	09.10.2024	-65 356	-0.01
GBP	1 000 000	CHF	1 105 919	21.11.2024	-18 810	0.00
GBP	9 000 000	CHF	9 957 519	21.11.2024	-165 039	-0.01
AUD	700 000	CHF	405 357	22.10.2024	-3 508	0.00
CHF	2 000 000	USD	2 355 852	09.10.2024	-14 314	0.00
CAD	16 800 000	CHF	10 531 181	22.11.2024	90 154	0.01
JPY	24 000 000 000	CHF	141 174 240	28.10.2024	-456 965	-0.04
USD	4 400 000	CHF	3 707 440	09.10.2024	-1 206	0.00
EUR	4 235 000	CHF	3 981 811	21.11.2024	9 687	0.00
GBP	423 000	CHF	475 015	21.11.2024	-745	0.00
JPY	80 000 000	CHF	472 569	28.10.2024	466	0.00
AUD	850 000	CHF	495 171	22.10.2024	-1 307	-0.01
					-86 785	-0.01

Obige Angaben können Rundungsdifferenzen enthalten.

* bewertet zu den Kursen, die am Hauptmarkt bezahlt werden (Art. 88 Abs. 1 KAG)

** bewertet aufgrund von am Markt beobachtbaren Parametern

Jahresbericht per 30. September 2024

Swiss Life iFunds (CH) Bond Global Government + (CHF hedged)

Während der Berichtsperiode getätigte engagementreduzierende Derivate

Instrument	Währung	Käufe/ Kontrakte	Verkäufe/ Kontrakte
Futures auf Zinsinstrumente/Obligationen			
EURO-BUXL FUTURE 07.12.23	EUR	56	0
EURO BTP ITALY GOVERNMENT FUTURE 07.12.23	EUR	60	0
EURO-BUND FUTURE 07.12.23	EUR	510	123
EURO-BOBL FUTURE 07.12.23	EUR	150	0
EURO-BUND FUTURE 07.03.24	EUR	54	54
EURO-BOBL FUTURE 07.03.24	EUR	35	35
JAPAN GOVERNMENT 10Y BOND (OSE) FUTURE 13.12.23	JPY	13	0
JAPAN GOVERNMENT 10Y BOND (OSE) FUTURE 13.03.24	JPY	39	39
JAPAN GOVERNMENT 10Y BOND (OSE) FUTURE 13.06.24	JPY	78	78
JAPAN GOVERNMENT 10Y BOND (OSE) FUTURE 13.12.24	JPY	0	18
JAPAN GOVERNMENT 10Y BOND (OSE) FUTURE 12.09.24	JPY	39	39

Während der Berichtsperiode getätigte engagementreduzierende Derivate

Instrument	Währung	Käufe/ Kontrakte	Verkäufe/ Kontrakte
Zinssatz-Swaps/Credit Default Swaps			
LCH/INTEREST RATE SWAP PAYER TP 3.01430% 23-15.11.48	EUR	8 700 000	8 700 000
LCH/INTEREST RATE SWAP RECEIVER TP 6MEIB 23-15.11.48	EUR	8 700 000	8 700 000

Während der Berichtsperiode getätigte engagementerhöhende Derivate

Instrument	Währung	Käufe/ Kontrakte	Verkäufe/ Kontrakte
Futures auf Zinsinstrumente/Obligationen			
EURO BTP ITALY GOVERNMENT FUTURE 06.06.24	EUR	120	120
EURO-BUND FUTURE 06.06.24	EUR	292	292
EURO-BOBL FUTURE 06.06.24	EUR	100	100
EURO-BUXL FUTURE 06.06.24	EUR	22	22
EURO-BUXL FUTURE 07.12.23	EUR	22	22
EURO-BUND FUTURE 07.03.24	EUR	246	246
EURO-BOBL FUTURE 07.03.24	EUR	100	100
EURO-BUXL FUTURE 07.03.24	EUR	22	22
EURO BTP ITALY GOVERNMENT FUTURE 06.09.24	EUR	120	120
EURO-BUND FUTURE 06.09.24	EUR	328	328
EURO-BOBL FUTURE 06.09.24	EUR	100	100
EURO-BUXL FUTURE 06.09.24	EUR	22	22
EURO BTP ITALY GOVERNMENT FUTURE 06.12.24	EUR	120	0
EURO-BUND FUTURE 06.12.24	EUR	208	0
EURO-BOBL FUTURE 06.12.24	EUR	100	0
EURO-BUXL FUTURE 06.12.24	EUR	22	0
LONG GILT FUTURE 26.03.24	GBP	193	193
LONG GILT FUTURE 26.06.24	GBP	408	408
LONG GILT FUTURE 26.09.24	GBP	408	408
LONG GILT FUTURE 27.12.24	GBP	212	0
US 10YR TREASURY NOTE FUTURE 19.12.23	USD	0	704
US 2YR TREASURY NOTE FUTURE 29.12.23	USD	0	150
US 5YR TREASURY NOTE FUTURE 29.12.23	USD	0	130
CAN 10YR BOND FUTURE 18.12.23	CAD	0	160
US ULTRA LONG BOND (CBT) FUTURE 19.03.24	USD	40	40
US 10YR TREASURY NOTE FUTURE 19.03.24	USD	939	939
US 2YR TREASURY NOTE FUTURE 28.03.24	USD	150	150
JAPAN GOVERNMENT 10Y BOND (OSE) FUTURE 13.03.24	JPY	39	39
US 5YR TREASURY NOTE FUTURE 28.03.24	USD	130	130
CAN 10YR BOND FUTURE 19.03.24	CAD	160	160
US 10YR TREASURY NOTE FUTURE 18.06.24	USD	1 049	1 049
US ULTRA LONG BOND (CBT) FUTURE 18.06.24	USD	40	40
US 2YR TREASURY NOTE FUTURE 28.06.24	USD	150	150
US 5YR TREASURY NOTE FUTURE 28.06.24	USD	130	130
CAN 10YR BOND FUTURE 19.06.24	CAD	320	320
US 10YR ULTRA NOTE FUTURE 19.12.24	USD	330	0
US ULTRA LONG BOND (CBT) FUTURE 19.12.24	USD	60	0
US 10YR TREASURY NOTE FUTURE 19.12.24	USD	1 449	464
US 10YR TREASURY NOTE FUTURE 19.09.24	USD	1 649	1 649
CAN 10YR BOND FUTURE 18.09.24	CAD	320	320
US 2YR TREASURY NOTE FUTURE 30.09.24	USD	150	150
US 5YR TREASURY NOTE FUTURE 30.09.24	USD	260	260
US ULTRA LONG BOND (CBT) FUTURE 19.09.24	USD	60	60
CAN 10YR BOND FUTURE 18.12.24	CAD	320	0
US 5YR TREASURY NOTE FUTURE 31.12.24	USD	260	0
AUSTRALIA 10YR BOND FUTURE 16.12.24	AUD	260	0

Während der Berichtsperiode getätigte Derivate auf Devisen

Verkauf Währung	Verkauf Betrag	Kauf Währung	Kauf Betrag	Fälligkeit
Devisentermingeschäfte				
CHF	33 360	ILS	140 000	19.10.2023
CHF	2 284 610	ILS	10 000 000	19.10.2023
CHF	284 680	CAD	425 000	06.11.2023
CAD	500 000	CHF	331 313	06.11.2023
CHF	195 055	CAD	300 000	06.11.2023
CHF	3 803 356	USD	4 150 000	16.11.2023
CHF	261 195	AUD	450 000	16.11.2023
USD	6 000 000	CHF	5 468 016	16.11.2023
EUR	4 000 000	CHF	3 832 627	16.11.2023
AUD	450 000	CHF	260 166	16.11.2023
USD	2 800 000	CHF	2 520 478	16.11.2023
CHF	2 954 809	USD	3 300 000	16.11.2023
CHF	337 574	AUD	600 000	16.11.2023
CHF	145 345	AUD	250 000	16.11.2023
USD	5 400 000	CHF	4 887 594	16.11.2023

Verkauf Währung	Verkauf Betrag	Kauf Währung	Kauf Betrag	Fälligkeit
EUR	3 000 000	CHF	2 887 208	16.11.2023
CHF	14 463 666	EUR	15 000 000	16.11.2023
CHF	16 906 094	AUD	29 400 000	16.11.2023
CHF	257 465 163	EUR	267 000 000	16.11.2023
CHF	230 760 448	USD	256 000 000	16.11.2023
CHF	9 376 210	AUD	16 300 000	16.11.2023
CHF	919 864	GBP	830 000	20.11.2023
GBP	600 000	CHF	663 502	20.11.2023
GBP	1 400 000	CHF	1 541 595	20.11.2023
CHF	1 639 804	JPY	265 000 000	21.11.2023
CHF	1 803 588	JPY	300 000 000	21.11.2023
JPY	1 800 000 000	CHF	10 733 760	21.11.2023
CHF	129 768 813	JPY	22 100 000 000	21.11.2023
CAD	19 100 000	CHF	12 460 955	06.12.2023
CAD	600 000	CHF	388 748	06.12.2023
CAD	500 000	CHF	322 150	06.12.2023
AUD	10 400 000	CHF	5 953 582	14.12.2023
AUD	29 200 000	CHF	16 755 821	14.12.2023
AUD	16 300 000	CHF	9 356 445	14.12.2023
AUD	8 000 000	CHF	4 652 887	14.12.2023
AUD	500 000	CHF	288 299	14.12.2023
CHF	2 848 297	AUD	5 000 000	12.01.2024
ILS	9 800 000	CHF	2 228 932	16.01.2024
CHF	2 166 310	ILS	9 800 000	16.01.2024
CNY	213 500 000	USD	29 596 462	08.02.2024
USD	46 960 750	CNY	338 000 000	08.02.2024
CHF	4 269 223	AUD	7 550 000	08.02.2024
CHF	14 793 233	USD	17 000 000	08.02.2024
EUR	267 000 000	CHF	255 934 986	16.02.2024
USD	256 000 000	CHF	228 432 896	16.02.2024
CHF	15 388 069	EUR	16 000 000	16.02.2024
USD	4 400 000	CHF	3 872 140	16.02.2024
EUR	10 000 000	CHF	9 601 240	16.02.2024
USD	5 500 000	CHF	4 774 578	16.02.2024
EUR	6 000 000	CHF	5 701 752	16.02.2024
USD	8 800 000	CHF	7 496 931	16.02.2024
EUR	10 000 000	CHF	9 394 050	16.02.2024
CHF	2 369 207	USD	2 800 000	16.02.2024
CHF	3 435 689	EUR	3 700 000	16.02.2024
CHF	13 495 089	EUR	14 500 000	16.02.2024
CHF	4 237 790	USD	5 000 000	16.02.2024
CHF	21 643 759	EUR	23 000 000	16.02.2024
CHF	10 346 239	EUR	11 000 000	16.02.2024
CHF	6 420 806	USD	7 500 000	16.02.2024
CHF	465 500	EUR	500 000	16.02.2024
CHF	8 439 876	EUR	9 000 000	16.02.2024
CHF	193 987 890	EUR	205 500 000	16.02.2024
CHF	221 333 925	USD	252 500 000	16.02.2024
GBP	1 350 000	CHF	1 482 639	20.02.2024
GBP	58 500 000	CHF	63 806 828	20.02.2024
GBP	800 000	CHF	877 162	20.02.2024
GBP	9 750 000	CHF	10 694 648	20.02.2024
GBP	2 700 000	CHF	2 920 390	20.02.2024
CHF	1 506 308	GBP	1 400 000	20.02.2024
CHF	5 604 699	GBP	5 100 000	20.02.2024
CHF	74 289 600	GBP	67 000 000	20.02.2024
JPY	22 400 000 000	CHF	132 158 074	21.02.2024
JPY	400 000 000	CHF	2 369 828	21.02.2024
JPY	905 000 000	CHF	5 469 503	21.02.2024
JPY	15 000 000	CHF	88 395	21.02.2024
JPY	50 000 000	CHF	294 114	21.02.2024
JPY	1 420 000 000	CHF	8 310 096	21.02.2024
JPY	1 400 000 000	CHF	8 231 552	21.02.2024
JPY	1 600 000 000	CHF	9 346 016	21.02.2024
CHF	166 625 441	JPY	28 400 000 000	21.02.2024
CAD	19 400 000	CHF	12 428 028	06.03.2024
CHF	214 512	CAD	340 000	06.03.2024
CHF	147 081	CAD	230 000	06.03.2024
CHF	326 844	CAD	500 000	06.03.2024
AUD	64 260 000	CHF	36 853 110	14.03.2024
AUD	1 500 000	CHF	866 418	14.03.2024
AUD	5 000 000	CHF	2 835 383	14.03.2024
AUD	5 000 000	CHF	2 837 076	14.03.2024
AUD	4 900 000	CHF	2 779 896	14.03.2024
AUD	4 600 000	CHF	2 614 134	14.03.2024
AUD	200 000	CHF	112 959	14.03.2024
AUD	7 550 000	CHF	4 258 283	14.03.2024
AUD	12 000 000	CHF	6 818 618	14.03.2024
AUD	2 000 000	CHF	1 145 668	14.03.2024
CHF	63 546 906	AUD	109 700 000	14.03.2024
CHF	586 667	AUD	1 000 000	03.04.2024
JPY	1 500 000 000	CHF	8 818 194	09.04.2024
USD	17 000 000	CHF	14 697 741	09.04.2024
USD	1 000 000	CHF	865 125	09.04.2024
CHF	14 310 026	USD	16 500 000	09.04.2024
USD	252 050 000	CHF	219 697 114	09.04.2024
JPY	1 500 000 000	CHF	8 860 475	09.04.2024
CHF	882 817	USD	1 000 000	09.04.2024
JPY	1 500 000 000	CHF	8 870 318	09.04.2024
JPY	1 400 000 000	CHF	8 264 922	09.04.2024
GBP	66 700 000	CHF	73 592 111	09.04.2024
JPY	28 400 000 000	CHF	167 018 753	09.04.2024
JPY	1 500 000 000	CHF	8 820 890	09.04.2024
AUD	2 300 000	CHF	1 321 992	09.04.2024
CHF	9 802 576	USD	11 200 000	09.04.2024
NZD	18 670 000	CHF	10 079 130	09.04.2024

Verkauf Währung	Verkauf Betrag	Kauf Währung	Kauf Betrag	Fälligkeit
CHF	277 277	GBP	250 000	09.04.2024
USD	1 000 000	CHF	877 549	09.04.2024
JPY	1 300 000 000	CHF	7 666 572	09.04.2024
AUD	109 700 000	CHF	63 420 422	09.04.2024
CHF	10 117 478	NZD	18 670 000	09.04.2024
GBP	1 600 000	CHF	1 822 069	09.04.2024
USD	2 800 000	CHF	2 522 506	09.04.2024
CHF	67 042 528	AUD	112 000 000	09.04.2024
CHF	212 149 065	JPY	35 500 000 000	09.04.2024
CHF	78 018 644	GBP	68 000 000	09.04.2024
CHF	223 090 512	USD	246 000 000	09.04.2024
EUR	203 750 000	CHF	191 632 784	12.04.2024
CHF	5 202 523	EUR	5 500 000	12.04.2024
EUR	4 400 000	CHF	4 182 952	12.04.2024
EUR	3 800 000	CHF	3 699 015	12.04.2024
CHF	198 974 678	EUR	202 500 000	12.04.2024
JPY	8 408 109 453	CHF	50 000 000	26.04.2024
JPY	1 600 000 000	CHF	9 541 344	26.04.2024
CHF	18 000 000	JPY	3 015 329 483	26.04.2024
CHF	43 000 000	JPY	7 299 911 960	26.04.2024
USD	243 200 000	CHF	219 845 504	08.05.2024
USD	9 000 000	CHF	8 126 369	08.05.2024
USD	1 000 000	CHF	901 787	08.05.2024
CHF	820 126	USD	900 000	08.05.2024
CHF	827 221	USD	910 000	08.05.2024
USD	1 200 000	CHF	1 100 878	08.05.2024
CNY	351 300 000	USD	49 232 710	10.05.2024
CNY	79 500 000	USD	11 021 919	10.05.2024
USD	59 609 626	CNY	430 000 000	10.05.2024
JPY	35 500 000 000	CHF	212 462 530	15.05.2024
CHF	1 289 421	JPY	218 600 000	15.05.2024
CHF	210 400 236	JPY	36 000 000 000	15.05.2024
CHF	5 508 666	AUD	9 150 000	21.05.2024
CHF	3 932 440	EUR	4 000 000	21.05.2024
JPY	7 291 732 024	CHF	43 000 000	24.05.2024
CHF	42 000 000	JPY	7 212 984 774	24.05.2024
CAD	16 600 000	CHF	10 725 376	30.05.2024
CAD	300 000	CHF	198 438	30.05.2024
CAD	200 000	CHF	131 853	30.05.2024
CAD	270 000	CHF	179 742	30.05.2024
AUD	1 000 000	CHF	583 855	31.05.2024
AUD	1 300 000	CHF	760 331	31.05.2024
AUD	111 700 000	CHF	66 581 354	31.05.2024
CHF	700 928	AUD	1 180 000	31.05.2024
AUD	6 000 000	CHF	3 593 089	31.05.2024
AUD	9 150 000	CHF	5 504 073	31.05.2024
CHF	77 715 712	AUD	128 000 000	31.05.2024
USD	16 976 054	CNY	123 000 000	06.06.2024
CHF	15 071 266	USD	16 700 000	06.06.2024
JPY	36 000 000 000	CHF	210 610 944	10.06.2024
CHF	212 590 900	JPY	37 000 000 000	10.06.2024
GBP	67 200 000	CHF	76 577 558	13.06.2024
CHF	1 016 506	GBP	900 000	13.06.2024
GBP	410 000	CHF	468 563	13.06.2024
GBP	1 000 000	CHF	1 154 812	13.06.2024
GBP	500 000	CHF	580 840	13.06.2024
GBP	2 500 000	CHF	2 898 177	13.06.2024
GBP	3 240 000	CHF	3 720 567	13.06.2024
CHF	87 711 701	GBP	77 000 000	13.06.2024
JPY	7 007 186 182	CHF	40 850 000	24.06.2024
JPY	1 000 000 000	CHF	5 803 480	24.06.2024
CHF	1 163 856	JPY	200 000 000	24.06.2024
USD	252 000 000	CHF	226 531 620	09.07.2024
USD	2 000 000	CHF	1 810 240	09.07.2024
USD	8 000 000	CHF	7 274 856	09.07.2024
USD	1 000 000	CHF	908 920	09.07.2024
USD	16 700 000	CHF	15 015 678	09.07.2024
USD	16 700 000	CHF	15 014 669	09.07.2024
USD	15 000 000	CHF	13 455 945	09.07.2024
USD	2 000 000	CHF	1 787 616	09.07.2024
USD	2 000 000	CHF	1 788 318	09.07.2024
USD	7 300 000	CHF	6 556 196	09.07.2024
JPY	37 000 000 000	CHF	212 829 920	10.07.2024
EUR	200 600 000	CHF	195 843 975	12.07.2024
CHF	1 539 924	EUR	1 600 000	12.07.2024
EUR	770 000	CHF	751 142	12.07.2024
EUR	4 000 000	CHF	3 918 040	12.07.2024
EUR	4 000 000	CHF	3 936 832	12.07.2024
EUR	8 000 000	CHF	7 877 256	12.07.2024
CHF	2 452 798	EUR	2 500 000	12.07.2024
EUR	4 500 000	CHF	4 397 851	12.07.2024
EUR	7 150 000	CHF	6 985 708	12.07.2024
GBP	77 000 000	CHF	87 435 194	12.07.2024
EUR	200 000	CHF	192 897	12.07.2024
GBP	1 900 000	CHF	2 155 687	12.07.2024
CHF	218 026 800	EUR	225 000 000	12.07.2024
CHF	89 986 905	GBP	78 500 000	12.07.2024
CHF	2 996 935	AUD	5 000 000	24.07.2024
JPY	10 317 120 169	CHF	58 000 000	25.07.2024
JPY	3 566 187 549	CHF	20 000 000	25.07.2024
JPY	1 243 016 246	CHF	7 000 000	25.07.2024
CHF	90 000 000	JPY	15 899 969 265	25.07.2024
CAD	17 000 000	CHF	11 297 469	30.07.2024
CAD	100 000	CHF	65 809	30.07.2024
CAD	800 000	CHF	524 128	30.07.2024
CHF	10 796 071	CAD	17 000 000	30.07.2024

Verkauf Währung	Verkauf Betrag	Kauf Währung	Kauf Betrag	Fälligkeit
AUD	128 000 000	CHF	77 314 688	31.07.2024
AUD	2 500 000	CHF	1 491 330	31.07.2024
AUD	24 000 000	CHF	14 337 432	31.07.2024
AUD	1 500 000	CHF	909 542	31.07.2024
AUD	5 000 000	CHF	2 995 009	31.07.2024
CHF	93 223 256	AUD	162 000 000	31.07.2024
USD	322 000 000	CHF	288 244 740	09.08.2024
USD	1 500 000	CHF	1 336 286	09.08.2024
CHF	4 433 105	USD	5 000 000	09.08.2024
USD	5 125 000	CHF	4 497 924	09.08.2024
USD	8 000 000	CHF	6 880 239	09.08.2024
CHF	281 760 930	USD	330 000 000	09.08.2024
CNY	430 000 000	USD	60 193 740	14.08.2024
CNY	123 000 000	USD	17 099 007	14.08.2024
JPY	39 000 000 000	CHF	217 322 586	21.08.2024
EUR	225 000 000	CHF	217 398 150	21.08.2024
GBP	78 500 000	CHF	89 586 948	21.08.2024
GBP	2 000 000	CHF	2 299 402	21.08.2024
EUR	6 000 000	CHF	5 815 146	21.08.2024
EUR	5 540 000	CHF	5 265 685	21.08.2024
GBP	850 000	CHF	955 742	21.08.2024
JPY	197 000 000	CHF	1 153 727	21.08.2024
EUR	11 000 000	CHF	10 316 889	21.08.2024
EUR	4 000 000	CHF	3 755 224	21.08.2024
EUR	6 000 000	CHF	5 572 184	21.08.2024
GBP	1 500 000	CHF	1 618 497	21.08.2024
AUD	162 000 000	CHF	93 017 241	23.08.2024
AUD	300 000	CHF	173 483	23.08.2024
AUD	2 430 000	CHF	1 390 252	23.08.2024
CHF	95 354 582	AUD	164 800 000	23.08.2024
JPY	15 882 838 302	CHF	90 000 000	28.08.2024
JPY	2 500 000 000	CHF	14 886 508	28.08.2024
JPY	2 000 000 000	CHF	11 814 116	28.08.2024
JPY	2 566 464 194	CHF	15 000 000	28.08.2024
CAD	17 000 000	CHF	10 766 360	29.08.2024
CAD	1 060 000	CHF	672 057	29.08.2024
CHF	10 654 172	CAD	17 000 000	29.08.2024
CAD	17 000 000	CHF	10 627 686	27.09.2024
JPY	22 000 000 000	CHF	129 693 520	30.09.2024
JPY	160 000 000	CHF	934 451	30.09.2024
JPY	1 900 000 000	CHF	11 085 514	30.09.2024
CHF	141 084 480	JPY	24 000 000 000	30.09.2024
USD	330 000 000	CHF	279 742 980	09.10.2024
USD	2 000 000	CHF	1 706 680	09.10.2024
USD	7 800 000	CHF	6 595 219	09.10.2024
CHF	11 612 730	USD	13 700 000	09.10.2024
CHF	2 000 000	USD	2 355 852	09.10.2024
USD	4 400 000	CHF	3 707 440	09.10.2024
JPY	38 000 000 000	CHF	224 825 735	21.10.2024
AUD	164 800 000	CHF	94 811 879	22.10.2024
AUD	3 200 000	CHF	1 834 618	22.10.2024
AUD	700 000	CHF	405 357	22.10.2024
AUD	850 000	CHF	495 171	22.10.2024
JPY	24 000 000 000	CHF	141 174 240	28.10.2024
JPY	80 000 000	CHF	472 569	28.10.2024
CNY	569 000 000	USD	80 097 976	21.11.2024
EUR	257 800 000	CHF	244 247 196	21.11.2024
GBP	83 000 000	CHF	92 015 460	21.11.2024
EUR	1 950 000	CHF	1 823 946	21.11.2024
GBP	580 000	CHF	641 876	21.11.2024
GBP	1 000 000	CHF	1 105 919	21.11.2024
GBP	9 000 000	CHF	9 957 519	21.11.2024
EUR	4 235 000	CHF	3 981 811	21.11.2024
GBP	423 000	CHF	475 015	21.11.2024
CAD	16 800 000	CHF	10 531 181	22.11.2024

Ergänzende Angaben

Derivative Finanzinstrumente

Risikomessverfahren Commitment-Ansatz I:
Art. 34 KKV-FINMA

TER für die letzten 12 Monate:

Klasse I-A1:	0.15%
Klasse I-A2:	0.45%
Klasse I-A3:	0.25%

Position	Betrag in CHF	in % des Nettofonds- vermögens
Total engagement- erhöhende Positionen	360 400 553.78	28.27%
Total engagement- reduzierende Positionen	1 211 831 553.14	95.06%

Pensionsgeschäfte

Die Fondsleitung tätigt für Rechnung des Teilvermögens keine Pensionsgeschäfte.

Vergütung an die Fondsleitung

Verwaltungskommission

- Effektiv erhobene Verwaltungskommission:
 - Klasse I-A1: 0.143625% p.a.;
 - Klasse I-A2: 0.443625% p.a.;
 - Klasse I-A3: 0.243625% p.a.;
- Maximale erhobene Verwaltungskommission gemäss Fondsvertrag:
 - Klasse I-A1: 0.25% p.a.;
 - Klasse I-A2: 0.50% p.a.;
 - Klasse I-A3: 0.25% p.a.;
- Effektiv erhobene Depotbankkommission für alle Klassen: 0.006375% p.a.;
- Maximale erhobene Depotbankkommission für alle Klassen gemäss Fondsvertrag: 0.20% p.a.;

Gebührenteilungsvereinbarungen («commission sharing agreements») und geldwerte Vorteile («soft commissions»)

Die Fondsleitung hat keine Gebührenteilungsvereinbarungen («commission sharing agreements») geschlossen. Die Fondsleitung hat keine Vereinbarungen bezüglich so genannten «soft commissions» geschlossen.

Total Expense Ratio (TER)

Diese Kennziffer wurde gemäss der «Richtlinie zur Berechnung und Offenlegung der Total Expense Ratio (TER) von kollektiven Kapitalanlagen» der Asset Management Association Switzerland (AMAS) in der aktuell gültigen Fassung berechnet und drückt die Gesamtheit derjenigen Kommissionen und Kosten, die laufend dem Fondsvermögen belastet werden (Betriebsaufwand), retrospektiv in einem %-Satz des Fondsvermögens aus.

Ausgabe- und Rücknahmepreis

Falls an einem Bewertungstag die Summe der Zeichnungen und Rücknahmen von Anteilen eines Teilvermögens zu einem Nettovermögenszufluss bzw. -abfluss führt, wird der Nettoinventarwert des entsprechenden Teilvermögens erhöht bzw. reduziert (Swinging Single Pricing). Die maximale Anpassung beläuft sich auf 2% des Nettoinventarwerts. Berücksichtigt werden die Nebenkosten (Geld/Brief-Spannen, marktübliche Courtagen, Kommissionen, Steuern und Abgaben usw.) sowie die Kosten für die Überprüfung und Aufrechterhaltung von Qualitätsstandards bei physischen Anlagen, die aus der Anlage des einbezahlten Betrags bzw. aus dem Verkauf eines dem gekündigten Anteil entsprechenden Teils der Anlagen erwachsen. Die Anpassung führt zu einer Erhöhung des Nettoinventarwerts, wenn die Nettobewegung zu einem Anstieg der Anzahl Anteile des Anlagefonds führt. Die Anpassung resultiert in einer Verminderung des Nettoinventarwerts, wenn die Nettobewegung einen Rückgang der Anzahl der Anteile des entsprechenden Teilvermögens bewirkt. Die Berücksichtigung dieser Nebenkosten entfällt, falls die Fondsleitung einer Ein- oder Auszahlung in Anlagen statt in bar gemäss § 19 Ziff. 8 gestattet sowie beim Wechsel zwischen Anteilsklassen innerhalb des Teilvermögens. Der unter Anwendung des Swinging Single Pricing ermittelte Nettoinventarwert ist somit ein modifizierter Nettoinventarwert.

Die Fondsleitung berücksichtigt grundsätzlich die durchschnittlichen Nebenkosten. Bei der Anpassung des Nettoinventarwertes kann sie jedoch auch die tatsächliche Höhe der Nebenkosten berücksichtigen, sofern dies unter Berücksichtigung der relevanten Umstände (z.B. Höhe des Betrags, allgemeine Marktsituation, spezifische Marktsituation für die betreffende Anlageklasse) im Ermessen der Fondsleitung angemessen erscheint. Die Anpassung kann in einem solchen Fall höher oder tiefer als die durchschnittlichen Nebenkosten ausfallen.

Grundsätze der Bewertung und der Nettoinventarwertberechnung

Siehe Anhang zu Ergänzende Angaben.

Umrechnungskurse

AUD 1 = CHF	0.585213	ILS 1 = CHF	0.226779
CAD 1 = CHF	0.624412	JPY 1 = CHF	0.005897
CNY 1 = CHF	0.120231	MXN 1 = CHF	0.043034
EUR 1 = CHF	0.941444	NZD 1 = CHF	0.536709
GBP 1 = CHF	1.131496	USD 1 = CHF	0.843550

Swiss Life iFunds (CH) Bond Global Corporates (CHF hedged)

Art übrige Fonds für traditionelle Anlagen

Dreijahresvergleich

	ISIN	30.9.2024	30.9.2023	30.9.2022
Nettofondsvermögen in CHF		1 050 400 533.24	1 038 350 182.62	854 474 858.52
Klasse I-A1	CH0114218610			
Nettoinventarwert pro Anteil in CHF		835.68	796.91	820.82
Ausgabe- und Rücknahmepreis pro Anteil in CHF ¹		837.69	799.38	823.94
Anzahl Anteile im Umlauf		1 153 091.5920	1 179 630.6760	932 504.6760
Klasse I-A2	CH0219870703			
Nettoinventarwert pro Anteil in CHF		837.62	798.76	822.38
Ausgabe- und Rücknahmepreis pro Anteil in CHF ¹		839.63	801.24	825.51
Anzahl Anteile im Umlauf		103 611.3080	123 057.3080	108 295.3080

¹ Siehe Ergänzende Angaben

Performance

	Währung	2023/2024	2022/2023	2021/2022
Klasse I-A1	CHF	8.5%	-0.5%	-17.2%
Klasse I-A2	CHF	8.1%	-0.9%	-17.6%
Referenzindex:				
Bloomberg Global Aggregate Corporates in CHF (CHF hedged)	CHF	8.3%	0.0%	-18.5%

Die historische Performance stellt keinen Indikator für die laufende oder zukünftige Performance dar.
Die Performancedaten lassen die bei der Ausgabe und Rücknahme der Anteile erhobenen Kommissionen und Kosten unberücksichtigt.

Struktur des Wertpapierportfolios (ungeprüft)

Aufteilung nach Risikodomizil in % des Gesamtfondsvermögens	
Vereinigte Staaten von Amerika	34.95
Grossbritannien	9.80
Frankreich	7.46
Deutschland	5.21
Schweiz	3.76
Spanien	3.60
Italien	3.58
Kanada	3.57
Japan	3.54
Niederlande	3.29
Übrige	16.59
Total	95.35

Obige Prozentsätze können Rundungsdifferenzen enthalten.

Vermögensrechnung

	30.9.2024	30.9.2023
	CHF	CHF
Verkehrswerte		
Bankguthaben		
– auf Sicht	30 828 898.49	59 625 498.03 ¹
Effekten		
– Obligationen, Wandelobligationen, Optionsanleihen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte	1 006 050 030.30	1 013 519 194.65
Derivative Finanzinstrumente	6 029 784.50	-20 483 612.38
Sonstige Vermögenswerte	12 227 794.30	11 023 720.69
Gesamtfondsvermögen	1 055 136 507.59	1 063 684 800.99
Kurzfristige Bankverbindlichkeiten	-4 248 022.56	-24 844 823.42
Andere Verbindlichkeiten	-487 951.79	-489 794.95
Nettofondsvermögen	1 050 400 533.24	1 038 350 182.62

Erfolgsrechnung

	1.10.2023-30.9.2024	1.10.2022-30.9.2023
	CHF	CHF
Ertrag		
Erträge der Bankguthaben	860 978.25	788 333.61
Negativzinsen	0.00	-85 051.11
Erträge der Effekten		
– aus Obligationen, Wandelobligationen, Optionsanleihen und sonstigen Forderungswertpapieren und -rechten	39 325 570.33	32 036 855.31
Ausgleichszahlungen aus Effektenleihe	3 088 193.21	2 978 511.28
Erträge der Effektenleihe	283 802.53	400 547.25
Einkauf in laufende Nettoerträge bei der Ausgabe von Anteilen	1 802 617.33	2 597 802.82
Total Ertrag	45 361 161.65	38 716 999.16
Aufwand		
Passivzinsen	-52 949.53	-22 178.09
Reglementarische Kommissionsvergütung an die Fondsleitung Klasse I-A1	-1 386 037.62	-1 306 009.78
Reglementarische Kommissionsvergütung an die Fondsleitung Klasse I-A2	-441 333.94	-502 213.59
Reglementarische Kommissionsvergütung an die Depotbank	-66 894.42	-72 845.85
Sonstige Aufwendungen	-1 620.72	-1 794.47
Ausrichtung laufender Nettoerträge bei der Rücknahme von Anteilen	-2 797 607.11	-823 046.16
Total Aufwand	-4 746 443.34	-2 728 087.94
Nettoertrag	40 614 718.31	35 988 911.22
Realisierte Kapitalgewinne und -verluste	-35 222 840.05	-37 316 534.52
Realisierter Erfolg	5 391 878.26	-1 327 623.30
Nicht realisierte Kapitalgewinne und -verluste	79 477 643.90	-7 672 695.65
Gesamterfolg	84 869 522.16	-9 000 318.95

Verwendung des Erfolges

	1.10.2023-30.9.2024	1.10.2022-30.9.2023
	CHF	CHF
Nettoertrag des Rechnungsjahres	40 614 718.31	35 988 911.22
Vortrag des Vorjahres	44 495.60	25 254.34
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg	40 659 213.91	36 014 165.56
Zur Ausschüttung an die Anlegerinnen und Anleger vorgesehener Erfolg	-40 652 500.05	-35 969 669.96
Vortrag auf neue Rechnung	6 713.86	44 495.60

¹ Zum 30. September 2023 wurden gegenüber Goldman Sachs in Höhe von CHF 840 000 als Sicherheiten hinterlegt.
Zum 30. September 2023 wurden gegenüber JP Morgan Chase New York in Höhe von CHF 1 250 000 als Sicherheiten hinterlegt.

Veränderung des Nettofondsvermögens

	1.10.2023-30.9.2024	1.10.2022-30.9.2023
	CHF	CHF
Nettofondsvermögen zu Beginn des Rechnungsjahres	1 038 350 182.62	854 474 858.52
Ordentliche Jahresausschüttung	-35 314 408.71	-25 010 846.79
Saldo aus dem Anteilverkehr	-37 504 762.83	217 886 489.84
Gesamterfolg	84 869 522.16	-9 000 318.95
Nettofondsvermögen am Ende der Berichtsperiode	1 050 400 533.24	1 038 350 182.62

Entwicklung der Anteile im Umlauf

	1.10.2023-30.9.2024	1.10.2022-30.9.2023
	Anzahl	Anzahl
Klasse I-A1		
Bestand Anfang Rechnungsjahr	1 179 630.6760	932 504.6760
Ausgegebene Anteile	104 909.9160	310 654.0000
Zurückgenommene Anteile	-131 449.0000	-63 528.0000
Bestand Ende Berichtsperiode	1 153 091.5920	1 179 630.6760
Differenz zwischen den ausgegebenen und zurückgenommenen Anteilen	-26 539.0840	247 126.0000
Klasse I-A2		
Bestand Anfang Rechnungsjahr	123 057.3080	108 295.3080
Ausgegebene Anteile	26 330.0000	34 276.0000
Zurückgenommene Anteile	-45 776.0000	-19 514.0000
Bestand Ende Berichtsperiode	103 611.3080	123 057.3080
Differenz zwischen den ausgegebenen und zurückgenommenen Anteilen	-19 446.0000	14 762.0000

Ausschüttung für 2023/2024

Klasse I-A1

(Ex-Datum 14.1.2025)

Aufgelaufener Ertrag pro Anteil	CHF	32.6026
Für in der Schweiz domizilierte Anteilinhaber brutto	CHF	32.6000
Abzüglich eidg. Verrechnungssteuer	CHF	-11.4100
Netto pro Anteil (zahlbar ab 16.1.2025)	CHF	21.1900
Für nicht in der Schweiz domizilierte Anteilinhaber mit Bankenerklärung		
Netto pro Anteil (zahlbar ab 16.1.2025)	CHF	32.6000

Klasse I-A2

(Ex-Datum 14.1.2025)

Aufgelaufener Ertrag pro Anteil	CHF	29.5855
Für in der Schweiz domizilierte Anteilinhaber brutto	CHF	29.5500
Abzüglich eidg. Verrechnungssteuer	CHF	-10.3425
Netto pro Anteil (zahlbar ab 16.1.2025)	CHF	19.2075
Für nicht in der Schweiz domizilierte Anteilinhaber mit Bankenerklärung		
Netto pro Anteil (zahlbar ab 16.1.2025)	CHF	29.5500

Titel		30.9.2023 Anzahl/ Nominal	Käufe ¹	Verkäufe ²	30.9.2024 Anzahl/ Nominal	Verkehrswert ³ in CHF	in % ³	Davon ausgeliehen Anzahl/Nominal
USD								
BANK OF MONTREAL 4.25000% 22-14.09.24*	USD	5 500 000		5 500 000				
BPCE SA-144A-SUB 4.87500% 16-01.04.26*	USD	2 200 000	2 000 000		4 200 000	3 536 586	0.34	
MET TOWER GLOBAL FUNDING-144A 4.85000% 24-16.01.27*	USD		3 300 000	3 300 000				
METROPOLITAN LIFE GLOBAL FUND-144A 3.30000% 22-21.03.29*	USD	2 600 000		2 600 000				
METROPOLITAN LIFE GLOBAL FUNDING-144A 4.05000% 22-25.08.25*	USD	7 400 000		7 400 000				
NEW YORK LIFE GLOBAL FUNDING-144A 4.55000% 23-28.01.33*	USD	4 600 000		1 500 000	3 100 000	2 626 147	0.25	
Total USD						6 162 733	0.58	
Total Medium-Term Notes, fester Zins						6 162 733	0.58	
Anleihen, fester Zins								
USD								
APA INFRASTRUCTURE LTD-144A 5.75000% 24-16.09.44*	USD		750 000		750 000	641 812	0.06	
ATHENE GLOBAL FUNDING-144A 5.58300% 24-09.01.29*	USD		9 000 000		9 000 000	7 861 981	0.75	1 100 000
FOUNDRY JV HOLDCO LLC-144A 6.15000% 24-25.01.32*	USD		2 000 000		2 000 000	1 754 503	0.17	
MASSMUTUAL GLOBAL FUNDING II-144A 5.05000% 22-07.12.27*	USD	3 700 000		3 700 000				
PUBLIC SERVICE CO OF COLORADO 2.70000% 20-15.01.51*	USD	3 400 000			3 400 000	1 860 849	0.18	
Total USD						12 119 145	1.15	
Total Anleihen, fester Zins						12 119 145	1.15	
Anleihen, variabler Zins								
USD								
DNB BANK ASA-REG-S 5.896%/VAR 22-09.10.26*	USD	7 500 000			7 500 000	6 402 603	0.61	
SCENTRE GROUP TRUST 2-REG-S-SUB 4.750%/VAR 20-24.09.80*	USD		3 000 000		3 000 000	2 512 235	0.24	
SOCIETE GENERALE SA-144A 6.066%/VAR 24-19.01.35*	USD		7 900 000	4 000 000	3 900 000	3 431 673	0.33	1 400 000
Total USD						12 346 511	1.17	
Total Anleihen, variabler Zins						12 346 511	1.17	
Total Effekten, die an einem andern geregelten Markt gehandelt werden						167 374 235	15.86	
Effekten, die nicht an einer Börse oder einem andern geregelten Markt gehandelt werden								
Notes, fester Zins								
CAD								
BANK OF NOVA SCOTIA 2.29000% 17-28.06.24**	CAD	3 500 000		3 500 000				
CANADIAN NATIONAL RAILWAY CO 3.00000% 19-08.02.29**	CAD	4 500 000			4 500 000	2 757 070	0.26	
Total CAD						2 757 070	0.26	
USD								
ATHENE GLOBAL FUNDING-144A 2.51400% 22-08.03.24**	USD	6 700 000		6 700 000				
NORTHERN NATURAL GAS CO DEL-144A 3.40000% 21-16.10.51**	USD	2 000 000			2 000 000	1 202 366	0.11	
ROYALTY PHARMA PLC 1.20000% 21-02.09.25**	USD	5 000 000			5 000 000	4 085 392	0.39	
Total USD						5 287 758	0.50	
Total Notes, fester Zins						8 044 828	0.76	
Notes, variabler Zins								
CAD								
GOLDMAN SACHS GROUP INC/THE 2.01300%/VAR 21-28.02.29**	CAD	5 000 000			5 000 000	2 955 750	0.28	
Total CAD						2 955 750	0.28	
Total Notes, variabler Zins						2 955 750	0.28	
Medium-Term Notes, fester Zins								
CAD								
INTER PIPELINE LTD 2.73400% 17-18.04.24**	CAD	4 500 000		4 500 000				
TRANSCANADA PIPELINES LTD 4.35000% 22-12.05.26**	CAD	2 600 000			2 600 000	1 640 243	0.16	
Total CAD						1 640 243	0.16	
Total Medium-Term Notes, fester Zins						1 640 243	0.16	
Anleihen, fester Zins								
JPY								
BPCE SA 0.89500% 23-14.12.26**	JPY		900 000 000		900 000 000	5 296 628	0.50	
Total JPY						5 296 628	0.50	
Total Anleihen, fester Zins						5 296 628	0.50	
Total Effekten, die nicht an einer Börse oder einem andern geregelten Markt gehandelt werden						17 937 448	1.70	
Total Wertschriften						1 006 050 030	95.35	
(davon ausgeliehen)						104 987 588	9.95)	
Bankguthaben auf Sicht						30 828 898	2.92	
Derivative Finanzinstrumente						6 029 785	0.57	
Sonstige Vermögenswerte						12 227 795	1.16	
Gesamtfondsvermögen						1 055 136 508	100.00	
Kurzfristige Bankverbindlichkeiten						-4 248 023		
Andere Verbindlichkeiten						-487 952		
Nettofondsvermögen						1 050 400 533		

Bewertungskategorie	Verkehrswert per 30.9.2024	in % des Gesamt- fondsvermögens ³
Anlagen bewertet zu den Kursen, die am Hauptmarkt bezahlt werden	987 592 998	93.60
Anlagen bewertet aufgrund von am Markt beobachtbaren Parametern	24 486 817	2.32
Anlagen bewertet mit geeigneten Bewertungsmodellen unter Berücksichtigung der aktuellen Marktgegebenheiten	-	-
Total	1 012 079 815	95.92

¹ «Käufe» umfassen die Transaktionen: Gratistitel / Käufe / Konversionen / Namensänderungen / «Splits» / Stock-/Wahldividenden / Titelaufteilungen / Überträge / Umbuchungen infolge Redenominierung in Euro / Umtausch zwischen Gesellschaften / Zuteilung aus Bezugs-/Optionsrechten / Zuteilung von Bezugsrechten ab Basistiteln / Sacheinlagen

² «Verkäufe» umfassen die Transaktionen: Auslosungen / Ausbuchung infolge Verfall / Ausübung von Bezugs-/Optionsrechten / «Reverse splits» / Rückzahlungen / Überträge / Umbuchungen infolge Redenominierung in Euro / Umtausch zwischen Gesellschaften / Verkäufe / Sachauslagen

³ Allfällige Abweichungen in den Totalisierungen sind auf Rundungsdifferenzen zurückzuführen

* bewertet zu den Kursen, die am Hauptmarkt bezahlt werden (Art. 88 Abs. 1 KAG)

** bewertet aufgrund von am Markt beobachtbaren Parametern

Derivative Finanzinstrumente

Gemäss KKV-FINMA Art. 23

Am Ende der Berichtsperiode offene engagementreduzierende Derivate

Instrument	Anzahl Kontrakte	Währung	Gebundene Basiswerte in Obligationen/Aktien in CHF	Variation Margin in CHF	In % des Vermögens
Futures auf Zinsinstrumente/Obligationen					
EURO-BUND FUTURE 06.12.24*	-327	EUR	-41 535 416	-358 813	-0.03
LONG GILT FUTURE 27.12.24*	-20	GBP	-2 227 463	14 257	0.00
			-43 762 879	-344 556	-0.03

Am Ende der Berichtsperiode offene engagementerhöhende Derivate

Instrument	Anzahl Kontrakte	Währung	Deckung in CHF	Variation Margin in CHF	In % des Vermögens
Futures auf Zinsinstrumente/Obligationen					
EURO-BOBL FUTURE 06.12.24*	20	EUR	2 260 407	24 666	0.00
US 10YR ULTRA NOTE FUTURE 19.12.24*	126	USD	12 573 455	-42 441	0.00
US LONG BOND FUTURE 19.12.24*	140	USD	14 666 171	36 905	0.00
US ULTRA LONG BOND (CBT) FUTURE 19.12.24*	12	USD	1 347 255	-6 010	0.00
US 10YR TREASURY NOTE FUTURE 19.12.24*	205	USD	19 762 399	-148 609	-0.01
US 5YR TREASURY NOTE FUTURE 31.12.24*	700	USD	64 884 154	-39 539	-0.01
			115 493 841	-175 028	-0.02

Am Ende der Berichtsperiode offene Derivate auf Devisen

Verkauf Währung	Verkauf Betrag	Kauf Währung	Kauf Betrag	Fälligkeit	Wiederbeschaffungswert in CHF	In % des Vermögens
Devisentermingeschäfte**						
GBP	42 800 000	CHF	46 746 374	15.10.2024	-1 617 508	-0.15
USD	190 000 000	CHF	163 216 650	15.10.2024	3 153 202	0.30
USD	229 000 000	CHF	196 779 242	15.10.2024	3 860 666	0.37
EUR	197 000 000	CHF	185 365 574	15.10.2024	59 412	0.01
EUR	101 000 000	CHF	95 043 323	15.10.2024	38 641	0.00
USD	11 000 000	CHF	9 318 210	15.10.2024	51 379	0.00
EUR	14 500 000	CHF	13 575 650	15.10.2024	-63 636	-0.01
EUR	1 000 000	CHF	938 098	15.10.2024	-2 543	0.00
EUR	100 000	CHF	93 675	15.10.2024	-389	0.00
CAD	11 900 000	CHF	7 432 859	09.10.2024	7 228	0.00
JPY	2 200 000 000	CHF	12 998 257	09.10.2024	22 149	0.00
GBP	1 200 000	CHF	1 333 382	15.10.2024	-22 614	0.00
JPY	2 129 000 000	CHF	12 853 454	18.10.2024	292 662	0.03
GBP	6 500 000	CHF	7 217 854	15.10.2024	-127 129	-0.01
USD	165 000 000	CHF	138 880 203	25.11.2024	541 373	0.05
USD	100 000 000	CHF	84 198 190	25.11.2024	356 476	0.03
					6 549 369	0.62

Obige Angaben können Rundungsdifferenzen enthalten.

* bewertet zu den Kursen, die am Hauptmarkt bezahlt werden (Art. 88 Abs. 1 KAG)

** bewertet aufgrund von am Markt beobachtbaren Parametern

Während der Berichtsperiode getätigte engagementreduzierende Derivate

Instrument	Währung	Käufe/ Kontrakte	Verkäufe/ Kontrakte
Futures auf Zinsinstrumente/Obligationen			
EURO-BUND FUTURE 06.06.24	EUR	153	153
EURO-BUND FUTURE 07.12.23	EUR	275	60
EURO-BUND FUTURE 07.03.24	EUR	85	85
EURO-BUND FUTURE 06.09.24	EUR	537	537
EURO-BUND FUTURE 06.12.24	EUR	120	447
LONG GILT FUTURE 26.06.24	GBP	130	130
LONG GILT FUTURE 26.09.24	GBP	120	120
LONG GILT FUTURE 27.12.24	GBP	0	20
US ULTRA LONG BOND (CBT) FUTURE 19.12.23	USD	135	60
US 10YR TREASURY NOTE FUTURE 19.03.24	USD	165	165
US 10YR TREASURY NOTE FUTURE 18.06.24	USD	95	95

Instrument	Währung	Käufe/ Kontrakte	Verkäufe/ Kontrakte
US 10YR ULTRA NOTE FUTURE 18.06.24	USD	380	380
US ULTRA LONG BOND (CBT) FUTURE 19.12.24	USD	16	16
US 10YR TREASURY NOTE FUTURE 19.12.24	USD	145	145
US 10YR TREASURY NOTE FUTURE 19.09.24	USD	145	145
US 10YR ULTRA NOTE FUTURE 19.09.24	USD	140	140
US ULTRA LONG BOND (CBT) FUTURE 19.09.24	USD	55	55

Während der Berichtsperiode getätigte engagementerhöhende Derivate

Instrument	Währung	Käufe/ Kontrakte	Verkäufe/ Kontrakte
------------	---------	---------------------	------------------------

Futures auf Zinsinstrumente/Obligationen

EURO-BUND FUTURE 06.06.24	EUR	30	30
EURO-BUND FUTURE 07.03.24	EUR	60	60
EURO-BOBL FUTURE 06.09.24	EUR	200	200
EURO-BOBL FUTURE 06.12.24	EUR	20	0
LONG GILT FUTURE 26.03.24	GBP	38	38
LONG GILT FUTURE 27.12.23	GBP	88	88
LONG GILT FUTURE 26.06.24	GBP	10	10
LONG GILT FUTURE 26.09.24	GBP	30	30
US 10YR TREASURY NOTE FUTURE 19.12.23	USD	270	735
US 2YR TREASURY NOTE FUTURE 29.12.23	USD	100	100
US 5YR TREASURY NOTE FUTURE 29.12.23	USD	0	590
CAN 10YR BOND FUTURE 18.12.23	CAD	0	10
US ULTRA LONG BOND (CBT) FUTURE 19.03.24	USD	50	50
US 10YR TREASURY NOTE FUTURE 19.03.24	USD	870	870
US 2YR TREASURY NOTE FUTURE 28.03.24	USD	200	200
US 5YR TREASURY NOTE FUTURE 28.03.24	USD	590	590
CAN 10YR BOND FUTURE 19.03.24	CAD	10	10
US 10YR TREASURY NOTE FUTURE 18.06.24	USD	200	200
US 10YR ULTRA NOTE FUTURE 18.06.24	USD	370	370
US LONG BOND FUTURE 18.06.24	USD	180	180
US 2YR TREASURY NOTE FUTURE 28.06.24	USD	200	200
US 5YR TREASURY NOTE FUTURE 28.06.24	USD	1 200	1 200
US 10YR ULTRA NOTE FUTURE 19.12.24	USD	126	0
US LONG BOND FUTURE 19.12.24	USD	190	50
US ULTRA LONG BOND (CBT) FUTURE 19.12.24	USD	16	4
US 10YR TREASURY NOTE FUTURE 19.12.24	USD	205	0
US 10YR TREASURY NOTE FUTURE 19.09.24	USD	5	5
US 2YR TREASURY NOTE FUTURE 30.09.24	USD	150	150
US LONG BOND FUTURE 19.09.24	USD	430	430
US 10YR ULTRA NOTE FUTURE 19.09.24	USD	100	100
US 5YR TREASURY NOTE FUTURE 30.09.24	USD	450	450
US ULTRA LONG BOND (CBT) FUTURE 19.09.24	USD	40	40
US 5YR TREASURY NOTE FUTURE 31.12.24	USD	750	50
US 2YR TREASURY NOTE FUTURE 31.12.24	USD	30	30

Instrument	Währung	Nominal
------------	---------	---------

Zinssatz-Swaps/Credit Default Swaps

GS/ITRX EUROPE S40 V1 CDI PAY 1.00000% 23-20.12.28	EUR	70 000 000
JP MORGAN/MARKIT CDX.NA.IG.41 CDI PAY 1.00000% 23-20.12.28	USD	100 000 000
ML/ITRX EUROPE S40 V1 CDI PAY 1.00000% 23-20.12.28	EUR	100 000 000
GS/MARKIT CDX.NA.IG.41 CDI PAY 1.00000% 24-20.12.28	USD	80 000 000
JP MORGAN/ITRX EUROPE S41 V1 CDI PAY 1.00000% 24-20.06.29	EUR	100 000 000
ML/MARKIT CDX.NA.IG.S42 V1 CDI PAY 1.00000% 24-20.06.29	USD	120 000 000
MERRILL LYNCH/ITRX EUROPE S41 V1 CDI PAY 1.00000% 24-20.06.2	EUR	105 000 000

Während der Berichtsperiode getätigte Derivate auf Devisen

Verkauf Währung	Verkauf Betrag	Kauf Währung	Kauf Betrag	Fälligkeit
--------------------	-------------------	-----------------	----------------	------------

Devisentermingeschäfte

CHF	3 211 451	USD	3 500 000	25.10.2023
CHF	4 574 202	USD	5 000 000	25.10.2023
CHF	4 506 083	USD	5 000 000	25.10.2023
CHF	3 592 078	USD	4 000 000	25.10.2023
CHF	4 496 985	USD	5 000 000	25.10.2023
EUR	2 000 000	CHF	1 911 815	30.10.2023
CHF	946 228	EUR	1 000 000	30.10.2023
USD	10 000 000	CHF	8 990 529	31.10.2023
CHF	221 792	GBP	200 000	07.11.2023
USD	182 000 000	CHF	161 899 738	27.11.2023
USD	7 000 000	CHF	6 183 387	27.11.2023
USD	175 000 000	CHF	156 521 225	30.11.2023
EUR	325 000 000	CHF	307 333 878	30.11.2023
USD	130 000 000	CHF	116 888 720	30.11.2023
EUR	4 000 000	CHF	3 832 768	30.11.2023
CHF	9 611 847	EUR	10 000 000	30.11.2023
USD	5 500 000	CHF	4 951 771	30.11.2023
CAD	23 100 000	CHF	15 443 676	05.12.2023
CHF	14 795 739	CAD	23 000 000	05.12.2023
GBP	32 000 000	CHF	35 450 829	07.12.2023
GBP	300 000	CHF	333 009	07.12.2023
GBP	2 800 000	CHF	3 099 146	07.12.2023
USD	215 000 000	CHF	193 044 845	11.12.2023
USD	10 000 000	CHF	8 842 814	11.12.2023
USD	13 000 000	CHF	11 353 113	11.12.2023
USD	3 000 000	CHF	2 620 523	11.12.2023
USD	186 000 000	CHF	163 804 341	27.12.2023
CHF	159 640 080	USD	186 000 000	27.12.2023
USD	318 000 000	CHF	278 457 336	29.12.2023
EUR	310 000 000	CHF	298 526 900	29.12.2023

Verkauf Währung	Verkauf Betrag	Kauf Währung	Kauf Betrag	Fälligkeit
EUR	1 500 000	CHF	1 437 611	29.12.2023
EUR	2 000 000	CHF	1 908 538	29.12.2023
USD	2 000 000	CHF	1 756 961	29.12.2023
CHF	2 831 916	EUR	3 000 000	29.12.2023
CHF	9 431 644	EUR	10 000 000	29.12.2023
CHF	273 343 200	USD	320 000 000	29.12.2023
CHF	282 368 220	EUR	300 000 000	29.12.2023
USD	244 000 000	CHF	212 361 472	11.01.2024
USD	6 200 000	CHF	5 372 851	11.01.2024
USD	186 000 000	CHF	159 070 548	29.01.2024
USD	320 000 000	CHF	272 407 456	29.01.2024
EUR	300 000 000	CHF	281 803 050	29.01.2024
USD	6 000 000	CHF	5 100 924	29.01.2024
EUR	15 000 000	CHF	13 997 400	29.01.2024
CHF	215 737 525	USD	250 000 000	29.01.2024
JPY	980 000 000	CHF	5 889 583	30.01.2024
GBP	3 300 000	CHF	3 649 368	31.01.2024
GBP	500 000	CHF	544 033	31.01.2024
GBP	3 200 000	CHF	3 470 650	31.01.2024
GBP	35 500 000	CHF	38 915 136	07.02.2024
GBP	7 000 000	CHF	7 665 371	07.02.2024
JPY	1 200 000 000	CHF	7 229 555	08.02.2024
JPY	20 000 000	CHF	119 184	08.02.2024
JPY	1 000 000 000	CHF	5 834 787	08.02.2024
USD	234 000 000	CHF	198 351 972	12.02.2024
USD	250 000 000	CHF	215 109 375	26.02.2024
USD	5 200 000	CHF	4 470 037	26.02.2024
EUR	166 500 000	CHF	156 455 055	29.02.2024
EUR	150 000 000	CHF	140 956 320	29.02.2024
USD	253 500 000	CHF	218 921 840	29.02.2024
EUR	6 300 000	CHF	5 865 655	29.02.2024
CHF	2 656 227	USD	3 000 000	29.02.2024
CAD	23 600 000	CHF	15 054 180	04.03.2024
GBP	42 500 000	CHF	46 439 580	07.03.2024
USD	225 000 000	CHF	195 853 950	12.03.2024
CHF	8 775 679	USD	10 000 000	12.03.2024
JPY	900 000 000	CHF	5 445 069	14.03.2024
USD	246 000 000	CHF	214 823 362	26.03.2024
EUR	316 000 000	CHF	301 133 053	28.03.2024
USD	237 500 000	CHF	208 391 240	28.03.2024
CHF	1 754 794	USD	2 000 000	28.03.2024
CHF	6 660 185	EUR	7 000 000	28.03.2024
CHF	14 374 371	EUR	15 000 000	28.03.2024
USD	7 600 000	CHF	6 665 382	28.03.2024
USD	5 000 000	CHF	4 414 945	28.03.2024
EUR	3 400 000	CHF	3 273 353	28.03.2024
CAD	23 800 000	CHF	15 382 368	04.04.2024
GBP	42 500 000	CHF	47 562 260	08.04.2024
GBP	3 500 000	CHF	3 936 489	08.04.2024
GBP	800 000	CHF	910 985	08.04.2024
USD	200 000 000	CHF	174 711 500	12.04.2024
USD	229 000 000	CHF	204 989 350	26.04.2024
CHF	3 646 712	USD	4 000 000	26.04.2024
CHF	3 192 843	USD	3 500 000	26.04.2024
EUR	298 000 000	CHF	290 833 994	30.04.2024
USD	245 000 000	CHF	219 906 120	30.04.2024
EUR	3 000 000	CHF	2 915 685	30.04.2024
EUR	3 000 000	CHF	2 920 608	30.04.2024
CHF	1 937 761	EUR	2 000 000	30.04.2024
CHF	1 453 671	EUR	1 500 000	30.04.2024
CHF	1 958 296	EUR	2 000 000	30.04.2024
CAD	19 200 000	CHF	12 817 344	06.05.2024
JPY	2 200 000 000	CHF	12 963 965	08.05.2024
USD	200 000 000	CHF	180 121 740	13.05.2024
CHF	2 726 980	USD	3 000 000	13.05.2024
CHF	178 097 360	USD	196 000 000	13.05.2024
USD	223 000 000	CHF	203 301 228	28.05.2024
EUR	299 000 000	CHF	291 580 913	31.05.2024
USD	239 000 000	CHF	217 201 527	31.05.2024
EUR	3 000 000	CHF	2 922 090	31.05.2024
CHF	9 903 360	EUR	10 000 000	31.05.2024
USD	4 000 000	CHF	3 655 754	31.05.2024
CHF	5 952 042	EUR	6 000 000	31.05.2024
CAD	15 000 000	CHF	9 951 326	06.06.2024
GBP	46 800 000	CHF	53 341 657	10.06.2024
CHF	3 017 791	GBP	2 600 000	10.06.2024
USD	234 000 000	CHF	213 821 806	11.06.2024
USD	196 000 000	CHF	177 476 628	13.06.2024
USD	3 000 000	CHF	2 707 509	13.06.2024
JPY	1 796 000 000	CHF	10 722 398	14.06.2024
EUR	292 000 000	CHF	288 756 873	14.06.2024
USD	240 000 000	CHF	218 663 832	14.06.2024
CHF	6 263 461	USD	7 000 000	14.06.2024
JPY	360 000 000	CHF	2 125 160	25.06.2024
CAD	14 950 000	CHF	9 734 932	08.07.2024
JPY	2 200 000 000	CHF	12 964 944	10.07.2024
CHF	12 272 229	JPY	2 200 000 000	10.07.2024
GBP	45 000 000	CHF	50 955 165	12.08.2024
GBP	5 600 000	CHF	6 255 099	12.08.2024
CHF	8 389 044	GBP	7 800 000	12.08.2024
USD	200 000 000	CHF	178 598 500	13.08.2024
CHF	5 310 822	USD	6 300 000	13.08.2024
CHF	2 566 393	USD	3 000 000	13.08.2024
CHF	259 413	USD	300 000	13.08.2024
USD	232 000 000	CHF	206 362 840	14.08.2024
EUR	290 000 000	CHF	278 400 087	14.08.2024
EUR	5 100 000	CHF	4 887 830	14.08.2024
CHF	464 955	EUR	500 000	14.08.2024

Verkauf Währung	Verkauf Betrag	Kauf Währung	Kauf Betrag	Fälligkeit
CHF	186 199 081	EUR	197 000 000	14.08.2024
CHF	198 220 339	USD	229 000 000	14.08.2024
CHF	95 470 553	EUR	101 000 000	14.08.2024
CAD	11 500 000	CHF	7 557 409	09.09.2024
JPY	2 200 000 000	CHF	12 295 842	09.09.2024
USD	235 000 000	CHF	208 634 645	11.09.2024
USD	5 000 000	CHF	4 461 290	11.09.2024
USD	4 000 000	CHF	3 515 852	11.09.2024
USD	15 000 000	CHF	13 246 490	11.09.2024
USD	3 400 000	CHF	2 997 692	11.09.2024
USD	6 000 000	CHF	5 253 279	11.09.2024
USD	10 000 000	CHF	8 468 064	11.09.2024
CHF	3 156 477	USD	3 700 000	11.09.2024
CHF	8 484 758	USD	10 000 000	11.09.2024
CHF	4 252 340	USD	5 000 000	11.09.2024
USD	15 000 000	CHF	12 689 117	11.09.2024
JPY	1 774 000 000	CHF	10 135 265	17.09.2024
JPY	359 000 000	CHF	2 018 187	17.09.2024
USD	275 000 000	CHF	232 906 603	25.09.2024
CHF	2 541 488	USD	3 000 000	25.09.2024
CAD	11 900 000	CHF	7 432 859	09.10.2024
JPY	2 200 000 000	CHF	12 998 257	09.10.2024
GBP	42 800 000	CHF	46 746 374	15.10.2024
USD	190 000 000	CHF	163 216 650	15.10.2024
USD	229 000 000	CHF	196 779 242	15.10.2024
EUR	197 000 000	CHF	185 365 574	15.10.2024
EUR	101 000 000	CHF	95 043 323	15.10.2024
USD	11 000 000	CHF	9 318 210	15.10.2024
EUR	14 500 000	CHF	13 575 650	15.10.2024
EUR	1 000 000	CHF	938 098	15.10.2024
EUR	100 000	CHF	93 675	15.10.2024
GBP	1 200 000	CHF	1 333 382	15.10.2024
GBP	6 500 000	CHF	7 217 854	15.10.2024
JPY	2 129 000 000	CHF	12 853 454	18.10.2024
USD	165 000 000	CHF	138 880 203	25.11.2024
USD	100 000 000	CHF	84 198 190	25.11.2024

Ergänzende Angaben

Derivative Finanzinstrumente

Risikomessverfahren Commitment-Ansatz I:
Art. 34 KKV-FINMA

Position	Betrag in CHF	in % des Nettofonds- vermögens
Total engagement- erhöhende Positionen	115 493 840.68	11.00%
Total engagement- reduzierende Positionen	1 015 367 424.13	96.66%

Pensionsgeschäfte

Die Fondsleitung tätigt für Rechnung des Teilvermögens keine Pensionsgeschäfte.

Vergütung an die Fondsleitung

Verwaltungskommission

- Effektiv erhobene Verwaltungskommission:
 - Klasse I-A1: 0.143625% p.a.;
 - Klasse I-A2: 0.523625% p.a.;
- Maximale erhobene Verwaltungskommission gemäss Fondsvertrag:
 - Klasse I-A1: 0.35% p.a.;
 - Klasse I-A2: 0.65% p.a.;
- Effektiv erhobene Depotbankkommission für alle Klassen: 0.006375% p.a.;
- Maximale erhobene Depotbankkommission für alle Klassen gemäss Fondsvertrag: 0.20% p.a.;

Gebührenteilungsvereinbarungen («commission sharing agreements») und geldwerte Vorteile («soft commissions»)

Die Fondsleitung hat keine Gebührenteilungsvereinbarungen («commission sharing agreements») geschlossen. Die Fondsleitung hat keine Vereinbarungen bezüglich so genannten «soft commissions» geschlossen.

Total Expense Ratio (TER)

Diese Kennziffer wurde gemäss der «Richtlinie zur Berechnung und Offenlegung der Total Expense Ratio (TER) von kollektiven Kapitalanlagen» der Asset Management Association Switzerland (AMAS) in der aktuell gültigen Fassung berechnet und drückt die Gesamtheit derjenigen Kommissionen und Kosten, die laufend dem Fondsvermögen belastet werden (Betriebsaufwand), retrospektiv in einem %-Satz des Fondsvermögens aus.

TER für die letzten 12 Monate:

Klasse I-A1:	0.15%
Klasse I-A2:	0.53%

Ausgabe- und Rücknahmepreis

Falls an einem Bewertungstag die Summe der Zeichnungen und Rücknahmen von Anteilen eines Teilvermögens zu einem Nettovermögenszufluss bzw. -abfluss führt, wird der Nettoinventarwert des entsprechenden Teilvermögens erhöht bzw. reduziert (Swinging Single Pricing). Die maximale Anpassung beläuft sich auf 2% des Nettoinventarwerts. Berücksichtigt werden die Nebenkosten (Geld/Brief-Spannen, marktübliche Courtagen, Kommissionen, Steuern und Abgaben usw.) sowie die Kosten für die Überprüfung und Aufrechterhaltung von Qualitätsstandards bei physischen Anlagen, die aus der Anlage des einbezahlten Betrags bzw. aus dem Verkauf eines dem gekündigten Anteil entsprechenden Teils der Anlagen erwachsen. Die Anpassung führt zu einer Erhöhung des Nettoinventarwerts, wenn die Nettobewegung zu einem Anstieg der Anzahl Anteile des Anlagefonds führt. Die Anpassung resultiert in einer Verminderung des Nettoinventarwerts, wenn die Nettobewegung einen Rückgang der Anzahl der Anteile des entsprechenden Teilvermögens bewirkt. Die Berücksichtigung dieser Nebenkosten entfällt, falls die Fondsleitung einer Ein- oder Auszahlung in Anlagen statt in bar gemäss § 19 Ziff. 8 gestattet sowie beim Wechsel zwischen Anteilsklassen innerhalb des Teilvermögens. Der unter Anwendung des Swinging Single Pricing ermittelte Nettoinventarwert ist somit ein modifizierter Nettoinventarwert.

Die Fondsleitung berücksichtigt grundsätzlich die durchschnittlichen Nebenkosten. Bei der Anpassung des Nettoinventarwertes kann sie jedoch auch die tatsächliche Höhe der Nebenkosten berücksichtigen, sofern dies unter Berücksichtigung der relevanten Umstände (z.B. Höhe des Betrags, allgemeine Marktsituation, spezifische Marktsituation für die betreffende Anlageklasse) im Ermessen der Fondsleitung angemessen erscheint. Die Anpassung kann in einem solchen Fall höher oder tiefer als die durchschnittlichen Nebenkosten ausfallen.

Grundsätze der Bewertung und der Nettoinventarwertberechnung

Siehe Anhang zu Ergänzende Angaben.

Umrechnungskurse

CAD 1 = CHF	0.624412	JPY 1 = CHF	0.005897
EUR 1 = CHF	0.941444	USD 1 = CHF	0.843550
GBP 1 = CHF	1.131496		

Swiss Life iFunds (CH) Bond Swiss Francs Domestic (CHF)

Art übrige Fonds für traditionelle Anlagen

Dreijahresvergleich

	ISIN	30.9.2024	30.9.2023	30.9.2022
Nettofondsvermögen in CHF		931 431 607.82	994 394 625.65	688 286 747.05
Klasse I-A1	CH0023989764			
Nettoinventarwert pro Anteil in CHF		1 079.74	1 003.42	971.07
Ausgabe- und Rücknahmepreis pro Anteil in CHF ¹		1 084.38	1 008.24	971.07
Anzahl Anteile im Umlauf		845 938.3120	925 082.2360	659 891.1700
Klasse I-A2	CH0324001053			
Nettoinventarwert pro Anteil in CHF		946.05	879.23	850.79
Ausgabe- und Rücknahmepreis pro Anteil in CHF ¹		950.12	883.45	850.79
Anzahl Anteile im Umlauf		19 064.2800	75 238.0000	55 814.0000

¹ Siehe Ergänzende Angaben

Performance

	Währung	2023/2024	2022/2023	2021/2022
Klasse I-A1	CHF	8.6%	4.0%	-13.0%
Klasse I-A2	CHF	8.4%	3.8%	-13.1%
Referenzindex:				
Swiss Bond Index Domestic AAA – BBB	CHF	8.2%	3.0%	-12.2%

Die historische Performance stellt keinen Indikator für die laufende oder zukünftige Performance dar.
Die Performancedaten lassen die bei der Ausgabe und Rücknahme der Anteile erhobenen Kommissionen und Kosten unberücksichtigt.

Struktur des Wertpapierportfolios (ungeprüft)

Aufteilung nach Risikodomizil in % des Gesamtfondsvermögens	
Schweiz	95.31
Vereinigte Staaten von Amerika	2.61
Liechtenstein	0.44
Italien	0.11
Total	98.47

Obige Prozentsätze können Rundungsdifferenzen enthalten.

Vermögensrechnung

	30.9.2024	30.9.2023
	CHF	CHF
Verkehrswerte		
Bankguthaben		
– auf Sicht	8 890 252.76	7 470 331.79
Effekten		
– Obligationen, Wandelobligationen, Optionsanleihen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte	921 690 406.01	963 994 255.94
– Anteile anderer kollektiver Kapitalanlagen	0.00	20 122 000.00
Derivative Finanzinstrumente	-1 433 027.83	12 989.63
Sonstige Vermögenswerte	6 793 515.28	6 192 597.45
Gesamtfondsvermögen	935 941 146.22	997 792 174.81
Kurzfristige Bankverbindlichkeiten	-4 296 596.60	-3 171 465.27
Andere Verbindlichkeiten	-212 941.80	-226 083.89
Nettofondsvermögen	931 431 607.82	994 394 625.65

Erfolgsrechnung

	1.10.2023-30.9.2024	1.10.2022-30.9.2023
	CHF	CHF
Ertrag		
Erträge der Bankguthaben	223 049.32	303 103.34
Negativzinsen	0.00	-46 888.99
Erträge der Geldmarktinstrumente	0.00	102 610.00
Erträge der Effekten		
– aus Obligationen, Wandelobligationen, Optionsanleihen und sonstigen Forderungswertpapieren und -rechten	10 577 464.23	7 377 806.17
– aus Anteilen anderer kollektiver Kapitalanlagen	226 893.60	0.00
Ausgleichszahlungen aus Effektenleihe	962 797.81	961 120.08
Erträge der Effektenleihe	137 050.36	150 305.88
Erträge der derivativen Finanzinstrumente	6 369.89	0.00
Einkauf in laufende Nettoerträge bei der Ausgabe von Anteilen	361 880.29	1 390 775.05
Total Ertrag	12 495 505.50	10 238 831.53
Aufwand		
Passivzinsen	-34 378.35	-8 923.99
Reglementarische Kommissionsvergütung an die Fondsleitung Klasse I-A1	-672 256.78	-580 636.03
Reglementarische Kommissionsvergütung an die Fondsleitung Klasse I-A2	-163 295.82	-150 222.56
Reglementarische Kommissionsvergütung an die Depotbank	-62 157.85	-61 292.29
Sonstige Aufwendungen	-288.00	-288.00
Ausrichtung laufender Nettoerträge bei der Rücknahme von Anteilen	-1 144 431.55	-375 403.63
Total Aufwand	-2 076 808.35	-1 176 766.50
Nettoertrag	10 418 697.15	9 062 065.03
Realisierte Kapitalgewinne und -verluste	-9 061 535.98	-4 821 732.63
Realisierter Erfolg	1 357 161.17	4 240 332.40
Nicht realisierte Kapitalgewinne und -verluste	78 618 410.97	28 926 266.79
Gesamterfolg	79 975 572.14	33 166 599.19

Verwendung des Erfolges

	1.10.2023-30.9.2024	1.10.2022-30.9.2023
	CHF	CHF
Nettoertrag des Rechnungsjahres	10 418 697.15	9 062 065.03
Vortrag des Vorjahres	41 287.84	21 518.59
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg	10 459 984.99	9 083 583.62
Zur Ausschüttung an die Anlegerinnen und Anleger vorgesehener Erfolg	-10 447 822.58	-9 042 295.78
Vortrag auf neue Rechnung	12 162.41	41 287.84

Veränderung des Nettofondsvermögens

	1.10.2023-30.9.2024	1.10.2022-30.9.2023
	CHF	CHF
Nettofondsvermögen zu Beginn des Rechnungsjahres	994 394 625.65	688 286 747.05
Ordentliche Jahresausschüttung	-8 891 104.50	-4 238 860.26
Saldo aus dem Anteilverkehr	-134 047 485.47	277 180 139.67
Gesamterfolg	79 975 572.14	33 166 599.19
Nettofondsvermögen am Ende der Berichtsperiode	931 431 607.82	994 394 625.65

Entwicklung der Anteile im Umlauf

	1.10.2023-30.9.2024	1.10.2022-30.9.2023
	Anzahl	Anzahl
Klasse I-A1		
Bestand Anfang Rechnungsjahr	925 082.2360	659 891.1700
Ausgegebene Anteile	92 819.1610	321 610.0660
Zurückgenommene Anteile	-171 963.0850	-56 419.0000
Bestand Ende Berichtsperiode	845 938.3120	925 082.2360
Differenz zwischen den ausgegebenen und zurückgenommenen Anteilen	-79 143.9240	265 191.0660
Klasse I-A2		
Bestand Anfang Rechnungsjahr	75 238.0000	55 814.0000
Ausgegebene Anteile	17 363.2800	46 088.0000
Zurückgenommene Anteile	-73 537.0000	-26 664.0000
Bestand Ende Berichtsperiode	19 064.2800	75 238.0000
Differenz zwischen den ausgegebenen und zurückgenommenen Anteilen	-56 173.7200	19 424.0000

Ausschüttung für 2023/2024

Klasse I-A1

(Ex-Datum 14.1.2025)

Aufgelaufener Ertrag pro Anteil	CHF	12.1639
Brutto	CHF	12.1500
Abzüglich eidg. Verrechnungssteuer	CHF	-4.2525
Netto pro Anteil (zahlbar ab 16.1.2025)	CHF	7.8975

Klasse I-A2

(Ex-Datum 14.1.2025)

Aufgelaufener Ertrag pro Anteil	CHF	8.9190
Brutto	CHF	8.9000
Abzüglich eidg. Verrechnungssteuer	CHF	-3.1150
Netto pro Anteil (zahlbar ab 16.1.2025)	CHF	5.7850

Titel		30.9.2023 Anzahl/ Nominal	Käufe ¹	Verkäufe ²	30.9.2024 Anzahl/ Nominal	Verkehrswert ³ in CHF	in % ³	Davon ausgeliehen Anzahl/Nominal
SWITZERLAND-REG-S 0.00000% 16-22.06.29*	CHF	20 000 000		20 000 000				
SWITZERLAND-REG-S 0.00000% 19-26.06.34*	CHF	6 000 000	6 700 000	4 700 000	8 000 000	7 688 800	0.82	6 000 000
SWITZERLAND-REG-S 0.00000% 19-24.07.39*	CHF	11 200 000		7 200 000	4 000 000	3 744 400	0.40	4 000 000
SWITZERLAND-REG-S 0.00000% 23-26.06.34*	CHF		3 000 000	3 000 000				
UBS SWITZERLAND AG-REG-S 0.00000% 19-16.07.29*	CHF	1 500 000			1 500 000	1 435 500	0.15	
VALIANT BANK AG-REG-S 0.00000% 19-31.07.29*	CHF	1 500 000			1 500 000	1 429 500	0.15	
WALLISER KANTONALBANK-REG-S 0.00000% 20-14.02.29*	CHF		1 700 000		1 700 000	1 630 300	0.17	200 000
ZUERCHER KANTONALBANK 0.00000% 21-21.01.33*	CHF	3 300 000	1 000 000	3 300 000	1 000 000	921 500	0.10	
ZUERICH, CANTON OF-REG-S 0.00000% 18-27.06.25*	CHF	1 000 000		1 000 000				
ZUERICH, CANTON OF-REG-S 0.00000% 20-23.06.28*	CHF	1 500 000		1 500 000				
Total CHF						41 775 000	4.46	

Total Anleihen, Nullcoupon

41 775 000 4.46

Anleihen, variabler Zins

CHF

SWISS LIFE AG-REG-S-SUB 2.625%/VAR 18-25.09.48*	CHF	1 000 000		250 000	750 000	773 250	0.08	
ZUERCHER KANTONALBANK-REG-S 2.000%/VAR 24-22.03.30*	CHF		3 000 000	1 000 000	2 000 000	2 076 000	0.21	
Total CHF						2 849 250	0.29	

Total Anleihen, variabler Zins

2 849 250 0.29

Total Effekten, die an einer Börse gehandelt werden

921 690 406 98.47

Effekten, die nicht an einer Börse oder einem andern geregelten Markt gehandelt werden

Investmentzertifikate, open end

Global

SWISS LIFE FUNDS (CH) MONEY MARKET SWISS FRANCS A CAP**	CHF	200 000	125 000	325 000				
Total Global							0.00	

Total Investmentzertifikate, open end

0.00

Total Effekten, die nicht an einer Börse oder einem andern geregelten Markt gehandelt werden

0.00

Total Wertschriften

(davon ausgeliehen)

921 690 406 98.47

77 375 020 8.27

Bankguthaben auf Sicht

8 890 253 0.95

Derivative Finanzinstrumente

-1 433 028 -0.15

Sonstige Vermögenswerte

6 793 515 0.73

Gesamtfondsvermögen

935 941 146 100.00

Kurzfristige Bankverbindlichkeiten

-4 296 597

Andere Verbindlichkeiten

-212 941

Nettofondsvermögen

931 431 608

Bewertungskategorie

Verkehrswert per

30.9.2024

in %

des Gesamt-

fondsvermögens³

Anlagen bewertet zu den Kursen, die am Hauptmarkt bezahlt werden

921 690 406 98.47

Anlagen bewertet aufgrund von am Markt beobachtbaren Parametern

-1 433 028 -0.15

Anlagen bewertet mit geeigneten Bewertungsmodellen unter Berücksichtigung der aktuellen Marktgegebenheiten

- - -

Total

920 257 378 98.32

¹ «Käufe» umfassen die Transaktionen: Gratistitel / Käufe / Konversionen / Namensänderungen / «Splits» / Stock-/Wahldividenden / Titelaufteilungen / Überträge / Umbuchungen infolge Redenominierung in Euro / Umtausch zwischen Gesellschaften / Zuteilung aus Bezugs-/Optionsrechten / Zuteilung von Bezugsrechten ab Basistiteln / Sacheinlagen

² «Verkäufe» umfassen die Transaktionen: Auslosungen / Ausbuchung infolge Verfall / Ausübung von Bezugs-/Optionsrechten / «Reverse splits» / Rückzahlungen / Überträge / Umbuchungen infolge Redenominierung in Euro / Umtausch zwischen Gesellschaften / Verkäufe / Sachauslagen

³ Allfällige Abweichungen in den Totalsierungen sind auf Rundungsdifferenzen zurückzuführen

* bewertet zu den Kursen, die am Hauptmarkt bezahlt werden (Art. 88 Abs. 1 KAG)

** bewertet aufgrund von am Markt beobachtbaren Parametern

Derivative Finanzinstrumente

Gemäss KKV-FINMA Art. 23

Am Ende der Berichtsperiode offene engagementreduzierende Derivate

Instrument	Nominal	Währung	Gebundene Basiswerte in Obligationen/Aktien in CHF	Wiederbeschaffungswert in CHF	In % des Vermögens
Zinssatz-Swaps/Credit Default Swaps					
LCH/INTEREST RATE SWAP TP PAYER 1.17940% 24-14.06.30**	17 000 000	CHF	17 000 000	-662 337	-0.07
LCH/INTEREST RATE SWAP REC TP SARON 24-14.06.30	17 000 000	CHF			
LCH/INTEREST RATE SWAP TP PAYER 1.06250% 24-18.06.29**	30 000 000	CHF	30 000 000	-754 776	-0.08
LCH/INTEREST RATE SWAP REC TP SARON 24-18.06.29	30 000 000	CHF			
			47 000 000	-1 417 113	-0.15

Am Ende der Berichtsperiode offene Derivate auf Devisen

Verkauf Währung	Verkauf Betrag	Kauf Währung	Kauf Betrag	Fälligkeit	Wiederbeschaffungswert in CHF	In % des Vermögens
Devisentermingeschäfte**						
GBP	450 000	CHF	501 561	17.10.2024	-6 674	0.00
GBP	700 000	CHF	781 347	17.10.2024	-9 241	0.00
					-15 915	0.00

Obige Angaben können Rundungsdifferenzen enthalten.

** bewertet aufgrund von am Markt beobachtbaren Parametern

Während der Berichtsperiode getätigte engagementreduzierende Derivate

Instrument	Währung	Nominal
Zinssatz-Swaps/Credit Default Swaps		
LCH/INTEREST RATE SWAP TP PAYER 1.17940% 24-14.06.30	CHF	17 000 000
LCH/INTEREST RATE SWAP REC TP SARON 24-14.06.30	CHF	17 000 000
LCH/INTEREST RATE SWAP TP PAYER 1.06250% 24-18.06.29	CHF	30 000 000
LCH/INTEREST RATE SWAP REC TP SARON 24-18.06.29	CHF	30 000 000

Während der Berichtsperiode getätigte Derivate auf Devisen

Verkauf Währung	Verkauf Betrag	Kauf Währung	Kauf Betrag	Fälligkeit
Devisentermingeschäfte				
GBP	600 000	CHF	653 505	17.01.2024
GBP	600 000	CHF	645 871	17.04.2024
GBP	450 000	CHF	501 561	17.10.2024
GBP	700 000	CHF	781 347	17.10.2024

Ergänzende Angaben

Derivative Finanzinstrumente

Risikomessverfahren Commitment-Ansatz I:
Art. 34 KKV-FINMA

Position	Betrag in CHF	in % des Nettofonds- vermögens
Total engagement- erhöhende Positionen	–	–
Total engagement- reduzierende Positionen	46 821 907.95	5.03%

Pensionsgeschäfte

Die Fondsleitung tätigt für Rechnung des Teilvermögens keine Pensionsgeschäfte.

Vergütung an die Fondsleitung

Verwaltungskommission

- Effektiv erhobene Verwaltungskommission:
 - Klasse I-A1: 0.073625% p.a.;
 - Klasse I-A2: 0.263625% p.a.;
- Maximale erhobene Verwaltungskommission gemäss Fondsvertrag:
 - Klasse I-A1: 0.20% p.a.;
 - Klasse I-A2: 0.30% p.a.;
- Effektiv erhobene Depotbankkommission für alle Klassen: 0.006375% p.a.;
- Maximale erhobene Depotbankkommission für alle Klassen gemäss Fondsvertrag: 0.20% p.a.;

Gebührenteilungsvereinbarungen («commission sharing agreements») und geldwerte Vorteile («soft commissions»)

Die Fondsleitung hat keine Gebührenteilungsvereinbarungen («commission sharing agreements») geschlossen. Die Fondsleitung hat keine Vereinbarungen bezüglich so genannten «soft commissions» geschlossen.

Total Expense Ratio (TER)

Diese Kennziffer wurde gemäss der «Richtlinie zur Berechnung und Offenlegung der Total Expense Ratio (TER) von kollektiven Kapitalanlagen» der Asset Management Association Switzerland (AMAS) in der aktuell gültigen Fassung berechnet und drückt die Gesamtheit derjenigen Kommissionen und Kosten, die laufend dem Fondsvermögen belastet werden (Betriebsaufwand), retrospektiv in einem %-Satz des Fondsvermögens aus.

TER für die letzten 12 Monate:

Klasse I-A1:	0.08%
Klasse I-A2:	0.27%

Ausgabe- und Rücknahmepreis

Falls an einem Bewertungstag die Summe der Zeichnungen und Rücknahmen von Anteilen eines Teilvermögens zu einem Nettovermögenszufluss bzw. -abfluss führt, wird der Nettoinventarwert des entsprechenden Teilvermögens erhöht bzw. reduziert (Swinging Single Pricing). Die maximale Anpassung beläuft sich auf 2% des Nettoinventarwerts. Berücksichtigt werden die Nebenkosten (Geld/Brief-Spannen, marktübliche Courtagen, Kommissionen, Steuern und Abgaben usw.) sowie die Kosten für die Überprüfung und Aufrechterhaltung von Qualitätsstandards bei physischen Anlagen, die aus der Anlage des einbezahlten Betrags bzw. aus dem Verkauf eines dem gekündigten Anteil entsprechenden Teils der Anlagen erwachsen. Die Anpassung führt zu einer Erhöhung des Nettoinventarwerts, wenn die Nettobewegung zu einem Anstieg der Anzahl Anteile des Anlagefonds führt. Die Anpassung resultiert in einer Verminderung des Nettoinventarwerts, wenn die Nettobewegung einen Rückgang der Anzahl der Anteile des entsprechenden Teilvermögens bewirkt. Die Berücksichtigung dieser Nebenkosten entfällt, falls die Fondsleitung einer Ein- oder Auszahlung in Anlagen statt in bar gemäss § 19 Ziff. 8 gestattet sowie beim Wechsel zwischen Anteilsklassen innerhalb des Teilvermögens. Der unter Anwendung des Swinging Single Pricing ermittelte Nettoinventarwert ist somit ein modifizierter Nettoinventarwert.

Die Fondsleitung berücksichtigt grundsätzlich die durchschnittlichen Nebenkosten. Bei der Anpassung des Nettoinventarwertes kann sie jedoch auch die tatsächliche Höhe der Nebenkosten berücksichtigen, sofern dies unter Berücksichtigung der relevanten Umstände (z.B. Höhe des Betrags, allgemeine Marktsituation, spezifische Marktsituation für die betreffende Anlageklasse) im Ermessen der Fondsleitung angemessen erscheint. Die Anpassung kann in einem solchen Fall höher oder tiefer als die durchschnittlichen Nebenkosten ausfallen.

Grundsätze der Bewertung und der Nettoinventarwertberechnung

Siehe Anhang zu Ergänzende Angaben.

Umrechnungskurs

GBP 1 = CHF 1.131496

Swiss Life iFunds (CH) Equity Switzerland (CHF)

Art übrige Fonds für traditionelle Anlagen

Dreijahresvergleich

	ISIN	30.9.2024	30.9.2023	30.9.2022
Nettofondsvermögen in CHF		315 677 867.62	912 173 928.51	859 713 053.01
Klasse I-A1	CH0108009199			
Nettoinventarwert pro Anteil in CHF		1 965.21	1 788.25	1 692.00
Anzahl Anteile im Umlauf		160 633.0930	510 091.8090	508 103.5510

Performance

	Währung	2023/2024	2022/2023	2021/2022
Klasse I-A1	CHF	12.9%	8.4%	-8.9%
Benchmark/Index: SPI 20 Total Return®	CHF	13.2%	8.6%	-8.7%

Die historische Performance stellt keinen Indikator für die laufende oder zukünftige Performance dar.
Die Performedaten lassen die bei der Ausgabe und Rücknahme der Anteile erhobenen Kommissionen und Kosten unberücksichtigt.

Struktur des Wertpapierportfolios (ungeprüft)

Aufteilung nach Risikodomizil in % des Gesamtfondsvermögens	
Schweiz	97.83
Total	97.83

Obige Prozentsätze können Rundungsdifferenzen enthalten.

Vermögensrechnung

	30.9.2024	30.9.2023
	CHF	CHF
Verkehrswerte		
Bankguthaben		
– auf Sicht	516 047.24	905 117.92
Effekten		
– Aktien und andere Beteiligungspapiere	308 985 363.86	905 912 847.67
Derivative Finanzinstrumente	110 780.00	-13 420.00
Sonstige Vermögenswerte	6 228 151.66	6 742 343.99
Gesamtfondsvermögen	315 840 342.76	913 546 889.58
Kurzfristige Bankverbindlichkeiten	0.00	-916 601.77
Andere Verbindlichkeiten	-162 475.14	-456 359.30
Nettofondsvermögen	315 677 867.62	912 173 928.51

Erfolgsrechnung

	1.10.2023-30.9.2024	1.10.2022-30.9.2023
	CHF	CHF
Ertrag		
Erträge der Bankguthaben	19 901.95	23 380.17
Negativzinsen	0.00	-7 170.55
Erträge der Effekten		
– aus Aktien und anderen Beteiligungspapieren	31 834 074.94	28 616 521.33
Erträge der Effektenleihe	12 734.98	13 943.86
Einkauf in laufende Nettoerträge bei der Ausgabe von Anteilen	1 132 008.05	1 286 611.19
Total Ertrag	32 998 719.92	29 933 286.00
Aufwand		
Passivzinsen	-5.34	-14.01
Reglementarische Kommissionsvergütung an die Fondsleitung Klasse I-A1	-1 614 699.36	-1 807 400.53
Reglementarische Kommissionsvergütung an die Depotbank	-53 162.99	-67 751.10
Sonstige Aufwendungen	-279.23	-22.00
Ausrichtung laufender Nettoerträge bei der Rücknahme von Anteilen	-23 378 855.16	-3 258 529.74
Total Aufwand	-25 047 002.08	-5 133 717.38
Nettoertrag	7 951 717.84	24 799 568.62
Realisierte Kapitalgewinne und -verluste	108 935 638.57	15 697 866.74
Realisierter Erfolg	116 887 356.41	40 497 435.36
Nicht realisierte Kapitalgewinne und -verluste	-5 247 717.35	35 196 598.51
Gesamterfolg	111 639 639.06	75 694 033.87

Verwendung des Erfolges

	1.10.2023-30.9.2024	1.10.2022-30.9.2023
	CHF	CHF
Nettoertrag des Rechnungsjahres	7 951 717.84	24 799 568.62
Vortrag des Vorjahres	13 095.99	3 989.29
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg	7 964 813.83	24 803 557.91
Zur Ausschüttung an die Anlegerinnen und Anleger vorgesehener Erfolg	-7 959 369.76	-24 790 461.92
Vortrag auf neue Rechnung	5 444.07	13 095.99

Veränderung des Nettofondsvermögens

	1.10.2023-30.9.2024	1.10.2022-30.9.2023
	CHF	CHF
Nettofondsvermögen zu Beginn des Rechnungsjahres	912 173 928.51	859 713 053.01
Ordentliche Jahresausschüttung	-29 291 712.08	-24 360 571.28
Saldo aus dem Anteilverkehr	-678 843 987.87	1 127 412.91
Gesamterfolg	111 639 639.06	75 694 033.87
Nettofondsvermögen am Ende der Berichtsperiode	315 677 867.62	912 173 928.51

Entwicklung der Anteile im Umlauf

	1.10.2023-30.9.2024	1.10.2022-30.9.2023
	Anzahl	Anzahl
Klasse I-A1		
Bestand Anfang Rechnungsjahr	510 091.8090	508 103.5510
Ausgegebene Anteile	168 493.3730	82 276.7930
Zurückgenommene Anteile	-517 952.0890	-80 288.5350
Bestand Ende Berichtsperiode	160 633.0930	510 091.8090
Differenz zwischen den ausgegebenen und zurückgenommenen Anteilen	-349 458.7160	1 988.2580

Ausschüttung für 2023/2024

Klasse I-A1

(Ex-Datum 14.1.2025)

Aufgelaufener Ertrag pro Anteil	CHF	49.5839
Brutto	CHF	49.5500
Abzüglich eidg. Verrechnungssteuer	CHF	-17.3425
Netto pro Anteil (zahlbar ab 16.1.2025)	CHF	32.2075

Inventar des Fondsvermögens

Titel		30.9.2023 Anzahl/ Nominal	Käufe ¹	Verkäufe ²	30.9.2024 Anzahl/ Nominal	Verkehrswert ³ in CHF	in % ³	Davon ausgeliehen Anzahl/Nominal
Effekten, die an einer Börse gehandelt werden								
Inhaberaktien								
Schweiz								
SWISS RE AG CHF0.10*	CHF	221 699	80 703	231 774	70 628	8 242 288	2.61	
Total Schweiz						8 242 288	2.61	
Total Inhaberaktien						8 242 288	2.61	
Weitere Aktien								
Schweiz								
ROCHE HLDGS AG GENUSSSCHEINE NPV*	CHF	536 607	184 087	551 544	169 150	45 771 990	14.49	
Total Schweiz						45 771 990	14.49	
Total Weitere Aktien						45 771 990	14.49	
Namensaktien								
Schweiz								
ABB LTD CHF0.12 (REGD)*	CHF	1 234 348	417 760	1 267 811	384 297	18 826 710	5.96	
ALCON AG CHF0.04*	CHF	381 915	133 683	395 239	120 359	10 148 671	3.21	
GEBERIT CHF0.10(REGD)*	CHF	26 808	9 056	27 836	8 028	4 426 639	1.40	
GIVAUDAN AG CHF10*	CHF	6 082	2 100	6 265	1 917	8 894 880	2.82	
HOLCIM LTD CHF2 (REGD)*	CHF	406 389	146 537	422 412	130 514	10 775 236	3.41	
KUEHNE&NAGEL INTL CHF1(REGD)(POST-SUBD)*	CHF	42 358	14 326	43 349	13 335	3 077 718	0.97	13 166
LOGITECH INTL CHF0.25(REGD) (POST-SUBD)*	CHF	125 811	40 558	126 902	39 467	2 982 127	0.94	
LONZA GROUP AG CHF1(REGD)*	CHF	56 725	19 828	59 175	17 378	9 290 279	2.94	
NESTLE SA CHF0.10(REGD)*	CHF	2 043 754	694 294	2 107 373	630 675	53 582 148	16.96	
NOVARTIS AG CHF0.49 (REGD)*	CHF	1 614 760	549 379	1 671 946	492 193	47 816 550	15.14	
PARTNERS GROUP HLG CHF0.01 (REGD)*	CHF	17 337	5 904	17 799	5 442	6 911 340	2.19	
RICHEMONT(CIE FIN) CHF1.00 (REG) SER 'A'*	CHF	398 913	150 712	420 287	129 338	17 305 424	5.48	
SANDOZ GROUP AG CHF0.05*	CHF		324 107	324 107				
SIKA AG CHF0.01 (REG)*	CHF	117 701	46 494	125 550	38 645	10 824 465	3.43	
SONOVA HOLDING AG CHF0.05 (REGD)*	CHF	38 819	12 422	39 419	11 822	3 591 524	1.14	
SWISS LIFE HLDG CHF5 1(REGD)*	CHF	22 493	7 691	23 224	6 960	4 913 760	1.56	
SWISSCOM AG CHF1(REGD)*	CHF	19 396	6 472	19 765	6 103	3 371 908	1.07	6 067
UBS GROUP CHF0.10 (REGD)*	CHF	2 336 702	965 898	2 524 176	778 424	20 285 729	6.42	
ZURICH INSURANCE GRP CHF0.10*	CHF	111 734	38 438	114 970	35 202	17 945 980	5.68	
Total Schweiz						254 971 086	80.73	
Total Namensaktien						254 971 086	80.73	
Total Effekten, die an einer Börse gehandelt werden						308 985 364	97.83	
Total Wertschriften						308 985 364	97.83	
(davon ausgeliehen)						6 405 213	2.03	
Bankguthaben auf Sicht						516 047	0.16	
Derivative Finanzinstrumente						110 780	0.04	
Sonstige Vermögenswerte						6 228 152	1.97	
Gesamtfondsvermögen						315 840 343	100.00	
Andere Verbindlichkeiten						-162 475		
Nettofondsvermögen						315 677 868		
Bewertungskategorie						Verkehrswert per 30.9.2024	in % des Gesamt- fondsvermögens³	
Anlagen bewertet zu den Kursen, die am Hauptmarkt bezahlt werden						309 096 144	97.87	
Anlagen bewertet aufgrund von am Markt beobachtbaren Parametern						-	-	
Anlagen bewertet mit geeigneten Bewertungsmodellen unter Berücksichtigung der aktuellen Marktgegebenheiten						-	-	
Total						309 096 144	97.87	

¹ «Käufe» umfassen die Transaktionen: Gratistitel / Käufe / Konversionen / Namensänderungen / «Splits» / Stock-/Wahldividenden / Titelaufteilungen / Überträge / Umbuchungen infolge Redenominierung in Euro / Umtausch zwischen Gesellschaften / Zuteilung aus Bezugs-/Optionsrechten / Zuteilung von Bezugsrechten ab Basisaktien / Sacheinlagen

² «Verkäufe» umfassen die Transaktionen: Auslosungen / Ausbuchung infolge Verfall / Ausübung von Bezugs-/Optionsrechten / «Reverse splits» / Rückzahlungen / Überträge / Umbuchungen infolge Redenominierung in Euro / Umtausch zwischen Gesellschaften / Verkäufe / Sachauslagen

³ Allfällige Abweichungen in den Totalisierungen sind auf Rundungsdifferenzen zurückzuführen

* bewertet zu den Kursen, die am Hauptmarkt bezahlt werden (Art. 88 Abs. 1 KAG)

Derivative Finanzinstrumente

Gemäss KKV-FINMA Art. 23

Am Ende der Berichtsperiode offene engagementerhöhende Derivate

Instrument	Anzahl Kontrakte	Währung	Deckung in CHF	Variation Margin in CHF	In % des Vermögens
Futures auf Indices/Commodities/Währungen					
SWISS MARKET INDEX FUTURE 20.12.24*	53	CHF	6 469 180	110 780	0.04
			6 469 180	110 780	0.04

Durch derivative Transaktionen gebundene geldnahe Mittel: CHF 6 469 180

Obige Angaben können Rundungsdifferenzen enthalten.

* bewertet zu den Kursen, die am Hauptmarkt bezahlt werden (Art. 88 Abs. 1 KAG)

Während der Berichtsperiode getätigte engagementerhöhende Derivate

Instrument	Währung	Käufe/ Kontrakte	Verkäufe/ Kontrakte
Futures auf Indices/Commodities/Währungen			
SWISS MARKET INDEX FUTURE 15.12.23	CHF	6	67
SWISS MARKET INDEX FUTURE 15.03.24	CHF	123	123
SWISS MARKET INDEX FUTURE 21.06.24	CHF	195	195
SWISS MARKET INDEX FUTURE 20.09.24	CHF	64	64
SWISS MARKET INDEX FUTURE 20.12.24	CHF	53	0

Ergänzende Angaben

Derivative Finanzinstrumente

Risikomessverfahren Commitment-Ansatz I:
Art. 34 KKV-FINMA

Position	Betrag in CHF	in % des Nettofonds- vermögens
Total engagement- erhöhende Positionen	6 469 180.00	2.05%
Total engagement- reduzierende Positionen	–	–

Pensionsgeschäfte

Die Fondsleitung tätigt für Rechnung des Teilvermögens keine Pensionsgeschäfte.

Vergütung an die Fondsleitung

Verwaltungskommission

- Effektiv erhobene Verwaltungskommission:
Klasse I-A1: 0.193625% p.a.;
- Maximale erhobene Verwaltungskommission gemäss
Fondsvertrag:
Klasse I-A1: 0.30% p.a.;
- Effektiv erhobene Depotbankkommission:
0.006375% p.a.;
- Maximale erhobene Depotbankkommission gemäss
Fondsvertrag: 0.20% p.a.;

Gebührenteilungsvereinbarungen («commission sharing agreements») und geldwerte Vorteile («soft commissions»)

Die Fondsleitung hat keine Gebührenteilungsvereinbarungen («commission sharing agreements») geschlossen. Die Fondsleitung hat keine Vereinbarungen bezüglich so genannten «soft commissions» geschlossen.

Total Expense Ratio (TER)

Diese Kennziffer wurde gemäss der «Richtlinie zur Berechnung und Offenlegung der Total Expense Ratio (TER) von kollektiven Kapitalanlagen» der Asset Management Association Switzerland (AMAS) in der aktuell gültigen Fassung berechnet und drückt die Gesamtheit derjenigen Kommissionen und Kosten, die laufend dem Fondsvermögen belastet werden (Betriebsaufwand), retrospektiv in einem %-Satz des Fondsvermögens aus.

TER für die letzten 12 Monate:

Klasse I-A1: 0.20%

Grundsätze der Bewertung und der Nettoinventarwertberechnung

Siehe Anhang zu Ergänzende Angaben.

Swiss Life iFunds (CH) Bond Global Corporates Short Term (CHF hedged)

Art übrige Fonds für traditionelle Anlagen

Dreijahresvergleich

	ISIN	30.9.2024	30.9.2023	30.9.2022
Nettofondsvermögen in CHF		1 573 421 871.85	1 651 607 337.58	1 841 404 070.82
Klasse I-A0 AST¹	CH1291247638			
Nettoinventarwert pro Anteil in CHF		1 039.33		
Ausgabe- und Rücknahmepreis pro Anteil in CHF ²		1 040.79		
Anzahl Anteile im Umlauf		1 324 480.0000		
Klasse I-A1	CH0219870430			
Nettoinventarwert pro Anteil in CHF		783.24	771.42	781.94
Ausgabe- und Rücknahmepreis pro Anteil in CHF ²		784.34	771.42	781.94
Anzahl Anteile im Umlauf		197 619.5760	2 081 889.7090	2 248 399.7090
Klasse I-A2	CH0219870455			
Nettoinventarwert pro Anteil in CHF		781.25	769.47	779.88
Ausgabe- und Rücknahmepreis pro Anteil in CHF ²		782.34	769.47	779.88
Anzahl Anteile im Umlauf		51 385.0000	56 832.0000	102 440.0000
Klasse I-A2 Cap	CH0407409843			
Nettoinventarwert pro Anteil in CHF		942.27	916.50	919.62
Ausgabe- und Rücknahmepreis pro Anteil in CHF ²		943.59	916.50	919.62
Anzahl Anteile im Umlauf		2 045.0000	2 045.0000	3 700.0000

¹ Erstemission per 2.10.2023

² Siehe Ergänzende Angaben

Performance

	Währung	2023/2024	2022/2023	2021/2022
Klasse I-A0 AST ¹	CHF	4.0%	-	-
Klasse I-A1	CHF	3.7%	0.5%	-6.3%
Klasse I-A2	CHF	3.5%	0.3%	-6.6%
Klasse I-A2 Cap	CHF	3.5%	0.3%	-6.6%
Referenzindex:				
Bloomberg Global Aggregate Corporates 1-3 years in CHF (CHF hedged)	CHF	4.0%	0.2%	-6.7%

¹ Die Performance wurde für den Zeitraum vom 2.10.2023 – 30.09.2024 berechnet

Die historische Performance stellt keinen Indikator für die laufende oder zukünftige Performance dar.

Die Performedaten lassen die bei der Ausgabe und Rücknahme der Anteile erhobenen Kommissionen und Kosten unberücksichtigt.

Struktur des Wertpapierportfolios (ungeprüft)

Aufteilung nach Risikodomizil in % des Gesamtfondsvermögens	
Vereinigte Staaten von Amerika	22.32
Grossbritannien	5.59
Frankreich	4.79
Kanada	4.79
Deutschland	4.00
Schweiz	3.97
Spanien	3.50
Italien	2.01
Japan	1.92
Irland	1.67
Übrige	9.12
Total	63.68

Obige Prozentsätze können Rundungsdifferenzen enthalten.

Vermögensrechnung

	30.9.2024	30.9.2023
	CHF	CHF
Verkehrswerte		
Bankguthaben		
– auf Sicht	828 543 095.07	21 717 049.78
Effekten		
– Obligationen, Wandelobligationen, Optionsanleihen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte	1 527 420 240.91	1 653 187 433.57
Derivative Finanzinstrumente	26 062 378.52	-34 064 927.70
Sonstige Vermögenswerte	16 252 936.69	11 547 816.40
Gesamtfondsvermögen	2 398 278 651.19	1 652 387 372.05
Kurzfristige Bankverbindlichkeiten	-824 619 897.28	-126 899.25
Andere Verbindlichkeiten	-236 882.06	-653 135.22
Nettofondsvermögen	1 573 421 871.85	1 651 607 337.58

Erfolgsrechnung

	1.10.2023-30.9.2024	1.10.2022-30.9.2023
	CHF	CHF
Ertrag		
Erträge der Bankguthaben	883 279.90	662 196.80
Negativzinsen	0.00	-57 562.87
Erträge der Effekten		
– aus Obligationen, Wandelobligationen, Optionsanleihen und sonstigen Forderungswertpapieren und -rechten	44 979 154.08	36 198 300.18
Ausgleichszahlungen aus Effektenleihe	1 611 250.95	2 151 703.13
Erträge der Effektenleihe	177 725.63	233 340.29
Einkauf in laufende Nettoerträge bei der Ausgabe von Anteilen	39 799 068.04	1 082 699.98
Total Ertrag	87 450 478.60	40 270 677.51
Aufwand		
Passivzinsen	-109 320.98	-40 236.49
Reglementarische Kommissionsvergütung an die Fondsleitung Klasse I-A0 AST	-442 116.99	0.00
Reglementarische Kommissionsvergütung an die Fondsleitung Klasse I-A1	-262 688.75	-2 331 586.18
Reglementarische Kommissionsvergütung an die Fondsleitung Klasse I-A2	-165 601.12	-241 235.05
Reglementarische Kommissionsvergütung an die Fondsleitung Klasse I-A2 Cap	-7 099.85	-11 317.27
Reglementarische Kommissionsvergütung an die Depotbank	-98 428.08	-122 904.08
Sonstige Aufwendungen	-1 455.37	-1 393.78
Ausrichtung laufender Nettoerträge bei der Rücknahme von Anteilen	-10 909 927.64	-1 949 013.35
Total Aufwand	-11 996 638.78	-4 697 686.20
Nettoertrag	75 453 839.82	35 572 991.31
Realisierte Kapitalgewinne und -verluste	-138 066 521.53	-21 640 517.34
Realisierter Erfolg	-62 612 681.71	13 932 473.97
Nicht realisierte Kapitalgewinne und -verluste	148 964 653.98	-5 630 775.74
Gesamterfolg	86 351 972.27	8 301 698.23

Verwendung des Erfolges

	1.10.2023-30.9.2024	1.10.2022-30.9.2023
	CHF	CHF
Nettoertrag des Rechnungsjahres	75 453 839.82	35 572 991.31
Vortrag des Vorjahres	75 845.12	46 360.40
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg	75 529 684.94	35 619 351.71
Zur Ausschüttung an die Anlegerinnen und Anleger vorgesehener Erfolg	-75 448 562.08	-35 507 418.85
Abzügl. Eidg. Verrechnungsteuer ¹	-18 047.52	-12 630.71
Zur Wiederanlage zurückbehaltener Erfolg	-33 516.81	-23 457.03
Vortrag auf neue Rechnung	29 558.53	75 845.12

Veränderung des Nettofondsvermögens

	1.10.2023-30.9.2024	1.10.2022-30.9.2023
	CHF	CHF
Nettofondsvermögen zu Beginn des Rechnungsjahres	1 651 607 337.58	1 841 404 070.82
Ordentliche Jahresausschüttung	-4 555 469.14	-31 102 260.94
Abgeführte Verrechnungssteuer	-12 619.83	-19 985.74
Saldo aus dem Anteilverkehr	-159 969 349.03	-166 976 184.79
Gesamterfolg	86 351 972.27	8 301 698.23
Nettofondsvermögen am Ende der Berichtsperiode	1 573 421 871.85	1 651 607 337.58

¹ resp. Ausgleichszahlung für nicht in der Schweiz domizillierte Anteilhaber gem. ESTV Kreisscheiben Nr. 24 vom 20.11.2017 Ziffer 2.3.4 in Verbindung mit Art. 34 Abs. 1 VStV

Entwicklung der Anteile im Umlauf

	1.10.2023-30.9.2024	1.10.2022-30.9.2023
Klasse I-A0 AST	Anzahl	
Bestand Anfang Rechnungsjahr	0.0000	
Ausgegebene Anteile	1 617 802.0000	
Zurückgenommene Anteile	-293 322.0000	
Bestand Ende Berichtsperiode	1 324 480.0000	
Differenz zwischen den ausgegebenen und zurückgenommenen Anteilen	1 324 480.0000	
Klasse I-A1	Anzahl	Anzahl
Bestand Anfang Rechnungsjahr	2 081 889.7090	2 248 399.7090
Ausgegebene Anteile	20 094.0000	170 434.0000
Zurückgenommene Anteile	-1 904 364.1330	-336 944.0000
Bestand Ende Berichtsperiode	197 619.5760	2 081 889.7090
Differenz zwischen den ausgegebenen und zurückgenommenen Anteilen	-1 884 270.1330	-166 510.0000
Klasse I-A2	Anzahl	Anzahl
Bestand Anfang Rechnungsjahr	56 832.0000	102 440.0000
Ausgegebene Anteile	47 966.0000	17 641.0000
Zurückgenommene Anteile	-53 413.0000	-63 249.0000
Bestand Ende Berichtsperiode	51 385.0000	56 832.0000
Differenz zwischen den ausgegebenen und zurückgenommenen Anteilen	-5 447.0000	-45 608.0000
Klasse I-A2 Cap	Anzahl	Anzahl
Bestand Anfang Rechnungsjahr	2 045.0000	3 700.0000
Ausgegebene Anteile	0.0000	35.0000
Zurückgenommene Anteile	0.0000	-1 690.0000
Bestand Ende Berichtsperiode	2 045.0000	2 045.0000
Differenz zwischen den ausgegebenen und zurückgenommenen Anteilen	0.0000	-1 655.0000

Ausschüttung für 2023/2024

Klasse I-A0 AST

(Ex-Datum 14.1.2025)

Aufgelaufener Ertrag pro Anteil	CHF	52.7678
Für in der Schweiz domizilierte Anteilinhaber Brutto	CHF	52.7500
Abzüglich eidg. Verrechnungssteuer ¹	CHF	-18.4625
Netto pro Anteil (zahlbar ab 16.1.2025)	CHF	34.2875

Klasse I-A1

(Ex-Datum 14.1.2025)

Aufgelaufener Ertrag pro Anteil	CHF	22.8258
Für in der Schweiz domizilierte Anteilinhaber Brutto	CHF	22.8000
Abzüglich eidg. Verrechnungssteuer	CHF	-7.9800
Netto pro Anteil (zahlbar ab 16.1.2025)	CHF	14.8200
Für nicht in der Schweiz domizilierte Anteilinhaber mit Bankenerklärung		
Netto pro Anteil (zahlbar ab 16.1.2025)	CHF	22.8000

Klasse I-A2

(Ex-Datum 14.1.2025)

Aufgelaufener Ertrag pro Anteil	CHF	20.9664
Für in der Schweiz domizilierte Anteilinhaber Brutto	CHF	20.9500
Abzüglich eidg. Verrechnungssteuer	CHF	-7.3325
Netto pro Anteil (zahlbar ab 16.1.2025)	CHF	13.6175
Für nicht in der Schweiz domizilierte Anteilinhaber mit Bankenerklärung		
Netto pro Anteil (zahlbar ab 16.1.2025)	CHF	20.9500

¹ Findet das Meldeverfahren gemäss ESTV Kreisschreiben Nr. 24 vom 20.11.2017 Ziffer 2.4 in Verbindung mit Art. 38a VStV Anwendung, erfolgt Ausschüttung brutto.

Zur Wiederanlage zurückbehaltener Erfolg (Thesaurierung)

Klasse I-A2 Cap

Thesaurierung per 14.1.2025

Brutto Thesaurierungsbetrag	CHF	25.2140
Abzüglich eidg. Verrechnungssteuer ¹	CHF	-8.8249
Thesaurierung netto pro Anteil	CHF	16.3891

¹ resp. Ausgleichszahlung für nicht in der Schweiz domizillierte Anteilinhaber gem. ESTV Kreisscheiben Nr. 24 vom 20.11.2017 Ziffer 2.3.4 in Verbindung mit Art. 34 Abs. 1 VStV.

Titel	30.9.2023 Anzahl/ Nominal	Käufe ¹	Verkäufe ²	30.9.2024 Anzahl/ Nominal	Verkehrswert ³ in CHF	in % ³	Davon ausgeliehen Anzahl/Nominal
-------	---------------------------------	--------------------	-----------------------	---------------------------------	-------------------------------------	-------------------	--

Effekten, die nicht an einer Börse oder einem andern geregelten Markt gehandelt werden

Investmentzertifikate, open end

Global

SWISS LIFE FUNDS (CH) MONEY MARKET SWISS FRANCS A CAP**	CHF	300 000	300 000				
Total Global						0.00	

Total Investmentzertifikate, open end

						0.00	
--	--	--	--	--	--	-------------	--

Notes, fester Zins

USD

BLACKSTONE PRIVATE CREDIT FUND 1.75000% 22-15.09.24**	USD	3 700 000	3 700 000				
BMW US CAPITAL LLC-144A 4.65000% 24-13.08.29**	USD		3 800 000	3 800 000	3 229 078	0.13	
GA GLOBAL FUNDING TRUST-144A 3.85000% 22-11.04.25**	USD	15 000 000		15 000 000	12 576 144	0.51	
HYUNDAI CAPITAL AMERICA-144A 5.25000% 24-08.01.27**	USD		7 000 000	7 000 000			
ROCHE HOLDINGS INC-144A 2.13200% 22-10.03.25**	USD	20 000 000	20 000 000				
Total USD					15 805 222	0.65	

Total Notes, fester Zins

					15 805 222	0.65	
--	--	--	--	--	-------------------	-------------	--

Total Effekten, die nicht an einer Börse oder einem andern geregelten Markt gehandelt werden

					1 527 420 241	63.68	
Total Wertschriften (davon ausgeliehen)					88 636 906	3.70	

Bankguthaben auf Sicht					828 543 095	34.55	
Derivative Finanzinstrumente					26 062 379	1.09	
Sonstige Vermögenswerte					16 252 936	0.68	
Gesamtfondsvermögen					2 398 278 651	100.00	

Kurzfristige Bankverbindlichkeiten					-824 619 897		
Andere Verbindlichkeiten					-236 882		
Nettofondsvermögen					1 573 421 872		

Bewertungskategorie

	Verkehrswert per 30.9.2024	in % des Gesamt- fondsvermögens ³
Anlagen bewertet zu den Kursen, die am Hauptmarkt bezahlt werden	1 511 874 886	63.04
Anlagen bewertet aufgrund von am Markt beobachtbaren Parametern	41 607 734	1.73
Anlagen bewertet mit geeigneten Bewertungsmodellen unter Berücksichtigung der aktuellen Marktgegebenheiten	-	-
Total	1 553 482 620	64.77

¹ «Käufe» umfassen die Transaktionen: Gratistitel / Käufe / Konversionen / Namensänderungen / «Splits» / Stock-/Wahldividenden / Titelaufteilungen / Überträge / Umbuchungen infolge Redenominierung in Euro / Umtausch zwischen Gesellschaften / Zuteilung aus Bezugs-/Optionsrechten / Zuteilung von Bezugsrechten ab Basistiteln / Sacheinlagen

² «Verkäufe» umfassen die Transaktionen: Auslosungen / Ausbuchung infolge Verfall / Ausübung von Bezugs-/Optionsrechten / «Reverse splits» / Rückzahlungen / Überträge / Umbuchungen infolge Redenominierung in Euro / Umtausch zwischen Gesellschaften / Verkäufe / Sachauslagen

³ Allfällige Abweichungen in den Totalisierungen sind auf Rundungsdifferenzen zurückzuführen

* bewertet zu den Kursen, die am Hauptmarkt bezahlt werden (Art. 88 Abs. 1 KAG)

** bewertet aufgrund von am Markt beobachtbaren Parametern

Derivative Finanzinstrumente

Gemäss KKV-FINMA Art. 23

Am Ende der Berichtsperiode offene engagementerhöhende Derivate

Instrument	Anzahl Kontrakte	Währung	Deckung in CHF	Variation Margin in CHF	In % des Vermögens
Futures auf Zinsinstrumente/Obligationen					
EURO-SCHATZ FUTURE 06.12.24*	300	EUR	30 269 777	172 284	0.01
US 2YR TREASURY NOTE FUTURE 31.12.24*	281	USD	49 361 219	87 583	0.00
			79 630 996	259 867	0.01

Durch derivative Transaktionen gebundene geldnahe Mittel: CHF 79 630 996

Am Ende der Berichtsperiode offene Derivate auf Devisen

Verkauf Währung	Verkauf Betrag	Kauf Währung	Kauf Betrag	Fälligkeit	Wiederbeschaffungswert in CHF	In % des Vermögens
Devisentermingeschäfte**						
USD	223 500 000	CHF	197 313 824	02.10.2024	8 780 399	0.37
GBP	36 000 000	CHF	41 052 024	02.10.2024	318 175	0.01
EUR	197 000 000	CHF	189 752 961	02.10.2024	4 288 497	0.18
USD	202 000 000	CHF	178 306 450	02.10.2024	7 909 350	0.33
USD	18 000 000	CHF	15 792 381	02.10.2024	608 481	0.03
EUR	10 000 000	CHF	9 546 950	02.10.2024	132 510	0.01
GBP	4 500 000	CHF	5 050 562	02.10.2024	-41 170	0.00
GBP	1 800 000	CHF	2 027 070	02.10.2024	-9 622	0.00
USD	17 000 000	CHF	14 942 952	02.10.2024	602 602	0.03
USD	7 000 000	CHF	6 112 301	02.10.2024	207 451	0.01
USD	6 500 000	CHF	5 594 326	02.10.2024	111 251	0.00

Verkauf Währung	Verkauf Betrag	Kauf Währung	Kauf Betrag	Fälligkeit	Wiederbeschaffungswert in CHF	In % des Vermögens
USD	5 000 000	CHF	4 322 539	02.10.2024	104 789	0.00
USD	2 500 000	CHF	2 148 598	02.10.2024	39 723	0.00
USD	10 000 000	CHF	8 390 640	02.10.2024	-44 860	0.00
EUR	1 500 000	CHF	1 406 369	02.10.2024	-5 797	0.00
EUR	11 000 000	CHF	10 332 432	02.10.2024	-23 452	0.00
EUR	37 000 000	CHF	34 719 968	02.10.2024	-113 460	0.00
USD	3 000 000	CHF	2 531 895	02.10.2024	1 245	0.00
EUR	10 000 000	CHF	9 383 140	02.10.2024	-31 300	0.00
USD	10 000 000	CHF	8 434 655	02.10.2024	-845	0.00
JPY	1 395 000 000	CHF	8 415 505	18.10.2024	185 207	0.01
EUR	132 000 000	CHF	124 544 640	31.10.2024	561 158	0.02
EUR	7 500 000	CHF	7 054 104	01.11.2024	10 159	0.00
EUR	170 000 000	CHF	159 998 900	01.11.2024	336 137	0.01
EUR	112 000 000	CHF	105 313 040	01.11.2024	123 455	0.01
GBP	42 000 000	CHF	47 287 170	04.11.2024	-50 767	0.00
GBP	5 300 000	CHF	5 971 521	04.11.2024	-2 076	0.00
USD	200 000 000	CHF	168 179 300	29.11.2024	602 616	0.03
USD	200 000 000	CHF	168 167 000	29.11.2024	590 316	0.02
USD	170 000 000	CHF	142 952 150	29.11.2024	511 969	0.02
USD	260 000 000	CHF	218 096 970	29.11.2024	247 281	0.01
USD	260 000 000	CHF	218 115 040	29.11.2024	265 351	0.01
JPY	1 490 000 000	CHF	8 395 569	27.12.2024	-412 261	-0.03
					25 802 512	1.08

Obige Angaben können Rundungsdifferenzen enthalten.

* bewertet zu den Kursen, die am Hauptmarkt bezahlt werden (Art. 88 Abs. 1 KAG)

** bewertet aufgrund von am Markt beobachtbaren Parametern

Während der Berichtsperiode getätigte engagementreduzierende Derivate

Instrument	Währung	Käufe/ Kontrakte	Verkäufe/ Kontrakte
Futures auf Zinsinstrumente/Obligationen			
EURO-BOBL FUTURE 06.09.24	EUR	12	12
EURO-BOBL FUTURE 06.12.24	EUR	12	12
US 5YR TREASURY NOTE FUTURE 28.06.24	USD	280	280
US 5YR TREASURY NOTE FUTURE 31.12.24	USD	50	50

Während der Berichtsperiode getätigte engagementerhöhende Derivate

Instrument	Währung	Käufe/ Kontrakte	Verkäufe/ Kontrakte
Futures auf Zinsinstrumente/Obligationen			
EURO-BOBL FUTURE 06.06.24	EUR	200	200
EURO-SCHATZ FUTURE 06.06.24	EUR	300	300
EURO-BOBL FUTURE 07.12.23	EUR	140	170
EURO-BOBL FUTURE 07.03.24	EUR	440	440
EURO-BOBL FUTURE 06.09.24	EUR	450	450
EURO-SCHATZ FUTURE 06.09.24	EUR	900	900
EURO-SCHATZ FUTURE 06.12.24	EUR	330	30
US 5YR TREASURY NOTE FUTURE 29.12.23	USD	250	1 800
US 5YR TREASURY NOTE FUTURE 28.03.24	USD	1 800	1 800
US 2YR TREASURY NOTE FUTURE 28.06.24	USD	1 200	1 200
US 5YR TREASURY NOTE FUTURE 28.06.24	USD	1 640	1 640
US 2YR TREASURY NOTE FUTURE 30.09.24	USD	700	700
US 5YR TREASURY NOTE FUTURE 30.09.24	USD	1 070	1 070
US 5YR TREASURY NOTE FUTURE 31.12.24	USD	136	136
US 2YR TREASURY NOTE FUTURE 31.12.24	USD	624	343

Während der Berichtsperiode getätigte Derivate auf Devisen

Verkauf Währung	Verkauf Betrag	Kauf Währung	Kauf Betrag	Fälligkeit
Devisentermingeschäfte				
EUR	3 000 000	CHF	2 868 595	25.10.2023
CHF	4 503 753	USD	5 000 000	25.10.2023
USD	9 000 000	CHF	8 221 421	17.11.2023
GBP	27 000 000	CHF	29 895 091	17.11.2023
CHF	50 204 784	USD	56 000 000	17.11.2023
CHF	28 884 160	USD	32 000 000	17.11.2023
CHF	3 577 293	EUR	3 700 000	17.11.2023
CHF	30 805 419	GBP	27 700 000	17.11.2023
CHF	161 518 246	USD	181 000 000	17.11.2023
USD	347 000 000	CHF	311 581 155	20.11.2023
GBP	700 000	CHF	772 778	20.11.2023
USD	250 000 000	CHF	222 411 925	27.11.2023
EUR	550 000 000	CHF	520 798 850	27.11.2023
CHF	16 369 429	EUR	17 000 000	27.11.2023
CHF	34 663 187	EUR	36 000 000	27.11.2023
EUR	8 000 000	CHF	7 729 672	27.11.2023
GBP	28 000 000	CHF	31 009 496	29.12.2023
USD	187 000 000	CHF	166 136 223	29.12.2023
USD	340 000 000	CHF	300 473 640	29.12.2023
USD	247 000 000	CHF	217 545 991	29.12.2023
EUR	200 000 000	CHF	192 432 800	29.12.2023
CHF	30 667 336	GBP	28 000 000	29.12.2023
CHF	257 649 960	USD	300 000 000	29.12.2023
CHF	185 050 656	EUR	196 000 000	29.12.2023
CHF	171 429 200	USD	200 000 000	29.12.2023
USD	200 000 000	CHF	178 488 000	12.01.2024
EUR	298 000 000	CHF	286 408 694	12.01.2024
USD	8 000 000	CHF	6 954 148	12.01.2024
EUR	4 000 000	CHF	3 774 104	12.01.2024

Verkauf Wahrung	Verkauf Betrag	Kauf Wahrung	Kauf Betrag	Falligkeit
USD	5 000 000	CHF	4 308 184	12.01.2024
EUR	1 000 000	CHF	948 573	12.01.2024
USD	2 000 000	CHF	1 670 944	12.01.2024
EUR	2 000 000	CHF	1 854 994	12.01.2024
USD	300 000 000	CHF	257 058 810	19.01.2024
GBP	28 000 000	CHF	30 602 152	19.01.2024
EUR	196 000 000	CHF	184 801 736	19.01.2024
USD	265 000 000	CHF	225 203 016	19.01.2024
USD	220 000 000	CHF	186 738 860	23.02.2024
EUR	320 000 000	CHF	297 941 440	23.02.2024
GBP	22 500 000	CHF	24 574 509	23.02.2024
GBP	10 000 000	CHF	10 986 713	23.02.2024
GBP	3 500 000	CHF	3 825 544	23.02.2024
GBP	4 800 000	CHF	5 236 548	23.02.2024
CHF	45 571 094	GBP	41 000 000	23.02.2024
CHF	183 233 648	USD	208 000 000	23.02.2024
CHF	283 734 442	EUR	298 000 000	23.02.2024
USD	200 000 000	CHF	170 338 400	27.02.2024
USD	9 000 000	CHF	7 610 805	27.02.2024
USD	500 000	CHF	433 005	27.02.2024
USD	12 000 000	CHF	10 382 176	27.02.2024
USD	5 000 000	CHF	4 285 134	27.02.2024
CHF	5 230 322	USD	6 000 000	27.02.2024
USD	560 000 000	CHF	482 898 080	29.02.2024
EUR	190 000 000	CHF	178 318 648	29.02.2024
EUR	6 000 000	CHF	5 665 300	29.02.2024
EUR	10 200 000	CHF	9 488 071	29.02.2024
EUR	6 500 000	CHF	6 081 465	29.02.2024
USD	208 000 000	CHF	182 699 088	22.03.2024
GBP	41 500 000	CHF	45 999 525	22.03.2024
EUR	298 000 000	CHF	283 220 988	22.03.2024
EUR	2 000 000	CHF	1 904 682	22.03.2024
GBP	5 100 000	CHF	5 738 933	22.03.2024
CHF	5 751 528	EUR	6 000 000	22.03.2024
CHF	7 905 663	USD	9 000 000	22.03.2024
CHF	1 771 818	USD	2 000 000	22.03.2024
USD	223 000 000	CHF	195 796 074	27.03.2024
EUR	213 000 000	CHF	203 042 463	28.03.2024
USD	300 000 000	CHF	263 338 710	28.03.2024
USD	245 000 000	CHF	215 192 810	28.03.2024
USD	185 000 000	CHF	164 342 623	22.04.2024
EUR	287 000 000	CHF	277 087 881	22.04.2024
GBP	46 600 000	CHF	52 620 207	22.04.2024
GBP	2 300 000	CHF	2 603 904	22.04.2024
USD	6 000 000	CHF	5 398 392	22.04.2024
USD	10 000 000	CHF	9 047 770	22.04.2024
EUR	10 000 000	CHF	9 833 789	22.04.2024
CHF	2 280 305	USD	2 500 000	22.04.2024
USD	208 000 000	CHF	186 127 136	29.04.2024
EUR	202 000 000	CHF	197 120 286	30.04.2024
USD	260 000 000	CHF	233 198 940	30.04.2024
USD	279 000 000	CHF	250 311 825	30.04.2024
USD	5 000 000	CHF	4 551 760	30.04.2024
EUR	283 000 000	CHF	273 989 280	22.05.2024
USD	206 000 000	CHF	186 560 192	22.05.2024
CHF	279 049 320	EUR	283 000 000	22.05.2024
CHF	185 246 280	USD	204 000 000	22.05.2024
USD	208 000 000	CHF	189 448 272	29.05.2024
USD	300 000 000	CHF	272 557 950	31.05.2024
EUR	195 000 000	CHF	190 229 910	31.05.2024
USD	240 400 000	CHF	219 143 904	31.05.2024
EUR	6 200 000	CHF	6 041 671	31.05.2024
USD	5 000 000	CHF	4 522 828	31.05.2024
USD	2 000 000	CHF	1 808 597	31.05.2024
CHF	12 751 681	EUR	13 000 000	31.05.2024
CHF	9 335 090	EUR	9 500 000	31.05.2024
CHF	14 362 041	EUR	14 500 000	31.05.2024
CHF	1 978 618	EUR	2 000 000	31.05.2024
CHF	3 660 588	USD	4 000 000	31.05.2024
CHF	4 958 080	EUR	5 000 000	31.05.2024
JPY	1 401 000 000	CHF	8 362 904	14.06.2024
GBP	49 000 000	CHF	55 158 095	24.06.2024
EUR	290 500 000	CHF	285 782 861	24.06.2024
USD	213 000 000	CHF	192 705 168	24.06.2024
CHF	6 956 239	GBP	6 000 000	24.06.2024
USD	204 000 000	CHF	185 556 768	24.06.2024
USD	5 000 000	CHF	4 552 505	24.06.2024
CHF	4 937 550	EUR	5 000 000	24.06.2024
EUR	16 500 000	CHF	15 968 601	24.06.2024
CHF	10 680 240	USD	12 000 000	24.06.2024
CHF	7 965 888	GBP	7 000 000	24.06.2024
CHF	17 812 172	EUR	18 500 000	24.06.2024
CHF	25 032 337	EUR	26 000 000	24.06.2024
USD	3 000 000	CHF	2 670 862	24.06.2024
JPY	1 490 000 000	CHF	8 796 397	25.06.2024
USD	5 500 000	CHF	4 887 187	24.07.2024
USD	200 000 000	CHF	177 749 660	24.07.2024
GBP	36 000 000	CHF	40 578 588	24.07.2024
USD	7 000 000	CHF	6 214 174	24.07.2024
CHF	8 583 255	EUR	9 000 000	24.07.2024
EUR	257 600 000	CHF	245 295 144	24.07.2024
USD	226 000 000	CHF	200 540 874	24.07.2024
CHF	1 903 751	EUR	2 000 000	24.07.2024
USD	3 800 000	CHF	3 373 995	24.07.2024
EUR	2 000 000	CHF	1 906 113	24.07.2024
CHF	10 549 088	EUR	11 000 000	24.07.2024
USD	11 000 000	CHF	9 828 753	24.07.2024
CHF	13 450 145	USD	15 000 000	24.07.2024
CHF	6 798 345	EUR	7 000 000	24.07.2024
CHF	18 448 457	EUR	19 000 000	24.07.2024

Verkauf Währung	Verkauf Betrag	Kauf Währung	Kauf Betrag	Fälligkeit
CHF	18 356 053	USD	20 500 000	24.07.2024
CHF	8 698 414	EUR	9 000 000	24.07.2024
EUR	156 000 000	CHF	153 397 608	30.08.2024
USD	300 000 000	CHF	270 985 200	30.08.2024
USD	241 000 000	CHF	217 678 912	30.08.2024
USD	9 000 000	CHF	7 974 353	30.08.2024
CHF	3 854 030	EUR	4 000 000	30.08.2024
USD	4 000 000	CHF	3 520 468	30.08.2024
USD	10 000 000	CHF	8 846 540	30.08.2024
JPY	1 401 000 000	CHF	8 009 871	17.09.2024
EUR	152 000 000	CHF	142 428 742	30.09.2024
USD	196 000 000	CHF	164 957 010	30.09.2024
USD	200 000 000	CHF	168 232 000	30.09.2024
USD	180 000 000	CHF	151 444 350	30.09.2024
CHF	10 184 484	USD	12 000 000	30.09.2024
USD	25 000 000	CHF	21 151 763	30.09.2024
USD	223 500 000	CHF	197 313 824	02.10.2024
GBP	36 000 000	CHF	41 052 024	02.10.2024
EUR	197 000 000	CHF	189 752 961	02.10.2024
USD	202 000 000	CHF	178 306 450	02.10.2024
USD	18 000 000	CHF	15 792 381	02.10.2024
EUR	10 000 000	CHF	9 546 950	02.10.2024
GBP	4 500 000	CHF	5 050 562	02.10.2024
GBP	1 800 000	CHF	2 027 070	02.10.2024
USD	17 000 000	CHF	14 942 952	02.10.2024
USD	7 000 000	CHF	6 112 301	02.10.2024
USD	6 500 000	CHF	5 594 326	02.10.2024
USD	5 000 000	CHF	4 322 539	02.10.2024
USD	2 500 000	CHF	2 148 598	02.10.2024
USD	10 000 000	CHF	8 390 640	02.10.2024
EUR	1 500 000	CHF	1 406 369	02.10.2024
EUR	11 000 000	CHF	10 332 432	02.10.2024
EUR	37 000 000	CHF	34 719 968	02.10.2024
USD	3 000 000	CHF	2 531 895	02.10.2024
EUR	10 000 000	CHF	9 383 140	02.10.2024
USD	10 000 000	CHF	8 434 655	02.10.2024
JPY	1 395 000 000	CHF	8 415 505	18.10.2024
EUR	132 000 000	CHF	124 544 640	31.10.2024
EUR	7 500 000	CHF	7 054 104	01.11.2024
EUR	170 000 000	CHF	159 998 900	01.11.2024
EUR	112 000 000	CHF	105 313 040	01.11.2024
GBP	42 000 000	CHF	47 287 170	04.11.2024
GBP	5 300 000	CHF	5 971 521	04.11.2024
USD	200 000 000	CHF	168 179 300	29.11.2024
USD	200 000 000	CHF	168 167 000	29.11.2024
USD	170 000 000	CHF	142 952 150	29.11.2024
USD	260 000 000	CHF	218 096 970	29.11.2024
USD	260 000 000	CHF	218 115 040	29.11.2024
JPY	1 490 000 000	CHF	8 395 569	27.12.2024

Ergänzende Angaben

Derivative Finanzinstrumente

Risikomessverfahren Commitment-Ansatz I:
Art. 34 KKV-FINMA

Position	Betrag in CHF	in % des Nettofonds- vermögens
Total engagement- erhöhende Positionen	79 630 995.55	5.06%
Total engagement- reduzierende Positionen	1 386 821 602.42	88.14%

Pensionsgeschäfte

Die Fondsleitung tätigt für Rechnung des Teilvermögens keine Pensionsgeschäfte.

Vergütung an die Fondsleitung

Verwaltungskommission

- Effektiv erhobene Verwaltungskommission:
 - Klasse I-A0 AST: 0.033625% p.a.;
 - Klasse I-A1: 0.143625% p.a.;
 - Klasse I-A2: 0.373625% p.a.;
 - Klasse I-A2 Cap: 0.373625% p.a.;
- Maximale erhobene Verwaltungskommission gemäss Fondsvertrag:
 - Klasse I-A0 AST: 0.10% p.a.;
 - Klasse I-A1: 0.35% p.a.;
 - Klasse I-A2: 0.65% p.a.;
 - Klasse I-A2 Cap: 0.65% p.a.;
- Effektiv erhobene Depotbankkommission für alle Klassen: 0.006375% p.a.;
- Maximale erhobene Depotbankkommission für alle Klassen gemäss Fondsvertrag: 0.20% p.a.;

Einzahlung in Effekten statt in bar

Swiss Life iFunds (CH)

- Bond Global Corporates Short Term (CHF hedged)
Klasse I-A0 AST

Während der Berichtsperiode wurden Effekten (statt in bar) im Gegenwert von 1 422 261 495.80 CHF eingebracht, was 1 422 258.0000 Anteilen entspricht.

Auszahlung in Effekten statt in bar

Swiss Life iFunds (CH)

- Bond Global Corporates Short Term (CHF hedged)
Klasse I-A1

Während der Berichtsperiode wurden Effekten (statt in bar) im Gegenwert von 1 419 761 105.48 CHF ausbezahlt, was 1 841 908.0000 Anteilen entspricht.

Gebührenteilungsvereinbarungen («commission sharing agreements») und geldwerte Vorteile («soft commissions»)

Die Fondsleitung hat keine Gebührenteilungsvereinbarungen («commission sharing agreements») geschlossen. Die Fondsleitung hat keine Vereinbarungen bezüglich so genannten «soft commissions» geschlossen.

Total Expense Ratio (TER)

Diese Kennziffer wurde gemäss der «Richtlinie zur Berechnung und Offenlegung der Total Expense Ratio (TER) von kollektiven Kapitalanlagen» der Asset Management Association Switzerland (AMAS) in der aktuell gültigen Fassung berechnet und drückt die Gesamtheit derjenigen Kommissionen und Kosten, die laufend dem Fondsvermögen belastet werden (Betriebsaufwand), retrospektiv in einem %-Satz des Fondsvermögens aus.

TER für die letzten 12 Monate:

Klasse I-A1:	0.15%
Klasse I-A2:	0.38%
Klasse I-A2 Cap:	0.38%

TER annualisiert

Klasse I-A0 AST:	0.04%
------------------	-------

Ausgabe- und Rücknahmepreis

Falls an einem Bewertungstag die Summe der Zeichnungen und Rücknahmen von Anteilen eines Teilvermögens zu einem Nettovermögenszufluss bzw. -abfluss führt, wird der Nettoinventarwert des entsprechenden Teilvermögens erhöht bzw. reduziert (Swinging Single Pricing). Die maximale Anpassung beläuft sich auf 2% des Nettoinventarwerts. Berücksichtigt werden die Nebenkosten (Geld/Brief-Spannen, marktübliche Courtagen, Kommissionen, Steuern und Abgaben usw.) sowie die Kosten für die Überprüfung und Aufrechterhaltung von Qualitätsstandards bei physischen Anlagen, die aus der Anlage des einbezahlten Betrags bzw. aus dem Verkauf eines dem gekündigten Anteil entsprechenden Teils der Anlagen erwachsen. Die Anpassung führt zu einer Erhöhung des Nettoinventarwerts, wenn die Nettobewegung zu einem Anstieg der Anzahl Anteile des Anlagefonds führt. Die Anpassung resultiert in einer Verminderung des Nettoinventarwerts, wenn die Nettobewegung einen Rückgang der Anteile des entsprechenden Teilvermögens bewirkt. Die Berücksichtigung dieser Nebenkosten entfällt, falls die Fondsleitung einer Ein- oder Auszahlung in Anlagen statt in bar gemäss § 19 Ziff. 8 gestattet sowie beim Wechsel zwischen Anteilsklassen innerhalb des Teilvermögens. Der unter Anwendung des Swinging Single Pricing ermittelte Nettoinventarwert ist somit ein modifizierter Nettoinventarwert.

Die Fondsleitung berücksichtigt grundsätzlich die durchschnittlichen Nebenkosten. Bei der Anpassung des Nettoinventarwertes kann sie jedoch auch die tatsächliche Höhe der Nebenkosten berücksichtigen, sofern dies unter Berücksichtigung der relevanten Umstände (z.B. Höhe des Betrags, allgemeine Marktsituation, spezifische Marktsituation für die betreffende Anlageklasse) im Ermessen der Fondsleitung angemessen erscheint. Die Anpassung kann in einem solchen Fall höher oder tiefer als die durchschnittlichen Nebenkosten ausfallen.

Grundsätze der Bewertung und der Nettoinventarwertberechnung

Siehe Anhang zu Ergänzende Angaben.

Umrechnungskurse

CAD 1 = CHF 0.624412	JPY 1 = CHF 0.005897
EUR 1 = CHF 0.941444	USD 1 = CHF 0.843550
GBP 1 = CHF 1.131496	

Swiss Life iFunds (CH) Bond Global Aggregate (CHF hedged)

Art übrige Fonds für traditionelle Anlagen

Wichtigste Daten

	ISIN	30.9.2024	30.9.2023
Nettofondsvermögen in CHF		199 029 838.23	146 294 684.52
Klasse I-A1	CH1232663679		1
Nettoinventarwert pro Anteil in CHF		996.24	956.62
Ausgabe- und Rücknahmepreis pro Anteil in CHF ²		996.24	956.62
Anzahl Anteile im Umlauf		199 680.6000	152 829.4210
Klasse I-A2	CH1232663687		1
Nettoinventarwert pro Anteil in CHF		993.11	954.67
Ausgabe- und Rücknahmepreis pro Anteil in CHF ²		993.11	954.67
Anzahl Anteile im Umlauf		100.0000	100.0000

¹ Erstemission per 1.2.2023

² Siehe Ergänzende Angaben

Performance

	Währung	2023/2024	2023 ¹
Klasse I-A1	CHF	5.9%	-4.3%
Klasse I-A2	CHF	5.6%	-4.5%
Referenzindex: ²			
Bloomberg Global Aggregate Ex Sec Ex CNY (CHF hedged)	CHF	5.7%	-4.4%

¹ Die Performance wurde für den Zeitraum vom 1.02.2023 - 30.9.2023 berechnet

² Referenzindex Performance der beiden Klassen seit Lancierung am 01.02.2023

Die historische Performance stellt keinen Indikator für die laufende und zukünftige Entwicklung dar.

Die Performancedaten lassen die bei der Ausgabe und Rücknahme der Anteile erhobenen Kommissionen und Kosten unberücksichtigt.

Struktur des Wertpapierportfolios (ungeprüft)

Aufteilung nach Risikodomizil in % des Gesamtfondsvermögens	
Vereinigte Staaten von Amerika	21.94
Japan	18.35
Global	9.33
Kanada	7.02
Italien	6.15
Supranational	5.98
Deutschland	4.85
Frankreich	4.70
Grossbritannien	3.85
Spanien	2.95
Übrige	9.41
Total	94.53

Obige Prozentsätze können Rundungsdifferenzen enthalten.

Vermögensrechnung

	30.9.2024	30.9.2023
	CHF	CHF
Verkehrswerte		
Bankguthaben		
– auf Sicht	9 457 760.34	1 227 730.83
Effekten		
– Obligationen, Wandelobligationen, Optionsanleihen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte	169 644 575.42	142 996 339.25
– Anteile anderer kollektiver Kapitalanlagen	18 578 487.20	5 030 500.00
Derivative Finanzinstrumente	-160 647.62	-4 290 000.10
Sonstige Vermögenswerte	1 586 133.25	1 381 367.04
Gesamtfondsvermögen	199 106 308.59	146 345 937.02
Andere Verbindlichkeiten	-76 470.36	-51 252.50
Nettofondsvermögen	199 029 838.23	146 294 684.52

Erfolgsrechnung

	1.10.2023-30.9.2024	1.2.2023-30.9.2023
	CHF	CHF
Ertrag		
Erträge der Bankguthaben	98 402.59	47 210.34
Erträge der Effekten		
– aus Obligationen, Wandelobligationen, Optionsanleihen und sonstigen Forderungswertpapieren und -rechten	4 455 579.09	2 187 730.58
– aus Anteilen anderer kollektiver Kapitalanlagen	94 539.01	0.00
Ausgleichszahlungen aus Effektenleihe	0.00	97 596.44
Erträge der Effektenleihe	0.00	13 712.46
Einkauf in laufende Nettoerträge bei der Ausgabe von Anteilen	1 316 261.49	614 630.99
Total Ertrag	5 964 782.18	2 960 880.81
Aufwand		
Passivzinsen	-550.55	-8 598.38
Reglementarische Kommissionsvergütung an die Fondsleitung Klasse I-A1	-241 041.47	-121 329.39
Reglementarische Kommissionsvergütung an die Fondsleitung Klasse I-A2	-442.42	-292.68
Reglementarische Kommissionsvergütung an die Depotbank	-10 705.75	-5 986.88
Sonstige Aufwendungen	-3 239.61	-2 219.33
Ausrichtung laufender Nettoerträge bei der Rücknahme von Anteilen	-553 421.74	-262 506.25
Total Aufwand	-809 401.54	-400 932.91
Nettoertrag	5 155 380.64	2 559 947.90
Realisierte Kapitalgewinne und -verluste	-2 328 734.87	4 290 132.48
Realisierter Erfolg	2 826 645.77	6 850 080.38
Nicht realisierte Kapitalgewinne und -verluste	7 827 401.89	-12 561 364.64
Gesamterfolg	10 654 047.66	-5 711 284.26

Verwendung des Erfolges

	1.10.2023-30.9.2024	1.2.2023-30.9.2023
	CHF	CHF
Nettoertrag des Rechnungsjahres	5 155 380.64	2 559 947.90
Vortrag des Vorjahres	6 226.57	0.00
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg	5 161 607.21	2 559 947.90
Zur Ausschüttung an die Anlegerinnen und Anleger vorgesehener Erfolg	-5 154 029.48	-2 553 721.33
Vortrag auf neue Rechnung	7 577.73	6 226.57

Veränderung des Nettofondsvermögens

	1.10.2023-30.9.2024	1.2.2023-30.9.2023
	CHF	CHF
Nettofondsvermögen zu Beginn des Rechnungsjahres	146 294 684.52	0.00
Ordentliche Jahresausschüttung	-2 592 493.24	0.00
Saldo aus dem Anteilverkehr	44 673 599.29	152 005 968.78
Gesamterfolg	10 654 047.66	-5 711 284.26
Nettofondsvermögen am Ende der Berichtsperiode	199 029 838.23	146 294 684.52

Entwicklung der Anteile im Umlauf

	1.10.2023-30.9.2024	1.2.2023-30.9.2023
	Anzahl	Anzahl
Klasse I-A1		
Bestand Anfang Rechnungsjahr	152 829.4210	0.0000
Ausgegebene Anteile	81 747.1790	179 884.4210
Zurückgenommene Anteile	-34 896.0000	-27 055.0000
Bestand Ende Berichtsperiode	199 680.6000	152 829.4210

Differenz zwischen den ausgegebenen und zurückgenommenen Anteilen 46 851.1790 152 829.4210

	Anzahl	Anzahl
Klasse I-A2		
Bestand Anfang Rechnungsjahr	100.0000	0.0000
Ausgegebene Anteile	0.0000	100.0000
Zurückgenommene Anteile	0.0000	0.0000
Bestand Ende Berichtsperiode	100.0000	100.0000

Differenz zwischen den ausgegebenen und zurückgenommenen Anteilen 0.0000 100.0000

Ausschüttung für 2023/2024

Klasse I-A1

(Ex-Datum 14.1.2025)

Aufgelaufener Ertrag pro Anteil	CHF	25.8379
Für in der Schweiz domizilierte Anteilinhaber brutto	CHF	25.8000
Abzüglich eidg. Verrechnungssteuer	CHF	-9.0300
Netto pro Anteil (zahlbar ab 16.1.2025)	CHF	16.7700

Für nicht in der Schweiz domizilierte Anteilinhaber mit Bankenerklärung

Netto pro Anteil (zahlbar ab 16.1.2025)	CHF	25.8000
--	-----	----------------

Klasse I-A2

(Ex-Datum 14.1.2025)

Aufgelaufener Ertrag pro Anteil	CHF	22.7319
Für in der Schweiz domizilierte Anteilinhaber brutto	CHF	22.7000
Abzüglich eidg. Verrechnungssteuer	CHF	-7.9450
Netto pro Anteil (zahlbar ab 16.1.2025)	CHF	14.7550

Für nicht in der Schweiz domizilierte Anteilinhaber mit Bankenerklärung

Netto pro Anteil (zahlbar ab 16.1.2025)	CHF	22.7000
--	-----	----------------

Titel	30.9.2023 Anzahl/ Nominal	Käufe ¹	Verkäufe ²	30.9.2024 Anzahl/ Nominal	Verkehrswert ³ in CHF	in % ³	Davon ausgeliehen Anzahl/Nominal
Notes, fester Zins							
CAD							
QUEBEC, PROVINCE OF 3.25000% 22-01.09.32**	CAD	500 000	250 000	750 000	462 996	0.23	
Total CAD					462 996	0.23	
USD							
ATHENE GLOBAL FUNDING-144A 2.51400% 22-08.03.24**	USD	300 000	300 000			0.00	
Total USD						0.00	
Total Notes, fester Zins					462 996	0.23	
Medium-Term Notes, fester Zins							
AUD							
KOMMUNALBANKEN AS 5.25000% 23-18.04.34**	AUD	2 500 000	300 000	2 200 000	1 355 588	0.68	
Total AUD					1 355 588	0.68	
CAD							
QUEBEC, PROVINCE OF CPN 4.40000% 22-01.12.55**	CAD	200 000		200 000	131 391	0.07	
Total CAD					131 391	0.07	
Total Medium-Term Notes, fester Zins					1 486 979	0.75	
Anleihen, fester Zins							
AUD							
BNG BANK NV 5.00000% 23-13.03.34**	AUD	2 000 000		2 000 000	1 205 317	0.61	
Total AUD					1 205 317	0.61	
Total Anleihen, fester Zins					1 205 317	0.61	
Total Effekten, die nicht an einer Börse oder einem andern geregelten Markt gehandelt werden					21 733 779	10.92	
Total Wertschriften (davon ausgeliehen)					188 223 063	94.53 0.00	
Bankguthaben auf Sicht					9 457 760	4.75	
Derivative Finanzinstrumente					-160 648	-0.08	
Sonstige Vermögenswerte					1 586 134	0.80	
Gesamtfondsvermögen					199 106 309	100.00	
Andere Verbindlichkeiten					-76 471		
Nettofondsvermögen					199 029 838		

Bewertungskategorie	Verkehrswert per 30.9.2024	in % des Gesamt- fondsvermögens ³
Anlagen bewertet zu den Kursen, die am Hauptmarkt bezahlt werden	166 609 141	83.67
Anlagen bewertet aufgrund von am Markt beobachtbaren Parametern	21 453 274	10.78
Anlagen bewertet mit geeigneten Bewertungsmodellen unter Berücksichtigung der aktuellen Marktgegebenheiten	-	-
Total	188 062 415	94.45

¹ «Käufe» umfassen die Transaktionen: Gratistitel / Käufe / Konversionen / Namensänderungen / «Splits» / Stock-Wahldividenden / Titelaufteilungen / Überträge / Umbuchungen infolge Redenominierung in Euro / Umtausch zwischen Gesellschaften / Zuteilung aus Bezugs-/Optionsrechten / Zuteilung von Bezugsrechten ab Basistiteln / Sacheinlagen

² «Verkäufe» umfassen die Transaktionen: Auslösungen / Ausbuchung infolge Verfall / Ausübung von Bezugs-/Optionsrechten / «Reverse splits» / Rückzahlungen / Überträge / Umbuchungen infolge Redenominierung in Euro / Umtausch zwischen Gesellschaften / Verkäufe / Sachauslagen

³ Allfällige Abweichungen in den Totalisierungen sind auf Rundungsdifferenzen zurückzuführen

* bewertet zu den Kursen, die am Hauptmarkt bezahlt werden (Art. 88 Abs. 1 KAG)

** bewertet aufgrund von am Markt beobachtbaren Parametern

Derivative Finanzinstrumente

Gemäss KKV-FINMA Art. 23

Am Ende der Berichtsperiode offene engagementreduzierende Derivate

Instrument	Anzahl Kontrakte	Währung	Gebundene Basiswerte in Obligationen/Aktien in CHF	Variation Margin in CHF	In % des Vermögens
Futures auf Zinsinstrumente/Obligationen					
JAPAN GOVERNMENT 10Y BOND (OSE) FUTURE 13.12.24*	-3	JPY	-2 559 134	-3 361	0.00
			-2 559 134	-3 361	0.00

Am Ende der Berichtsperiode offene engagementerhöhende Derivate

Instrument	Anzahl Kontrakte	Währung	Deckung in CHF	Variation Margin in CHF	In % des Vermögens
Futures auf Zinsinstrumente/Obligationen					
EURO BTP ITALY GOVERNMENT FUTURE 06.12.24*	15	EUR	1 715 358	42 930	0.02
EURO-BUND FUTURE 06.12.24*	22	EUR	2 794 432	41 009	0.02
LONG GILT FUTURE 27.12.24*	42	GBP	4 677 672	-23 965	-0.01
US ULTRA LONG BOND (CBT) FUTURE 19.12.24*	21	USD	2 357 696	554	0.00
US 10YR TREASURY NOTE FUTURE 19.12.24*	125	USD	12 050 244	38 718	0.02
CAN 10YR BOND FUTURE 18.12.24*	63	CAD	4 917 641	36 977	0.02
AUSTRALIA 10YR BOND FUTURE 16.12.24*	38	AUD	2 588 429	-13 005	-0.01
			31 101 472	123 218	0.06

Durch derivative Transaktionen gebundene geldnahe Mittel: CHF 31 101 472

Am Ende der Berichtsperiode offene Derivate auf Devisen

Verkauf Währung	Verkauf Betrag	Kauf Währung	Kauf Betrag	Fälligkeit	Wiederbeschaffungswert in CHF	In % des Vermögens
Devisentermingeschäfte**						
MXN	3 110 000	USD	163 459	06.12.2024	5 469	0.00
AUD	24 750 000	CHF	13 925 885	15.10.2024	-541 724	-0.27
CAD	7 897 000	CHF	4 932 024	15.10.2024	6 307	0.00
GBP	7 620 000	CHF	8 360 893	18.11.2024	-214 275	-0.11
EUR	51 670 000	CHF	48 928 390	16.10.2024	337 326	0.17
JPY	2 490 000 000	CHF	14 634 052	16.10.2024	-55 688	-0.03
EUR	320 000	CHF	299 529	16.10.2024	-1 403	0.00
CAD	130 000	CHF	81 524	15.10.2024	437	0.00
AUD	550 000	CHF	315 262	15.10.2024	-6 241	0.00
GBP	60 000	CHF	66 335	18.11.2024	-1 186	0.00
SEK	6 815 000	CHF	559 096	09.12.2024	-5 642	0.00
JPY	4 010 000 000	CHF	23 740 439	25.10.2024	76 950	0.04
USD	69 000 000	CHF	58 154 753	25.10.2024	116 266	0.06
AUD	50 000	CHF	29 017	15.10.2024	-211	0.00
USD	1 170 000	CHF	986 299	25.10.2024	2 168	0.00
JPY	6 470 000	CHF	38 296	25.10.2024	116	0.00
SEK	40 000	CHF	3 319	09.12.2024	4	0.00
GBP	20 000	CHF	22 491	18.11.2024	-16	0.00
CAD	210 000	CHF	131 219	15.10.2024	232	0.00
AUD	130 000	CHF	76 075	15.10.2024	84	0.00
EUR	730 000	CHF	687 022	16.10.2024	522	0.00
					-280 505	-0.14

Obige Angaben können Rundungsdifferenzen enthalten.

* bewertet zu den Kursen, die am Hauptmarkt bezahlt werden (Art. 88 Abs. 1 KAG)

** bewertet aufgrund von am Markt beobachtbaren Parametern

Während der Berichtsperiode getätigte engagementreduzierende Derivate

Instrument	Währung	Käufe/ Kontrakte	Verkäufe/ Kontrakte
Futures auf Zinsinstrumente/Obligationen			
US LONG BOND FUTURE 19.12.23	USD	5	0
US LONG BOND FUTURE 19.03.24	USD	5	5
JAPAN GOVERNMENT 10Y BOND (OSE) FUTURE 13.03.24	JPY	7	7
JAPAN GOVERNMENT 10Y BOND (OSE) FUTURE 13.06.24	JPY	14	14
JAPAN GOVERNMENT 10Y BOND (OSE) FUTURE 13.12.24	JPY	0	3
JAPAN GOVERNMENT 10Y BOND (OSE) FUTURE 12.09.24	JPY	7	7

Während der Berichtsperiode getätigte engagementerhöhende Derivate

Instrument	Währung	Käufe/ Kontrakte	Verkäufe/ Kontrakte
Futures auf Zinsinstrumente/Obligationen			
EURO BTP ITALY GOVERNMENT FUTURE 06.06.24	EUR	10	10
EURO-BUND FUTURE 06.06.24	EUR	50	50
EURO-BUND FUTURE 07.03.24	EUR	28	28
EURO BTP ITALY GOVERNMENT FUTURE 06.09.24	EUR	15	15
EURO-BUND FUTURE 06.09.24	EUR	58	58
EURO BTP ITALY GOVERNMENT FUTURE 06.12.24	EUR	15	0
EURO-BUND FUTURE 06.12.24	EUR	32	10
LONG GILT FUTURE 26.03.24	GBP	35	35
LONG GILT FUTURE 26.06.24	GBP	67	67
LONG GILT FUTURE 26.09.24	GBP	79	79
LONG GILT FUTURE 27.12.24	GBP	42	0
US 10YR TREASURY NOTE FUTURE 19.12.23	USD	13	43
CAN 10YR BOND FUTURE 18.12.23	CAD	0	25
US ULTRA LONG BOND (CBT) FUTURE 19.03.24	USD	14	14
US 10YR TREASURY NOTE FUTURE 19.03.24	USD	58	58
JAPAN GOVERNMENT 10Y BOND (OSE) FUTURE 13.03.24	JPY	7	7
CAN 10YR BOND FUTURE 19.03.24	CAD	25	25
US 10YR TREASURY NOTE FUTURE 18.06.24	USD	81	81
US ULTRA LONG BOND (CBT) FUTURE 18.06.24	USD	25	25
CAN 10YR BOND FUTURE 19.06.24	CAD	73	73
US ULTRA LONG BOND (CBT) FUTURE 19.12.24	USD	21	0
US 10YR TREASURY NOTE FUTURE 19.12.24	USD	160	35
US 10YR TREASURY NOTE FUTURE 19.09.24	USD	188	188
CAN 10YR BOND FUTURE 18.09.24	CAD	63	63
US ULTRA LONG BOND (CBT) FUTURE 19.09.24	USD	37	37
CAN 10YR BOND FUTURE 18.12.24	CAD	63	0
AUSTRALIA 10YR BOND FUTURE 16.12.24	AUD	38	0

Instrument	Währung	Nominal
Zinssatz-Swaps/Credit Default Swaps		
JPM/MARKIT CDX.NA.IG.S40 V1 CDI PAY 1.00000% 23-20.06.28	USD	10 000 000
JPM/MARKIT CDX.NA.IG.S40 V1 CDI PAY 1.00000% 23-20.06.28	USD	10 000 000

Während der Berichtsperiode getätigte Derivate auf Devisen

Verkauf Währung	Verkauf Betrag	Kauf Währung	Kauf Betrag	Fälligkeit
Devisentermingeschäfte				
CHF	1 195 802	USD	1 300 000	10.10.2023
USD	523 494	MXN	9 450 000	10.10.2023
CHF	1 492 938	JPY	250 000 000	27.10.2023
EUR	400 000	CHF	383 521	06.11.2023
EUR	1 056 757	SEK	12 450 000	08.11.2023
GBP	7 250 000	CHF	8 047 164	10.11.2023
GBP	70 000	CHF	77 422	10.11.2023

Verkauf Währung	Verkauf Betrag	Kauf Währung	Kauf Betrag	Fälligkeit
CHF	86 744	GBP	80 000	10.11.2023
GBP	100 000	CHF	110 297	10.11.2023
CHF	58 021	AUD	100 000	15.11.2023
CHF	28 786	AUD	50 000	15.11.2023
CHF	545 070	AUD	950 000	15.11.2023
MXN	9 450 000	USD	520 264	16.11.2023
USD	64 300 000	CHF	58 529 937	16.11.2023
USD	700 000	CHF	629 415	16.11.2023
CHF	804 995	USD	900 000	16.11.2023
USD	500 000	CHF	453 888	16.11.2023
CHF	96 886	CAD	145 000	30.11.2023
CAD	110 000	CHF	72 678	30.11.2023
CHF	262 032	CAD	400 000	30.11.2023
CAD	100 000	CHF	65 322	30.11.2023
CHF	5 099 549	CAD	7 895 000	30.11.2023
JPY	775 000 000	CHF	4 786 413	05.12.2023
JPY	150 000 000	CHF	914 638	05.12.2023
JPY	250 000 000	CHF	1 496 035	05.12.2023
EUR	42 815 000	CHF	41 001 357	06.12.2023
CHF	1 009 324	EUR	1 050 000	06.12.2023
EUR	150 000	CHF	144 562	06.12.2023
EUR	600 000	CHF	578 165	06.12.2023
CHF	41 015 477	EUR	43 000 000	06.12.2023
AUD	950 000	CHF	543 881	14.12.2023
AUD	25 000	CHF	14 363	14.12.2023
CHF	558 630	AUD	975 000	14.12.2023
SEK	12 450 000	CHF	1 013 421	11.01.2024
SEK	250 000	CHF	20 712	11.01.2024
SEK	300 000	CHF	24 914	11.01.2024
SEK	540 000	CHF	45 048	11.01.2024
JPY	1 345 500 000	CHF	8 131 136	18.01.2024
CHF	6 048	JPY	1 000 000	18.01.2024
GBP	7 340 000	CHF	8 054 305	18.01.2024
GBP	30 000	CHF	32 996	18.01.2024
JPY	12 000 000	CHF	71 724	18.01.2024
JPY	65 000 000	CHF	383 736	18.01.2024
GBP	535 000	CHF	586 849	18.01.2024
JPY	1 170 000 000	CHF	6 923 323	18.01.2024
CHF	27 503	GBP	25 000	18.01.2024
JPY	10 000 000	CHF	59 518	18.01.2024
JPY	20 000 000	CHF	120 559	18.01.2024
JPY	8 610 000	CHF	51 005	18.01.2024
GBP	410 000	CHF	436 077	18.01.2024
CHF	15 477 608	JPY	2 630 110 000	18.01.2024
CHF	9 005 648	GBP	8 290 000	18.01.2024
CAD	7 895 000	CHF	5 073 801	22.01.2024
CAD	370 000	CHF	236 407	22.01.2024
EUR	1 400 000	CHF	1 326 231	22.01.2024
EUR	43 000 000	CHF	40 887 612	22.01.2024
CAD	300 000	CHF	189 359	22.01.2024
EUR	1 730 000	CHF	1 600 085	22.01.2024
CHF	560 798	EUR	600 000	22.01.2024
CHF	5 459 031	CAD	8 565 000	22.01.2024
CHF	42 709 471	EUR	45 530 000	22.01.2024
CHF	432 983	USD	500 000	23.01.2024
CHF	1 407 620	AUD	2 500 000	08.02.2024
CHF	5 206	ILS	22 000	15.02.2024
CHF	3 366	ILS	15 000	15.02.2024
ILS	40 000	CHF	9 287	15.02.2024
ILS	10 000	CHF	2 357	15.02.2024
CHF	299 436	ILS	1 263 000	15.02.2024
USD	270 000	CHF	241 662	16.02.2024
MXN	9 750 000	USD	544 964	16.02.2024
USD	64 600 000	CHF	57 639 802	16.02.2024
AUD	4 600 000	CHF	2 645 911	16.02.2024
AUD	1 900 000	CHF	1 099 362	16.02.2024
CHF	654 765	USD	750 000	16.02.2024
USD	3 250 000	CHF	2 808 101	16.02.2024
AUD	200 000	CHF	114 656	16.02.2024
AUD	975 000	CHF	555 877	16.02.2024
MXN	280 000	USD	16 410	16.02.2024
AUD	270 000	CHF	153 215	16.02.2024
USD	2 680 000	CHF	2 234 955	16.02.2024
CHF	732 008	USD	850 000	16.02.2024
USD	500 000	CHF	431 896	16.02.2024
CHF	260 043	USD	300 000	16.02.2024
AUD	2 800 000	CHF	1 593 833	16.02.2024
MXN	60 000	USD	3 484	16.02.2024
USD	480 000	CHF	410 759	16.02.2024
CHF	50 991	AUD	90 000	16.02.2024
AUD	110 000	CHF	61 993	16.02.2024
USD	410 000	CHF	353 958	16.02.2024
AUD	2 500 000	CHF	1 406 780	16.02.2024
CHF	2 052 337	USD	2 400 000	16.02.2024
CHF	651 600	USD	750 000	16.02.2024
CHF	42 581	AUD	75 000	16.02.2024
USD	591 195	MXN	10 090 000	16.02.2024
CHF	8 390 149	AUD	14 690 000	16.02.2024
CHF	58 872 668	USD	67 250 000	16.02.2024
ILS	1 250 000	CHF	302 723	20.02.2024
CHF	867 494	AUD	1 500 000	28.02.2024
SEK	13 340 000	CHF	1 103 992	11.03.2024
CHF	1 656	SEK	20 000	11.03.2024
SEK	80 000	CHF	6 609	11.03.2024
CHF	501 595	SEK	5 900 000	11.03.2024
CHF	21 306	SEK	250 000	11.03.2024
CHF	617 584	SEK	7 250 000	11.03.2024
AUD	900 000	CHF	511 849	14.03.2024
AUD	14 690 000	CHF	8 373 344	14.03.2024
USD	67 000 000	CHF	58 488 186	14.03.2024

Verkauf Währung	Verkauf Betrag	Kauf Währung	Kauf Betrag	Fälligkeit
SEK	955 000	CHF	80 669	11.09.2024
SEK	170 000	CHF	14 071	11.09.2024
CHF	562 169	SEK	6 815 000	11.09.2024
USD	67 000 000	CHF	57 623 859	16.09.2024
USD	2 070 000	CHF	1 753 310	16.09.2024
CHF	58 422 203	USD	69 000 000	16.09.2024
JPY	4 000 000 000	CHF	23 494 981	17.09.2024
JPY	11 590 000	CHF	67 557	17.09.2024
CHF	23 718 105	JPY	4 010 000 000	17.09.2024
AUD	24 750 000	CHF	13 925 885	15.10.2024
CAD	7 897 000	CHF	4 932 024	15.10.2024
CAD	130 000	CHF	81 524	15.10.2024
AUD	550 000	CHF	315 262	15.10.2024
AUD	50 000	CHF	29 017	15.10.2024
CAD	210 000	CHF	131 219	15.10.2024
AUD	130 000	CHF	76 075	15.10.2024
EUR	51 670 000	CHF	48 928 390	16.10.2024
JPY	2 490 000 000	CHF	14 634 052	16.10.2024
EUR	320 000	CHF	299 529	16.10.2024
EUR	730 000	CHF	687 022	16.10.2024
JPY	4 010 000 000	CHF	23 740 439	25.10.2024
USD	69 000 000	CHF	58 154 753	25.10.2024
USD	1 170 000	CHF	986 299	25.10.2024
JPY	6 470 000	CHF	38 296	25.10.2024
GBP	7 620 000	CHF	8 360 893	18.11.2024
GBP	60 000	CHF	66 335	18.11.2024
GBP	20 000	CHF	22 491	18.11.2024
MXN	3 110 000	USD	163 459	06.12.2024
SEK	6 815 000	CHF	559 096	09.12.2024
SEK	40 000	CHF	3 319	09.12.2024

Ergänzende Angaben

Derivative Finanzinstrumente

Risikomessverfahren Commitment-Ansatz I:
Art. 34 KKV-FINMA

Position	Betrag in CHF	in % des Nettofonds- vermögens
Total engagement- erhöhende Positionen	31 239 358.01	15.70%
Total engagement- reduzierende Positionen	179 225 901.06	90.05%

Pensionsgeschäfte

Die Fondsleitung tätigt für Rechnung des Teilvermögens keine Pensionsgeschäfte.

Vergütung an die Fondsleitung

Verwaltungskommission

- Effektiv erhobene Verwaltungskommission:
 - Klasse I-A1: 0.143625% p.a.;
 - Klasse I-A2: 0.453625% p.a.;
- Maximale erhobene Verwaltungskommission gemäss Fondsvertrag:
 - Klasse I-A1: 0.35% p.a.;
 - Klasse I-A2: 0.65% p.a.;
- Effektiv erhobene Depotbankkommission für alle Klassen: 0.006375% p.a.;
- Maximale erhobene Depotbankkommission für alle Klassen gemäss Fondsvertrag: 0.20% p.a.;

Gebührenteilungsvereinbarungen («commission sharing agreements») und geldwerte Vorteile («soft commissions»)

Die Fondsleitung hat keine Gebührenteilungsvereinbarungen («commission sharing agreements») geschlossen. Die Fondsleitung hat keine Vereinbarungen bezüglich so genannten «soft commissions» geschlossen.

Total Expense Ratio (TER)

Diese Kennziffer wurde gemäss der «Richtlinie zur Berechnung und Offenlegung der Total Expense Ratio (TER) von kollektiven Kapitalanlagen» der Asset Management Association Switzerland (AMAS) in der aktuell gültigen Fassung berechnet und drückt die Gesamtheit derjenigen Kommissionen und Kosten, die laufend dem Fondsvermögen belastet werden (Betriebsaufwand), retrospektiv in einem %-Satz des Fondsvermögens aus.

TER für die letzten 12 Monate:

Klasse I-A1:	0.15%
Klasse I-A2:	0.46%

Ausgabe- und Rücknahmepreis

Falls an einem Bewertungstag die Summe der Zeichnungen und Rücknahmen von Anteilen eines Teilvermögens zu einem Nettovermögenszufluss bzw. -abfluss führt, wird der Nettoinventarwert des entsprechenden Teilvermögens erhöht bzw. reduziert (Swinging Single Pricing). Die maximale Anpassung beläuft sich auf 2% des Nettoinventarwerts. Berücksichtigt werden die Nebenkosten (Geld/Brief-Spannen, marktübliche Courtagen, Kommissionen, Steuern und Abgaben usw.) sowie die Kosten für die Überprüfung und Aufrechterhaltung von Qualitätsstandards bei physischen Anlagen, die aus der Anlage des einbezahlten Betrags bzw. aus dem Verkauf eines dem gekündigten Anteil entsprechenden Teils der Anlagen erwachsen. Die Anpassung führt zu einer Erhöhung des Nettoinventarwerts, wenn die Nettobewegung zu einem Anstieg der Anzahl Anteile des Anlagefonds führt. Die Anpassung resultiert in einer Verminderung des Nettoinventarwerts, wenn die Nettobewegung einen Rückgang der Anzahl der Anteile des entsprechenden Teilvermögens bewirkt. Die Berücksichtigung dieser Nebenkosten entfällt, falls die Fondsleitung einer Ein- oder Auszahlung in Anlagen statt in bar gemäss § 19 Ziff. 8 gestattet sowie beim Wechsel zwischen Anteilsklassen innerhalb des Teilvermögens. Der unter Anwendung des Swinging Single Pricing ermittelte Nettoinventarwert ist somit ein modifizierter Nettoinventarwert.

Die Fondsleitung berücksichtigt grundsätzlich die durchschnittlichen Nebenkosten. Bei der Anpassung des Nettoinventarwertes kann sie jedoch auch die tatsächliche Höhe der Nebenkosten berücksichtigen, sofern dies unter Berücksichtigung der relevanten Umstände (z.B. Höhe des Betrags, allgemeine Marktsituation, spezifische Marktsituation für die betreffende Anlageklasse) im Ermessen der Fondsleitung angemessen erscheint. Die Anpassung kann in einem solchen Fall höher oder tiefer als die durchschnittlichen Nebenkosten ausfallen.

Grundsätze der Bewertung und der Nettoinventarwertberechnung

Siehe Anhang zu Ergänzende Angaben.

Umrechnungskurse

AUD 1 = CHF	0.585213	JPY 1 = CHF	0.005897
CAD 1 = CHF	0.624412	MXN 1 = CHF	0.043034
EUR 1 = CHF	0.941444	NZD 1 = CHF	0.536709
GBP 1 = CHF	1.131496	SEK 1 = CHF	0.083218
ILS 1 = CHF	0.226779	USD 1 = CHF	0.843550

Anhang zu Ergänzende Angaben

Grundsätze der Bewertung und der Nettoinventarwertberechnung

Grundsätze der Bewertung

1. Der Nettoinventarwert jedes Teilvermögens und der Anteil der einzelnen Anteilsklassen (Quoten) wird zum Verkehrswert auf Ende des Rechnungsjahres sowie für jeden Tag, an dem Anteile ausgegeben oder zurückgenommen werden, in der Rechungseinheit des entsprechenden Teilvermögens berechnet. Bewertungstag eines Teilvermögens («Bewertungstag») ist jeweils der auf einen Ausgabe- und Rücknahmetag gemäss § 19 Ziff. 1 (in Verbindung mit den massgeblichen Bestimmungen des Besonderen Teils) folgende Bankarbeitstag in Zürich. Für Tage, an welchen die Börsen bzw. Märkte der Hauptanlageländer eines Teilvermögens geschlossen sind (z.B. Banken- und Börsenfeiertage), findet keine Bewertung des Vermögens des entsprechenden Teilvermögens statt.
2. An einer Börse oder an einem anderen geregelten, dem Publikum offen stehenden Markt gehandelte Anlagen sind mit den am Hauptmarkt bezahlten aktuellen Kursen zu bewerten. Andere Anlagen oder Anlagen, für die keine aktuellen Kurse verfügbar sind, sind mit dem Preis zu bewerten, der bei sorgfältigem Verkauf im Zeitpunkt der Schätzung wahrscheinlich erzielt würde. Die Fondsleitung wendet in diesem Fall zur Ermittlung des Verkehrswertes angemessene und in der Praxis anerkannte Bewertungsmodelle und -grundsätze an.
3. Offene kollektive Kapitalanlagen werden mit ihrem Rücknahmepreis bzw. Nettoinventarwert bewertet. Werden sie regelmässig an einer Börse oder an einem anderen geregelten, dem Publikum offen stehenden Markt gehandelt, so kann die Fondsleitung diese gemäss Ziff. 2 bewerten.
4. Der Wert von Geldmarktinstrumenten, welche nicht an einer Börse oder an einem anderen geregelten, dem Publikum offen stehenden Markt gehandelt werden, wird wie folgt bestimmt: Der Bewertungspreis solcher Anlagen basiert auf der jeweils relevanten Zinskurve. Die auf der Zinskurve basierende Bewertung bezieht sich auf die Komponenten Zinssatz und Spread. Dabei werden folgende Grundsätze angewandt: Für jedes Geldmarktinstrument werden die der Restlaufzeit nächsten Zinssätze intrapoliert. Der dadurch ermittelte Zinssatz wird unter Zuzug eines Spreads, welcher die Bonität des zugrundeliegenden Schuldners wiedergibt, in einen Marktkurs konvertiert. Dieser Spread wird bei signifikanter Änderung der Bonität des Schuldners angepasst.
5. Bankguthaben werden mit ihrem Forderungsbetrag plus aufgelaufene Zinsen bewertet. Bei wesentlichen Änderungen der Marktbedingungen oder der Bonität wird die Bewertungsgrundlage für Bankguthaben auf Zeit der neuen Verhältnissen angepasst.
6. Derivative Finanzinstrumente, welche an einer Börse oder an einem anderen geregelten, dem Publikum offen stehenden Markt gehandelt werden, sind mit den am Hauptmarkt bezahlten aktuellen Kursen zu bewerten. Derivative Finanzinstrumente, welche nicht an einer Börse oder an einem anderen geregelten, dem Publikum offen stehenden Markt gehandelt werden (OTC - Derivate), sind mit dem Preis zu bewerten, der bei sorgfältigem Verkauf im Zeitpunkt der Schätzung wahrscheinlich erzielt würde. Die Fondsleitung wendet in diesem Fall zur Ermittlung des Verkehrswertes angemessene und in der Praxis anerkannte Bewertungsmodelle und -grundsätze an.
7. Die Quoten am Verkehrswert des Nettovermögens eines Teilvermögens (Vermögen eines Teilvermögens, abzüglich der Verbindlichkeiten), welche den jeweiligen Anteilsklassen zuzurechnen sind, werden erstmals bei der Erstausgabe mehrerer Anteilsklassen (wenn diese gleichzeitig erfolgt) oder der Erstausgabe einer weiteren Anteilsklasse auf der Basis der dem entsprechenden Teilvermögen für jede Anteilsklasse zufließenden Beträge bestimmt. Die Quote wird bei folgenden Ereignissen jeweils neu berechnet:
 - a) bei der Ausgabe und Rücknahme von Anteilen.
 - b) auf den Stichtag von Ausschüttungen, sofern (i) solche Ausschüttungen nur auf einzelnen Anteilsklassen (Ausschüttungsklassen) anfallen oder sofern (ii) die Ausschüttungen der verschiedenen Anteilsklassen in Prozenten ihres jeweiligen Nettoinventarwertes unterschiedlich ausfallen oder sofern (iii) auf den Ausschüttungen der verschiedenen Anteilsklassen in Prozenten der Ausschüttung unterschiedliche Kommissions- oder Kostenbelastungen anfallen.
 - c) bei der Inventarwertberechnung, im Rahmen der Zuweisung von Verbindlichkeiten (einschliesslich der fälligen oder aufgelaufenen Kosten und Kommissionen) an die verschiedenen Anteilsklassen, sofern die Verbindlichkeiten der verschiedenen Anteilsklassen in Prozenten ihres jeweiligen Nettoinventarwertes unterschiedlich ausfallen, namentlich, wenn (i) für die verschiedenen Anteilsklassen unterschiedliche Kommissionssätze zur Anwendung gelangen oder wenn (ii) klassenspezifische Kostenbelastungen erfolgen.

- d) bei der Inventarwertberechnung, im Rahmen der Zuweisung von Erträgen oder Kapitalerträgen an die verschiedenen Anteilsklassen, sofern die Erträge oder Kapitalerträge aus Transaktionen anfallen, die nur im Interesse einer Klasse oder im Interesse mehrerer Anteilsklassen, nicht jedoch proportional zu deren Quote am Nettovermögen eines Teilvermögens, getätigt wurden.

Grundsätze der Nettoinventarwertberechnung

Der Nettoinventarwert eines Anteils einer Anteilsklasse eines Teilvermögens ergibt sich aus der der betreffenden Anteilsklasse am Verkehrswert des Vermögens eines Teilvermögens zukommenden Quote, vermindert um all-fällige Verbindlichkeiten dieses Teilvermögens, die der betreffenden Anteilsklasse zugeteilt sind, dividiert durch die Anzahl der sich im Umlauf befindlichen Anteile der entsprechenden Anteilsklasse. Er wird auf 1/100 der Rechnungseinheit des entsprechenden Teilvermögens oder, falls abweichend, der Referenzwährung der entsprechenden Anteilsklasse gerundet. Der Besondere Teil kann für einzelne Rechnungseinheiten bzw. Referenzwährungen abweichende Rundungsbestimmungen vorsehen.

(OTC-)Derivate und Effektenleihe

Führt das Teilvermögen ausserbörsliche Transaktionen (OTC-Geschäfte) durch, so kann es dadurch Risiken im Zusammenhang mit der Kreditwürdigkeit der OTC-Gegenpartei ausgesetzt sein: bei Abschluss von Terminkontrakten, Optionen und Swap-Transaktionen oder Verwendung sonstiger derivativer Techniken unterliegt das Teilvermögen dem Risiko, dass eine OTC-Gegenpartei ihren Verpflichtungen aus einem bestimmten oder mehreren Verträgen nicht nachkommt (bzw. nicht nachkommen kann). Das Kontrahentenrisiko kann durch die Hinterlegung einer Sicherheit verringert werden. Falls dem Teilvermögen ein Wertpapier gemäss einer anwendbaren Vereinbarung geschuldet wird, wird dieses Wertpapier in einer Depotbank/Verwahrstelle für das Teilvermögen verwahrt. Konkurs- und Insolvenzfälle bzw. sonstige Kreditausfallereignisse bei der OTC-Gegenpartei, der Depotbank oder innerhalb ihres Unterverwahrstellen-/ Korrespondenzbanknetzwerks können dazu führen, dass die Rechte oder die Anerkennung des Teilvermögens in Zusammenhang mit dem Wertpapier verzögert, eingeschränkt oder sogar ausgeschlossen werden könnten, was das Teilvermögen zwingen würde, seinen Verpflichtungen im Rahmen der OTC-Transaktion nachzukommen, und zwar trotz eines Wertpapiers, das zuvor zur Verfügung gestellt wurde, um eine solche Verpflichtung abzusichern.

Die Gesellschaft darf ebenfalls Teile ihres Wertpapierbestandes an Dritte ausleihen. Im Allgemeinen dürfen Ausleihungen nur über anerkannte Clearinghäuser, wie Clearstream International oder Euroclear, sowie über erstrangige Finanzinstitute, welche in dieser Aktivität spezialisiert sind, innerhalb deren festgesetzten Rahmenbedingungen erfolgen. Collateral erhält man in Verbindung mit ausgeliehenen Wertpapieren. Collateral setzt sich aus hochwertigen Wertpapieren zusammen, welche zumindest dem Betrag des Marktwertes der ausgeliehenen Wertpapiere entsprechen.

Gegenparteien, Art und Höhe der entgegengenommenen Sicherheiten aus OTC-Derivaten:

Stichtag: 30.9.2024	Swiss Life iFunds (CH) Bond Swiss Francs Foreign (CHF)	Swiss Life iFunds (CH) Bond Global Government + (CHF hedged)	Swiss Life iFunds (CH) Bond Global Corporates (CHF hedged)	Swiss Life iFunds (CH) Bond Swiss Francs Domestic (CHF)
Währung:	CHF	CHF	CHF	CHF
Gegenparteien und Kurswert der OTC Derivate				
Credit Agricole Corp	-	-65 355.85	541 372.88	-
Goldman Sachs	-	-871 047.14	-	-
HSBC Bank	-	-1 336 359.99	-	-
JP Morgan	-	-	-	-
LCH Group Holdings	332 856.46	-1 064 504.00	-	-1 417 112.61
Merrill Lynch	-	3 371.06	191 542.83	-
UBS AG	-4 252.02	2 161 675.14	7 119 149.51	-15 915.22
Zuercher Kantonalbank	-	20 931.80	-1 302 696.26	-
Art und Höhe der entgegengenommenen Sicherheiten:				
- Anleihen	-	-	-	-
- Aktien	-	-	-	-
- Barmittel	-	-	-	-
- Anlagefonds	-	-	-	-
- Geldmarktanlagen	-	-	-	-
- Übrige Sicherheiten	-	-	-	-
Total entgegengenommenen Sicherheiten	-	-	-	-

Stichtag: 30.9.2024	Swiss Life iFunds (CH) Bond Global Corporates Short Term (CHF hedged)	Swiss Life iFunds (CH) Bond Global Aggregate (CHF hedged)
Währung:	CHF	CHF
Gegenparteien und Kurswert der OTC Derivate		
Credit Agricole Corp	1 381 404.28	-
Goldman Sachs	-	-56 649.67
HSBC Bank	-	-
JP Morgan	-	-
LCH Group Holdings	-	-
Merrill Lynch	17 827 086.32	188 278.00
UBS AG	5 853 453.97	-412 133.80
Zuercher Kantonalbank	740 566.97	-
Art und Höhe der entgegengenommenen Sicherheiten:		
- Anleihen	-	-
- Aktien	-	-
- Barmittel	-	-
- Anlagefonds	-	-
- Geldmarktanlagen	-	-
- Übrige Sicherheiten	-	-
Total entgegengenommenen Sicherheiten	-	-

Effektenleihe und Sicherheiten

Berichtszeitraum: 1. Oktober 2023 - 30. September 2024	Swiss Life iFunds (CH) Equity Switzerland Small & Mid Cap (CHF)	Swiss Life iFunds (CH) Bond Swiss Francs Foreign (CHF)	Swiss Life iFunds (CH) Bond Global Government + (CHF hedged)	Swiss Life iFunds (CH) Bond Global Corporates (CHF hedged)
Kontrahentenrisiko aus der Effektenleihe per 30. September 2024				
UBS AG				
- Marktwert der verliehenen Effekten	20 807 710.23 CHF	32 571 749.90 CHF	175 347 803.66 CHF	104 987 587.79 CHF
- Sicherheiten	22 098 420.85 CHF	34 450 283.27 CHF	184 215 193.58 CHF	110 487 259.14 CHF
Aufschlüsselung der Sicherheiten (Gewichtung in %) per 30. September 2024				
nach Art der Vermögenswerte:				
- Anleihen	100.00	100.00	96.22	100.00
- Aktien	0.00	0.00	3.78	0.00
- Geldmarktanlagen	-	-	-	-
Effektenleihe				
Erträge aus der Effektenleihe	33 577.34 CHF	72 655.20 CHF	232 373.37 CHF	405 432.19 CHF
Operative Kosten der Effektenleihe	10 073.20 CHF	21 796.56 CHF	69 712.01 CHF	121 629.66 CHF
Fondserträge aus der Effektenleihe	23 504.14 CHF	50 858.64 CHF	162 661.36 CHF	283 802.53 CHF

Berichtszeitraum: 1. Oktober 2023 - 30. September 2024	Swiss Life iFunds (CH) Bond Swiss Francs Domestic (CHF)	Swiss Life iFunds (CH) Equity Switzerland (CHF)	Swiss Life iFunds (CH) Bond Global Corporates Short Term (CHF hedged)
Kontrahentenrisiko aus der Effektenleihe per 30. September 2024			
UBS AG			
- Marktwert der verliehenen Effekten	77 375 019.76 CHF	6 405 212.90 CHF	88 636 905.59 CHF
- Sicherheiten	81 493 700.55 CHF	6 825 464.54 CHF	93 168 674.94 CHF
Aufschlüsselung der Sicherheiten (Gewichtung in %) per 30. September 2024			
nach Art der Vermögenswerte:			
- Anleihen	92.86	100.00	96.22
- Aktien	7.14	0.00	3.78
- Geldmarktanlagen	-	-	-
Effektenleihe			
Erträge aus der Effektenleihe	195 786.23 CHF	18 192.83 CHF	253 893.76 CHF
Operative Kosten der Effektenleihe	58 735.87 CHF	5 457.85 CHF	76 168.13 CHF
Fondserträge aus der Effektenleihe	137 050.36 CHF	12 734.98 CHF	177 725.63 CHF

Der Marktwert der verliehenen Effekten sowie die Werte der erhaltenen Sicherheiten für ausgeliehene Wertschriften in der Tabelle Effektenleihe und Sicherheiten beziehen sich auf die Daten der Depotbank per Monatsultimo.

Die Ausgleichszahlungen und die Kommissionserträge aus Effektenleihe in den Erfolgsrechnungen sowie die im Inventar ausgewiesenen, ausgeliehenen Werte stammen hingegen aus der Wertschriftenbuchhaltung. Die Wertschriftenbuchhaltung verbucht die ausgeliehenen Wertschriften an T+1 gegenüber der Depotbank.

Sonstige Informationen

Bericht des Portfoliomanagers (ungeprüft)

Swiss Life iFunds (CH) Equity Switzerland Small & Mid Cap (CHF)

Die Schweizer Small & Mid Caps starteten turbulent in die Berichtsperiode. Im Oktober 2023 zeichnete sich eine Eintrübung der Weltwirtschaft ab und gleichzeitig hatten die Zinsen weiter zugelegt, was die Korrektur an den Aktienmärkten verstärkte. Ab November erholten sich die Aktienmärkte dann wieder deutlich dank dem Rückgang der Zinsen. Schwächere Quartalsabschlüsse bei Unternehmen bestätigten jedoch insgesamt die Konjunkturabschwächung. Der positiven Stimmung an den Finanzmärkten konnte dies aber nichts anhaben, setzte sich die Hausse doch auch nach dem Jahreswechsel ins 2024 nahtlos fort. Die Aussicht auf baldige Zinssenkungen sowie erfreuliche Wirtschafts- und Arbeitsmarktdaten aus den USA trieben die Aktienkurse auch in der Schweiz weiter in die Höhe. Der SPI Extra Index stieg von den Tiefstwerten im Oktober bis in den Sommer 2024 gegen 20%, bevor schwache Arbeitsmarktdaten in den USA und vor allem die Zinserhöhung der japanischen Notenbank die Märkte auf eine kurze, aber rasante Talfahrt schickte. Der SPI Extra Index erholte sich jedoch rasch und konnte das Berichtsjahr mit +12.27% beenden. Insgesamt war das Umfeld geprägt von grossen geopolitischen und wirtschaftspolitischen Unsicherheiten. Die Unternehmen mussten sich nach den Lieferketten-Problemen im Vorjahr mit zu hohen Lagenbeständen bei ihren Kunden und daher mit rückläufigen Bestellungseingängen auseinandersetzen. Auch die inflationsbedingten Preissteigerungen mussten absorbiert werden. Im Portfolio kam es zu folgenden Veränderungen. Sandoz, ein führender Generikahersteller wurde mittels Spin-off aus dem Novartis Konzern gelöst und notiert seither als eigenständige Firma an der Schweizer Börse. Sandoz ist Teil des SPI Extra Index und wurde als defensiver Wert neu ins Portfolio aufgenommen. Am IPO von Galderma, einem Dermatologie Unternehmen, welches ursprünglich zu Nestlé gehörte, wurde partizipiert und der Titel wurde in der Folge mehrmals aufgestockt. Die kleinen Positionen in Crealogix und Schweiter wurden gegen Ende 2023 verkauft.

Einen positiven Einfluss auf die relative Performance des Fonds hatten im Portfolio übergewichtete Titel wie Comet, Arbonia, Sulzer, Siegfried, Belimo, Swissquote und VAT sowie untergewichtete oder nicht enthaltene Titel wie Meyer Burger, ams-Osram und Stadler Rail. Einen negativen Einfluss auf die relative Performance hatten die übergewichteten Positionen wie BKW, SoftwareOne, Forbo, Bystronic, Orior und Medmix sowie nicht vertretene Titel wie Accelleron, VZ Holding und Dormakaba.

Swiss Life iFunds (CH) Bond Swiss Francs Foreign (CHF)

Im Auslandssegment fiel die absolute Rendite klar positiv aus und es konnte eine deutliche Überrendite erzielt werden. Dies ist vor allem auf eine Auswahl von Anleihen zurückzuführen, die eine Überrendite erzielen konnten. Zudem trug die Übergewichtung bestimmter Sektoren positiv zum relativen Gesamtergebnis bei. Der Einfluss aufgrund der Positionierung auf der Zinskurve war hingegen neutral.

Swiss Life iFunds (CH) Bond Global Government + (CHF hedged)

Erhöhte Volatilität an den Zinsmärkten haben das vergangene Geschäftsjahr geprägt. Der Zinserhöhungszyklus der grössten Zentralbanken war bereits abgeschlossen. Die Leitzinsen wurden unverändert auf erhöhten Niveaus gehalten, bis sich die Inflation in den entsprechenden Ländern etwas erholt hatte und die Inflationserwartungen auf akzeptable Niveaus zurückkehrten. Die EZB vollzog den ersten Zinsschritt im Juni 2024, woraufhin auch andere Zentralbanken (BoE, Fed) mit dem Zinssenkungszyklus begannen. Während die EZB wie auch die BoE vorsichtig agierten und den Leitzins zu Beginn um lediglich 25 BP reduzierten, legte die Fed etwas überraschend einen aggressiveren Start hin. Mit 50 BP Zinsreduktion wollte die Fed den schwächelnden US-Arbeitsmarkt, welcher kurzfristig für erhöhte Nervosität am Markt sorgte, unterstützen. Die Bank of Japan, die sich in einer anderen Phase im Wirtschaftszyklus befindet, erhöhte ihren Leitzins um 25 BP. Dies führte zu stärkeren Turbulenzen am Markt, die JPY-Schwäche konnte allerdings dadurch etwas reduziert werden. Die ökonomischen Daten aus den USA zeigten nach wie vor ein stabiles Bild. Die Möglichkeit eines sogenannten «Soft Landing» rückte in den Vordergrund. Eine ähnliche Entwicklung konnte im UK beobachtet werden. Politische Unsicherheiten aufgrund von Neuwahlen in Frankreich und die damit verbundenen

Sorgen betreffend das Haushaltsbudget lösten stärkere Marktbewegungen innerhalb von Europa aus. Dies führte zu einer Ausweitung des OAT/Bund-Spreads. Neu erreichte Eskalationsstufen im Nahostkonflikt und der andauernde Krieg zwischen Russland und der Ukraine führten ebenfalls zu erhöhter Volatilität. Getrieben durch akkommodativere Zentralbanken gepaart mit tieferen Inflationserwartungen sanken die Zinsen in den Hauptwährungen über die gesamte Kurve hinweg und die Zinskurven wurden steiler. Einzig in Japan konnte man über die gesamte JPY-Kurve steigende Zinsen beobachten.

Die absolute Performance fiel aufgrund der tieferen Zinsen positiv aus. Die relative Performance der Anlagegruppe gegenüber der Benchmark war ebenfalls positiv. Der grösste positive Beitrag stammte aus der «Long»-Durationpositionierung in AUD/GBP/EUR/USD. Ebenso leistete unser Über-gewicht in EUR Core SSA einen positiven Beitrag.

Swiss Life iFunds (CH) Bond Global Corporates (CHF hedged)

Das Geschäftsjahr 2023/2024 zeichnete sich durch eine überdurchschnittliche positive absolute Performance der Anlagegruppe aus, die zudem die Benchmark übertraf. Wesentliche Treiber dieser Entwicklung waren der anhaltende Zinsrückgang und die kontinuierliche Verengung der Kreditspannen im Laufe des Berichtszeitraums. Nach einem vorübergehenden Abflauen der Inflation per drittem Quartal 2023 war dann wieder zu Beginn 2024 die immer wieder aufkeimende Inflation das grosse Thema. Erwartete Zinssenkungen in den USA und der Eurozone rückten in den Hintergrund, stattdessen setzte sich das Narrativ von «higher for longer» durch. Infolgedessen stiegen die Zinsen in US-Dollar und Euro im ersten Halbjahr 2024 kontinuierlich an und erreichten im zweiten Quartal 2024 ihre Höchststände. Erst mit dem deutlichen Rückgang der Inflation im zweiten Quartal kam es zu einer Entspannung am Zinsmarkt. Die Europäische Zentralbank (EZB) initiierte im Juni 2024 den ersten Zinsschritt, gefolgt von einer etwas überraschenden Zinssenkung der Federal Reserve (Fed) um 50 Basispunkte (BP) im September. Die US-Wirtschaftsdaten zeichneten weiterhin ein robustes Bild. In Kombination mit dem Zinssenkungszyklus verstärkte sich die Erwartung eines sogenannten «Soft Landing». Dieses Umfeld begünstigte den Kreditmarkt, was sich in einer kontinuierlichen Verengung der Kreditspanne über das restliche Geschäftsjahr widerspiegelte. Die unerwartete Leitzinserhöhung der Bank of Japan um 25 BP im Juli führte zu kurzfristigen Marktverwerfungen. Die Kreditspannen weiteten sich kurzzeitig aus, verengten sich jedoch bis zum Ende des Geschäftsjahres wieder.

Swiss Life iFunds (CH) Bond Swiss Francs Domestic (CHF)

Das Geschäftsjahr 2023/2024 war wiederum geprägt von sehr volatilen CHF-Zinsmärkten. Über den gesamten Zeitraum gesehen, bewegte sich zum Beispiel die zehnjährige Anleihe der Schweizerischen Eidgenossenschaft in einer Bandbreite von ca. 0.3% bis 1.2%. Im vierten Quartal 2023 setzte aufgrund rückläufiger Inflation und der gesteigerten Erwartung an frühere Leitzinssenkungen ein markanter Zinsrückgang am CHF-Kapitalmarkt ein. Im ersten Quartal 2024 kam es zunächst zu einer Trendumkehr mit steigenden Zinsen bis Mitte Februar, bevor die CHF-Zinsen abermals zurückgingen. Zusätzlich überraschte die SNB mit einer Zinssenkung im März 2024. Nach einem leichten Zinsanstieg im Mai 2024 erfolgte anschliessend ein steter Rückgang der CHF-Zinsen bis zum Ende des Geschäftsjahres, der durch zwei weitere Zinssenkungen der SNB verstärkt wurde.

Im Geschäftsjahr 2023/2024 fiel die absolute Performance der Anlagegruppe deutlich positiv aus und es konnte ausserdem eine Überrendite im Vergleich zur Benchmark erzielt werden. Diese Überrendite wurde in erster Linie durch die Übergewichtung des Kreditrisikos und bestimmter Sektoren erzielt, die von einem Rückgang des Kreditrisikos profitieren konnten. Die Positionierung auf der Zinskurve lieferte hingegen einen negativen Beitrag zur relativen Rendite.

Swiss Life iFunds (CH) Equity Switzerland (CHF)

Der Anlagefonds investiert passiv in den Referenzindex SPI 20.

Während der Berichtsperiode betrug der Two-Way Turnover der Benchmark SPI 20 5.936%.

Insgesamt 1 Neuaufnahme, 1 Streichung und 17 andere Veränderungen (Anzahl ausstehender Aktien, Streubesitzfaktoren) berechnet für einen One-Way Turnover von 0.876%, 0.885%, beziehungsweise 1.870%.

Diese Zahlen können wie folgt aufgeteilt werden:

- Die Umschichtung, welche am **15. Dezember 2023** stattfand, erzeugte einen Two-Way Turnover von 0.578% mit 5 signifikanten Veränderungen (0.414%). Es gab weder Neuaufnahmen noch Streichungen.
- Die Umschichtung, welche am **15. März 2024** stattfand, erzeugte einen Two-Way Turnover von 0.916% mit 4 signifikanten Veränderungen (0.904%). Es gab weder Neuaufnahmen noch Streichungen.

- Die Umschichtung, welche am **21. Juni 2024** stattfand, erzeugte einen Two-Way Turnover von 0.653% mit 5 signifikanten Veränderungen (0.388%). Es gab weder Neuaufnahmen noch Streichungen.
- Die Umschichtung, welche am **20. September 2024** stattfand, erzeugte einen Two-Way Turnover von 0.267% mit 3 signifikanten Veränderungen (0.164%). Es gab weder Neuaufnahmen noch Streichungen.

Ohne Berücksichtigung der Umschichtungen lag der Two-Way Turnover bei 3.522% mit 1 Neuaufnahme (0.876%) und 1 Streichung (0.885%). Diese Neuaufnahme bzw. Streichung bezieht sich auf Sandoz und erfolgte Ende September 2023 nach dem Spin-off von Novartis.

Die **grössten Titelgewichtserhöhungen** auf Tagesbasis lagen bei:

SANDOZ GROUP N (0.876%; 03.10.2023)

UBS GROUP N (0.391%; 15.03.2024)

NESTLE N (0.211%; 04.10.2023)

RICHEMONT N (0.149%; 15.12.2023)

NOVARTIS N (0.142%; 04.10.2023)

Die **grössten Titelgewichtsreduzierungen** auf Tagesbasis lagen bei:

SANDOZ GROUP N (-0.885%; 04.10.2023)

NOVARTIS N (-0.445%; 15.03.2024)

NESTLE N (-0.273%; 21.06.2024)

NESTLE N (-0.206%; 03.10.2023)

NOVARTIS N (-0.146%; 03.10.2023)

Swiss Life iFunds (CH) Bond Global Corporates Short Term (CHF hedged)

Kurzfristige Unternehmensanleihen verzeichneten im Berichtszeitraum eine erfreuliche Ertragsentwicklung. Das Geschäftsjahr 2023/2024 war geprägt von einer Reihe von Zinssenkungen, die in Kombination mit robusten US- Wirtschaftsdaten eine Einengung der Kreditspanne begünstigten. Mit dem deutlichen Rückgang der Inflation im zweiten Quartal 2024 leiteten die Zentralbanken den Zinssenkungszyklus ein. Die Europäische Zentralbank (EZB) initiierte im Juni 2024 den ersten Zinsschritt, gefolgt von einer etwas überraschenden Zinssenkung der Federal Reserve (Fed) um 50 Basispunkte (BP) im September. Lediglich die unerwartete Leitzinserhöhung der Bank of Japan um 25 BP im Juli führte zu kurzfristigen Marktverwerfungen. Bis zum Ende des Geschäftsjahres verengten sich die Kreditspannen jedoch wieder.

Swiss Life iFunds (CH) Bond Global Aggregate (CHF hedged)

Der Zielfonds der Anlagegruppe investiert in Staats- und Unternehmensanleihen. Die absolute Performance der Anlagegruppe war aufgrund des Zinsanstiegs negativ. Aus relativer Sicht fiel das Ergebnis ebenfalls negativ aus. Der negative Beitrag von Unternehmensanleihen zur aktiven Rendite konnte durch den positiven Beitrag der Staatsanleihen zur aktiven Rendite jedoch nicht vollständig kompensiert werden.