

# **Swiss Life Funds (CH)**

## **Money Market Swiss Francs**

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

**Halbjahresbericht per 30. Juni 2024**



# Ungeprüfter Halbjahresbericht per 30. Juni 2024

<b>Inhaltsverzeichnis</b>	<b>Seite</b>	<b>ISIN</b>
Organisation	3	
Swiss Life Funds (CH)		
Money Market Swiss Francs	5	
	A	CH1238845866
	A Cap	CH1238845874

## 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](http://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 Holding AG und der Ina Invest 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 Anlage Richtlinien 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)

## Money Market Swiss Francs

Art übrige Fonds für traditionelle Anlagen

### Wichtigste Daten

	ISIN	30.6.2024	31.12.2023
Nettofondsvermögen in CHF		1 266 834 135,53	810 457 341,91
<b>Klasse A<sup>1</sup></b>	<b>CH1238845866</b>		
Nettoinventarwert pro Anteil in CHF		101,33	101,07
Anzahl Anteile im Umlauf		2 402 965,8510	1 591 649,0500
<b>Klasse A Cap<sup>1</sup></b>	<b>CH1238845874</b>		
Nettoinventarwert pro Anteil in CHF		101,71	101,07
Anzahl Anteile im Umlauf		10 061 381,3320	6 427 206,2590

<sup>1</sup> Erstemission per 29.3.2023

### Struktur des Wertpapierportfolios (ungeprüft)

Die 10 grössten Positionen in % des Gesamtfondsvermögens	
Credit Suisse Schweiz AG	4,28
Pfandbriefbank schweizerischer Hypothekarinstitute AG	3,78
Pfandbriefzentrale der schweizerischen Kantonalbanken	3,71
Basellandschaftliche Kantonalbank	3,04
Amag Leasing AG	3,04
Bank Cler AG	2,99
Aargauische Kantonalbank	2,87
Raiffeisen Schweiz Genossenschaft	2,72
Luzerner Kantonalbank	2,10
Goldman Sachs Group Inc	1,98
Übrige	52,93
<b>Total</b>	<b>83,44</b>

Obige Prozentsätze können Rundungsdifferenzen enthalten.

## Vermögensrechnung

	30.6.2024	31.12.2023
	CHF	CHF
<b>Verkehrswerte</b>		
Bankguthaben		
– auf Sicht	180 489 451.72	43 248 527.09
Bankguthaben auf Zeit	35 000 000.00	30 000 000.00
Geldmarktinstrumente	45 012 121.00	59 802 007.80
Effekten		
– Obligationen, Wandelobligationen, Optionsanleihen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte	1 071 984 687.87	673 247 034.49
Derivative Finanzinstrumente	-325 145.05	0.00
Sonstige Vermögenswerte	6 624 583.64	4 353 143.27
<b>Gesamtfondsvermögen</b>	<b>1 338 785 699.18</b>	<b>810 650 712.65</b>
Kurzfristige Bankverbindlichkeiten	-71 698 456.03	0.00
Andere Verbindlichkeiten	-253 107.62	-193 370.74
<b>Nettofondsvermögen</b>	<b>1 266 834 135.53</b>	<b>810 457 341.91</b>

## Erfolgsrechnung

	1.1.2024-30.6.2024	29.3.2023-31.12.2023
	CHF	CHF
<b>Ertrag</b>		
Erträge der Bankguthaben	344 804.89	475 409.46
Negativzinsen	0.00	-27 884.73
Erträge der Geldmarktinstrumente	930 119.96	1 084 010.00
Erträge der Effekten		
– aus Obligationen, Wandelobligationen, Optionsanleihen und sonstigen Forderungswertpapieren und -rechten	4 452 923.44	3 326 792.60
Einkauf in laufende Nettoerträge bei der Ausgabe von Anteilen	3 023 657.68	3 116 321.67
<b>Total Ertrag</b>	<b>8 751 505.97</b>	<b>7 974 649.00</b>
<b>Aufwand</b>		
Reglementarische Kommissionsvergütung an die Fondsleitung Klasse A	-108 611.53	-80 792.64
Reglementarische Kommissionsvergütung an die Fondsleitung Klasse A Cap	-330 767.99	-368 938.63
Reglementarische Kommissionsvergütung an die Depotbank	-29 917.69	-31 757.49
Sonstige Aufwendungen	-749.49	-388.72
Ausrichtung laufender Nettoerträge bei der Rücknahme von Anteilen	-1 277 625.40	-2 438 587.68
<b>Total Aufwand</b>	<b>-1 747 672.10</b>	<b>-2 920 465.16</b>
<b>Nettoertrag</b>	<b>7 003 833.87</b>	<b>5 054 183.84</b>
Realisierte Kapitalgewinne und -verluste	2 404 162.72	969 612.32
<b>Realisierter Erfolg</b>	<b>9 407 996.59</b>	<b>6 023 796.16</b>
Nicht realisierte Kapitalgewinne und -verluste	406 701.42	2 504 320.38
<b>Gesamterfolg</b>	<b>9 814 698.01</b>	<b>8 528 116.54</b>



## Veränderung des Nettofondsvermögens

	1.1.2024-30.6.2024	29.3.2023-31.12.2023
	CHF	CHF
Nettofondsvermögen zu Beginn des Rechnungsjahres	810 457 341.91	0.00
Ordentliche Jahresausschüttung	-1 411 984.83	0.00
Abgeführte Verrechnungssteuer	-1 546 532.88	0.00
Saldo aus dem Anteilverkehr	449 520 613.32	801 929 225.37
Gesamterfolg	9 814 698.01	8 528 116.54
<b>Nettofondsvermögen am Ende der Berichtsperiode</b>	<b>1 266 834 135.53</b>	<b>810 457 341.91</b>

## Entwicklung der Anteile im Umlauf

	1.1.2024-30.6.2024	29.3.2023-31.12.2023
<b>Klasse A</b>	<b>Anzahl</b>	<b>Anzahl</b>
Bestand Anfang Rechnungsjahr	1 591 649,0500	0,0000
Ausgegebene Anteile	1 639 319,0000	1 591 649,0500
Zurückgenommene Anteile	-828 002,1990	0,0000
<b>Bestand Ende Berichtsperiode</b>	<b>2 402 965,8510</b>	<b>1 591 649,0500</b>

Differenz zwischen den ausgegebenen und zurückgenommenen Anteilen 811 316,8010 1 591 649,0500

<b>Klasse A Cap</b>	<b>Anzahl</b>	<b>Anzahl</b>
Bestand Anfang Rechnungsjahr	6 427 206,2590	0,0000
Ausgegebene Anteile	7 630 304,6180	14 333 893,5760
Zurückgenommene Anteile	-3 996 129,5450	-7 906 687,3170
<b>Bestand Ende Berichtsperiode</b>	<b>10 061 381,3320</b>	<b>6 427 206,2590</b>

Differenz zwischen den ausgegebenen und zurückgenommenen Anteilen 3 634 175,0730 6 427 206,2590

# Inventar des Fondsvermögens

Titel	31.12.2023 Anzahl/ Nominal	Käufe <sup>1</sup>	Verkäufe <sup>2</sup>	30.6.2024 Anzahl/ Nominal	Verkehrswert <sup>3</sup> in CHF	in % <sup>3</sup>	Davon ausgeliehen Anzahl/Nominal
<b>Effekten, die an einer Börse gehandelt werden</b>							
<b>Notes, fester Zins</b>							
<b>CHF</b>							
BANCO DE CHILE 0.25000% 16-05.12.24*	CHF	1 250 000		1 250 000	1 242 500	0,09	
BASLER KANTONALBANK 1.75000% 23-04.04.25*	CHF	5 350 000		5 350 000	5 367 120	0,40	
CAISSE DE REFINANCE DE L'HABITAT-REG-S 2.37500% 12-05.03.24*	CHF	35 805 000	35 805 000				
GLARNER KANTONALBANK-REG-S 1.95000% 23-04.04.25*	CHF	1 185 000		1 185 000	1 188 911	0,09	
ITAU BBA INTERNATIONAL PLC-REG-S 0.56000% 22-17.02.25*	CHF	6 245 000		6 245 000	6 194 416	0,46	
KOREA NATIONAL OIL CORP 2.15000% 22-19.12.24*	CHF	5 500 000		5 500 000	5 515 400	0,41	
NORTH AMERICAN DEVELOPMENT BANK-REG-S 0.25000% 15-30.04.25*	CHF	21 180 000		21 180 000	20 970 318	1,57	
PFANDBRIEFBK SCHWEIZERISCHER INST-REG-S 1.37500% 12-14.02.24*	CHF	18 000 000	18 000 000				
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL INC-REG-S 1.62500% 14-16.05.24*	CHF	9 600 000	3 000 000	12 600 000			
SIKA AG-REG-S 1.60000% 22-28.05.24*	CHF	2 000 000	2 000 000				
SWISSCOM AG-REG-S 1.75000% 12-10.07.24*	CHF	5 500 000	3 950 000	9 450 000	9 450 000	0,71	
TESSINER STAATSBANK-REG-S 0.50000% 15-24.06.24*	CHF	1 000 000	1 000 000				
<b>Total CHF</b>					<b>49 928 664</b>	<b>3,73</b>	
<b>USD</b>							
UBS AG/STAMFORD CT 7.95000% 23-09.01.25*	USD	15 000 000		15 000 000	13 620 573	1,02	
<b>Total USD</b>					<b>13 620 573</b>	<b>1,02</b>	
<b>Total Notes, fester Zins</b>					<b>63 549 237</b>	<b>4,75</b>	
<b>Notes, Nullcoupon</b>							
<b>CHF</b>							
BKW AG 0.00000% 22-18.10.24*	CHF	3 865 000		3 865 000	3 847 994	0,29	
<b>Total CHF</b>					<b>3 847 994</b>	<b>0,29</b>	
<b>Total Notes, Nullcoupon</b>					<b>3 847 994</b>	<b>0,29</b>	
<b>Medium-Term Notes, fester Zins</b>							
<b>CHF</b>							
ABN AMRO BANK NV-REG-S 0.30000% 16-18.12.24*	CHF	7 080 000		7 080 000	7 042 476	0,53	
AGENCE FRANCAISE DE DEVELOPPEMENT-REG-S 2.62500% 10-18.02.25*	CHF	1 240 000		1 240 000	1 247 316	0,09	
ANZ NEW ZEALAND INT'L LTD/LONDON-REG-S 0.35000% 18-22.10.24*	CHF	10 900 000		10 900 000	10 866 210	0,81	
ASB BANK LTD-REG-S 0.20000% 17-02.08.24*	CHF	2 500 000		2 500 000	2 497 250	0,19	
AUCKLAND COUNCIL 1.12500% 13-07.02.24*	CHF	850 000	850 000				
BANCO DE CREDITO E INVERSIONES-REG-S 0.40000% 19-22.11.24*	CHF	1 000 000	8 600 000	9 600 000	9 553 920	0,71	
BANCO DEL ESTADO DE CHILE-REG-S 0.69250% 18-04.12.24*	CHF	1 500 000	1 000 000	2 500 000	2 486 750	0,19	
BANCO DEL ESTADO DE CHILE-REG-S 0.24000% 19-06.06.25*	CHF	4 245 000		4 245 000	4 194 909	0,31	
BANCO SANTANDER CHILE-REG-S 0.35000% 16-30.05.25*	CHF	4 150 000		4 150 000	4 103 105	0,31	
BANCO SANTANDER SA-REG-S 1.00000% 18-10.12.24*	CHF	5 830 000		5 830 000	5 814 259	0,43	
BANCO SANTANDER SA-REG-S 1.32750% 22-10.06.25*	CHF	1 000 000		1 000 000	998 700	0,07	
BANQUE FEDERATIVE DU CREDIT MUTUEL-REG-S 2.00000% 14-22.05.24*	CHF	4 300 000	4 300 000				
BANQUE FEDERTIVE DU CREDIT MUTUEL-REG-S 0.36600% 18-10.10.24*	CHF	3 000 000		3 000 000	2 990 100	0,22	
BERLIN HYP AG 0.37500% 22-21.02.25*	CHF	7 830 000		7 830 000	7 777 539	0,58	
BMW INTERNATIONAL INVESTMENT BV-REG-S 0.30000% 19-05.09.24*	CHF	10 000 000		10 000 000	9 980 000	0,75	
BNG BANK NV-REG-S 1.25000% 14-30.04.24*	CHF	3 000 000	3 000 000				
BNP PARIBAS-REG-S 1.00000% 18-06.06.25*	CHF	13 500 000		13 500 000	13 451 400	1,00	
CAISSE DES DEPOTS ET CONSIGNATION-REG-S 0.25000% 18-30.05.25*	CHF	2 400 000		2 400 000	2 376 000	0,18	
CBQ FINANCE LTD-REG-S 0.19500% 21-22.04.24*	CHF	13 500 000	13 500 000				
CENTRAL AMERICAN BK ECO INTEGRAT-REG-S 0.20000% 19-25.03.24*	CHF	11 555 000	1 000 000	12 555 000			
CENTRAL AMERICAN BK ECO INTEGRAT-REG-S 0.40500% 20-25.06.25*	CHF	5 000 000		5 000 000	4 945 500	0,37	
CITIGROUP INC-REG-S 0.50000% 17-22.11.24*	CHF	3 000 000	23 300 000	26 300 000	26 197 430	1,96	
CORPORACION ANDINA DE FOMENTO-REG-S 2.00000% 14-05.02.24*	CHF	5 500 000		5 500 000			
CREDIT AGRICOLE HOME LOAN SFH SA-REG-S 1.12500% 14-05.06.24*	CHF	15 000 000	500 000	15 500 000			
CREDIT AGRICOLE SA LONDON-REG-S 2.12500% 14-30.10.24*	CHF	1 885 000		1 885 000	1 886 697	0,14	
CREDIT AGRICOLE SA LONDON-REG-S 0.30000% 17-18.04.24*	CHF	4 200 000	300 000	4 500 000			
CREDIT SUISSE LONDON BRANCH-REG-S 0.55000% 16-15.04.24*	CHF	1 000 000		1 000 000			
CREDIT SUISSE SCHWEIZ AG-REG-S 2.45860% 23-22.11.24*	CHF	8 600 000	21 565 000	30 165 000	30 282 644	2,26	
DNB BANK ASA-REG-S 0.05000% 19-13.03.24*	CHF	5 900 000		5 900 000			
ELI LILLY & CO-REG-S 0.15000% 16-24.05.24*	CHF	14 000 000	8 190 000	22 190 000			
ENGIE SA-REG-S 1.62500% 12-09.10.24*	CHF	4 000 000		4 000 000	4 001 200	0,30	
ERSTE EUR PFANDBRIEF & KOMMUNALBANK AG 2.87500% 05-10.03.25*	CHF	1 520 000		1 520 000	1 525 472	0,11	
EXPORT-IMPORT BANK OF KOREA-REG-S 0.38250% 18-11.07.24*	CHF	3 200 000		3 200 000	3 199 040	0,24	
GLENORE FINANCE EUROPE SA-REG-S 1.25000% 18-09.10.24*	CHF	12 000 000		12 000 000	11 991 600	0,90	
GOLDMAN SACHS GROUP INC-REG-S 0.50000% 17-04.12.24*	CHF	3 000 000	23 570 000	26 570 000	26 466 377	1,98	
HEATHROW FUNDING LTD-REG-S 0.50000% 16-17.05.24*	CHF	9 840 000	21 740 000	31 580 000			
HYPONOE GRUPPE BANK AG-REG-S 0.10000% 19-27.11.24*	CHF	4 390 000		4 390 000	4 366 733	0,33	
HYUNDAI CAPITAL SERVICES INC-REG-S 0.73250% 19-26.02.24*	CHF	14 000 000		14 000 000			
HYUNDAI CAPITAL SERVICES INC-REG-S 0.26000% 20-11.02.25*	CHF	20 140 000		20 140 000	19 980 894	1,49	
INSTITUTO DE CREDITO OFICIAL-REG-S 3.25000% 07-28.06.24*	CHF	12 000 000	3 065 000	15 065 000			
KOREA DEVELOPMENT BANK-REG-S 0.44500% 20-08.05.25*	CHF	9 145 000		9 145 000	9 073 669	0,68	
KOREA EXPRESSWAY CORP-REG-S 0.25000% 17-07.06.24*	CHF	1 700 000	710 000	2 410 000			
KOREA LAND & HOUSING CORP-REG-S 0.19250% 20-15.06.25*	CHF	1 500 000		1 500 000	1 482 450	0,11	
KOREA WESTERN POWER CO LTD-REG-S 0.12500% 19-27.02.24*	CHF	2 400 000	2 400 000				
LLOYDS BANKING GROUP PLC-REG-S 1.00000% 18-04.03.25*	CHF	24 090 000		24 090 000	24 022 548	1,79	
LUZERNER KANTONALBANK-REG-S 0.10000% 18-08.05.24*	CHF	5 500 000		5 500 000			
MACQUARIE BANK-REG-S 0.75000% 16-05.02.24*	CHF	7 600 000		7 600 000			
MCDONALD'S CORP-REG-S 0.17000% 16-04.10.24*	CHF	1 000 000	3 500 000	4 500 000	4 485 150	0,34	
MUENCHENER HYPOTHEKENBANK EG-REG-S 0.30000% 17-20.12.24*	CHF	19 150 000		19 150 000	19 044 675	1,42	
MUENCHENER HYPOTHEKENBANK EG-REG-S 0.00100% 19-19.02.24*	CHF	1 000 000	1 000 000				
MUNICIPALITY FINANCE PLC-REG-S 0.75000% 14-17.09.24*	CHF	2 700 000		2 700 000	2 695 950	0,20	
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD-REG-S 1.50000% 14-07.02.24*	CHF	5 520 000		5 520 000			
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD 0.25000% 18-13.03.24*	CHF	3 400 000	3 400 000				
NATWEST MARKETS PLC-REG-S 0.89750% 22-04.04.25*	CHF	5 000 000		5 000 000	4 978 000	0,37	
NEDERLANDSE WATERSCHAPS BANK NV-REG-S 1.25000% 12-09.08.24*	CHF	900 000		900 000	899 730	0,07	
NORDRHEIN-WESTFALEN, STATE OF-REG-S 0.87500% 14-29.07.24*	CHF	8 000 000		8 000 000	7 996 800	0,60	
PFANDBRIEFBK SCHWEIZERISCHER HYPOTHEKEN-REG-S 0.12500% 17-25.03.24*	CHF	500 000	500 000				
QNB FINANCE LTD 1.55000% 24-20.06.25*	CHF	20 000 000		20 000 000	20 038 600	1,50	
QUEBEC, PROVINCE OF-REG-S 0.75000% 14-21.11.24*	CHF	8 000 000		8 000 000	7 980 800	0,60	
SANTANDER CONSUMER FINANCE SA-REG-S 0.15000% 19-10.12.24*	CHF	13 735 000		13 735 000	13 656 711	1,02	

Titel		31.12.2023 Anzahl/ Nominal	Käufe <sup>1</sup>	Verkäufe <sup>2</sup>	30.6.2024 Anzahl/ Nominal	Verkehrswert <sup>3</sup> in CHF	in % <sup>3</sup>	Davon ausgeliehen Anzahl/Nominal
TOTAL CAPITAL INTERNATIONAL SA-REG-S 1.00000% 14-29.08.24*	CHF	13 000 000	12 000 000		25 000 000	24 980 000	1,87	
UBS AG/LONDON-REG-S 2.38500% 23-09.05.25*	CHF		11 000 000		11 000 000	11 093 500	0,83	
WELLS FARGO & CO-REG-S 1.25000% 14-03.09.24*	CHF	6 500 000	4 000 000		10 500 000	10 493 700	0,78	
WELLS FARGO & CO-REG-S 0.75000% 20-27.05.25*	CHF		6 000 000		6 000 000	5 962 800	0,45	
WESTPAC SECURITIES NZ LTD/LONDON-REG-S 0.37500% 16-05.02.24*	CHF	4 300 000		4 300 000				
<b>Total CHF</b>						<b>389 108 603</b>	<b>29,06</b>	
<b>EUR</b>								
INFRABEL SA-REG-S 3.95000% 12-27.03.24*	EUR		1 000 000	1 000 000				
<b>Total EUR</b>							<b>0,00</b>	
<b>Total Medium-Term Notes, fester Zins</b>						<b>389 108 603</b>	<b>29,06</b>	
<b>Medium-Term Notes, Nullcoupon</b>								
<b>CHF</b>								
CREDIT SUISSE SCHWEIZ AG-REG-S 0.00000% 20-17.12.24*	CHF		27 145 000		27 145 000	26 973 987	2,01	
EXPORT-IMPORT BANK OF KOREA-REG-S 0.00000% 19-27.05.25*	CHF		12 200 000		12 200 000	12 047 500	0,90	
KOREA RAILROAD CORP 0.00000% 19-19.11.24*	CHF		2 000 000		2 000 000	1 989 400	0,15	
<b>Total CHF</b>						<b>41 010 887</b>	<b>3,06</b>	
<b>Total Medium-Term Notes, Nullcoupon</b>						<b>41 010 887</b>	<b>3,06</b>	
<b>Anleihen, fester Zins</b>								
<b>CHF</b>								
AARGAUISCHE KANTONALBANK 0.02000% 16-17.10.24*	CHF	8 285 000	2 600 000		10 885 000	10 839 283	0,81	
AARGAUISCHE KANTONALBANK-REG-S 0.11000% 17-21.02.24*	CHF	3 440 000		3 440 000				
AARGAUISCHE KANTONALBANK 0.25000% 18-03.04.25*	CHF		21 625 000		21 625 000	21 452 000	1,60	
AARGAUISCHE KANTONALBANK 0.15000% 18-15.11.24*	CHF	4 000 000	2 165 000		6 165 000	6 137 258	0,46	
APPLE INC-REG-S 0.37500% 15-25.11.24*	CHF	5 950 000			5 950 000	5 928 580	0,44	
BANK OF NOVA SCOTIA 0.29500% 22-25.04.25*	CHF		1 000 000		1 000 000	991 800	0,07	
BANQUE CANTONALE DU JURA-REG-S 0.62500% 15-04.03.25*	CHF		2 140 000		2 140 000	2 126 946	0,16	
BASEL-LANDSCHAFT, CANTON OF-REG-S 0.25000% 15-24.06.24*	CHF	3 775 000		3 775 000				
BASELSTADT KANTONALBANK 1.75000% 11-22.11.24*	CHF	10 000 000	11 375 000		21 375 000	21 402 788	1,60	
BASELSTADT KANTONALBANK-REG-S 0.25000% 15-13.05.25*	CHF		15 910 000		15 910 000	15 766 810	1,18	
BASELSTADT KANTONALBANK 1.87500% 23-28.03.25*	CHF		3 550 000		3 550 000	3 562 425	0,27	
BASLER KANTONALBANK-REG-S 0.12500% 18-11.04.24*	CHF	16 000 000		16 000 000				
BERN, CANTON OF 1.25000% 14-22.04.24*	CHF	1 000 000		1 000 000				
BERN, CANTON OF-REG-S 1.00000% 12-25.10.24*	CHF	5 000 000	3 980 000		8 980 000	8 970 122	0,67	
BERN, CITY OF-REG-S 1.62500% 11-01.11.24*	CHF	4 000 000	14 485 000		18 485 000	18 507 182	1,38	
BP CAPITAL MARKETS PLC-REG-S 1.75000% 14-28.02.24*	CHF	1 600 000		1 600 000				
CA AUTO FINANCE SUISSE SA-REG-S 0.05190% 21-20.12.24*	CHF		7 125 000		7 125 000	7 058 738	0,53	
COOP-GRUPPE GENOSSENSCHAFT-REG-S 0.87500% 15-31.07.24*	CHF		2 125 000		2 125 000	2 123 938	0,16	
COOP-GRUPPE GENOSSENSCHAFT-REG-S 0.75000% 18-06.06.25*	CHF		19 860 000		19 860 000	19 728 924	1,47	
EMISSIONSZENTRALE GEM WOHNBAUT-REG-S 0.75000% 14-24.09.24*	CHF	2 000 000			2 000 000	1 997 200	0,15	
EUROFMA EUROPEAN RAILROAD FIN CO-REG-S 3.00000% 07-22.05.24*	CHF		8 290 000	8 290 000				
FLUGHAFEN ZUERICH AG-REG-S 0.70000% 20-22.05.24*	CHF		1 630 000	1 630 000				
FONDO FINANCIERO-REG-S 0.57800% 19-11.03.24*	CHF	3 040 000		3 040 000				
GENEVA, CANTON OF-REG-S 1.50000% 11-14.10.24*	CHF	2 000 000	3 480 000		5 480 000	5 481 644	0,41	
GENEVA, CANTON OF-REG-S 0.02000% 15-27.11.24*	CHF	4 000 000	4 500 000		8 500 000	8 454 100	0,63	
GENEVA, CITY OF 0.12500%-REG-S 15-12.02.25*	CHF		2 760 000		2 760 000	2 739 300	0,20	
GLARNER KANTONALBANK-REG-S 0.05000% 18-06.12.24*	CHF		4 600 000		4 600 000	4 572 400	0,34	
GRAUBUENDNER KANTONALBANK-REG-S 1.25000% 12-14.06.24*	CHF	2 250 000		3 450 000				
GRAUBUENDNER KANTONALBANK 1.37500% 13-11.03.25*	CHF		2 550 000		2 550 000	2 551 275	0,19	
GRAUBUENDNER KANTONALBANK 0.12500% 18-29.05.24*	CHF	9 750 000		9 750 000				
HELVETIA SCHWEIZ VERSICHERUNGSGES-REG-S 1.50000% 14-28.04.25*	CHF		5 540 000		5 540 000	5 544 432	0,41	
HOLCIM LTD-REG-S 1.00000% 18-11.12.24*	CHF		2 725 000	2 725 000				
KOREA NATIONAL OIL CORP-REG-S 0.87500% 20-21.04.25*	CHF		14 800 000		14 800 000	14 726 000	1,10	
KUEHNE+NAGEL INTERNATIONAL AG-REG-S 0.20000% 19-18.06.25*	CHF		4 470 000		4 470 000	4 414 572	0,33	
LAUSANNE, CITY OF-REG-S 1.25000% 12-07.06.24*	CHF	2 000 000		2 000 000				
LUGANO, CITY OF-REG-S 0.87500% 14-09.12.24*	CHF		9 985 000		9 985 000	9 964 032	0,74	
LUZERNER KANTONALBANK-REG-S 3.00000% 05-11.03.25*	CHF		18 850 000		18 850 000	19 059 235	1,42	
LUZERNER KANTONALBANK-REG-S 0.20000% 17-11.04.25*	CHF		9 110 000		9 110 000	9 032 565	0,67	
NESTLE SA-REG-S 0.25000% 18-28.06.24*	CHF	6 000 000		6 000 000				
NIDWALDNER KANTONALBANK-REG-S 0.20000% 18-28.03.25*	CHF		2 530 000		2 530 000	2 508 495	0,19	
OESTERREICHISCHE KONTROLLBANK AG-REG-S 2.62500% 06-22.11.24*	CHF	3 000 000			3 000 000	3 015 300	0,23	
PFANDBRIEFBANK SCHWEIZERISCHER-REG-S 1.50000% 22-25.06.24*	CHF	10 000 000		10 000 000				
PFANDBRIEFBANK SCHWEIZERISCHER HYPO-REG-S 1.37500% 14-14.11.24*	CHF	10 000 000	12 635 000		22 635 000	22 639 527	1,69	
PFANDBRIEFBANK SCHWEIZERISCHER HYPO-REG-S 1.00000% 14-21.05.24*	CHF	3 000 000	1 000 000	4 000 000				
PFANDBRIEFBANK SCHWEIZERISCHER HYPO-REG-S 0.75000% 14-23.08.24*	CHF	4 000 000			4 000 000	3 996 800	0,30	
PFANDBRIEFBANK SCHWEIZERISCHER HYPO-REG-S 0.62500% 14-19.03.25*	CHF		5 460 000		5 460 000	5 435 976	0,41	
PFANDBRIEFBANK SCHWEIZERISCHER HYPO-REG-S 0.12500% 17-06.05.25*	CHF		17 980 000		17 980 000	17 812 785	1,33	
PFANDBRIEFZENTR SCHWEIZ KANTONAL- REG-S 1.62500% 11-31.10.24*	CHF	5 000 000			5 000 000	5 004 500	0,37	
PFANDBRIEFZENTR SCHWEIZ KANTONAL-REG-S 1.25000% 12-17.07.24*	CHF	2 000 000	7 665 000		9 665 000	9 665 000	0,72	
PFANDBRIEFZENTR SCHWEIZ KANTONAL-REG-S 0.75000% 14-15.04.24*	CHF	11 150 000		11 150 000				
PFANDBRIEFZENTR SCHWEIZ KANTONAL-REG-S 0.75000% 14-23.09.24*	CHF	3 000 000			3 000 000	2 996 100	0,22	
PFANDBRIEFZENTR SCHWEIZ KANTONAL-REG-S 0.37500% 15-14.02.25*	CHF		2 000 000	2 000 000				
PFANDBRIEFZENTR SCHWEIZ KANTONAL-REG-S 0.12500% 15-12.03.24*	CHF	24 745 000		24 745 000				
PFANDBRIEFZENTR SCHWEIZ KANTONAL-REG-S 0.12500% 15-17.07.24*	CHF	21 170 000	3 000 000		24 170 000	24 157 915	1,80	
PFANDBRIEFZENTR SCHWEIZ KANTONAL-REG-S 0.12500% 16-02.12.24*	CHF	3 930 000	3 000 000		6 930 000	6 896 043	0,52	
PFANDBRIEFZENTR SCHWEIZ KANTONAL-REG-S 0.01000% 17-05.02.24*	CHF	4 400 000		4 400 000				
PFANDBRIEFZENTR SCHWEIZ KANTONAL-REG-S- 0.12500% 18-16.04.25*	CHF		1 000 000		1 000 000	991 600	0,07	
PSP SWISS PROPERTY AG-REG-S 1.00000% 15-06.02.25*	CHF		12 430 000		12 430 000	12 396 439	0,93	
PSP SWISS PROPERTY AG-REG-S 0.50000% 16-16.02.24*	CHF	5 000 000		5 000 000				
RAIFFEISEN SCHWEIZ GENOSSENSCHAFT 0.30000% 16-22.04.25*	CHF		36 730 000		36 730 000	36 395 757	2,72	
RAIFFEISEN SCHWEIZ GENOSSENSCHAFT-REG-S 0.35000% 18-16.02.24*	CHF	13 300 000		13 300 000				
ROCHE KAPITALMARKT AG-REG-S 0.10000% 17-23.09.24*	CHF	17 000 000			17 000 000	16 945 600	1,27	
SFS GROUP AG-REG-S 1.00000% 22-06.06.25*	CHF		10 700 000		10 700 000	10 651 850	0,80	
SIKA AG 2.12500% 23-11.10.24*	CHF	2 500 000	1 000 000		3 500 000	3 504 900	0,26	
SIKA AG-REG-S 0.62500% 18-12.07.24*	CHF	11 000 000	1 240 000		12 240 000	12 236 328	0,91	
ST GALLER KANTONALBANK-REG-S 0.50000% 15-24.06.25*	CHF		9 280 000		9 280 000	9 208 544	0,69	

Titel		31.12.2023 Anzahl/ Nominal	Käufe <sup>1</sup>	Verkäufe <sup>2</sup>	30.6.2024 Anzahl/ Nominal	Verkehrswert <sup>3</sup> in CHF	in % <sup>3</sup>	Davon ausgeliehen Anzahl/Nominal
SWISS PRIME SITE FINANCE AG-REG-S 2.00000% 14-10.12.24*	CHF		7 840 000		7 840 000	7 853 328	0,59	
SWISS PRIME SITE FINANCE AG-REG-S 1.00000% 18-16.07.24*	CHF		455 000		455 000	454 909	0,03	
SWISS REINSURANCE CO LTD-REG-S 1.00000% 14-17.09.24*	CHF	5 300 000			5 300 000	5 295 760	0,40	
SWISSGRID AG-REG-S 1.62500% 13-30.01.25*	CHF		4 210 000		4 210 000	4 216 315	0,31	
SWITZERLAND-REG-S 1.25000% 12-11.06.24*	CHF		2 569 000	2 569 000				
THURGAUER KANTONALBANK 1.75000% 13-30.09.24*	CHF	3 000 000	10 000 000		13 000 000	13 009 100	0,97	
THURGAUER KANTONALBANK 0.37500% 15-31.03.25*	CHF		7 430 000		7 430 000	7 375 761	0,55	
TICINO, CANTON OF-REG-S 0.75000% 14-13.11.24*	CHF		3 000 000		3 000 000	2 993 100	0,22	
VALIANT BANK AG-REG-S 0.12500% 18-23.04.24*	CHF	2 000 000	1 510 000	3 510 000				
VP BANK AG-REG-S 0.87500% 15-07.10.24*	CHF		5 225 000		5 225 000	5 215 073	0,39	
ZUERCHER KANTONALBANK-REG-S 1.12500% 13-29.01.24*	CHF	1 000 000		1 000 000				
ZUERCHER KANTONALBANK-REG-S 0.25000% 18-08.05.25*	CHF		10 100 000		10 100 000	10 012 130	0,75	
ZUERCHER KANTONALBANK 0.20000% 22-31.03.25*	CHF		2 895 000		2 895 000	2 870 972	0,21	
ZUERICH, CITY OF-REG-S 2.75000% 05-14.02.25*	CHF		3 915 000		3 915 000	3 952 193	0,30	
ZUERICH, CITY OF-REG-S 2.37500% 11-21.02.24*	CHF	5 000 000		5 000 000				
ZUERICH, CITY OF-REG-S 1.62500% 13-26.09.24*	CHF	4 000 000	17 500 000		21 500 000	21 515 050	1,61	
<b>Total CHF</b>						<b>524 356 696</b>	<b>39,17</b>	

#### EUR

WPC EURO BOND BV 2.25000% 17-19.07.24*	EUR		3 559 000		3 559 000	3 423 312	0,26	
<b>Total EUR</b>						<b>3 423 312</b>	<b>0,26</b>	

#### Total Anleihen, fester Zins

**527 780 008 39,42**

#### Anleihen, Nullcoupon

##### CHF

AMAG LEASING AG-REG-S 0.00000% 21-18.02.25*	CHF		41 120 000		41 120 000	40 708 800	3,04	
KOREA NATIONAL OIL CORP-REG-S 0.00000% 19-04.10.24*	CHF	5 300 000			5 300 000	5 279 860	0,39	
PFANDBRIEFBK SCHWEIZERISCHER HYPO-REG-S 0.00000% 19-29.07.24*	CHF		700 000		700 000	699 300	0,05	
PFANDBRIEFZENTR SCHWEIZ KANTONAL-REG-S 0.00000% 16-14.06.24*	CHF	18 450 000		18 450 000				
<b>Total CHF</b>						<b>46 687 960</b>	<b>3,49</b>	

##### EUR

BANK JULIUS BAER & CO AG-REG-S 0.00000% 21-25.06.24*	EUR		3 750 000	3 750 000				
<b>Total EUR</b>							<b>0,00</b>	

#### Total Anleihen, Nullcoupon

**46 687 960 3,49**

#### Total Effekten, die an einer Börse gehandelt werden

**1 071 984 688 80,07**

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

#### Notes, fester Zins

##### CHF

GLARNER KANTONALBANK 2.02500% 23-12.06.24**	CHF	25 000 000		25 000 000				
UBS AG/LONDON 2.05000% 23-28.04.24**	CHF	20 000 000		20 000 000				
<b>Total CHF</b>							<b>0,00</b>	

#### Total Notes, fester Zins

**0,00**

#### Anleihen, fester Zins

##### CHF

BANK CLER AG 2.07500% 23-28.06.24**	CHF	25 000 000		25 000 000				
SWISSGRID AG 2.19000% 23-31.05.24**	CHF	20 000 000		20 000 000				
<b>Total CHF</b>							<b>0,00</b>	

#### Total Anleihen, fester Zins

**0,00**

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

**0,00**

### Nicht-Effekten

#### Treasury-Bills, Nullcoupon

##### CHF

SWISS NATIONAL BANK BILL-REG-S 0.00000% 02.05.23-02.04.24**	CHF	20 000 000		20 000 000				
SWISS NATIONAL BANK BILL TB 0.00000% 18.03.24-15.04.24**	CHF		3 000 000	3 000 000				
SWISS NATIONAL BANK BILL-REG-S TB 0.00000% 08.04.24-06.05.24**	CHF		5 000 000	5 000 000				
SWISS NATIONAL BANK BILLS-REG-S TB 0.00000% 03.04.23-04.03.24**	CHF	5 000 000		5 000 000				
SWISS NATIONAL BANK BILLS TB 0.00000% 29.01.24-26.02.24**	CHF		15 000 000	15 000 000				
SWISS NATIONAL BANK BILLS TB 0.00000% 05.02.24-04.03.24**	CHF		10 000 000	10 000 000				
SWITZERLAND TB-REG-S 0.00000% 02.11.23-01.02.24**	CHF	20 000 000		20 000 000				
SWITZERLAND-REG-S TB 0.00000% 28.09.23-28.03.24**	CHF	15 000 000		15 000 000				
SWITZERLAND-REG-S TB 0.00000% 07.03.24-06.06.24**	CHF		25 000 000	25 000 000				
<b>Total CHF</b>							<b>0,00</b>	

#### Total Treasury-Bills, Nullcoupon

**0,00**

#### Inländische Depositenzertifikate, fester Zins

##### CHF

BANK CLER AG CD 1.42250% 28.06.24-28.03.25**	CHF		25 000 000		25 000 000	25 000 000	1,87	
BANK CLER AG CP 1.76750% 16.02.24-15.11.24**	CHF		15 000 000		15 000 000	15 011 250	1,12	
ZUERCHER KANTONALBANK CD 1.74000% 09.01.24-09.07.24**	CHF		5 000 000		5 000 000	5 000 871	0,38	
ZUERCHER KANTONALBANK CD 1.44000% 28.03.24-28.06.24**	CHF		10 000 000	10 000 000				
<b>Total CHF</b>						<b>45 012 121</b>	<b>3,37</b>	

#### Total Inländische Depositenzertifikate, fester Zins

**45 012 121 3,37**

#### Total Nicht-Effekten

**45 012 121 3,37**

Titel	31.12.2023 Anzahl/ Nominal	Käufe <sup>1</sup>	Verkäufe <sup>2</sup>	30.6.2024 Anzahl/ Nominal	Verkehrswert <sup>3</sup> in CHF	in % <sup>3</sup>	Davon ausgeliehen Anzahl/Nominal
<b>Total Wertschriften</b> (davon ausgeliehen)					<b>1 116 996 809</b>	<b>83,44</b>	<b>0,00</b>
Bankguthaben auf Sicht					180 489 452	13,48	
Bankguthaben auf Zeit					35 000 000	2,61	
Derivative Finanzinstrumente					-325 145	-0,02	
Sonstige Vermögenswerte					6 624 583	0,49	
<b>Gesamtfondsvermögen</b>					<b>1 338 785 699</b>	<b>100,00</b>	
Kurzfristige Bankverbindlichkeiten					-71 698 456		
Andere Verbindlichkeiten					-253 107		
<b>Nettofondsvermögen</b>					<b>1 266 834 136</b>		

Bewertungskategorie	Verkehrswert per 30.6.2024	in % des Gesamt- fondsvermögens <sup>3</sup>
Anlagen bewertet zu den Kursen, die am Hauptmarkt bezahlt werden	1 071 984 688	80,07
Anlagen bewertet aufgrund von am Markt beobachtbaren Parametern	44 686 976	3,35
Anlagen bewertet mit geeigneten Bewertungsmodellen unter Berücksichtigung der aktuellen Marktgegebenheiten	-	-
<b>Total</b>	<b>1 116 671 664</b>	<b>83,42</b>

<sup>1</sup> «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 Basisiteln / Sacheinlagen

<sup>2</sup> «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

<sup>3</sup> 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 Derivate auf Devisen

Verkauf Währung	Verkauf Betrag	Kauf Währung	Kauf Betrag	Fälligkeit	Wiederbeschaffungswert in CHF	In % des Vermögens
<b>Devisentermingeschäfte**</b>						
EUR	100	CHF	95	19.07.2024	-1	0.00
EUR	504 000	CHF	479 607	19.07.2024	-5 088	0.00
EUR	3 100 000	CHF	2 944 275	19.07.2024	-36 986	0.00
USD	10 330 000	CHF	8 784 766	09.01.2025	-283 212	-0.02
USD	5 180 000	CHF	4 547 299	09.01.2025	142	0.00
					-325 145	-0.02

Obige Angaben können Rundungsdifferenzen enthalten.

\*\* bewertet aufgrund von am Markt beobachtbaren Parametern

### Während der Berichtsperiode getätigte Derivate auf Devisen

Verkauf Währung	Verkauf Betrag	Kauf Währung	Kauf Betrag	Fälligkeit
<b>Devisentermingeschäfte</b>				
EUR	1 040 000	CHF	996 474	27.03.2024
EUR	595 000	CHF	566 782	25.06.2024
EUR	3 120 000	CHF	2 973 317	25.06.2024
EUR	100	CHF	95	19.07.2024
EUR	504 000	CHF	479 607	19.07.2024
EUR	3 100 000	CHF	2 944 275	19.07.2024
USD	10 330 000	CHF	8 784 766	09.01.2025
USD	5 180 000	CHF	4 547 299	09.01.2025

## Ergänzende Angaben

### Derivative Finanzinstrumente

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

Position	Betrag in CHF	in % des Nettofonds- vermögens
Total engagementerhöhende Positionen	–	–
Total engagementreduzierende Positionen	17 408 302,99	1,37%

### Pensionsgeschäfte

Per Bilanzstichtag waren keine Effekten in Pension gegeben.

### Vergütung an die Fondsleitung

Verwaltungskommission

- Effektiv erhobene Verwaltungskommission:
  - Klasse A: 0,093625% p.a.;
  - Klasse A Cap: 0,093625% p.a.;
- Maximale erhobene Verwaltungskommission für alle Klassen gemäss Fondsvertrag: 0,50% p.a.;
- Effektiv erhobene Depotbankkommission für alle Klassen: 0,006375% p.a.;
- Maximale erhobene Depotbankkommission für alle Klassen gemäss Fondsvertrag: 0,25% 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 A:	0,10%
Klasse A Cap:	0,10%

### Umrechnungskurse

EUR 1 = CHF 0.963075      USD 1 = CHF 0.898600

## (OTC-)Derivate

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.

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

Stichtag: 30.6.2024	Swiss Life Funds (CH) Money Market Swiss Francs
<b>Währung:</b>	<b>CHF</b>
<b>Gegenparteien und Kurswert der OTC Derivate</b>	
Merrill Lynch	-1.05
UBS AG	-325 144.00
<b>Art und Höhe der entgegengenommenen Sicherheiten:</b>	
- Anleihen	-
- Aktien	-
- Barmittel	-
- Anlagefonds	-
- Geldmarktanlagen	-
- Übrige Sicherheiten	-
<b>Total entgegengenommenen Sicherheiten</b>	<b>-</b>