

Swiss Life Funds (CH)

Swiss Small & Mid Cap Equities

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

Halbjahresbericht per 30. Juni 2024

Ungeprüfter Halbjahresbericht per 30. Juni 2024

Inhaltsverzeichnis	Seite	ISIN
Organisation	2	
Swiss Life Funds (CH)		
Swiss Small & Mid Cap Equities	4	I-A1/ CH1269116823 I-A2/ CH1269116831

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 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 durch ihre langjährige Erfahrung in den übertragenen Bereichen aus. 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)

Swiss Small & Mid Cap Equities

Art übrige Fonds für traditionelle Anlagen

Wichtigste Daten

	ISIN	30.6.2024 ¹
Nettofondsvermögen in CHF		218 625 300.74
Klasse I-A1	CH1269116823	
Nettoinventarwert pro Anteil in CHF		105.55
Ausgabe- und Rücknahmepreis pro Anteil in CHF ²		105.55
Anzahl Anteile im Umlauf		2 059 180,0000
Klasse I-A2	CH1269116831	
Nettoinventarwert pro Anteil in CHF		105.29
Ausgabe- und Rücknahmepreis pro Anteil in CHF ²		105.29
Anzahl Anteile im Umlauf		12 211,0000

¹ Erstemission per 30.6.2023

² siehe Ergänzende Angaben

Struktur des Wertpapierportfolios (ungeprüft)

Die 10 grössten Positionen in % des Gesamtfondsvermögens	
Sandoz Group AG	7,34
Schindler Holding AG	7,15
Roche Holding AG	5,22
Julius Baer Group Ltd	5,22
Lindt & Spruengli AG	5,12
PSP Swiss Property AG	4,29
Siegfried Holding AG	4,18
Helvetia Holding AG	4,16
Sulzer AG	3,27
Swissquote Group Holding Ltd	3,17
Übrige	49,17
Total	98,29

Obige Prozentsätze können Rundungsdifferenzen enthalten.

Vermögensrechnung

30.6.2024

Verkehrswerte	CHF
Bankguthaben	
– auf Sicht	2 144 612.84
Effekten	
– Aktien und andere Beteiligungspapiere	215 009 165.97
Sonstige Vermögenswerte	1 607 733.74
Gesamtfondsvermögen	218 761 512.55
Andere Verbindlichkeiten	-136 211.81
Nettofondsvermögen	218 625 300.74

Erfolgsrechnung

30.6.2023-30.6.2024

Ertrag	CHF
Erträge der Bankguthaben	16 339.99
Erträge der Effekten	
– aus Aktien und anderen Beteiligungspapieren	4 562 774.39
Erträge der Effektenleihe	4 150.06
Einkauf in laufende Nettoerträge bei der Ausgabe von Anteilen	178 612.75
Total Ertrag	4 761 877.19
Aufwand	
Passivzinsen	-292.85
Reglementarische Kommissionsvergütung an die Fondsleitung Klasse I-A1	-420 369.64
Reglementarische Kommissionsvergütung an die Fondsleitung Klasse I-A2	-968.09
Reglementarische Kommissionsvergütung an die Depotbank	-11 012.23
Sonstige Aufwendungen	-60.00
Ausrichtung laufender Nettoerträge bei der Rücknahme von Anteilen	-241.75
Total Aufwand	-432 944.56
Nettoertrag	4 328 932.63
Realisierte Kapitalgewinne und -verluste	-815 256.91
Realisierter Erfolg	3 513 675.72
Nicht realisierte Kapitalgewinne und -verluste	13 051 383.81
Gesamterfolg	16 565 059.53

Veränderung des Nettofondsvermögens

30.6.2023-30.6.2024

	CHF
Nettofondsvermögen zu Beginn des Rechnungsjahres	0.00
Saldo aus dem Anteilverkehr	202 060 241.21
Gesamterfolg	16 565 059.53
Nettofondsvermögen am Ende der Berichtsperiode	218 625 300.74

Entwicklung der Anteile im Umlauf

30.6.2023-30.6.2024

Klasse I-A1	Anzahl
Bestand Anfang Rechnungsjahr	0,0000
Ausgegebene Anteile	2 059 180,0000
Zurückgenommene Anteile	0,0000
Bestand Ende Berichtsperiode	2 059 180,0000

Differenz zwischen den ausgegebenen und zurückgenommenen Anteilen 2 059 180,0000

Klasse I-A2	Anzahl
Bestand Anfang Rechnungsjahr	0,0000
Ausgegebene Anteile	12 366,0000
Zurückgenommene Anteile	-155,0000
Bestand Ende Berichtsperiode	12 211,0000

Differenz zwischen den ausgegebenen und zurückgenommenen Anteilen 12 211,0000

Inventar des Fondsvermögens

Titel	30.6.2023 Anzahl/ Nominal	Käufe ¹	Verkäufe ²	30.6.2024 Anzahl/ Nominal	Verkehrswert ³ in CHF	in % ³	Davon ausgeliehen Anzahl/Nominal
Effekten, die an einer Börse gehandelt werden							
Inhaberaktien							
Österreich							
PIERER MOBILITY AG NPV*	CHF	5 458	5 458				
Total Österreich							0,00
Schweiz							
AUTONEUM HLDG AG CHF0.05(REGD)*	CHF	20 067	2 020	18 047	2 346 110	1,07	6 381
GALENICA AG CHF0.1*	CHF	119 876	26 876	93 000	6 840 150	3,13	
LANDIS & GYR GROUP CHF10 (REGD)*	CHF	94 396		94 396	6 853 150	3,13	
ROCHE HLDGS AG CHF1(BR)*	CHF	43 981	2 289	41 692	11 415 270	5,22	
SENSIRION AG NPV*	CHF	5 311		5 311			
SKAN GROUP AG CHF0.01 (REGD)*	CHF	29 306	331	28 975	2 312 205	1,06	
SWATCH GROUP CHF2.25(BR)*	CHF	35 490	35 490				
Total Schweiz					29 766 884	13,61	
Total Inhaberaktien					29 766 884	13,61	
Partizipationsscheine							
Schweiz							
LINDT & SPRUENGLI PTG CERT CHF10*	CHF	1 115	47	1 068	11 203 320	5,12	
SCHINDLER-HLDG AG PTG CERT CHF0.10(POST-SUBD)*	CHF	74 214	4 923	69 291	15 645 908	7,15	
Total Schweiz					26 849 228	12,27	
Total Partizipationsscheine					26 849 228	12,27	
Namensaktien							
Nordamerika							
BB BIOTECH AG CHF0.20 (REGD)*	CHF	119 969		119 969	4 810 757	2,20	
Total Nordamerika					4 810 757	2,20	
Schweiz							
ACCELLERON INDUSTRI CHF1*	CHF	257 219	61 540	195 679	6 887 901	3,15	
ADECCO GROUP AG CHF0.1 (REGD)*	CHF	229 871	229 871				
ALLREAL HOLDING AG CHF1*	CHF	21 383	21 383				
ALSO HOLDING AG CHF1.00 (REGD)*	CHF	18 421	1 647	16 774	4 646 398	2,12	
ARYZTA AG CHF0.02 (REGD)*	CHF	2 928 688	156 568	2 772 120	4 435 392	2,03	
AVOLTA AG CHF5 (REGD)*	CHF	63 819		63 819	2 227 283	1,02	
BASILEA PHARMA CEUT CHF1(REGD)*	CHF	61 370	4 492	56 878	2 221 086	1,02	56 436
BKW AG CHF2.5*	CHF	22 582	22 582				
BQE CANT VAUDOISE CHF1*	CHF	79 980	8 353	71 627	6 829 634	3,12	
BUCHER INDUSTRIES CHF0.20 (REGD)*	CHF	16 386	16 386				
BURCKHARDT COMPRES CHF2.5*	CHF	10 354	10 354				
BURKHALTER HOLDING CHF0.04 (REG) POST CONS*	CHF	4 604	4 604				
CEMBRA MONEY BANK CHF1.00 (REGD)*	CHF	29 705	117	29 588	2 269 400	1,04	
DKSH HOLDING LTD CHF0.1*	CHF	112 508		112 508	6 829 236	3,12	
EMMI AG CHF10 (REGD)*	CHF	2 679	142	2 537	2 252 856	1,03	798
EMS-CHEMIE HLDG AG CHF0.01(REGD)(POST RECON)*	CHF	3 317	196	3 121	2 298 617	1,05	
FORBO HLDGS AG CHF0.10(REGD)*	CHF	3 014	867	2 147	2 245 762	1,03	
GALDERMA GROUP AG CHF0.01*	CHF	33 000	2 496	30 504	2 256 076	1,03	
GEORG FISCHER AG CHF0.05 (REGD) (POST SPLIT)*	CHF	32 538	32 538				
HELVETIA HOLDING CHF0.02 (REGD) POST SUBD*	CHF	75 244	300	74 944	9 105 696	4,16	
IMPLENIA AG CHF1.02 (REGD)*	CHF	16 279	16 279				
INFICON HOLDING AG CHF5(REGD)*	CHF	4 991	49	4 942	6 750 772	3,09	
JULIUS BAER GRUPPE CHF0.02 (REGD)*	CHF	323 780	96 503	227 277	11 409 305	5,22	
LEM HLDGS AG CHF0.50(REGD)(POST SUBD)*	CHF	1 575	1 575		2 252 250	1,03	
MEDACTA GROUP SA CHF0.10*	CHF	3 668	3 668				
MOBILEZONE HOLDING CHF0.01(REG)*	CHF	231 857	67 349	164 508	2 243 889	1,03	
MOBIMO HLDG AG CHF23.40 (REGD)*	CHF	18 457	152	18 305	4 658 623	2,13	
PSP SWISS PROPERTY CHF0.10 (REGD)*	CHF	83 051	1 625	81 426	9 388 418	4,29	
SANDOZ GROUP AG CHF0.05*	CHF	493 424		493 424	16 056 017	7,34	
SFS GROUP AG CHF0.1*	CHF	11 281	11 281				
SGS SA CHF0.04*	CHF	33 983	5 593	28 390	2 271 200	1,04	
SIEGFRIED HLDG AG CHF27 (REGD)*	CHF	9 804		9 804	9 147 132	4,18	
STRAUMANN HLDG CHF0.01 (REGD) (POST SPLIT)*	CHF	68 849	47 334	21 515	2 394 620	1,09	
SULZER AG CHF0.01*	CHF	62 154	4 494	57 660	7 161 372	3,27	
SWISS PRIME SITE CHF15.3 (REGD)*	CHF	90 249	90 249				
SWISSQUOTE GP HLDG CHF0.20 (REGD)*	CHF	31 981	7 549	24 432	6 928 915	3,17	
TECAN GROUP AG CHF0.10(REGD)*	CHF	22 978	351	22 627	6 806 202	3,11	
TEMENOS AG CHF5 (REGD)*	CHF	123 582	123 582				
U-BLOX HOLDING AG CHF10.50 (REGD)*	CHF	52 256	4 055	48 201	4 540 534	2,08	
VAT GROUP AG CHF0.10*	CHF	4 724	113	4 611	2 348 843	1,07	
VONTOBEL HLDGS AG CHF1 (REGD)*	CHF	45 244	45 244				
VZ HOLDING AG CHF0.05 (REGD)*	CHF	20 346	43	20 303	2 338 906	1,07	
YPSOMED HOLDING AG CHF14.15 (REGD)*	CHF	22 044	16 153	5 891	2 379 964	1,10	
ZEHNDER GROUP CHF0.05 (REGD) 'A'*	CHF	30 713	30 713				
Total Schweiz					153 582 297	70,22	
Total Namensaktien					158 393 054	72,41	
Total Effekten, die an einer Börse gehandelt werden					215 009 166	98,29	
Total Wertschriften (davon ausgeliehen)					215 009 166	98,29	3 741 980 (1,71)
Bankguthaben auf Sicht					2 144 613	0,98	
Sonstige Vermögenswerte					1 607 734	0,73	
Gesamtfondsvermögen					218 761 513	100,00	
Andere Verbindlichkeiten					-136 212		
Nettofondsvermögen					218 625 301		

Bewertungskategorie	Verkehrswert per 30.6.2024	in % des Gesamt- fondsvermögens ³
Anlagen bewertet zu den Kursen, die am Hauptmarkt bezahlt werden	215 009 166	98,29
Anlagen bewertet aufgrund von am Markt beobachtbaren Parametern	–	–
Anlagen bewertet mit geeigneten Bewertungsmodellen unter Berücksichtigung der aktuellen Marktgegebenheiten	–	–
Total	215 009 166	98,29

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)

Ergänzende Angaben

Derivative Finanzinstrumente

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

Per Bilanzstichtag waren keine Kontrakte in derivativen Finanzinstrumenten offen.

Pensionsgeschäfte

Die Fondsleitung tätigt keine Pensionsgeschäfte.

Vergütung an die Fondsleitung

Verwaltungskommission

- Effektiv erhobene Verwaltungskommission:
 - Klasse I-A1: 0,243625% p.a.;
 - Klasse I-A2: 0,493625% p.a.;
- Maximale Verwaltungskommission gemäss Fondsvertrag:
 - Klasse I-A1: 1,00% p.a.;
 - Klasse I-A2: 1,20% p.a.;
- Effektiv erhobene Depotbankkommission:
 - für alle Klassen 0,006375% p.a.;
- Maximale Depotbankkommission 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 annualisiert:

- Klasse I-A1: 0,25%
- Klasse I-A2: 0,50%

Ausgabe- und Rücknahmepreis

Falls an einem Bewertungstag die Summe der Zeichnungen und Rücknahmen von Anteilen des Anlagefonds zu einem Nettovermögenszufluss bzw. -abfluss führt, wird der Nettoinventarwert des Anlagefonds erhöht bzw. reduziert (Swinging Single Pricing). Die maximale Anpassung beläuft sich auf 2% des Nettoinventarwerts. Berücksichtigt werden die Nebenkosten (Geld/Brief-Spannen, marktübliche Courtagen, Kommissionen, Steuern und Abgaben usw.) sowie die Kosten für die Überprüfung und Aufrechterhaltung von Qualitätsstandards bei physischen Anlagen, die aus der Anlage des einbezahlten Betrags bzw. aus dem Verkauf eines dem gekündigten Anteil entsprechenden Teils der Anlagen erwachsen. Die Anpassung führt zu einer Erhöhung des Nettoinventarwerts, wenn die Nettobewegung zu einem Anstieg der Anzahl Anteile des Anlagefonds führt. Die Anpassung resultiert in einer Verminderung des Nettoinventarwerts, wenn die Nettobewegung einen Rückgang der Anzahl der Anteile des Anlagefonds bewirkt. Die Berücksichtigung dieser Nebenkosten entfällt, falls die Fondsleitung einer Ein- oder Auszahlung in Anlagen statt in bar gemäss § 17 Ziff. 7 gestattet sowie beim Wechsel zwischen Anteilsklassen innerhalb des Anlagefonds. Der unter Anwendung des Swinging Single Pricing ermittelte Nettoinventarwert ist somit ein modifizierter Nettoinventarwert.

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

Effektenleihe

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.

Effektenleihe und Sicherheiten

Berichtszeitraum: 30. Juni 2023 - 30. Juni 2024	Swiss Life Funds (CH) Swiss Small & Mid Cap Equities
Kontrahentenrisiko aus der Effektenleihe per 30. Juni 2024	
UBS AG	
- Marktwert der verliehenen Effekten	3 779 094.00 CHF
- Sicherheiten	4 094 507.24 CHF
Aufschlüsselung der Sicherheiten (Gewichtung in %) per 30. Juni 2024	
nach Art der Vermögenswerte:	
- Anleihen	100.00%
- Aktien	-
- Geldmarktanlagen	-
Effektenleihe	
Erträge aus der Effektenleihe	5 928.66 CHF
Operative Kosten der Effektenleihe	1 778.60 CHF
Fondserträge aus der Effektenleihe	4 150.06 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.