

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

Information Périodique au 30.06.2024

État du patrimoine

Éléments de l'état du patrimoine	<i>Devise de comptabilité de l'OPC : EUR</i>	Montant à l'arrêté périodique
a) Titres financiers éligibles mentionnés au 1° du I de l'article L.214-20 / 1° du I de l'article L.214-24-55 du code monétaire et financier		4 931 105 625,58
b) Avoirs bancaires		1 021 418 731,37
c) Autres actifs détenus par l'OPC		799 057 238,96
d) Total des actifs détenus par l'OPC (lignes a+b+c)		6 751 581 595,91
e) Passif		-19 844 779,70
f) Valeur nette d'inventaire (lignes d+e = actif net OPC)		6 731 736 816,21

Nombre de parts ou actions en circulation et valeur nette d'inventaire par part ou action

Parts ou actions	Nombre de parts ou actions en circulation	<i>Devise parts ou actions</i>	Valeur nette d'inventaire par part ou action (Valeur liquidative)
ACTION I / FR0010089649	239 471,195	EUR	26 125,65
ACTION P / FR0010540385	4 194 791,051	EUR	113,329

Portefeuille titres

Éléments du portefeuille titres	Pourcentage	
	Actif net	Total des actifs
a) Les titres financiers éligibles et les instruments du marché monétaire admis à la négociation sur un marché réglementé au sens de l'article L. 422-1 du code monétaire et financier.	73,25	73,04
b) Les titres financiers éligibles et les instruments du marché monétaire admis à la négociation sur un autre marché réglementé, en fonctionnement régulier, reconnu, ouvert au public et dont le siège est situé dans un Etat membre de l'Union européenne ou dans un autre Etat partie à l'accord sur l'Espace économique européen.	-	-
c) Les titres financiers éligibles et les instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs d'un pays tiers ou négociés sur un autre marché d'un pays tiers, réglementé, en fonctionnement régulier, reconnu et ouvert au public, pour autant que cette bourse ou ce marché ne figure pas sur une liste établie par l'Autorité des marchés financiers ou que le choix de cette bourse ou de ce marché soit prévu par la loi ou par le règlement ou les statuts de l'OPC / du fonds d'investissement à vocation générale.	-	-
d) Les titres financiers nouvellement émis mentionnés au 4° du I de l'article R. 214-11 / 4° du I de l'article R.214-32-18 du code monétaire et financier.	-	-
e) Les autres actifs	9,59	9,56

Répartition des actifs par devise

Devises (10 principales devises)	Montant En devise de comptabilité de l'OPC	Pourcentage	
	EUR	Actif net	Total des actifs
Euro	4 931 105 625,58	73,25	73,04
-	-	-	-
-	-	-	-
-	-	-	-
-	-	-	-
-	-	-	-
-	-	-	-
-	-	-	-
-	-	-	-
-	-	-	-
-	-	-	-
Autres devises	-	-	-
Total	4 931 105 625,58	73,25	73,04

Répartition des actifs par pays de résidence de l'émetteur

Pays (10 principaux pays)	Pourcentage	
	Actif net	Total des actifs
France	30,57	30,48
Pays-Bas	10,21	10,19
Royaume-Uni	8,89	8,87
Canada	8,16	8,13
Allemagne	3,00	2,99
Danemark	2,81	2,80
Luxembourg	1,53	1,52
États-Unis	1,50	1,49
Irlande	1,45	1,44
Italie	1,39	1,39
Autres pays	3,74	3,74
Total	73,25	73,04

Répartition des actifs par secteur économique

Secteur économique (10 principaux secteurs)	Pourcentage	
	Actif net	Total des actifs
Banques	39,86	39,75
Expert en finance	10,17	10,14
Chimie de spécialité	1,57	1,56
Services multiples aux collectivités	1,56	1,55
Pharmacie	1,48	1,47
Pipelines	1,39	1,39
Construction lourde	1,38	1,37
Composants électriques	1,35	1,34
Composants et équipements électriques	1,33	1,33
Industries diversifiées	1,32	1,32
Autres secteurs	11,84	11,82
Total	73,25	73,04

Ventilation des autres actifs par nature

Nature d'actifs	Pourcentage	
	Actif net	Total des actifs
Parts d'OPC	9,59	9,56
- OPCVM et équivalents d'autres Etats membres de l'Union européenne	9,59	9,56
- FIA et équivalents d'autres Etats membres de l'Union européenne	-	-
- Autres OPC et fonds d'investissements	-	-
Autres actifs	-	-
Total	9,59	9,56

Indication des mouvements intervenus dans la composition du portefeuille titres, au cours de la période de référence

Éléments du portefeuille titres	Mouvements (en montant)	
	Acquisitions	Cessions / Remboursements
<i>Devise de comptabilité de l'OPC : EUR</i>		
a) Les titres financiers éligibles et les instruments du marché monétaire admis à la négociation sur un marché réglementé au sens de l'article L. 422-1° du code monétaire et financier.	23 672 264 751,79	23 675 382 623,29
b) Les titres financiers éligibles et les instruments du marché monétaire admis à la négociation sur un autre marché réglementé, en fonctionnement régulier, reconnu, ouvert au public et dont le siège est situé dans un Etat membre de l'Union européenne ou dans un autre Etat partie à l'accord sur l'Espace économique européen.	-	-
c) Les titres financiers éligibles et les instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs d'un pays tiers ou négociés sur un autre marché d'un pays tiers, réglementé, en fonctionnement régulier, reconnu et ouvert au public, pour autant que cette bourse ou ce marché ne figure pas sur une liste établie par l'Autorité des marchés financiers ou que le choix de cette bourse ou de ce marché soit prévu par la loi ou par le règlement ou les statuts de l'OPC / du fonds d'investissement à vocation générale.	-	-
d) Les titres financiers nouvellement émis mentionnés au 4° du I de l'article R. 214-11 / 4° du I de l'article R.214-32-18 du code monétaire et financier.	-	-
e) Les autres actifs	435 720 829,15	466 787 416,23
Total sur la période	24 107 985 580,94	24 142 170 039,52

Indication des données chiffrées relatives aux distributions unitaires sur résultat et/ou sur plus ou moins-values nettes réalisées (« PVNR »), versées au cours de la période ou à verser, après déduction des impôts

Date	Catégorie de parts/actions	Devise parts/actions	Nature	Montant net unitaire	Crédit d'impôt unitaire	Montant brut unitaire
-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-

Information sur les commissions de surperformance (en EUR)

Commission de surperformance (frais variables) : montant et % des frais sur la période				
Catégorie de part :	Frais de gestion variables provisionnés	%	Frais de gestion variables acquis (<i>dus aux rachats</i>)	%
ACTION I / FR0010089649	-	-	-	-
ACTION P / FR0010540385	-	-	-	-

Récapitulatif des cas et conditions dans lesquels le plafonnement des rachats a, au cours de la période, été décidé

La Sicav n'a pas recouru à des opérations de plafonnement des rachats au cours de la période.

Informations relatives aux opérations de financement sur titres et contrat d'échange sur rendement global (TRS) au 28/06/2024 :

La Sicav n'a pas recouru à des opérations de financement sur titres au cours de la période.

Informations générales :

Montant des titres et matières premières prêtés en proportion du total des actifs pouvant être prêtés définis comme excluant la trésorerie et les équivalents de trésorerie.	Néant
--	-------

	Opérations de financement sur titres	Contrat d'échange sur rendement global
Le montant des actifs engagés dans chaque type d'opération de financement sur titres et de contrats d'échange sur rendement global exprimés en valeur absolue (dans la monnaie de l'organisme de placement collectif) et en proportion des actifs sous gestion de l'OPC.	Néant	Néant

Données sur la concentration :

	Opérations de financement sur titres	Contrat d'échange sur rendement global
Les dix plus gros émetteurs de garanties pour tous les types d'opérations de financement sur titres et de contrats d'échange sur rendement global (ventilation des volumes de garanties et de matières premières reçus par noms d'émetteurs)	Néant	Néant
Les dix principales contreparties pour chaque type d'opérations de financement sur titres et de contrats d'échange sur rendement global séparément (nom de la contrepartie et volume brut des opérations en cours).	Néant	Néant

Données d'opération agrégées pour chaque type d'opérations de financement sur titres et de contrats d'échange sur rendement global séparément ventilées en fonction des catégories suivantes :

	Opérations de financement sur titres	Contrat d'échange sur rendement global
Le type et la qualité des garanties (collatéral)	Néant	Néant
L'échéance de la garantie, ventilée en fonction des tranches d'échéance suivantes: moins d'un jour, un jour à une semaine, une semaine à un mois, un à trois mois, trois mois à un an, plus d'un an, opérations ouvertes	Néant	Néant

Swiss Life Funds (F) ESG Money Market Euro

	Opérations de financement sur titres	Contrat d'échange sur rendement global
La monnaie de la garantie	Néant	Néant
L'échéance des opérations de financement sur titres et des contrats d'échange sur rendement global, ventilée en fonction des tranches d'échéance suivantes : moins d'un jour, un jour à une semaine, une semaine à un mois, un à trois mois, trois mois à un an, plus d'un an, opérations ouvertes	Néant	Néant
Le pays où sont établies les contreparties	Néant	Néant
Le règlement et la compensation (p. ex. à trois parties, contrepartie centrale, bilatéraux)	Néant	Néant

Données sur la réutilisation des garanties (collatéral) :

	Opérations de financement sur titres	Contrat d'échange sur rendement global
La part des garanties reçues qui est réutilisée, par rapport au montant maximum précisé dans le prospectus ou dans les informations à communiquer aux investisseurs	Néant	Néant
Les revenus, pour l'OPC, du réinvestissement des garanties en espèces	Néant	Néant

Conservation des garanties reçues par l'OPC dans le cadre des opérations de financement sur titres et des contrats d'échange sur rendement global :

Nom de(s)Dépositaire(s)	Montant des actifs en garantie conservés par chacun des dépositaires
Swiss Life Banque Privée	Néant

Conservation des garanties fournies par l'OPC dans le cadre des opérations de financement sur titres et des contrats d'échange sur rendement global :

Néant.

Données sur les revenus et les coûts de chaque type d'opération de financement sur titres et de contrat d'échange sur rendement global :

	Opérations de financement sur titres	Contrat d'échange sur rendement global
Ventilation entre l'OPC, le gestionnaire de l'organisme de placement collectif et les tiers (par exemple, l'agent prêteur), en valeur absolue et en pourcentage des revenus globaux générés par ce type d'opération de financement sur titres et de contrat d'échange sur rendement global	Néant	Néant

Inventaire au 30.06.2024

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

Swiss Life Funds (F) ESG Money Market Euro

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

Swiss Life Funds (F) ESG Money Market Euro

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

Swiss Life Funds (F) ESG Money Market Euro

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

Swiss Life Funds (F) ESG Money Market Euro

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

Swiss Life Funds (F) ESG Money Market Euro

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

Swiss Life Funds (F) ESG Money Market Euro

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

Swiss Life Funds (F) ESG Money Market Euro

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

Swiss Life Funds (F) ESG Money Market Euro

Code valeur	Libellé valeur	Statut Valeur	Quantité	Valeur boursière	Devise de cotation	% Actif net
FR0127736587	SOCRAM BANQUE E3R+0.65% 22/11/2024	PROPRE	10 000 000,00	10 057 853,78	EUR	0,15
FR0128345149	SOCRAM BANQUE E3R+0.7% 28/11/2025	PROPRE	10 000 000,00	10 061 773,62	EUR	0,15
Total Taux revisable				474 052 574,68		7,04
Total Creances negociables				3 272 602 579,55		48,61
Total Swiss Life Funds (F) ESG Money Market Euro				6 731 736 816,21		100,00

ANNEXE AU RAPPORT
destinée aux souscripteurs suisses

Le prospectus de la Sicav, le document d'information clé (DIC), les rapports annuels et semi-annuels peuvent être obtenus gratuitement et sur simple demande auprès des bureaux du Représentant en Suisse. Une liste de toutes les transactions effectuées pour la Sicav durant la période sous revue est disponible gratuitement auprès du représentant de la Sicav en Suisse.

Représentant en Suisse :

Swiss Life Asset Management AG, General-Guisan-Quai 40, 8002 Zurich, a été autorisé par l'Autorité fédérale de surveillance des marchés financiers (FINMA) en tant que représentant en Suisse de la Sicav pour l'offre et la distribution en Suisse ou à partir de la Suisse, des actions de la Sicav en vertu de l'article 120 de la Loi fédérale sur les placements collectifs de capitaux du 23 juin 2006 (LPCC).

Agent payeur en Suisse :

UBS Switzerland AG, Bahnhofstrasse 45, 8001 Zurich, est une banque dûment licenciée selon la Loi fédérale sur les banques ; elle a été nommée Agent Payeur de la Sicav pour la Suisse, conformément à l'art. 121 LPCC.

Clôture annuelle de la sicav : 31-déc.

Fortune moyenne de la sicav pour la période du 01/07/23 au 27/06/24 : 6 771 785 681,19

Action I **FR0010089649**

Commission de gestion de la direction de l'OPCVM : 0,30 % TTC

Fortune moyenne de l'action I pour la période du 01/07/23 au 27/06/24 : 6 399 657 090,09

extrait du compte de résultat

Charges en euro	Rapport semestriel 30/06/2023	Rapport annuel 29/12/2023	Rapport semestriel 27/06/2024
Commission de la direction de l'OPCVM	3 768 800,34	7 546 127,68	3 844 521,36
Rémunération en fonction de la performance	0,00	0,00	0,00
Commission de la banque dépositaire	0,00	0,00	0,00
Autres charges	10218,90		
Impôts	0,00	0,00	0,00
Total des charges d'exploitation hors bonification	3 779 019,24	7 546 127,68	3 844 521,36
Total des charges d'exploitation avec bonification	3 779 019,24	7 546 127,68	3 844 521,36

TER y compris rémunération en fonction de la performance

$$(((7546127.68-3779019.24)+3844521.36)/6399657090.09)*100$$

TER 0,12 %

Rémunération de la performance comme quote-part en pour cent de la fortune moyenne

0,00 %

Swiss Life Funds (F) ESG Money Market Euro

Action P

FR0010540385

Commission de gestion de la direction de l'OPCVM : 0,60 % TTC

Fortune moyenne de l'action P pour la période du 01/07/23 au 27/06/24 : 372 128 591,10

extrait du compte de résultat

Charges en euro	Rapport semestriel	Rapport annuel	Rapport semestriel
	30/06/2023	29/12/2023	27/06/2024
Commission de la direction de l'OPCVM	301 846,69	731 272,79	863 208,52
Rémunération en fonction de la performance	0,00	0,00	0,00
Commission de la banque dépositaire	0,00	0,00	0,00
Autres charges	369,33		
Impôts	0,00	0,00	0,00
Total des charges d'exploitation hors bonification	302 216,02	731 272,79	863 208,52
Total des charges d'exploitation avec bonification	302 216,02	731 272,79	863 208,52

TER y compris rémunération en fonction de la performance

$$(((731272.79-302216.02)+863208.52)/372128591.1)*100$$

TER 0,35 %

Rémunération de la performance comme quote-part en pour cent de la fortune moyenne

0,00 %

Bilan**Actif**

	28.06.2024
Devise	EUR
Immobilisations corporelles nettes	-
Titres financiers	
Actions et valeurs assimilées (A) ⁽¹⁾	-
Négoziées sur un marché réglementé ou assimilé	-
Non négociées sur un marché réglementé ou assimilé	-
Obligations convertibles en actions (B) ⁽¹⁾	-
Négoziées sur un marché réglementé ou assimilé	-
Non négociées sur un marché réglementé ou assimilé	-
Obligations et valeurs assimilées (C) ⁽¹⁾	1 658 503 046,03
Négoziées sur un marché réglementé ou assimilé	1 658 503 046,03
Non négociées sur un marché réglementé ou assimilé	-
Titres de créances (D)	3 272 602 579,55
Négoziées sur un marché réglementé ou assimilé	3 272 602 579,55
Non négociées sur un marché réglementé ou assimilé	-
Parts d'OPC et de fonds d'investissements (E)	645 474 974,20
OPCVM	645 474 974,20
FIA et équivalents d'autres Etats membres de l'Union Européenne	-
Autres OPC et fonds d'investissement	-
Dépôts (F)	147 899 503,89
Instruments financiers à terme (G)	730 398,73
Opérations temporaires sur titres (H)	-
Créances représentatives de titres financiers reçus en pension	-
Créances représentatives de titres donnés en garantie	-
Créances représentatives de titres financiers prêtés	-
Titres financiers empruntés	-
Titres financiers donnés en pension	-
Autres opérations temporaires	-
Prêts (I)	-
Autres actifs éligibles (J)	-
Sous-total actifs éligibles I = (A + B + C + D + E + F + G + H + I + J)	5 725 210 502,40
Créances et comptes d'ajustement actifs	4 952 362,14
Comptes financiers	1 021 418 731,37
Sous-total actifs autres que les actifs éligibles II	1 026 371 093,51
Total Actif I + II	6 751 581 595,91

⁽¹⁾ Les autres actifs sont les actifs autres que les actifs éligibles tels que définis par le règlement ou les statuts de l'OPC à capital variable qui sont nécessaires à leur fonctionnement.

Bilan**Passif**

	28.06.2024
Devise	EUR
Capitaux propres :	
Capital	6 592 522 884,52
Report à nouveau sur revenu net	-
Report à nouveau des plus et moins-values latentes nettes	-
Report à nouveau des plus et moins-values réalisées nettes	-
Résultat net de l'exercice	139 213 931,69
Capitaux propres I	6 731 736 816,21
Passifs de financement II ⁽¹⁾	-
Capitaux propres et passifs de financement (I+II) ⁽¹⁾	-
Passifs éligibles :	
Instruments financiers (A)	-
Opérations de cession sur instruments financiers	-
Opérations temporaires sur titres financiers	-
Instruments financiers à terme (B)	730 398,73
Emprunts	-
Autres passifs éligibles (C)	-
Sous-total passifs éligibles III = A + B + C	730 398,73
Autres passifs :	
Dettes et comptes d'ajustement passifs	19 114 380,97
Concours bancaires	-
Sous-total autres passifs IV	19 114 380,97
Total Passifs: I + II + III + IV	6 751 581 595,91

⁽¹⁾ Cette rubrique est facultative, et ne concerne que les OFS. Les passifs de financement sont les passifs émis par l'OFS autres que les parts ou actions.

Compte de résultat

	28.06.2024
Devise	EUR
Revenus financiers nets	
Produits sur opérations financières	
Produits sur actions	-
Produits sur obligations	32 358 370,27
Produits sur titres de créance	80 397 251,13
Produits sur des parts d'OPC	-
Produits sur instruments financiers à terme	2 320 803,85
Produits sur opérations temporaires sur titres	-
Produits sur prêts et créances	-
Produits sur autres actifs et passifs éligibles	2 123 935,14
Autres produits financiers	8 342,16
Sous-total Produits sur opérations financières	117 208 702,55
Charges sur opérations financières	
Charges sur opérations financières	-
Charges sur instruments financiers à terme	-34 498,22
Charges sur opérations temporaires sur titres	-
Charges sur emprunts	-
Charges sur autres actifs et passifs éligibles	-
Charges sur passifs de financement	-
Autres charges financières	13 269 573,85
Sous-total charges sur opérations financières	13 235 075,63
Total Revenus financiers nets (A)	130 443 778,18
Autres produits :	
Frais pris en charge par l'entreprise ⁽¹⁾	-
Rétrocession des frais de gestion au bénéfice de l'OPC	-
Versements en garantie de capital ou de performance	-
Autres produits	-
Autres charges :	
Frais de gestion de la société de gestion	-4 784 855,49
Frais d'audit, d'études des fonds de capital investissement	-
Impôts et taxes	-
Autres charges	-9 182,80
Sous-total Autres produits et Autres charges (B)	-4 794 038,29
Sous total Revenus nets avant compte de régularisation C = A - B	125 649 739,89
Régularisation des revenus nets de l'exercice (D)	-4 493 503,06

⁽¹⁾ Seulement pour les FCPE.

Compte de résultat (suite)

	28.06.2024
Devise	EUR
Sous-total revenus nets I = C + D	121 156 236,83
Plus ou moins-values réalisées nettes avant compte de régularisations :	
Plus et moins-values réalisées	16 038 047,33
Frais de transactions externes et frais de cession	-3 773,80
Frais de recherche	-
Quote-part des plus-values réalisées restituées aux assureurs	-
Indemnités d'assurance perçues	-
Versements en garantie de capital ou de performance reçus	-
Sous total plus ou moins-values réalisées nettes avant compte de régularisations E	16 034 273,53
Régularisations des plus ou moins-values réalisées nettes F	133 001,85
Plus ou moins-values réalisées nettes II = E + F	16 167 275,38
Plus ou moins-values latentes nettes avant compte de régularisations :	
Variation des plus ou moins-values latentes yc les écarts de change sur les actifs éligibles	2 852 265,62
Écarts de change sur les comptes financiers en devises	-
Versements en garantie de capital ou de performance à recevoir	-
Quote-part des plus-values latentes à restituer aux assureurs	-
Sous total plus ou moins-values latentes nettes avant compte de régularisation G	2 852 265,62
Régularisations des plus ou moins-values latentes nettes H	-961 846,14
Plus ou moins-values latentes nettes III = G + H	1 890 419,48
Acomptes :	
Acomptes sur revenus nets versés au titre de l'exercice J	-
Acomptes sur plus ou moins-values réalisées nettes versés au titre de l'exercice K	-
Acomptes sur plus ou moins-values latentes nettes versés au titre de l'exercice L ⁽²⁾	-
Total acomptes versés au titre de l'exercice IV = J + K + L	-
Impôt sur le résultat V	-
Résultat net I + II + III -IV -V	139 213 931,69

⁽²⁾ Seulement pour les MMF.

Evolution du nombre de parts ou actions au cours de la période**ACTION I**

FR0010089649	En parts ou actions	En montant
Parts ou actions souscrites durant la période	1 432 426,427	36 704 479 706,43
Parts ou actions rachetées durant la période	1 450 069,461	37 156 903 955,21
Solde net des souscriptions/rachats	-17 643,034	-452 424 248,78

ACTION P

FR0010540385	En parts ou actions	En montant
Parts ou actions souscrites durant la période	7 785 857,806	866 954 323,48
Parts ou actions rachetées durant la période	5 910 594,99	658 877 533,41
Solde net des souscriptions/rachats	1 875 262,816	208 076 790,07

*Nous permettons à chacun
de vivre selon ses propres choix.*

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

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

fr.swisslife-am.com

SA au capital social de 671 167 €
499 320 059 R.C.S. Marseille
Société de gestion de portefeuille
Agrément AMF n° GP 07000055
Carte professionnelle n°A12-5387
Caisse de Garantie CEGC
16, rue Hoche, Tour Kupka B, TSA 39999,
92919 La Défense Cedex