

Swiss Life Funds (CH) – iDynamic Light (CHF hedged)

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

Halbjahresbericht per 30. September 2024

Ungeprüfter Halbjahresbericht per 30. September 2024

Inhaltsverzeichnis	Seite	ISIN
Organisation	2	
Swiss Life Funds (CH)		
– iDynamic Light (CHF hedged)	4	A1/ CH0111458680 A2/ CH0261124199

Verkaufsrestriktionen

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

- a) Für folgende Länder liegt eine Bewilligung für die Vertriebstätigkeit vor: -Schweiz
- b) Anteile dieses Anlagefonds 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
Bahnhofstrasse 45
8001 Zürich

Prüfgesellschaft

PricewaterhouseCoopers AG
Birchstrasse 160
8050 Zürich

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

Swiss Life Funds (CH) – iDynamic Light (CHF hedged)

Art übrige Fonds für traditionelle Anlagen

Wichtigste Daten

	ISIN	30.9.2024	31.3.2024	31.3.2023
Nettofondsvermögen in CHF		829 827 833.43	846 151 535.15	886 637 925.38
Klasse A1	CH0111458680			
Nettoinventarwert pro Anteil in CHF		110.20	108.36	106.71
Anzahl Anteile im Umlauf		3 336 646.5460	3 663 427.4280	4 301 767.0340
Klasse A2	CH0261124199			
Nettoinventarwert pro Anteil in CHF		109.16	107.16	104.69
Anzahl Anteile im Umlauf		4 233 544.7790	4 191 430.1200	4 084 486.6590

Struktur des Wertpapierportfolios

Aufteilung nach Risikodomizil in % des Gesamtfondsvermögens	
Global	38.22
Vereinigte Staaten von Amerika	24.44
Deutschland	15.34
Eurozone	12.30
Total	90.30

Obige Prozentsätze können Rundungsdifferenzen enthalten.

Vermögensrechnung

	30.9.2024	31.3.2024
	CHF	CHF
Verkehrswerte		
Bankguthaben		
– auf Sicht	62 506 472.06	54 384 508.11
Effekten		
– Obligationen, Wandelobligationen, Optionsanleihen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte	334 969 593.42	346 083 484.83
– Anteile anderer kollektiver Kapitalanlagen	425 409 441.25	456 658 429.91
Derivative Finanzinstrumente	13 825 334.64	-12 293 110.10
Sonstige Vermögenswerte	5 352 391.89	3 487 556.72
Gesamtfondsvermögen	842 063 233.26	848 320 869.47
Kurzfristige Bankverbindlichkeiten	-10 328 311.62	-264 100.00
Andere Verbindlichkeiten	-1 907 088.21	-1 905 234.32
Nettofondsvermögen	829 827 833.43	846 151 535.15

Erfolgsrechnung

	1.4.2024-30.9.2024	1.4.2023-31.3.2024
	CHF	CHF
Ertrag		
Erträge der Bankguthaben	828 899.66	1 690 023.95
Erträge der Effekten		
– aus Obligationen, Wandelobligationen, Optionsanleihen und sonstigen Forderungswertpapieren und -rechten	4 525 976.24	7 278 644.73
– aus Anteilen anderer kollektiver Kapitalanlagen	0.00	5 188 066.14
Ausgleichszahlungen aus Effektenleihe	591 785.36	1 585 498.98
Erträge der Effektenleihe	67 347.00	152 747.50
Einkauf in laufende Nettoerträge bei der Ausgabe von Anteilen	22 224.32	67 985.88
Total Ertrag	6 036 232.58	15 962 967.18
Aufwand		
Passivzinsen	-467.69	-5 880.01
Prüfaufwand	0.00	-15 885.75
Reglementarische Kommissionsvergütung an die Fondsleitung Klasse A1	-2 689 400.67	-5 833 682.52
Reglementarische Kommissionsvergütung an die Fondsleitung Klasse A2	-1 088 005.58	-2 025 277.16
Reglementarische Kommissionsvergütung an die Depotbank	-26 881.15	-76 289.64
Sonstige Aufwendungen	-225.60	-4 179.65
Ausrichtung laufender Nettoerträge bei der Rücknahme von Anteilen	-16 723.78	26 700.72
Total Aufwand	-3 821 704.47	-7 934 494.01
Nettoertrag	2 214 528.11	8 028 473.17
Realisierte Kapitalgewinne und -verluste	-1 985 590.07	13 582 108.71
Realisierter Erfolg	228 938.04	21 610 581.88
Nicht realisierte Kapitalgewinne und -verluste	16 990 376.80	-5 158 585.36
Gesamterfolg	17 219 314.84	16 451 996.52

Veränderung des Nettofondsvermögens

	1.4.2024-30.9.2024	1.4.2023-31.3.2024
	CHF	CHF
Nettofondsvermögen zu Beginn des Rechnungsjahres	846 151 535.15	886 637 925.38
Abgeführte Verrechnungssteuer	-2 780 364.06	-621 302.42
Saldo aus dem Anteilverkehr	-30 762 652.50	-56 317 084.33
Gesamterfolg	17 219 314.84	16 451 996.52
Nettofondsvermögen am Ende der Berichtsperiode	829 827 833.43	846 151 535.15

Entwicklung der Anteile im Umlauf

	1.4.2024-30.9.2024	1.4.2023-31.3.2024
	Anzahl	Anzahl
Klasse A1		
Bestand Anfang Rechnungsjahr	3 663 427.4280	4 301 767.0340
Ausgegebene Anteile	9 183.1830	20 791.5260
Zurückgenommene Anteile	-335 964.0650	-659 131.1320
Bestand Ende Berichtsperiode	3 336 646.5460	3 663 427.4280
Differenz zwischen den ausgegebenen und zurückgenommenen Anteilen	-326 780.8820	-638 339.6060
Klasse A2		
Bestand Anfang Rechnungsjahr	4 191 430.1200	4 084 486.6590
Ausgegebene Anteile	86 095.8610	204 929.4620
Zurückgenommene Anteile	-43 981.2020	-97 986.0010
Bestand Ende Berichtsperiode	4 233 544.7790	4 191 430.1200
Differenz zwischen den ausgegebenen und zurückgenommenen Anteilen	42 114.6590	106 943.4610

Inventar des Fondsvermögens

Titel	31.3.2024 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

Anleihen, fester Zins

EUR

GERMANY, REPUBLIC OF-REG-S 2.10000% 22-15.11.29*	EUR	43 000 000		43 000 000	40 780 201	4.84	42 800 000
GERMANY, REPUBLIC OF-REG-S 6.25000% 00-04.01.30*	EUR	35 000 000		35 000 000	39 922 181	4.74	
GERMANY, REPUBLIC OF-REG-S 5.50000% 00-04.01.31*	EUR	20 000 000		20 000 000	22 697 875	2.70	15 400 000
Total EUR					103 400 258	12.28	

Total Anleihen, fester Zins

103 400 258 12.28

Anleihen, Nullcoupon

EUR

GERMANY, REPUBLIC OF-REG-S 0.00000% 19-15.08.29*	EUR	30 000 000		30 000 000	25 788 410	3.06	29 912 620
Total EUR					25 788 410	3.06	

Total Anleihen, Nullcoupon

25 788 410 3.06

Treasury-Notes, fester Zins

USD

AMERICA, UNITED STATES OF 2.75000% 18-15.02.28*	USD	20 000 000		20 000 000	16 428 136	1.95	11 750 000
AMERICA, UNITED STATES OF 2.87500% 18-15.05.28*	USD	20 000 000		20 000 000	16 468 337	1.96	17 686 000
AMERICA, UNITED STATES OF 0.87500% 20-15.11.30*	USD	25 000 000		25 000 000	17 948 503	2.13	
AMERICA, UNITED STATES OF 0.75000% 21-31.01.28*	USD	50 000 000	50 000 000				
AMERICA, UNITED STATES OF 1.12500% 21-15.02.31*	USD		50 000 000	50 000 000	36 269 355	4.31	8 750 000
AMERICA, UNITED STATES OF 3.87500% 23-31.12.29*	USD	23 000 000		23 000 000	19 654 781	2.33	
AMERICA, UNITED STATES OF 3.62500% 23-31.03.30*	USD	20 000 000		20 000 000	16 882 203	2.00	875 000
AMERICA, UNITED STATES OF 3.75000% 23-30.06.30*	USD	38 000 000		38 000 000	32 265 260	3.83	19 470 000
AMERICA, UNITED STATES OF 4.12500% 23-31.08.30*	USD	38 000 000		38 000 000	32 893 837	3.91	
AMERICA, UNITED STATES OF 3.75000% 24-31.12.30*	USD	20 000 000		20 000 000	16 970 513	2.02	540 000
Total USD					205 780 926	24.44	

Total Treasury-Notes, fester Zins

205 780 926 24.44

Total Effekten, die an einer Börse gehandelt werden

334 969 593 39.78

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

Investmentzertifikate, open end

Eurozone

SWISS LIFE FUNDS (F) MONEY MARKET EURO I**	EUR	4 370	200	4 170	103 547 740	12.30	
Total Eurozone					103 547 740	12.30	

Global

AMUNDI EURO LIQUIDITY-RATED SRI-PARTS -I-**	EUR	72		72	75 204 730	8.93	
BNP PARIBAS ASSET MANAGEMENT - BNP PARIBAS MONEY 3M-IC-3 DEC**	EUR	4 575		4 575	105 327 559	12.51	
LO FUNDS - SHORT-TERM MONEY MARKET USD-SHS -N- CAP**	USD	5 150 000		5 150 000	54 234 892	6.44	
LOMBARD ODIER FDS SICAV - SHORT-TERM MONEY MARKET CHF-N-CAP**	CHF	245 000		245 000	30 759 309	3.65	
SWISS LIFE FUNDS (CH) MONEY MARKET SWISS FRANCS A CAP**	CHF		230 000	230 000	23 478 308	2.79	
SWISSCANTO LU MONEY MARKET FUND CHF-D-CAP**	CHF	50 000		50 000	4 904 039	0.58	
SYZ AM CH LIQUIDITY MANAGEMENT-CHF-I3-DISTRIBUTION**	CHF	81 500	50 000	31 500	27 952 866	3.32	
Total Global					321 861 703	38.22	

Total Investmentzertifikate, open end

425 409 442 50.52

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

425 409 442 50.52

Total Wertschriften

(davon ausgeliehen)

760 379 035 90.30

133 434 765 15.85)

Bankguthaben auf Sicht

62 506 472 7.42

Derivative Finanzinstrumente

13 825 335 1.64

Sonstige Vermögenswerte

5 352 391 0.64

Gesamtfondsvermögen

842 063 233 100.00

Kurzfristige Bankverbindlichkeiten

-10 328 312

Andere Verbindlichkeiten

-1 907 088

Nettofondsvermögen

829 827 833

Bewertungskategorie

Verkehrswert per
30.9.2024
in %
des Gesamt-
fondsvermögens³

Anlagen bewertet zu den Kursen, die am Hauptmarkt bezahlt werden	342 535 004	40.68
Anlagen bewertet aufgrund von am Markt beobachtbaren Parametern	431 669 366	51.26
Anlagen bewertet mit geeigneten Bewertungsmodellen unter Berücksichtigung der aktuellen Marktgegebenheiten	-	-
Total	774 204 370	91.94

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 Indices/Commodities/Währungen					
EURO STOXX 50 INDEX FUTURE 20.12.24*	1 620	EUR	76 714 504	2 569 860	0.31
SWISS MARKET INDEX FUTURE 20.12.24*	675	CHF	82 390 500	1 147 500	0.14
FTSE 100 INDEX FUTURE 20.12.24*	170	GBP	15 943 285	-100 024	-0.01
S&P500 EMINI FUTURE 20.12.24*	270	USD	66 212 243	1 406 978	0.17
MINI MSCI EMERGING MARKETS INDEX FUTURE 20.12.24*	180	USD	8 903 080	542 824	0.05
			259 163 612	5 567 138	0.66

Instrument	Anzahl Kontrakte	Währung	Deckung in CHF	Variation Margin in CHF	In % des Vermögens
Futures auf Zinsinstrumente/Obligationen					
EURO-BUND FUTURE 06.12.24*	490	EUR	62 239 615	913 389	0.11
EURO-BOBL FUTURE 06.12.24*	535	EUR	60 465 887	659 811	0.08
US 10YR TREASURY NOTE FUTURE 19.12.24*	1 200	USD	115 682 338	371 692	0.04
US 5YR TREASURY NOTE FUTURE 31.12.24*	225	USD	20 855 620	53 381	0.01
			259 243 460	1 998 273	0.24

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	210 000 000	CHF	179 631 900	24.10.2024	2 970 281	0.35
EUR	275 000 000	CHF	260 334 718	21.11.2024	2 404 627	0.29
USD	110 000 000	CHF	92 538 578	27.11.2024	351 840	0.04
EUR	180 000 000	CHF	169 711 200	23.10.2024	533 176	0.06
					6 259 924	0.74

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 engagementerhöhende Derivate

Instrument	Währung	Käufe/ Kontrakte	Verkäufe/ Kontrakte
Futures auf Indices/Commodities/Währungen			
EURO STOXX 50 INDEX FUTURE 21.06.24	EUR	120	1 540
EURO STOXX 50 INDEX FUTURE 20.09.24	EUR	1 670	1 670
EURO STOXX 50 INDEX FUTURE 20.12.24	EUR	1 620	0
SWISS MARKET INDEX FUTURE 21.06.24	CHF	0	695
SWISS MARKET INDEX FUTURE 20.09.24	CHF	675	675
SWISS MARKET INDEX FUTURE 20.12.24	CHF	675	0
FTSE 100 INDEX FUTURE 21.06.24	GBP	0	210
FTSE 100 INDEX FUTURE 20.09.24	GBP	170	170
FTSE 100 INDEX FUTURE 20.12.24	GBP	170	0
MINI MSCI EMERGING MARKETS INDEX FUTURE 21.06.24	USD	100	300
MINI MSCI EMERGING MARKETS INDEX FUTURE 20.09.24	USD	300	300
S&P500 EMINI FUTURE 20.09.24	USD	270	270
NIKKEI 225 (OSE) INDEX FUTURE 13.06.24	JPY	0	50
S&P500 EMINI FUTURE 21.06.24	USD	0	330
NIKKEI 225 (OSE) INDEX FUTURE 12.09.24	JPY	35	35
S&P500 EMINI FUTURE 20.12.24	USD	270	0
MINI MSCI EMERGING MARKETS INDEX FUTURE 20.12.24	USD	180	0
Futures auf Zinsinstrumente/Obligationen			
EURO-BUND FUTURE 06.06.24	EUR	0	500
EURO-BOBL FUTURE 06.06.24	EUR	0	535
EURO-BUND FUTURE 06.09.24	EUR	590	590
EURO-BOBL FUTURE 06.09.24	EUR	535	535
EURO-BUND FUTURE 06.12.24	EUR	490	0
EURO-BOBL FUTURE 06.12.24	EUR	535	0
US 10YR TREASURY NOTE FUTURE 18.06.24	USD	0	1 230
US 5YR TREASURY NOTE FUTURE 28.06.24	USD	0	125
US 10YR TREASURY NOTE FUTURE 19.12.24	USD	1 200	0
US 10YR TREASURY NOTE FUTURE 19.09.24	USD	1 300	1 300
US 5YR TREASURY NOTE FUTURE 30.09.24	USD	225	225
US 5YR TREASURY NOTE FUTURE 31.12.24	USD	225	0

Während der Berichtsperiode getätigte Derivate auf Devisen

Verkauf Währung	Verkauf Betrag	Kauf Währung	Kauf Betrag	Fälligkeit
Devisentermingeschäfte				
EUR	180 000 000	CHF	166 956 768	05.04.2024
USD	220 000 000	CHF	193 427 080	19.04.2024
CHF	4 546 562	USD	5 000 000	19.04.2024
EUR	270 000 000	CHF	257 774 400	24.05.2024
CHF	4 865 165	EUR	5 000 000	24.05.2024
USD	105 000 000	CHF	91 082 093	27.06.2024
CHF	4 512 412	USD	5 000 000	27.06.2024
EUR	185 000 000	CHF	179 750 625	11.07.2024

Verkauf Währung	Verkauf Betrag	Kauf Währung	Kauf Betrag	Fälligkeit
CHF	4 888 667	EUR	5 000 000	11.07.2024
USD	210 000 000	CHF	188 739 180	09.08.2024
EUR	270 000 000	CHF	265 847 400	22.08.2024
USD	100 000 000	CHF	88 617 300	06.09.2024
USD	10 000 000	CHF	8 584 510	06.09.2024
EUR	180 000 000	CHF	173 931 552	26.09.2024
EUR	180 000 000	CHF	169 711 200	23.10.2024
USD	210 000 000	CHF	179 631 900	24.10.2024
EUR	275 000 000	CHF	260 334 718	21.11.2024
USD	110 000 000	CHF	92 538 578	27.11.2024

Ergänzende Angaben

Derivative Finanzinstrumente

Risikomessverfahren Commitment-Ansatz II:
Art. 35ff KKV-FINMA

Per Bilanzstichtag waren keine Kontrakte in derivativen Finanzinstrumenten offen.

Pensionsgeschäfte

Die Fondsleitung tätigt keine Pensionsgeschäfte.

Vergütung an die Fondsleitung

Verwaltungskommission

- Effektiv erhobene Verwaltungskommission:
 - Klasse A1: 1.401125% p.a.;
 - Klasse A2: 0.473625% p.a.;
- Maximale Verwaltungskommission gemäss Fondsvertrag:
 - Klasse A1: 2.00% p.a.;
 - Klasse A2: 0.48% p.a.;
- Effektiv erhobene Depotbankkommission für beide Klassen: 0.006375% p.a.;
- Maximale Depotbankkommission für beide Klassen gemäss Fondsvertrag: 0.25% p.a.

Die Verwaltungskommission der Zielfonds, in die investiert wird, darf unter Berücksichtigung von allfälligen Rückvergütungen höchstens 3% betragen. Die maximale effektive Verwaltungskommission der Zielfonds beträgt 0.26%.

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 A1:	1.42%
Klasse A2:	0.48%

Zusammengesetzte TER für die letzten 12 Monate:

Klasse A1:	1.49%
Klasse A2:	0.55%

Umrechnungskurse

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

(OTC-)Derivate und Effektenleihe

Führt der Anlagefonds 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 der Anlagefonds 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 Anlagefonds ein Wertpapier gemäss einer anwendbaren Vereinbarung geschuldet wird, wird dieses Wertpapier in einer Depotbank/Verwahrstelle für den Anlagefonds 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 Anlagefonds in Zusammenhang mit dem Wertpapier verzögert, eingeschränkt oder sogar ausgeschlossen werden könnten, was den Anlagefonds 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 Funds (CH) – iDynamic Light (CHF hedged)
Währung:	CHF
Gegenparteien und Kurswert der OTC Derivate	
Merrill Lynch	2 756 466.69
UBS AG	2 970 281.46
Zuercher Kantonalbank	533 175.35
Art und Höhe der entgegengenommenen Sicherheiten:	
– Anleihen	-
– Aktien	-
– Barmittel	-
– Anlagefonds	-
– Geldmarktanlagen	-
– Übrige Sicherheiten	-
Total entgegengenommene Sicherheiten	-

Effektenleihe und Sicherheiten

Berichtszeitraum:	
1. April 2024 -	Swiss Life Funds (CH)
30. September 2024	– iDynamic Light (CHF hedged)
Kontrahentenrisiko aus der Effektenleihe per 30. September 2024	
UBS AG	
– Marktwert der verliehenen Effekten	133 434 765.26 CHF
– Sicherheiten	140 206 815.17 CHF
Aufschlüsselung der Sicherheiten (Gewichtung in %) per 30. September 2024	
nach Art der Vermögenswerte:	
– Anleihen	99.52
– Aktien	0.48
Effektenleihe	
Erträge aus der Effektenleihe	96 210.00 CHF
Operative Kosten der Effektenleihe	28 863.00 CHF
Fondserträge aus der Effektenleihe	67 347.00 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.