SwissLife
Asset Managers

# Swiss Life Funds (LUX)

Bond Emerging Markets Corporates
Bond Emerging Markets Corporates Short Term
Bond Euro Corporates
Bond Global Corporates
Bond Global Corporates Short Term
Bond Global High Yield
Bond Inflation Protection
Equity Euro Zone
Equity Global
Equity Global High Dividend
Equity Global Long/Short
Equity Global Minimum Volatility
Equity Global Protect
Equity USA
Fixed Income Alpha Select (3. September 2019)
Multi Asset Risk Premia
Prudent (EUR)
Harmony (EUR)
Income Equity Euro Zone (19. Dezember 2019)
Portfolio Global Growth (CHF)
Vitality (EUR)

*Investmentgesellschaft mit veränderlichem Kapital*
Luxemburg B 69.186

## Halbjahresbericht mit ungeprüftem Geschäftsbericht zum 29. Februar 2020

Auf alleiniger Grundlage dieses Berichts kann keine Zeichnung entgegengenommen werden. Zeichnungen sind nur gültig, falls sie auf Grundlage des aktuellen Prospekts erfolgen, der durch den letzten verfügbaren Geschäftsbericht einschließlich des geprüften Jahresabschlusses der SICAV und den letzten Halbjahresbericht (sofern nach diesem Jahresbericht veröffentlicht) ergänzt wurde.

Vertriebsbeschränkungen
Anteile dieser Gesellschaft dürfen nicht in den USA angeboten, verkauft oder vertrieben werden.

Dieses Dokument kann auch in andere Sprachen übersetzt werden. Bei Unstimmigkeiten zwischen der englischen Version und der Version in einer anderen Sprache hat die englische Version Vorrang, außer im gesetzlich erforderlichen Umfang anderer Rechtsgebiete, in denen die Anteile verkauft werden (und nur insoweit).

## Inhaltsverzeichnis

Organisation und Verwaltung 1
Allgemeine Informationen zum Unternehmen 3
Informationen für die Anteilinhaber 5
Nettovermögensaufstellung 8
Aufwands- und Ertragsrechnung und Veränderungen im Nettovermögen 16
Statistische Informationen 24
Wertentwicklung 36

**Swiss Life Funds (LUX) Bond Emerging Markets Corporates**
Anlagenübersicht 45
Sektorstruktur und geographische Verteilung der Anlagen 52

**Swiss Life Funds (LUX) Bond Emerging Markets Corporates Short Term**
Anlagenübersicht 53
Sektorstruktur und geographische Verteilung der Anlagen 57

**Swiss Life Funds (LUX) Bond Euro Corporates**
Anlagenübersicht 58
Sektorstruktur und geographische Verteilung der Anlagen 64

**Swiss Life Funds (LUX) Bond Global Corporates**
Anlagenübersicht 65
Sektorstruktur und geographische Verteilung der Anlagen 72

**Swiss Life Funds (LUX) Bond Global Corporates Short Term**
Anlagenübersicht 73
Sektorstruktur und geographische Verteilung der Anlagen 78

**Swiss Life Funds (LUX) Bond Global High Yield**
Anlagenübersicht 79
Sektorstruktur und geographische Verteilung der Anlagen 85

**Swiss Life Funds (LUX) Bond Inflation Protection**
Anlagenübersicht 86
Sektorstruktur und geographische Verteilung der Anlagen 87

**Swiss Life Funds (LUX) Equity Euro Zone**
Anlagenübersicht 88
Sektorstruktur und geographische Verteilung der Anlagen 92

**Swiss Life Funds (LUX) Equity Global**
Anlagenübersicht 93
Sektorstruktur und geographische Verteilung der Anlagen 101

## **Inhaltsverzeichnis** (Fortsetzung)

**Swiss Life Funds (LUX) Equity Global High Dividend**
Anlagenübersicht 102
Sektorstruktur und geographische Verteilung der Anlagen 107

**Swiss Life Funds (LUX) Equity Global Long/Short**
Anlagenübersicht 108
Sektorstruktur und geographische Verteilung der Anlagen 119

**Swiss Life Funds (LUX) Equity Global Minimum Volatility**
Anlagenübersicht 120
Sektorstruktur und geographische Verteilung der Anlagen 124

**Swiss Life Funds (LUX) Equity Global Protect**
Anlagenübersicht 125
Sektorstruktur und geographische Verteilung der Anlagen 138

**Swiss Life Funds (LUX) Equity USA**
Anlagenübersicht 139
Sektorstruktur und geographische Verteilung der Anlagen 144

**Swiss Life Funds (LUX) Fixed Income Alpha Select**
Anlagenübersicht 145
Sektorstruktur und geographische Verteilung der Anlagen 150

**Swiss Life Funds (LUX) Multi Asset Risk Premia**
Anlagenübersicht 151

**Swiss Life Funds (LUX) Prudent (EUR)**
Anlagenübersicht 162
Sektorstruktur und geographische Verteilung der Anlagen 163

**Swiss Life Funds (LUX) Harmony (EUR)**
Anlagenübersicht 164
Sektorstruktur und geographische Verteilung der Anlagen 165

**Swiss Life Funds (LUX) Income Equity Euro Zone**
Anlagenübersicht 166
Sektorstruktur und geographische Verteilung der Anlagen 168

**Swiss Life Funds (LUX) Portfolio Global Growth (CHF)**
Anlagenübersicht 169
Sektorstruktur und geographische Verteilung der Anlagen 173

## **Inhaltsverzeichnis** (Fortsetzung)

**Swiss Life Funds (LUX) Vitality (EUR)**
Anlagenübersicht 174
Sektorstruktur und geographische Verteilung der Anlagen 175

Anmerkungen zum Geschäftsbericht 176

Sonstige Informationen 205

## Organisation und Verwaltung

**Geschäftssitz**

4a, rue Albert Borschette, L-1246 Luxemburg,
Großherzogtum Luxemburg

**Verwaltungsrat der Gesellschaft**

**Vorsitzender:**
(bis zum 6. März 2019)
Frank Engelmann, Vorsitzender
Swiss Life Asset Managers Luxembourg
Luxemburg, Großherzogtum Luxemburg

(ab 6. März 2019)
Thomas Albert, Vorsitzender
Swiss Life Asset Managers Luxembourg
Luxemburg, Großherzogtum Luxemburg

**Verwaltungsratsmitglieder:**
(bis zum 6. März 2019)
Julia Delarue, Director
Swiss Life Asset Management (France) S.A.
Paris, Frankreich

(ab 6. März 2019)
Christine Bernhofer, Director
Swiss Life Asset Management (France) S.A.
Paris, Frankreich

Lorenzo Kyburz, Executive Director
Swiss Life Investment Management Holding Ltd.
Zürich, Schweiz

**Verwaltungsgesellschaft**

**Eingetragener Sitz:**
Swiss Life Asset Managers Luxemburg
4a, rue Albert Borschette, L-1246 Luxemburg,
Großherzogtum Luxemburg

**Verwaltungsrat der Verwaltungsgesellschaft**

**Vorsitzender:**
Dagmar Maroni
Head Business & Product Management
Swiss Life Asset Management AG

**Verwaltungsratsmitglieder:**
Per Erikson
Chief Investment Officer von Swiss Life
Frankreich

Uwe Druckenmüller
Chief Executive Officer
Swiss Life Asset Managers Luxembourg

Robin van Berkel
Head Collective Investments und
CEO Swiss Life Asset Management AG

Thomas Nummer
Partner
Trinova Group

**Leitende Mitarbeiter der Verwaltungsgesellschaft**

Thomas Albert
Swiss Life Asset Managers Luxembourg
Großherzogtum Luxemburg

Uwe Druckenmüller
Swiss Life Asset Managers Luxembourg
Großherzogtum Luxemburg

Franziska Feitzinger
Swiss Life Asset Managers Luxembourg
Großherzogtum Luxemburg

Jasmin Heitz
Swiss Life Asset Managers Luxembourg
Großherzogtum Luxemburg

Tilo Reichert
Swiss Life Asset Managers Luxembourg
Großherzogtum Luxemburg

Giedre Plentaite-Bartkiene,
Swiss Life Asset Managers Luxembourg
Großherzogtum Luxemburg

**Vertretungs- und Domizilstelle**

Swiss Life Asset Managers Luxembourg
4a, rue Albert Borshette, L-1246 Luxembourg,
Großherzogtum Luxemburg

## Organisation und Verwaltung (Fortsetzung)

**Verwaltungs und Registerstelle**

Société Générale Luxembourg
11, avenue Emile Reuter, L-2420 Luxemburg,
Großherzogtum Luxemburg

Betriebszentrale
28-32, Place de la gare, L-1616 Luxemburg,
Großherzogtum Luxemburg

**Depot- und Zahlstelle („Depotstelle")**

Société Générale Luxemburg
11, avenue Emile Reuter, L-2420 Luxemburg,
Großherzogtum Luxemburg

**Wirtschaftsprüfer**

PricewaterhouseCoopers, Société coopérative
Chartered Accountants
2, rue Gerhard Mercator, L-2182 Luxemburg,
Großherzogtum Luxemburg

**Portfolioverwaltung**

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

Swiss Life Asset Management (Frankreich)
153, rue Saint Honoré, F-75001 Paris,
Frankreich

**Vertreter in der Schweiz**

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

**Zahlstelle in der Schweiz**

UBS Switzerland AG
Bahnhofstrasse 45, CH-8001 Zürich,
Schweiz

**Informationsstelle in Deutschland**

Swiss Life Invest GmbH
Zeppelinstrasse 1,
D-85748 Garching, München, Deutschland

**Zahlstelle in Deutschland**

Landesbank Hessen-Thüringen
Girozentrale, Neue Mainzer Straße 52-58,
D-60311 Frankfurt am Main, Deutschland

**Zentralstelle in Frankreich**

(bis zum 28. Juni 2019)
Swiss Life Banque Privée
7, place Vendôme, F-75041 Paris Cedex 01,
Frankreich

(ab 28. Juni 2019)
Société Générale
32, rue du champ de Tir CS 30812 F-44312 Nantes
Cedex 3 Frankreich

**Rechtsbeistand**

Arendt & Medernach S.A.
Avocats à la Cour
41A, avenue J.F. Kennedy
L-2082 Luxemburg
Großherzogtum Luxemburg

Der Verkaufsprospekt und das Basisinformationsblatt (wesentliche Informationen für den Anleger, auch kurz KIID), das Verwaltungsreglement, die Jahres- und Halbjahresberichte sowie die in diesem Dokument erwähnten Portfoliobewegungen der Gesellschaft sind beim Schweizer Vertreter und am eingetragenen Geschäftssitz der Gesellschaft kostenlos erhältlich.

## Allgemeine Informationen zum Unternehmen

Swiss Life Funds (LUX) (die „Gesellschaft“ oder die „SICAV“) ist eine offene Anlagegesellschaft, gegründet am 8. April 1999 auf unbestimmte Zeit auf Initiative von Swiss Life Ltd., mit eingetragenem Sitz in Zürich.

Die Gesellschaft ist in Luxemburg registriert als Organismus für gemeinsame Anlagen in Wertpapieren (OGAW bzw. OPCVM *Organisme de Placement Collectif en Valeurs Mobilières*). Die Gesellschaft wird auf der offiziellen Liste der Organismen für gemeinsame Anlagen geführt, gemäß dem Gesetz vom 17. Dezember 2010 über Organismen für gemeinsame Anlagen in geänderter Fassung (das „Gesetz von 2010“) und dem Gesetz vom 10. August 1915 über Handelsgesellschaften in geänderter Fassung. Maßgeblich ist insbesondere Teil I des Gesetzes von 2010.

Die Gesellschaftssatzung wurde erstmalig am 14. Mai 1999 im Mémorial veröffentlicht, nach Hinterlegung bei der Registerstelle des Amtsgerichts von Luxemburg, wo sie eingesehen werden kann und wo gegen Zahlung der Gebühr der Registerstelle Exemplare erhältlich sind. Die Satzung wurde letztmalig am 6. Juli 2015 durch notarielle Urkunde des Notariats Hellinckx geändert und am 27. Juli 2015 im Mémorial veröffentlicht.

Die Gesellschaft ist im Luxemburger Handelsregister unter der Nummer B 69.186 eingetragen.

Die Gesellschaft ist als Umbrellafonds organisiert. Die Satzung sieht vor, dass die Gesellschaft separate Anteilklassen ausgeben darf, die jeweils eine Beteiligung an einem Teilfonds darstellen und aus einem individuellen Anlageportfolio bestehen. Nach vorheriger Genehmigung der Aufsichtsbehörde kann der Verwaltungsrat zusätzliche Teilfonds schaffen.

Zum 29. Februar 2020, 21 Anlegern stehen folgende Teilfonds zur Verfügung:

- Swiss Life Funds (LUX) Bond Emerging Markets Corporates
- Swiss Life Funds (LUX) Bond Emerging Markets Corporates Short Term
- Swiss Life Funds (LUX) Bond Euro Corporates
- Swiss Life Funds (LUX) Bond Global Corporates
- Swiss Life Funds (LUX) Bond Global Corporates Short Term
- Swiss Life Funds (LUX) Bond Global High Yield
- Swiss Life Funds (LUX) Bond Inflation Protection
- Swiss Life Funds (LUX) Equity Euro Zone
- Swiss Life Funds (LUX) Equity Global
- Swiss Life Funds (LUX) Equity Global High Dividend
- Swiss Life Funds (LUX) Equity Global Long/Short
- Swiss Life Funds (LUX) Equity Global Minimum Volatility
- Swiss Life Funds (LUX) Equity Global Protect
- Swiss Life Funds (LUX) Equity USA
- Swiss Life Funds (LUX) Fixed Income Alpha Select [(1)]
- Swiss Life Funds (LUX) Multi Asset Risk Premia
- Swiss Life Funds (LUX) Prudent (EUR)
- Swiss Life Funds (LUX) Harmony (EUR)
- Swiss Life Funds (LUX) Income Equity Euro Zone [(1)]
- Swiss Life Funds (LUX) Portfolio Global Growth (CHF)
- Swiss Life Funds (LUX) Vitality (EUR)

In allen Klassen gibt es folgende Anteilsarten:

- ausschüttende Anteile, bei denen Anleger Anspruch auf eine jährliche Dividende haben und deren Nettoinventarwert sich um den Betrag der erfolgten Ausschüttung reduziert („ausschüttende Anteile“),
- thesaurierende Anteile, bei denen Anleger keinen Anspruch auf eine Dividende haben, deren Nettoinventarwert sich am Datum der Dividendenzahlung nicht ändert und bei denen sich der Prozentanteil am gesamten Nettoinventarwert, der auf die thesaurierenden Anteile zurückzuführen ist, entsprechend erhöht („thesaurierende Anteile“).

Der Verwaltungsrat kann die Ausgabe weiterer Anteilsklassen beschließen. Die Ausgabe weiterer Anteilsklassen muss der Aufsichtsbehörde mitgeteilt werden.

[(1)] Swiss Life Funds (LUX) Fixed Income Alpha Select wurde zum 3. September 2019 aufgelegt und Swiss Life Funds (LUX) Income Equity Euro Zone wurde zum 19. Dezember 2019 aufgelegt.

## **Allgemeine Informationen zum Unternehmen** (Fortsetzung)

Jede Anteilsklasse hat eine eigene Gebührenordnung für den Verkauf und die Rücknahme und für Verwaltungs- und Beratungsgebühren sowie unterschiedliche Vertriebs- und Servicegebühren oder sonstige Gebühren und richtet sich an unterschiedliche Arten von Anlegern.

Anteile der Klasse R („R-Anteile“) stehen allen Anlegern offen.

Anteile der Klasse I („I-Anteile“) sind beschränkt auf institutionelle Anleger im Sinne von Artikel 174 des Gesetzes von 2010.

Anteile der Klasse Q („Q-Anteile“) sind beschränkt auf institutionelle Anleger im Sinne von Artikel 174 des Gesetzes von 2010.

Anteile der Klasse S („S-Anteile“) sind beschränkt auf Teilfonds der Gesellschaft.

Anteile der Klasse AM („AM-Anteile“) sind beschränkt auf institutionelle Anleger im Sinne von Artikel 174 des Gesetzes von 2010, die eine Anlageverwaltungsvereinbarung mit Swiss Life Asset Management AG oder einem anderen Unternehmen der Swiss Life Group getroffen haben.

Anteile der Klasse M („M-Anteile“) sind beschränkt auf Swiss Life Asset Management AG, Swiss Life Germany oder ein anderes Unternehmen der Swiss Life Group, die im Auftrag ihrer fondsgebundenen Produktkunden handeln.

Anteile der Klasse SL („SL-Anteile“) sind beschränkt auf Swiss Life France, Swiss Life Germany und Swiss Life Switzerland oder ein anderes Unternehmen der Swiss Life Group, die im Auftrag ihres eigenen Versicherungsportfolios handeln.

Anteile der Klasse F („F-Anteile“) stehen allen Anlegern offen, werden aber nur über bestimmte Finanzintermediäre, Vertriebspartner oder Ähnliches angeboten, die im Auftrag ihrer Kunden investieren und diesen Beratungsgebühren oder Ähnliches berechnen.

Anteile der Klasse SF („SF-Anteile“) sind beschränkt auf Swiss Life France, die im Auftrag ihrer fondsgebundenen Produktkunden handelt.

## Informationen für die Anteilinhaber

Alle Hauptversammlungen finden am eingetragenen Sitz der Gesellschaft in Luxemburg statt oder an einem anderen Ort, der in der Ladung zu der Versammlung genannt wird. Ladungen zu einer Hauptversammlung müssen jedem registrierten Anteilinhaber mindestens acht Tage vor der Versammlung per Post an dessen im Anteilregister aufgeführte Adresse zugestellt und in dem in Luxemburg gesetzlich erforderlichen Umfang im Mémorial und je nach Entschluss des Verwaltungsrats in Luxemburger Zeitungen und anderen Zeitungen veröffentlicht werden.

Die Jahreshauptversammlung findet am zweiten Donnerstag des Monats Dezember um 11:00 Uhr am eingetragenen Sitz der Gesellschaft statt oder an einem anderen Ort im Großherzogtum Luxemburg, der in der Ladung zu der Versammlung genannt wird. Falls dieser Tag kein Werktag ist, findet die Versammlung am unmittelbar darauffolgenden Werktag statt.

Die Ladung wird gemäß Luxemburger Recht veröffentlicht und muss Ort und Zeitpunkt der Versammlung sowie die Tagesordnung der Versammlung angeben.

Das Geschäftsjahr der Gesellschaft dauert zwölf Monate und endet jedes Jahr am 31. August. Der Jahresbericht mit dem geprüften Geschäftsbericht der Gesellschaft und dem ungeprüften Halbjahresbericht der Gesellschaft und der Teilfonds für jedes Geschäftsjahr steht Anteilinhabern innerhalb von vier bzw. zwei Monaten nach Ende des betreffenden Jahres zur Verfügung.

Anteilinhaber können ihre Teilnahme an einen Stellvertreter delegieren. Anforderungen zur Beschlussfähigkeit und zu Stimmenmehrheiten aller Hauptversammlungen sind in der Satzung dargelegt.

Bei allen die Gesellschaft betreffenden Angelegenheiten, die Anteilinhabern zur Abstimmung vorgelegt werden, hat jeder Anteilinhaber eine Stimme pro Anteil. Alle Anteile aller Klassen haben die gleichen Stimmrechte.

Die Liste der Bestandsveränderungen ist am eingetragenen Sitz der Gesellschaft und bei Vertretungen im Ausland erhältlich.

Die detaillierte Gesamtkostenquote (Total Expense Ratio, TER) für das am 29. Februar 2020 beendete Jahr ist unten aufgeführt.

Die TER wurde in Übereinstimmung mit den „Guidelines on the calculation and disclosure of the TER“ der Swiss Funds & Asset Management Association (SFAMA) berechnet. Sie bringt die Summe aller dem Nettovermögen angerechneten laufenden Kosten und Provisionszahlungen (Betriebsaufwendungen) als rückwirkenden Prozentanteil des Nettovermögens zum Ausdruck.

Wenn ein Teilfonds mindestens 10% seines Nettovermögens als Dachfonds in Zielfonds anlegt, ist eine zusammengesetzte TER des Dachfonds wie folgt zu berechnen. Die anteilige TER des einzelnen Zielfonds einschließlich einer erfolgsabhängigen Vergütung, gewichtet nach dem Anteil, den sie am Gesamtvolumen des Dachfonds am Stichtag darstellen, und die TER des Dachfonds abzüglich der rückwirkenden Provisionen, die im Berichtsjahr vom Zielfonds erhalten wurde.

| Teilfonds | Anteilklassen | Währung | TER | Erfolgskosten |
|---|---|---|---|---|
| Swiss Life Funds (LUX) Bond Emerging Markets Corporates | AM-Anteile - in CHF Abgesichert - Thesaurierend | CHF | 0.23% | - |
| | AM-Anteile - in EUR Abgesichert -Thesaurierend | EUR | 0.22% | - |
| | F-Anteile - Thesaurierend | USD | 0.99% | - |
| | I-Anteile - Thesaurierend | USD | 0.78% | - |
| | I-Anteile - in CHF Abgesichert - Thesaurierend | CHF | 0.78% | - |
| | I-Anteile - in EUR Abgesichert - Ausschüttend | EUR | 0.77% | - |
| | I-Anteile - in EUR Abgesichert - Thesaurierend | EUR | 0.78% | - |
| | R-Anteile - in CHF Abgesichert - Thesaurierend | CHF | 1.43% | - |
| | R-Anteile - in EUR Abgesichert - Thesaurierend | EUR | 1.42% | - |
| | S-Anteile - in EUR Abgesichert - Thesaurierend | EUR | 0.07% | - |
| Swiss Life Funds (LUX) Bond Emerging Markets Corporates Short Term | AM-Anteile - in CHF Abgesichert Thesaurierend | CHF | 0.23% | - |
| | F-Anteile - Thesaurierend | USD | 0.74% | - |
| | I-Anteile - Thesaurierend | USD | 0.53% | - |
| | I-Anteile - in EUR Abgesichert Thesaurierend | EUR | 0.54% | - |
| | I-Anteile - in CHF Abgesichert Thesaurierend | CHF | 0.45% | - |
| Swiss Life Funds (LUX) Bond Euro Corporates | Q-Anteile - Thesaurierend | EUR | 0.66% | - |
| | R-Anteile - Thesaurierend | EUR | 1.14% | - |
| | R-Anteile in CHF Abgesichert - Thesaurierend | CHF | 1.15% | - |

## Informationen für die Anteilinhaber (Fortsetzung)

| Teilfonds | Anteilklassen | Währung | TER | Erfolgskosten |
|---|---|---|---|---|
| Swiss Life Funds (LUX) Bond Global Corporates | AM-Anteile - Thesaurierend | EUR | 0.25% | - |
| | I-Anteile - Thesaurierend | EUR | 0.51% | - |
| | I-Anteile - Ausschüttend | EUR | 0.49% | - |
| | I-Anteile in USD Abgesichert - Thesaurierend | USD | 0.51% | - |
| | R-Anteile - Thesaurierend | EUR | 1.04% | - |
| | R-Anteile in CHF Abgesichert - Thesaurierend | CHF | 1.04% | - |
| | S-Anteile - Thesaurierend | EUR | 0.09% | - |
| Swiss Life Funds (LUX) Bond Global Corporates Short Term | I-Anteile - Ausschüttend | EUR | 0.37% | - |
| | I-Anteile - Thesaurierend | EUR | 0.38% | - |
| | R-Anteile - Ausschüttend | EUR | 0.60% | - |
| Swiss Life Funds (LUX) Bond Global High Yield | AM-Anteile - Thesaurierend | EUR | 0.23% | - |
| | AM-Anteile in CHF Abgesichert - Thesaurierend | CHF | 0.23% | - |
| | F-Anteile - Thesaurierend | EUR | 0.89% | - |
| | I-Anteile - Thesaurierend | EUR | 0.68% | - |
| | I-Anteile - Ausschüttend | EUR | 0.68% | - |
| | I-Anteile - in CHF Abgesichert - Thesaurierend | CHF | 0.68% | - |
| | R-Anteile - Thesaurierend | EUR | 1.30% | - |
| | R-Anteile in CHF Abgesichert - Thesaurierend | CHF | 1.32% | - |
| | S-Anteile - Thesaurierend | EUR | 0.08% | - |
| Swiss Life Funds (LUX) Bond Inflation Protection | I-Anteile - Thesaurierend | EUR | 0.81% | - |
| | R-Anteile - Thesaurierend | EUR | 1.27% | - |
| Swiss Life Funds (LUX) Equity Euro Zone | AM-Anteile - Thesaurierend | EUR | 0.26% | - |
| | F-Anteile - Thesaurierend | EUR | 1.02% | - |
| | I-Anteile - Thesaurierend | EUR | 0.71% | - |
| | R-Anteile - Thesaurierend | EUR | 1.66% | - |
| | S-Anteile - Thesaurierend | EUR | 0.11% | - |
| Swiss Life Funds (LUX) Equity Global | AM-Anteile in EUR - Thesaurierend | EUR | 0.30% | - |
| | F-Anteile in CHF - Thesaurierend | CHF | 1.04% | - |
| | I-Anteile - Thesaurierend | USD | 0.74% | - |
| | I-Anteile EUR - Thesaurierend | EUR | 0.75% | - |
| | S-Anteile EUR - Thesaurierend | EUR | 0.15% | - |
| Swiss Life Funds (LUX) Equity Global High Dividend | AM-Anteile - Thesaurierend | EUR | 0.25% | - |
| | I-Anteile - Thesaurierend | EUR | 0.70% | - |
| | I-Anteile - Ausschüttend | EUR | 0.71% | - |
| | R-Anteile - Thesaurierend | EUR | 1.65% | - |
| | R-Anteile in CHF - Ausschüttend | CHF | 1.65% | - |
| | S-Anteile - Thesaurierend | EUR | 0.10% | - |
| Swiss Life Funds (LUX) Equity Global Long/Short | AM-Anteile - Thesaurierend | EUR | 0.31% | - |
| | I-Anteile - Thesaurierend | EUR | 0.46% | - |
| | S-Anteile - Thesaurierend | EUR | 0.16% | - |
| Swiss Life Funds (LUX) Equity Global Minimum Volatility | AM-Anteile in EUR - Thesaurierend | EUR | 0.25% | - |
| | I-Anteile - Thesaurierend | USD | 0.69% | - |
| | I-Anteile EUR - Thesaurierend | EUR | 0.70% | - |
| | I-Anteile EUR - Ausschüttend | EUR | 0.70% | - |
| | R-Anteile EUR - Ausschüttend | EUR | 1.64% | - |
| | S-Anteile EUR - Thesaurierend | EUR | 0.10% | - |
| Swiss Life Funds (LUX) Equity Global Protect | I-Anteile - Thesaurierend | EUR | 0.69% | - |
| | S-Anteile - Thesaurierend | EUR | 0.09% | - |
| Swiss Life Funds (LUX) Equity USA | AM-Anteile in EUR - Thesaurierend | EUR | 0.24% | - |
| | F-Anteile - Thesaurierend | USD | 1.00% | - |
| | I-Anteile - Thesaurierend | USD | 0.69% | - |
| | I-Anteile EUR - Thesaurierend | EUR | 0.69% | - |
| | R-Anteile - Thesaurierend | USD | 1.60% | - |
| | S-Anteile - Thesaurierend | USD | 0.09% | - |
| | SL-Anteile in EUR - Ausschüttend | EUR | 0.39% | - |

## **Informationen für die Anteilinhaber** (Fortsetzung)

| Teilfonds | Anteilklassen | Währung | TER | Erfolgskosten |
|---|---|---|---|---|
| Swiss Life Funds (LUX) Fixed Income Alpha Select [1] | AM-Anteile - Thesaurierend | EUR | 0.35% | - |
| | I-Anteile - Thesaurierend | EUR | 0.90% | - |
| | S-Anteile - Thesaurierend | EUR | 0.20% | - |
| Swiss Life Funds (LUX) Multi Asset Risk Premia | AM-Anteile - Thesaurierend | EUR | 0.35% | - |
| | AM-Anteile in CHF Abgesichert - Thesaurierend | CHF | 0.35% | - |
| | I-Anteile - Thesaurierend | EUR | 0.67% | - |
| | I-Anteile in CHF Abgesichert - Thesaurierend | CHF | 0.70% | - |
| | R-Anteile in CHF Abgesichert - Thesaurierend | CHF | 1.51% | - |
| | S-Anteile - Thesaurierend | EUR | 0.10% | - |
| Swiss Life Funds (LUX) Prudent (EUR) | F-Anteile - Thesaurierend | EUR | 0.87% | - |
| | I-Anteile - Thesaurierend | EUR | 0.63% | - |
| | M-Anteile - Thesaurierend | EUR | 0.53% | - |
| | R-Anteile - Thesaurierend | EUR | 1.35% | - |
| Swiss Life Funds (LUX) Harmony (EUR) | M-Anteile - Thesaurierend | EUR | 0.61% | - |
| | R-Anteile - Thesaurierend | EUR | 1.64% | - |
| Swiss Life Funds (LUX) Income Equity Euro Zone [2] | AM-Anteile - Ausschüttend | EUR | 0.27% | - |
| | S-Anteile - Thesaurierend | EUR | 0.12% | - |
| | SL-Anteile - Ausschüttend | EUR | 0.52% | - |
| Swiss Life Funds (LUX) Portfolio Global Growth (CHF) | R-Anteile - Thesaurierend | CHF | 1.75% | - |
| Swiss Life Funds (LUX) Vitality (EUR) | M-Anteile - Thesaurierend | EUR | 0.69% | - |
| | R-Anteile - Thesaurierend | EUR | 1.92% | - |

[1] Dieser Teilfonds wurde zum 3. September 2019 aufgelegt.

[2] Dieser Teilfonds wurde zum 19. Dezember 2019 aufgelegt.

## Nettovermögensaufstellung

(in der Währung des Teilfonds)

| | Anmerkungen | Swiss Life Funds (LUX) Bond Emerging Markets Corporates USD | Swiss Life Funds (LUX) Bond Emerging Markets Corporates Short Term USD | Swiss Life Funds (LUX) Bond Euro Corporates EUR |
|---|---|---|---|---|
| **VERMÖGENSWERTE** | | | | |
| Wertpapierbestand zu Einstandspreisen | | 425 704 569 | 278 856 468 | 55 040 796 |
| Nicht realisierter Nettogewinn/ (-verlust) | | 22 887 448 | 2 457 578 | 1 069 333 |
| Wertpapierbestand zum Marktwert | 2.3 | 448 592 017 | 281 314 046 | 56 110 129 |
| Bareinlagen bei Banken | | 24 710 932 | 10 230 436 | 5 088 511 |
| Festgelder | | - | - | - |
| Forderungen für ausgegebene Fondsanteile | | 49 619 | - | - |
| Forderungen für verkaufte Wertpapiere | 2.8 | 12 232 641 | 1 026 250 | 426 684 |
| Forderungen aus Dividenden, netto | | - | - | - |
| Erhaltene Bankzinsen | | - | - | - |
| Zinsforderungen aus Anleihen | | 4 860 827 | 2 899 653 | 353 726 |
| Zum Marktwert gekaufte Optionen | 7 | - | - | - |
| Swapgeschäfte zum Marktwert | 10 | - | - | - |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisentermingeschäften | 8 | 217 142 | 81 275 | 183 731 |
| Nicht realisierter Gewinn aus Finanztermingeschäften | 6 | - | 56 250 | 66 780 |
| Gründungskosten, netto | 2.10 | - | - | - |
| | | **490 663 178** | **295 607 910** | **62 229 561** |
| **VERBINDLICHKEITEN** | | | | |
| Überziehungskredit | | - | - | 5 032 |
| Verbindlichkeiten für zurückgenommene Fondsanteile | | 438 285 | 1 596 384 | 16 276 |
| Verbindlichkeiten für erworbene Wertpapiere | 2.8 | 4 191 905 | 1 610 539 | - |
| Verbindlichkeiten aus Swapgeschäften | 10 | - | - | - |
| Verbindlichkeiten aus Managementgebühren | 3 | 282 018 | 90 147 | 54 679 |
| Verbindlichkeiten aus Depotgebühren | 4 | 49 117 | 29 397 | 5 782 |
| *Verbindlichkeiten aus der „Taxe d'abonnement"* | 5 | 10 056 | 4 914 | 2 105 |
| Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühren | 4 | 119 665 | 66 579 | 26 571 |
| Fällige Gebühren der Registerstelle | 4 | 1 013 | 1 014 | 923 |
| Verbindlichkeiten aus Honoraren | | 12 563 | 12 563 | 11 407 |
| Verbindlichkeiten aus Zinsen und Bankgebühren | | 6 429 | 1 832 | 2 001 |
| Zinsverbindlichkeiten aus Swapgeschäften | | - | - | - |
| Zu Marktpreisen verkaufte Optionen | 7 | - | - | - |
| Swapgeschäfte zum Marktwert | 10 | - | - | - |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisentermingeschäften | 8 | 2 104 694 | 424 280 | 777 |
| Nicht realisierter Verlust aus Finanztermingeschäften | 6 | - | - | - |
| Sonstige Passiva | | 5 691 | - | 3 006 |
| | | **7 221 436** | **3 837 649** | **128 559** |
| **GESAMTVERMÖGEN** | | **483 441 742** | **291 770 261** | **62 101 002** |

## **Nettovermögensaufstellung** (Fortsetzung)

(in der Währung des Teilfonds)

| | Anmerkungen | Swiss Life Funds (LUX) Bond Global Corporates EUR | Swiss Life Funds (LUX) Bond Global Corporates Short Term EUR | Swiss Life Funds (LUX) Bond Global High Yield EUR |
|---|---|---|---|---|
| **VERMÖGENSWERTE** | | | | |
| Wertpapierbestand zu Einstandspreisen | | 177 228 001 | 64 993 765 | 279 263 154 |
| Nicht realisierter Nettogewinn/ (-verlust) | | 15 094 713 | 1 885 466 | 1 768 694 |
| Wertpapierbestand zum Marktwert | 2.3 | 192 322 714 | 66 879 231 | 281 031 848 |
| Bareinlagen bei Banken | | 6 142 476 | 2 566 695 | 5 473 650 |
| Festgelder | | - | - | - |
| Forderungen für ausgegebene Fondsanteile | | 3 331 | - | - |
| Forderungen für verkaufte Wertpapiere | 2.8 | 4 196 548 | - | - |
| Forderungen aus Dividenden, netto | | - | - | - |
| Erhaltene Bankzinsen | | - | - | - |
| Zinsforderungen aus Anleihen | | 1 403 033 | 521 105 | 3 801 257 |
| Zum Marktwert gekaufte Optionen | 7 | - | - | - |
| Swapgeschäfte zum Marktwert | 10 | - | - | - |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisentermingeschäften | 8 | 1 626 917 | 630 542 | 1 545 527 |
| Nicht realisierter Gewinn aus Finanztermingeschäften | 6 | 426 868 | 66 740 | - |
| Gründungskosten, netto | 2.10 | - | 29 | - |
| | | **206 121 887** | **70 664 342** | **291 852 282** |
| **VERBINDLICHKEITEN** | | | | |
| Überziehungskredit | | - | 5 349 | 973 747 |
| Verbindlichkeiten für zurückgenommene Fondsanteile | | 16 778 | - | - |
| Verbindlichkeiten für erworbene Wertpapiere | 2.8 | - | 376 205 | - |
| Verbindlichkeiten aus Swapgeschäften | 10 | - | - | - |
| Verbindlichkeiten aus Managementgebühren | 3 | 191 240 | 32 012 | 133 542 |
| Verbindlichkeiten aus Depotgebühren | 4 | 20 334 | 9 009 | 30 913 |
| *Verbindlichkeiten aus der „Taxe d'abonnement"* | 5 | 11 097 | 1 416 | 5 738 |
| Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühren | 4 | 58 918 | 29 201 | 83 868 |
| Fällige Gebühren der Registerstelle | 4 | 923 | 923 | 923 |
| Verbindlichkeiten aus Honoraren | | 11 407 | 11 407 | 11 407 |
| Verbindlichkeiten aus Zinsen und Bankgebühren | | 10 058 | 2 403 | 4 395 |
| Zinsverbindlichkeiten aus Swapgeschäften | | 2 571 | - | - |
| Zu Marktpreisen verkaufte Optionen | 7 | - | - | - |
| Swapgeschäfte zum Marktwert | 10 | 394 403 | - | - |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisentermingeschäften | 8 | 88 344 | 469 616 | 1 822 705 |
| Nicht realisierter Verlust aus Finanztermingeschäften | 6 | 272 160 | 46 414 | - |
| Sonstige Passiva | | 3 588 | 2 814 | 4 641 |
| | | **1 081 821** | **986 769** | **3 071 879** |
| **GESAMTVERMÖGEN** | | **205 040 066** | **69 677 573** | **288 780 403** |

## **Nettovermögensaufstellung** (Fortsetzung)

(in der Währung des Teilfonds)

| | Anmerkungen | Swiss Life Funds (LUX) Bond Inflation Protection EUR | Swiss Life Funds (LUX) Equity Euro Zone EUR | Swiss Life Funds (LUX) Equity Global USD |
|---|---|---|---|---|
| **VERMÖGENSWERTE** | | | | |
| Wertpapierbestand zu Einstandspreisen | | 18 331 442 | 217 149 591 | 158 362 616 |
| Nicht realisierter Nettogewinn/ (-verlust) | | 1 567 331 | (7 127 296) | (7 117 500) |
| Wertpapierbestand zum Marktwert | 2.3 | 19 898 773 | 210 022 295 | 151 245 116 |
| Bareinlagen bei Banken | | 1 680 706 | 751 903 | 2 111 415 |
| Festgelder | | - | - | - |
| Forderungen für ausgegebene Fondsanteile | | - | - | 89 246 |
| Forderungen für verkaufte Wertpapiere | 2.8 | - | 44 850 779 | - |
| Forderungen aus Dividenden, netto | | - | 469 504 | 223 607 |
| Erhaltene Bankzinsen | | - | - | - |
| Zinsforderungen aus Anleihen | | 19 027 | - | - |
| Zum Marktwert gekaufte Optionen | 7 | - | - | - |
| Swapgeschäfte zum Marktwert | 10 | - | - | - |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisentermingeschäften | 8 | 42 762 | - | - |
| Nicht realisierter Gewinn aus Finanztermingeschäften | 6 | - | - | - |
| Gründungskosten, netto | 2.10 | - | - | - |
| | | **21 641 268** | **256 094 481** | **153 669 384** |
| **VERBINDLICHKEITEN** | | | | |
| Überziehungskredit | | - | - | - |
| Verbindlichkeiten für zurückgenommene Fondsanteile | | 3 362 | - | 6 179 |
| Verbindlichkeiten für erworbene Wertpapiere | 2.8 | - | 45 832 884 | - |
| Verbindlichkeiten aus Swapgeschäften | 10 | - | - | - |
| Verbindlichkeiten aus Managementgebühren | 3 | 20 452 | 304 259 | 108 167 |
| Verbindlichkeiten aus Depotgebühren | 4 | 4 816 | 24 704 | 17 699 |
| *Verbindlichkeiten aus der „Taxe d'abonnement"* | 5 | 399 | 9 906 | 2 964 |
| Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühren | 4 | 23 587 | 63 023 | 49 278 |
| Fällige Gebühren der Registerstelle | 4 | 923 | 926 | 1 015 |
| Verbindlichkeiten aus Honoraren | | 43 533 | 11 498 | 12 614 |
| Verbindlichkeiten aus Zinsen und Bankgebühren | | 832 | 19 012 | 30 293 |
| Zinsverbindlichkeiten aus Swapgeschäften | | - | - | - |
| Zu Marktpreisen verkaufte Optionen | 7 | - | - | - |
| Swapgeschäfte zum Marktwert | 10 | - | - | - |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisentermingeschäften | 8 | 387 686 | - | - |
| Nicht realisierter Verlust aus Finanztermingeschäften | 6 | 565 489 | 64 800 | 228 869 |
| Sonstige Passiva | | 2 763 | 2 682 | 4 250 |
| | | **1 053 842** | **46 333 694** | **461 328** |
| **GESAMTVERMÖGEN** | | **20 587 426** | **209 760 787** | **153 208 056** |

## **Nettovermögensaufstellung** (Fortsetzung)

(in der Währung des Teilfonds)

| | Anmerkungen | Swiss Life Funds (LUX) Equity Global High Dividend EUR | Swiss Life Funds (LUX) Equity Global Long/Short EUR | Swiss Life Funds (LUX) Equity Global Minimum Volatility USD |
|---|---|---|---|---|
| **VERMÖGENSWERTE** | | | | |
| Wertpapierbestand zu Einstandspreisen | | 193 967 841 | 129 264 303 | 173 500 476 |
| Nicht realisierter Nettogewinn/ (-verlust) | | (7 243 647) | 2 559 928 | 766 942 |
| Wertpapierbestand zum Marktwert | 2.3 | 186 724 194 | 131 824 231 | 174 267 418 |
| Bareinlagen bei Banken | | 6 645 340 | 21 887 309 | 1 172 600 |
| Festgelder | | - | - | - |
| Forderungen für ausgegebene Fondsanteile | | 13 004 | - | - |
| Forderungen für verkaufte Wertpapiere | 2.8 | - | - | - |
| Forderungen aus Dividenden, netto | | 700 909 | 290 568 | 303 172 |
| Erhaltene Bankzinsen | | - | - | - |
| Zinsforderungen aus Anleihen | | - | - | - |
| Zum Marktwert gekaufte Optionen | 7 | - | - | - |
| Swapgeschäfte zum Marktwert | 10 | - | - | - |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisentermingeschäften | 8 | - | - | - |
| Nicht realisierter Gewinn aus Finanztermingeschäften | 6 | - | 9 833 968 | - |
| Gründungskosten, netto | 2.10 | - | - | - |
| | | **194 083 447** | **163 836 076** | **175 743 190** |
| **VERBINDLICHKEITEN** | | | | |
| Überziehungskredit | | 54 660 | 1 183 206 | 29 497 |
| Verbindlichkeiten für zurückgenommene Fondsanteile | | - | - | - |
| Verbindlichkeiten für erworbene Wertpapiere | 2.8 | - | - | - |
| Verbindlichkeiten aus Swapgeschäften | 10 | - | - | - |
| Verbindlichkeiten aus Managementgebühren | 3 | 166 247 | 37 115 | 96 798 |
| Verbindlichkeiten aus Depotgebühren | 4 | 22 414 | 17 265 | 21 172 |
| *Verbindlichkeiten aus der „Taxe d'abonnement"* | 5 | 5 635 | 2 640 | 3 783 |
| Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühren | 4 | 61 723 | 44 754 | 57 482 |
| Fällige Gebühren der Registerstelle | 4 | 926 | 924 | 1 015 |
| Verbindlichkeiten aus Honoraren | | 11 498 | 11 452 | 12 614 |
| Verbindlichkeiten aus Zinsen und Bankgebühren | | 7 743 | 44 264 | 6 266 |
| Zinsverbindlichkeiten aus Swapgeschäften | | - | - | - |
| Zu Marktpreisen verkaufte Optionen | 7 | - | - | - |
| Swapgeschäfte zum Marktwert | 10 | - | - | - |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisentermingeschäften | 8 | - | 1 261 034 | - |
| Nicht realisierter Verlust aus Finanztermingeschäften | 6 | 438 428 | - | - |
| Sonstige Passiva | | 3 680 | 3 110 | 2 031 |
| | | **772 954** | **2 605 764** | **230 658** |
| **GESAMTVERMÖGEN** | | **193 310 493** | **161 230 312** | **175 512 532** |

## **Nettovermögensaufstellung** (Fortsetzung)

(in der Währung des Teilfonds)

| | Anmerkungen | Swiss Life Funds (LUX) Equity Global Protect EUR | Swiss Life Funds (LUX) Equity USA USD | Swiss Life Funds (LUX) Fixed Income Alpha Select[1] EUR |
|---|---|---|---|---|
| **VERMÖGENSWERTE** | | | | |
| Wertpapierbestand zu Einstandspreisen | | 236 212 529 | 313 631 800 | 50 236 169 |
| Nicht realisierter Nettogewinn/ (-verlust) | | 30 154 960 | (6 448 676) | 686 181 |
| Wertpapierbestand zum Marktwert | 2.3 | 266 367 489 | 307 183 124 | 50 922 350 |
| Bareinlagen bei Banken | | 5 213 196 | 18 850 573 | 3 536 126 |
| Festgelder | | - | - | - |
| Forderungen für ausgegebene Fondsanteile | | - | - | - |
| Forderungen für verkaufte Wertpapiere | 2.8 | - | - | 102 224 |
| Forderungen aus Dividenden, netto | | 467 589 | 446 149 | - |
| Erhaltene Bankzinsen | | - | - | - |
| Zinsforderungen aus Anleihen | | - | - | 324 685 |
| Zum Marktwert gekaufte Optionen | 7 | 30 464 412 | - | 370 114 |
| Swapgeschäfte zum Marktwert | 10 | - | - | 171 751 |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisentermingeschäften | 8 | 1 111 453 | - | 30 303 |
| Nicht realisierter Gewinn aus Finanztermingeschäften | 6 | - | - | 79 676 |
| Gründungskosten, netto | 2.10 | - | - | - |
| | | **303 624 139** | **326 479 846** | **55 537 229** |
| **VERBINDLICHKEITEN** | | | | |
| Überziehungskredit | | - | - | 32 158 |
| Verbindlichkeiten für zurückgenommene Fondsanteile | | - | 50 534 | - |
| Verbindlichkeiten für erworbene Wertpapiere | 2.8 | - | - | 282 552 |
| Verbindlichkeiten aus Swapgeschäften | 10 | - | - | 202 399 |
| Verbindlichkeiten aus Managementgebühren | 3 | 180 703 | 124 234 | 7 678 |
| Verbindlichkeiten aus Depotgebühren | 4 | 33 913 | 37 707 | 5 905 |
| *Verbindlichkeiten aus der „Taxe d'abonnement"* | 5 | 4 673 | 5 669 | 870 |
| Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühren | 4 | 72 670 | 86 583 | 14 263 |
| Fällige Gebühren der Registerstelle | 4 | 923 | 1 016 | 292 |
| Verbindlichkeiten aus Honoraren | | 11 407 | 12 614 | 6 673 |
| Verbindlichkeiten aus Zinsen und Bankgebühren | | 17 566 | 13 043 | 784 |
| Zinsverbindlichkeiten aus Swapgeschäften | | - | - | 19 444 |
| Zu Marktpreisen verkaufte Optionen | 7 | 4 957 833 | - | - |
| Swapgeschäfte zum Marktwert | 10 | - | - | 343 286 |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisentermingeschäften | 8 | 3 629 565 | - | 312 744 |
| Nicht realisierter Verlust aus Finanztermingeschäften | 6 | 1 620 173 | 1 519 365 | 299 652 |
| Sonstige Passiva | | 2 807 | 3 073 | - |
| | | **10 532 233** | **1 853 838** | **1 528 700** |
| **GESAMTVERMÖGEN** | | **293 091 906** | **324 626 008** | **54 008 529** |

[1] Dieser Teilfonds wurde zum 3. September 2019 aufgelegt.

Die beigefügten Anmerkungen sind integraler Bestandteil dieses Geschäftsberichts.

## **Nettovermögensaufstellung** (Fortsetzung)

(in der Währung des Teilfonds)

| | Anmerkungen | Swiss Life Funds (LUX) Multi Asset Risk Premia EUR | Swiss Life Funds (LUX) Prudent (EUR) EUR | Swiss Life Funds (LUX) Harmony (EUR) EUR |
|---|---|---|---|---|
| **VERMÖGENSWERTE** | | | | |
| Wertpapierbestand zu Einstandspreisen | | 164 431 275 | 1 279 684 211 | 386 970 628 |
| Nicht realisierter Nettogewinn/ (-verlust) | | (2 096 156) | 85 082 568 | 26 640 435 |
| Wertpapierbestand zum Marktwert | 2.3 | 162 335 119 | 1 364 766 779 | 413 611 063 |
| Bareinlagen bei Banken | | 56 250 258 | 132 036 023 | 35 152 557 |
| Festgelder | | 15 000 000 | - | - |
| Forderungen für ausgegebene Fondsanteile | | 41 467 | 207 288 | 100 599 |
| Forderungen für verkaufte Wertpapiere | 2.8 | - | - | - |
| Forderungen aus Dividenden, netto | | 313 677 | - | 17 634 |
| Erhaltene Bankzinsen | | 7 250 | - | - |
| Zinsforderungen aus Anleihen | | - | - | - |
| Zum Marktwert gekaufte Optionen | 7 | - | - | - |
| Swapgeschäfte zum Marktwert | 10 | 986 613 | - | - |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisentermingeschäften | 8 | 483 368 | 260 816 | 111 716 |
| Nicht realisierter Gewinn aus Finanztermingeschäften | 6 | 13 257 218 | 6 032 257 | 1 082 460 |
| Gründungskosten, netto | 2.10 | - | - | - |
| | | **248 674 970** | **1 503 303 163** | **450 076 029** |
| **VERBINDLICHKEITEN** | | | | |
| Überziehungskredit | | 1 070 071 | - | - |
| Verbindlichkeiten für zurückgenommene Fondsanteile | | 74 641 | 616 752 | 132 631 |
| Verbindlichkeiten für erworbene Wertpapiere | 2.8 | - | 1 578 715 | 1 546 576 |
| Verbindlichkeiten aus Swapgeschäften | 10 | - | - | - |
| Verbindlichkeiten aus Managementgebühren | 3 | 85 986 | 2 874 304 | 1 012 759 |
| Verbindlichkeiten aus Depotgebühren | 4 | 27 224 | 159 155 | 47 185 |
| *Verbindlichkeiten aus der „Taxe d'abonnement"* | 5 | 4 199 | 56 133 | 18 895 |
| Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühren | 4 | 67 797 | 288 583 | 94 269 |
| Fällige Gebühren der Registerstelle | 4 | 923 | 926 | 926 |
| Verbindlichkeiten aus Honoraren | | 10 050 | 11 498 | 10 480 |
| Verbindlichkeiten aus Zinsen und Bankgebühren | | 18 429 | 2 040 | 1 794 |
| Zinsverbindlichkeiten aus Swapgeschäften | | 244 510 | - | - |
| Zu Marktpreisen verkaufte Optionen | 7 | - | - | - |
| Swapgeschäfte zum Marktwert | 10 | 534 188 | - | - |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisentermingeschäften | 8 | 477 245 | 1 283 181 | 436 522 |
| Nicht realisierter Verlust aus Finanztermingeschäften | 6 | 1 844 810 | 7 068 603 | 6 023 818 |
| Sonstige Passiva | | - | 1 957 | 1 602 |
| | | **4 460 073** | **13 941 847** | **9 327 457** |
| **GESAMTVERMÖGEN** | | **244 214 897** | **1 489 361 316** | **440 748 572** |

## **Nettovermögensaufstellung** (Fortsetzung)

(in der Währung des Teilfonds)

| | Anmerkungen | Swiss Life Funds (LUX) Income Equity Euro Zone[1] EUR | Swiss Life Funds (LUX) Portfolio Global Growth (CHF) CHF | Swiss Life Funds (LUX) Vitality (EUR) EUR |
|---|---|---|---|---|
| **VERMÖGENSWERTE** | | | | |
| Wertpapierbestand zu Einstandspreisen | | 92 967 548 | 32 853 250 | 130 478 903 |
| Nicht realisierter Nettogewinn/ (-verlust) | | (10 336 958) | 12 322 464 | 8 160 495 |
| Wertpapierbestand zum Marktwert | 2.3 | 82 630 590 | 45 175 714 | 138 639 398 |
| Bareinlagen bei Banken | | 14 526 385 | 3 883 820 | 16 097 579 |
| Festgelder | | - | - | - |
| Forderungen für ausgegebene Fondsanteile | | - | 6 521 | 39 341 |
| Forderungen für verkaufte Wertpapiere | 2.8 | - | - | - |
| Forderungen aus Dividenden, netto | | 30 952 | - | - |
| Erhaltene Bankzinsen | | - | - | - |
| Zinsforderungen aus Anleihen | | - | 52 980 | - |
| Zum Marktwert gekaufte Optionen | 7 | - | - | - |
| Swapgeschäfte zum Marktwert | 10 | - | - | - |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisentermingeschäften | 8 | - | 45 909 | 47 295 |
| Nicht realisierter Gewinn aus Finanztermingeschäften | 6 | 7 861 680 | - | 80 466 |
| Gründungskosten, netto | 2.10 | - | - | - |
| | | **105 049 607** | **49 164 944** | **154 904 079** |
| **VERBINDLICHKEITEN** | | | | |
| Überziehungskredit | | 1 258 226 | - | - |
| Verbindlichkeiten für zurückgenommene Fondsanteile | | - | 3 992 | 99 871 |
| Verbindlichkeiten für erworbene Wertpapiere | 2.8 | - | - | 900 231 |
| Verbindlichkeiten aus Swapgeschäften | 10 | - | - | - |
| Verbindlichkeiten aus Managementgebühren | 3 | 18 215 | 128 405 | 385 883 |
| Verbindlichkeiten aus Depotgebühren | 4 | 5 173 | 6 266 | 16 231 |
| *Verbindlichkeiten aus der „Taxe d'abonnement"* | 5 | 1 655 | 2 093 | 6 633 |
| Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühren | 4 | 7 433 | 22 920 | 41 958 |
| Fällige Gebühren der Registerstelle | 4 | 157 | 981 | 926 |
| Verbindlichkeiten aus Honoraren | | 2 339 | 12 162 | 11 498 |
| Verbindlichkeiten aus Zinsen und Bankgebühren | | - | 1 156 | 1 658 |
| Zinsverbindlichkeiten aus Swapgeschäften | | - | - | - |
| Zu Marktpreisen verkaufte Optionen | 7 | 1 034 125 | - | - |
| Swapgeschäfte zum Marktwert | 10 | - | - | - |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisentermingeschäften | 8 | - | 6 436 | 167 817 |
| Nicht realisierter Verlust aus Finanztermingeschäften | 6 | - | 296 609 | 3 623 015 |
| Sonstige Passiva | | - | 2 387 | 1 634 |
| | | **2 327 323** | **483 407** | **5 257 355** |
| **GESAMTVERMÖGEN** | | **102 722 284** | **48 681 537** | **149 646 724** |

[1] Dieser Teilfonds wurde zum 19. Dezember 2019 aufgelegt.

Die beigefügten Anmerkungen sind integraler Bestandteil dieses Geschäftsberichts.

## **Nettovermögensaufstellung** (Fortsetzung)

(in der Währung des Teilfonds)

| | Anmerkungen | Konsolidiert EUR |
|---|---|---|
| **VERMÖGENSWERTE** | | |
| Wertpapierbestand zu Einstandspreisen | | 4 736 169 382 |
| Nicht realisierter Nettogewinn/ (-verlust) | | 170 876 761 |
| Wertpapierbestand zum Marktwert | 2.3 | 4 907 046 143 |
| Bareinlagen bei Banken | | 368 661 724 |
| Festgelder | | 15 000 000 |
| Forderungen für ausgegebene Fondsanteile | | 537 582 |
| Forderungen für verkaufte Wertpapiere | 2.8 | 61 646 732 |
| Forderungen aus Dividenden, netto | | 3 176 557 |
| Erhaltene Bankzinsen | | 7 250 |
| Zinsforderungen aus Anleihen | | 13 537 569 |
| Zum Marktwert gekaufte Optionen | 7 | 30 834 526 |
| Swapgeschäfte zum Marktwert | 10 | 1 158 364 |
| Nicht realisierter Gewinn aus Devisentermingeschäften | 8 | 6 389 278 |
| Nicht realisierter Gewinn aus Finanztermingeschäften | 6 | 38 839 321 |
| Gründungskosten, netto | 2.10 | 29 |
| | | **5 446 835 075** |
| **VERBINDLICHKEITEN** | | |
| Überziehungskredit | | 4 609 302 |
| Verbindlichkeiten für zurückgenommene Fondsanteile | | 2 867 997 |
| Verbindlichkeiten für erworbene Wertpapiere | 2.8 | 55 799 534 |
| Verbindlichkeiten aus Swapgeschäften | 10 | 202 399 |
| Verbindlichkeiten aus Managementgebühren | 3 | 6 264 341 |
| Verbindlichkeiten aus Depotgebühren | 4 | 577 107 |
| *Verbindlichkeiten aus der „Taxe d'abonnement"* | 5 | 158 894 |
| Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühren | 4 | 1 345 739 |
| Fällige Gebühren der Registerstelle | 4 | 18 005 |
| Verbindlichkeiten aus Honoraren | | 256 317 |
| Verbindlichkeiten aus Zinsen und Bankgebühren | | 186 743 |
| Zinsverbindlichkeiten aus Swapgeschäften | | 266 525 |
| Zu Marktpreisen verkaufte Optionen | 7 | 5 991 958 |
| Swapgeschäfte zum Marktwert | 10 | 1 271 877 |
| Nicht realisierter Verlust aus Devisentermingeschäften | 8 | 12 645 591 |
| Nicht realisierter Verlust aus Finanztermingeschäften | 6 | 23 737 866 |
| Sonstige Passiva | | 50 226 |
| | | **116 250 421** |
| **GESAMTVERMÖGEN** | | **5 330 584 654** |

Die beigefügten Anmerkungen sind integraler Bestandteil dieses Geschäftsberichts.

## Aufwands- und Ertragsrechnung für das Nettovermögen

(in der Währung des Teilfonds)

| | Anmerkungen | Swiss Life Funds (LUX) Bond Emerging Markets Corporates USD | Swiss Life Funds (LUX) Bond Emerging Markets Corporates Short Term USD | Swiss Life Funds (LUX) Bond Euro Corporates EUR |
|---|---|---|---|---|
| **Nettovermögen zu Beginn des Jahres** | | **462 451 770** | **271 912 686** | **42 114 739** |
| **EINNAHMEN** | | | | |
| Nettodividenden | 2.9 | - | - | - |
| Zinsen auf Anleihen, netto | | 9 028 842 | 5 180 478 | 286 674 |
| Bankzinsen | | 90 735 | 49 487 | 75 |
| Zinsen aus Swapgeschäften | | - | - | - |
| Erträge aus Wertpapierbeleihungen | 9 | 27 123 | 4 205 | 26 |
| | | **9 146 700** | **5 234 170** | **286 775** |
| **AUSGABEN** | | | | |
| Managementgebühren | 3 | 855 387 | 268 667 | 144 354 |
| Depotgebühren | 4 | 59 127 | 34 691 | 4 598 |
| *Taxe d'abonnement* | 5 | 29 959 | 13 686 | 5 791 |
| Verwaltungsgebühren | 4 | 70 421 | 42 729 | 11 056 |
| Gebühren der Registerstelle | 4 | 5 491 | 1 364 | 4 007 |
| Honorare | | 20 994 | 17 783 | 16 838 |
| Zinsen und Bankgebühren | | 646 | 10 | 2 088 |
| Zinsen aus Swapgeschäften | | - | - | - |
| Abschreibung der Gründungskosten | | - | - | - |
| Transaktionskosten | | 11 544 | 4 960 | 12 405 |
| Sonstige Ausgaben | | 1 115 | 337 | 680 |
| | | **1 054 684** | **384 227** | **201 817** |
| **Nettoinvestitionsertrag/ (-verlust)** | | **8 092 016** | **4 849 943** | **84 958** |
| **Realisierter Nettogewinn/ (-verlust) aus** | | | | |
| - Verkäufen von Wertpapieren | 2.5 | 4 719 267 | (795 639) | 643 668 |
| - Währungen | | (17 612) | 30 959 | (11) |
| - Devisentermingeschäften | | (2 711 563) | 641 394 | 303 050 |
| - Optionen | | - | - | - |
| - Finanztermingeschäften | | (929 063) | (250 626) | (53 790) |
| - Swapgeschäfte | | - | - | - |
| | | **1 061 029** | **(373 912)** | **892 917** |
| **Realisierter Nettoertrag für das Jahr** | | **9 153 045** | **4 476 031** | **977 875** |
| **Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/ (-verlusts) aus** | | | | |
| - Wertpapieren | | 1 098 409 | 1 215 090 | (838 201) |
| - Devisentermingeschäften | | 3 074 078 | 754 900 | (18 205) |
| - Optionen | | - | - | - |
| - Finanztermingeschäften | | - | 25 158 | 120 180 |
| - Swapgeschäfte | | - | - | - |
| | | **4 172 487** | **1 995 148** | **(736 226)** |
| **Nettovermögensergebnis gemäß Erfolg** | | **13 325 532** | **6 471 179** | **241 649** |
| **Kapitalveränderungen** | | | | |
| Zeichnungen | | 50 442 760 | 30 880 197 | 21 120 205 |
| Rücknahmen | | (42 454 469) | (17 493 801) | (1 375 591) |
| | | **7 988 291** | **13 386 396** | **19 744 614** |
| Dividendenausschüttungen | 12 | (323 851) | - | - |
| Kursdifferenzen beim Nettovermögen zum 28. Februar 2019 | | - | - | - |
| **Nettovermögen am Ende des Jahres** | | **483 441 742** | **291 770 261** | **62 101 002** |

Die beigefügten Anmerkungen sind integraler Bestandteil dieses Geschäftsberichts.

## Aufwands- und Ertragsrechnung für das Nettovermögen (Fortsetzung)

(in der Währung des Teilfonds)

| | Anmerkungen | Swiss Life Funds (LUX) Bond Global Corporates EUR | Swiss Life Funds (LUX) Bond Global Corporates Short Term EUR | Swiss Life Funds (LUX) Bond Global High Yield EUR |
|---|---|---|---|---|
| **Nettovermögen zu Beginn des Jahres** | | **228 864 692** | **92 477 190** | **294 912 874** |
| **EINNAHMEN** | | | | |
| Nettodividenden | 2.9 | - | - | - |
| Zinsen auf Anleihen, netto | | 2 548 423 | 1 074 139 | 6 654 707 |
| Bankzinsen | | 15 517 | 4 054 | 19 079 |
| Zinsen aus Swapgeschäften | | 16 440 | - | - |
| Erträge aus Wertpapierbeleihungen | 9 | 498 | - | - |
| | | **2 580 878** | **1 078 193** | **6 673 786** |
| **AUSGABEN** | | | | |
| Managementgebühren | 3 | 567 813 | 113 006 | 402 855 |
| Depotgebühren | 4 | 23 426 | 11 026 | 36 000 |
| *Taxe d'abonnement* | 5 | 31 570 | 5 013 | 17 773 |
| Verwaltungsgebühren | 4 | 32 158 | 16 022 | 45 854 |
| Gebühren der Registerstelle | 4 | 4 532 | 737 | 2 694 |
| Honorare | | 17 954 | 17 510 | 17 624 |
| Zinsen und Bankgebühren | | 15 116 | 1 494 | 9 558 |
| Zinsen aus Swapgeschäften | | 2 571 | - | - |
| Abschreibung der Gründungskosten | | - | 42 | - |
| Transaktionskosten | | 14 024 | 4 919 | 3 323 |
| Sonstige Ausgaben | | 741 | 571 | 917 |
| | | **709 905** | **170 340** | **536 598** |
| **Nettoinvestitionsertrag/ (-verlust)** | | **1 870 973** | **907 853** | **6 137 188** |
| **Realisierter Nettogewinn/ (-verlust) aus** | | | | |
| - Verkäufen von Wertpapieren | 2.5 | 7 231 086 | 438 637 | (471 374) |
| - Währungen | | 13 643 | 102 499 | (76 087) |
| - Devisentermingeschäften | | (3 953 269) | (1 765 147) | (1 573 673) |
| - Optionen | | - | - | - |
| - Finanztermingeschäften | | 231 204 | (81 896) | - |
| - Swapgeschäfte | | - | - | - |
| | | **3 522 664** | **(1 305 907)** | **(2 121 134)** |
| **Realisierter Nettoertrag für das Jahr** | | **5 393 637** | **(398 054)** | **4 016 054** |
| **Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/ (-verlusts) aus** | | | | |
| - Wertpapieren | | (3 354 802) | (271 008) | (5 159 454) |
| - Devisentermingeschäften | | 3 253 065 | 784 253 | 1 488 013 |
| - Optionen | | - | - | - |
| - Finanztermingeschäften | | 302 319 | 42 067 | - |
| - Swapgeschäfte | | (81 598) | - | - |
| | | **118 984** | **555 312** | **(3 671 441)** |
| **Nettovermögensergebnis gemäß Erfolg** | | **5 512 621** | **157 258** | **344 613** |
| **Kapitalveränderungen** | | | | |
| Zeichnungen | | 28 269 305 | 5 013 379 | 14 019 586 |
| Rücknahmen | | (57 386 870) | (25 591 397) | (19 598 112) |
| | | **(29 117 565)** | **(20 578 018)** | **(5 578 526)** |
| Dividendenausschüttungen | 12 | (219 682) | (2 378 857) | (898 558) |
| Kursdifferenzen beim Nettovermögen zum 28. Februar 2019 | | - | - | - |
| **Nettovermögen am Ende des Jahres** | | **205 040 066** | **69 677 573** | **288 780 403** |

Die beigefügten Anmerkungen sind integraler Bestandteil dieses Geschäftsberichts.

## Aufwands- und Ertragsrechnung für das Nettovermögen (Fortsetzung)

(in der Währung des Teilfonds)

| | Anmerkungen | Swiss Life Funds (LUX) Bond Inflation Protection EUR | Swiss Life Funds (LUX) Equity Euro Zone EUR | Swiss Life Funds (LUX) Equity Global USD |
|---|---|---|---|---|
| **Nettovermögen zu Beginn des Jahres** | | **17 608 944** | **215 753 694** | **152 934 287** |
| **EINNAHMEN** | | | | |
| Nettodividenden | 2.9 | - | 1 160 730 | 1 274 100 |
| Zinsen auf Anleihen, netto | | 78 402 | 12 498 | - |
| Bankzinsen | | 6 900 | 264 | 6 992 |
| Zinsen aus Swapgeschäften | | - | - | - |
| Erträge aus Wertpapierbeleihungen | 9 | 985 | 45 074 | 1 339 |
| | | **86 287** | **1 218 566** | **1 282 431** |
| **AUSGABEN** | | | | |
| Managementgebühren | 3 | 54 255 | 934 848 | 321 615 |
| Depotgebühren | 4 | 1 340 | 27 319 | 21 310 |
| *Taxe d'abonnement* | 5 | 1 351 | 31 825 | 9 416 |
| Verwaltungsgebühren | 4 | 9 551 | 38 919 | 27 530 |
| Gebühren der Registerstelle | 4 | 2 473 | 3 409 | 1 053 |
| Honorare | | 21 950 | 17 962 | 19 869 |
| Zinsen und Bankgebühren | | 1 697 | 8 023 | 2 858 |
| Zinsen aus Swapgeschäften | | - | - | - |
| Abschreibung der Gründungskosten | | - | - | - |
| Transaktionskosten | | 3 174 | 759 798 | 212 868 |
| Sonstige Ausgaben | | 586 | 625 | 882 |
| | | **96 377** | **1 822 728** | **617 401** |
| **Nettoinvestitionsertrag/ (-verlust)** | | **(10 090)** | **(604 162)** | **665 030** |
| **Realisierter Nettogewinn/ (-verlust) aus** | | | | |
| - Verkäufen von Wertpapieren | 2.5 | 1 945 273 | 1 241 747 | 7 160 422 |
| - Währungen | | (86 624) | 368 | 45 455 |
| - Devisentermingeschäften | | (487 522) | - | (24 822) |
| - Optionen | | - | - | - |
| - Finanztermingeschäften | | (775 546) | 21 530 | 118 004 |
| - Swapgeschäfte | | - | - | - |
| | | **595 581** | **1 263 645** | **7 299 059** |
| **Realisierter Nettoertrag für das Jahr** | | **585 491** | **659 483** | **7 964 089** |
| **Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/ (-verlusts) aus** | | | | |
| - Wertpapieren | | (809 576) | (6 039 528) | (7 755 956) |
| - Devisentermingeschäften | | 31 827 | - | (1 590) |
| - Optionen | | - | - | - |
| - Finanztermingeschäften | | (515 637) | (45 330) | (222 594) |
| - Swapgeschäfte | | - | - | - |
| | | **(1 293 386)** | **(6 084 858)** | **(7 980 140)** |
| **Nettovermögensergebnis gemäß Erfolg** | | **(707 895)** | **(5 425 375)** | **(16 051)** |
| **Kapitalveränderungen** | | | | |
| Zeichnungen | | 19 602 304 | 7 885 420 | 2 798 400 |
| Rücknahmen | | (15 915 927) | (8 452 952) | (2 508 580) |
| | | **3 686 377** | **(567 532)** | **289 820** |
| Dividendenausschüttungen | 12 | - | - | - |
| Kursdifferenzen beim Nettovermögen zum 28. Februar 2019 | | - | - | - |
| **Nettovermögen am Ende des Jahres** | | **20 587 426** | **209 760 787** | **153 208 056** |

Die beigefügten Anmerkungen sind integraler Bestandteil dieses Geschäftsberichts.

## Aufwands- und Ertragsrechnung für das Nettovermögen (Fortsetzung)

(in der Währung des Teilfonds)

| | Anmerkungen | Swiss Life Funds (LUX) Equity Global High Dividend EUR | Swiss Life Funds (LUX) Equity Global Long/Short EUR | Swiss Life Funds (LUX) Equity Global Minimum Volatility USD |
|---|---|---|---|---|
| **Nettovermögen zu Beginn des Jahres** | | **192 634 352** | **158 074 719** | **184 087 906** |
| **EINNAHMEN** | | | | |
| Nettodividenden | 2.9 | 2 801 615 | 1 029 851 | 2 137 919 |
| Zinsen auf Anleihen, netto | | - | 2 255 | 3 583 |
| Bankzinsen | | 4 070 | 22 904 | 5 696 |
| Zinsen aus Swapgeschäften | | - | - | - |
| Erträge aus Wertpapierbeleihungen | 9 | 4 380 | 3 442 | 4 673 |
| | | **2 810 065** | **1 058 452** | **2 151 871** |
| **AUSGABEN** | | | | |
| Managementgebühren | 3 | 499 897 | 116 392 | 320 483 |
| Depotgebühren | 4 | 25 826 | 17 902 | 24 991 |
| *Taxe d'abonnement* | 5 | 17 788 | 8 008 | 11 851 |
| Verwaltungsgebühren | 4 | 34 777 | 26 442 | 32 264 |
| Gebühren der Registerstelle | 4 | 4 734 | 573 | 1 340 |
| Honorare | | 17 892 | 17 092 | 19 296 |
| Zinsen und Bankgebühren | | 13 832 | 36 561 | 8 803 |
| Zinsen aus Swapgeschäften | | - | - | - |
| Abschreibung der Gründungskosten | | - | - | - |
| Transaktionskosten | | 102 459 | 207 444 | 162 434 |
| Sonstige Ausgaben | | 830 | 662 | 468 |
| | | **718 035** | **431 076** | **581 930** |
| **Nettoinvestitionsertrag/ (-verlust)** | | **2 092 030** | **627 376** | **1 569 941** |
| **Realisierter Nettogewinn/ (-verlust) aus** | | | | |
| - Verkäufen von Wertpapieren | 2.5 | 4 107 072 | 7 656 035 | 14 130 939 |
| - Währungen | | 67 405 | 60 734 | (1 778) |
| - Devisentermingeschäften | | (2 289) | (2 065 987) | (31 210) |
| - Optionen | | - | - | - |
| - Finanztermingeschäften | | 453 888 | (11 794 908) | 172 574 |
| - Swapgeschäfte | | - | - | - |
| | | **4 626 076** | **(6 144 126)** | **14 270 525** |
| **Realisierter Nettoertrag für das Jahr** | | **6 718 106** | **(5 516 750)** | **15 840 466** |
| **Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/ (-verlusts) aus** | | | | |
| - Wertpapieren | | (9 270 176) | (7 039 941) | (18 087 635) |
| - Devisentermingeschäften | | - | 1 082 015 | - |
| - Optionen | | - | - | - |
| - Finanztermingeschäften | | (359 252) | 10 875 734 | 25 050 |
| - Swapgeschäfte | | - | - | - |
| | | **(9 629 428)** | **4 917 808** | **(18 062 585)** |
| **Nettovermögensergebnis gemäß Erfolg** | | **(2 911 322)** | **(598 942)** | **(2 222 119)** |
| **Kapitalveränderungen** | | | | |
| Zeichnungen | | 11 996 759 | 5 842 283 | 20 187 125 |
| Rücknahmen | | (5 465 793) | (2 087 748) | (25 240 791) |
| | | **6 530 966** | **3 754 535** | **(5 053 666)** |
| Dividendenausschüttungen | 12 | (2 943 503) | - | (1 299 589) |
| Kursdifferenzen beim Nettovermögen zum 28. Februar 2019 | | - | - | - |
| **Nettovermögen am Ende des Jahres** | | **193 310 493** | **161 230 312** | **175 512 532** |



Die beigefügten Anmerkungen sind integraler Bestandteil dieses Geschäftsberichts.

## Aufwands- und Ertragsrechnung für das Nettovermögen (Fortsetzung)

(in der Währung des Teilfonds)

| | Anmerkungen | Swiss Life Funds (LUX) Equity Global Protect EUR | Swiss Life Funds (LUX) Equity USA USD | Swiss Life Funds (LUX) Fixed Income Alpha Select[1] EUR |
|---|---|---|---|---|
| **Nettovermögen zu Beginn des Jahres** | | **306 984 950** | **327 292 640** | **-** |
| **EINNAHMEN** | | | | |
| Nettodividenden | 2.9 | 2 163 028 | 3 271 641 | 58 |
| Zinsen auf Anleihen, netto | | 465 | - | 472 279 |
| Bankzinsen | | 26 470 | 105 431 | 3 015 |
| Zinsen aus Swapgeschäften | | - | - | - |
| Erträge aus Wertpapierbeleihungen | 9 | 9 748 | 297 | - |
| | | **2 199 711** | **3 377 369** | **475 352** |
| **AUSGABEN** | | | | |
| Managementgebühren | 3 | 591 858 | 367 628 | 22 924 |
| Depotgebühren | 4 | 36 888 | 42 398 | 6 919 |
| *Taxe d'abonnement* | 5 | 15 700 | 18 560 | 3 369 |
| Verwaltungsgebühren | 4 | 49 874 | 55 381 | 14 263 |
| Gebühren der Registerstelle | 4 | 837 | 2 411 | 292 |
| Honorare | | 17 834 | 18 455 | 20 904 |
| Zinsen und Bankgebühren | | 10 877 | 2 574 | 12 225 |
| Zinsen aus Swapgeschäften | | - | - | 1 527 |
| Abschreibung der Gründungskosten | | - | - | - |
| Transaktionskosten | | 47 598 | 203 625 | 7 146 |
| Sonstige Ausgaben | | 599 | 667 | - |
| | | **772 065** | **711 699** | **89 569** |
| **Nettoinvestitionsertrag/ (-verlust)** | | **1 427 646** | **2 665 670** | **385 783** |
| **Realisierter Nettogewinn/ (-verlust) aus** | | | | |
| - Verkäufen von Wertpapieren | 2.5 | 5 679 606 | 4 666 130 | 37 871 |
| - Währungen | | 46 255 | 35 569 | 68 317 |
| - Devisentermingeschäften | | (5 219 031) | (48 473) | (182 431) |
| - Optionen | | (14 672 585) | - | 48 000 |
| - Finanztermingeschäften | | 2 138 798 | 1 201 710 | (179 368) |
| - Swapgeschäfte | | - | - | 43 714 |
| | | **(12 026 957)** | **5 854 936** | **(163 897)** |
| **Realisierter Nettoertrag für das Jahr** | | **(10 599 311)** | **8 520 606** | **221 886** |
| **Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/ (-verlusts) aus** | | | | |
| - Wertpapieren | | (3 073 363) | (8 269 343) | 686 181 |
| - Devisentermingeschäften | | 1 656 727 | - | (282 441) |
| - Optionen | | 21 840 454 | - | 299 748 |
| - Finanztermingeschäften | | (1 091 563) | (1 406 995) | (219 976) |
| - Swapgeschäfte | | - | - | (171 534) |
| | | **19 332 255** | **(9 676 338)** | **311 978** |
| **Nettovermögensergebnis gemäß Erfolg** | | **8 732 944** | **(1 155 732)** | **533 864** |
| **Kapitalveränderungen** | | | | |
| Zeichnungen | | 9 642 782 | 17 676 012 | 53 474 665 |
| Rücknahmen | | (32 268 770) | (18 162 512) | - |
| | | **(22 625 988)** | **(486 500)** | **53 474 665** |
| Dividendenausschüttungen | 12 | - | (1 024 400) | - |
| Kursdifferenzen beim Nettovermögen zum 28. Februar 2019 | | - | - | - |
| **Nettovermögen am Ende des Jahres** | | **293 091 906** | **324 626 008** | **54 008 529** |

[1] Dieser Teilfonds wurde zum 3. September 2019 aufgelegt.

Die beigefügten Anmerkungen sind integraler Bestandteil dieses Geschäftsberichts.

## Aufwands- und Ertragsrechnung für das Nettovermögen (Fortsetzung)

(in der Währung des Teilfonds)

| | Anmerkungen | Swiss Life Funds (LUX) Multi Asset Risk Premia EUR | Swiss Life Funds (LUX) Prudent (EUR) EUR | Swiss Life Funds (LUX) Harmony (EUR) EUR |
|---|---|---|---|---|
| **Nettovermögen zu Beginn des Jahres** | | **295 026 951** | **1 406 438 782** | **404 241 929** |
| **EINNAHMEN** | | | | |
| Nettodividenden | 2.9 | 1 201 363 | - | - |
| Zinsen auf Anleihen, netto | | - | - | - |
| Bankzinsen | | 79 340 | 209 598 | 81 946 |
| Zinsen aus Swapgeschäften | | 9 987 | - | - |
| Erträge aus Wertpapierbeleihungen | 9 | 3 251 | 2 313 | 936 |
| | | **1 293 941** | **211 911** | **82 882** |
| **AUSGABEN** | | | | |
| Managementgebühren | 3 | 284 734 | 8 549 358 | 2 998 446 |
| Depotgebühren | 4 | 21 743 | 167 451 | 47 846 |
| *Taxe d'abonnement* | 5 | 13 181 | 172 400 | 57 681 |
| Verwaltungsgebühren | 4 | 40 221 | 210 233 | 66 663 |
| Gebühren der Registerstelle | 4 | 2 708 | 4 441 | 7 356 |
| Honorare | | 20 468 | 24 238 | 19 405 |
| Zinsen und Bankgebühren | | 98 639 | 277 840 | 101 490 |
| Zinsen aus Swapgeschäften | | 50 971 | - | - |
| Abschreibung der Gründungskosten | | - | - | - |
| Transaktionskosten | | 338 505 | 40 021 | 14 922 |
| Sonstige Ausgaben | | 32 271 | 482 | 410 |
| | | **903 441** | **9 446 464** | **3 314 219** |
| **Nettoinvestitionsertrag/ (-verlust)** | | **390 500** | **(9 234 553)** | **(3 231 337)** |
| **Realisierter Nettogewinn/ (-verlust) aus** | | | | |
| - Verkäufen von Wertpapieren | 2.5 | 8 116 272 | 5 059 858 | 973 882 |
| - Währungen | | 313 564 | 536 514 | 242 861 |
| - Devisentermingeschäften | | 2 539 351 | (4 048 485) | (1 474 179) |
| - Optionen | | - | - | - |
| - Finanztermingeschäften | | (5 059 638) | 6 550 618 | 3 472 550 |
| - Swapgeschäfte | | (7 400 988) | - | - |
| | | **(1 491 439)** | **8 098 505** | **3 215 114** |
| **Realisierter Nettoertrag für das Jahr** | | **(1 100 939)** | **(1 136 048)** | **(16 223)** |
| **Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/ (-verlusts) aus** | | | | |
| - Wertpapieren | | (6 630 248) | 1 310 238 | 511 237 |
| - Devisentermingeschäften | | (1 088 993) | 30 324 | 18 397 |
| - Optionen | | - | - | - |
| - Finanztermingeschäften | | 4 788 906 | (5 749 057) | (5 030 627) |
| - Swapgeschäfte | | 4 876 769 | - | - |
| | | **1 946 434** | **(4 408 495)** | **(4 500 993)** |
| **Nettovermögensergebnis gemäß Erfolg** | | **845 495** | **(5 544 543)** | **(4 517 216)** |
| **Kapitalveränderungen** | | | | |
| Zeichnungen | | 2 450 670 | 160 006 740 | 65 988 877 |
| Rücknahmen | | (54 108 219) | (71 539 663) | (24 965 018) |
| | | **(51 657 549)** | **88 467 077** | **41 023 859** |
| Dividendenausschüttungen | 12 | - | - | - |
| Kursdifferenzen beim Nettovermögen zum 28. Februar 2019 | | - | - | - |
| **Nettovermögen am Ende des Jahres** | | **244 214 897** | **1 489 361 316** | **440 748 572** |



Die beigefügten Anmerkungen sind integraler Bestandteil dieses Geschäftsberichts.

## Aufwands- und Ertragsrechnung für das Nettovermögen (Fortsetzung)

(in der Währung des Teilfonds)

| | Anmerkungen | Swiss Life Funds (LUX) Income Equity Euro Zone[1] EUR | Swiss Life Funds (LUX) Portfolio Global Growth (CHF) CHF | Swiss Life Funds (LUX) Vitality (EUR) EUR |
|---|---|---|---|---|
| **Nettovermögen zu Beginn des Jahres** | | **-** | **52 441 375** | **131 706 239** |
| **EINNAHMEN** | | | | |
| Nettodividenden | 2.9 | 221 995 | 12 492 | - |
| Zinsen auf Anleihen, netto | | - | 90 891 | - |
| Bankzinsen | | - | 11 585 | 35 255 |
| Zinsen aus Swapgeschäften | | - | - | - |
| Erträge aus Wertpapierbeleihungen | 9 | - | 616 | 1 196 |
| | | **221 995** | **115 584** | **36 451** |
| **AUSGABEN** | | | | |
| Managementgebühren | 3 | 21 946 | 396 767 | 1 130 761 |
| Depotgebühren | 4 | 5 173 | 7 478 | 16 026 |
| *Taxe d'abonnement* | 5 | 4 234 | 6 392 | 20 406 |
| Verwaltungsgebühren | 4 | 7 433 | 13 589 | 27 029 |
| Gebühren der Registerstelle | 4 | 157 | 1 695 | 6 715 |
| Honorare | | 7 267 | 18 065 | 19 431 |
| Zinsen und Bankgebühren | | 14 753 | 1 823 | 37 292 |
| Zinsen aus Swapgeschäften | | - | - | - |
| Abschreibung der Gründungskosten | | - | - | - |
| Transaktionskosten | | 139 611 | 1 088 | 8 013 |
| Sonstige Ausgaben | | - | 566 | 405 |
| | | **200 574** | **447 463** | **1 266 078** |
| **Nettoinvestitionsertrag/ (-verlust)** | | **21 421** | **(331 879)** | **(1 229 627)** |
| **Realisierter Nettogewinn/ (-verlust) aus** | | | | |
| - Verkäufen von Wertpapieren | 2.5 | 19 690 | 767 358 | 201 920 |
| - Währungen | | - | (99 761) | 79 047 |
| - Devisentermingeschäften | | - | 45 919 | (544 597) |
| - Optionen | | 711 309 | - | - |
| - Finanztermingeschäften | | (1 840) | 375 540 | 1 874 197 |
| - Swapgeschäfte | | - | - | - |
| | | **729 159** | **1 089 056** | **1 610 567** |
| **Realisierter Nettoertrag für das Jahr** | | **750 580** | **757 177** | **380 940** |
| **Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/ (-verlusts) aus** | | | | |
| - Wertpapieren | | (10 336 958) | (1 184 391) | (92 112) |
| - Devisentermingeschäften | | - | 92 900 | 5 964 |
| - Optionen | | (635 310) | - | - |
| - Finanztermingeschäften | | 7 861 680 | (305 200) | (3 130 767) |
| - Swapgeschäfte | | - | - | - |
| | | **(3 110 588)** | **(1 396 691)** | **(3 216 915)** |
| **Nettovermögensergebnis gemäß Erfolg** | | **(2 360 008)** | **(639 514)** | **(2 835 975)** |
| **Kapitalveränderungen** | | | | |
| Zeichnungen | | 105 181 234 | 418 244 | 34 108 513 |
| Rücknahmen | | (98 942) | (3 538 568) | (13 332 053) |
| | | **105 082 292** | **(3 120 324)** | **20 776 460** |
| Dividendenausschüttungen | 12 | - | - | - |
| Kursdifferenzen beim Nettovermögen zum 28. Februar 2019 | | - | - | - |
| **Nettovermögen am Ende des Jahres** | | **102 722 284** | **48 681 537** | **149 646 724** |

[1] Dieser Teilfonds wurde zum 19. Dezember 2019 aufgelegt.

Die beigefügten Anmerkungen sind integraler Bestandteil dieses Geschäftsberichts.

## Aufwands- und Ertragsrechnung für das Nettovermögen (Fortsetzung)

(in der Währung des Teilfonds)

| | Anmerkungen | Konsolidiert EUR |
|---|---|---|
| **Nettovermögen zu Beginn des Jahres** | | **5 105 051 791** |
| **EINNAHMEN** | | |
| Nettodividenden | 2.9 | 14 674 992 |
| Zinsen auf Anleihen, netto | | 24 154 326 |
| Bankzinsen | | 754 569 |
| Zinsen aus Swapgeschäften | | 26 427 |
| Erträge aus Wertpapierbeleihungen | 9 | 106 692 |
| | | **39 717 006** |
| **AUSGABEN** | | |
| Managementgebühren | 3 | 18 749 140 |
| Depotgebühren | 4 | 622 674 |
| *Taxe d'abonnement* | 5 | 488 092 |
| Verwaltungsgebühren | 4 | 851 136 |
| Gebühren der Registerstelle | 4 | 57 873 |
| Honorare | | 379 116 |
| Zinsen und Bankgebühren | | 656 756 |
| Zinsen aus Swapgeschäften | | 55 069 |
| Abschreibung der Gründungskosten | | 42 |
| Transaktionskosten | | 2 246 448 |
| Sonstige Ausgaben | | 43 469 |
| | | **24 149 815** |
| **Nettoinvestitionsertrag/ (-verlust)** | | **15 567 191** |
| **Realisierter Nettogewinn/ (-verlust) aus** | | |
| - Verkäufen von Wertpapieren | 2.5 | 70 805 825 |
| - Währungen | | 1 358 953 |
| - Devisentermingeschäften | | (20 410 780) |
| - Optionen | | (13 913 276) |
| - Finanztermingeschäften | | (2 566 421) |
| - Swapgeschäfte | | (7 357 274) |
| | | **27 917 027** |
| **Realisierter Nettoertrag für das Jahr** | | **43 484 218** |
| **Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/ (-verlusts) aus** | | |
| - Wertpapieren | | (80 470 894) |
| - Devisentermingeschäften | | 10 532 659 |
| - Optionen | | 21 504 892 |
| - Finanztermingeschäften | | 6 123 812 |
| - Swapgeschäfte | | 4 623 637 |
| | | **(37 685 894)** |
| **Nettovermögensergebnis gemäß Erfolg** | | **5 798 324** |
| **Kapitalveränderungen** | | |
| Zeichnungen | | 656 047 108 |
| Rücknahmen | | (431 887 021) |
| | | **224 160 087** |
| Dividendenausschüttungen | 12 | (8 851 114) |
| Kursdifferenzen beim Nettovermögen zum 28. Februar 2019* | | 4 425 566 |
| **Nettovermögen am Ende des Jahres** | | **5 330 584 654** |

Betrag erklärt sich durch die Differenz zwischen dem zum 31. August 2019 geltenden Wechselkurs und dem zum 29. Februar 2020 geltenden Wechselkurs zur Berechnung des Nettovermögens zum Jahresbeginn der Teilfonds, die in anderen Währungen als EUR lauten.
Die beigefügten Anmerkungen sind integraler Bestandteil dieses Geschäftsberichts.

# Statistische Informationen

## Swiss Life Funds (LUX) Bond Emerging Markets Corporates

| | Währung | 29.02.2020 | 31.08.2019 | 31.08.2018 |
|---|---|---|---|---|
| **AM-Anteile - in CHF Abgesichert Thesaurierend** | | | | |
| Anzahl Anteile | | 27 075.000 | 27 011.515 | 16 070.515 |
| Nettoinventarwert je Anteil | CHF | 10 562.71 | 10 419.80 | 9 661.62 |
| **AM-Anteile - in EUR Abgesichert Thesaurierend** | | | | |
| Anzahl Anteile | | 595.000 | 580.000 | 675.000 |
| Nettoinventarwert je Anteil | EUR | 10 705.38 | 10 539.53 | 9 723.94 |
| **F-Anteile - Thesaurierend** | | | | |
| Anzahl Anteile | | 30 000.000 | 30 000.000 | - |
| Nettoinventarwert je Anteil | USD | 114.89 | 111.99 | - |
| **I-Anteile - Thesaurierend** | | | | |
| Anzahl Anteile | | 1 000.000 | 1 000.000 | 1 179.000 |
| Nettoinventarwert je Anteil | USD | 12 556.81 | 12 228.43 | 11 001.04 |
| **I-Anteile in CHF Abgesichert - Thesaurierend** | | | | |
| Anzahl Anteile | | 4 002.621 | 3 593.715 | 6 466.627 |
| Nettoinventarwert je Anteil | CHF | 11 002.50 | 10 887.15 | 10 151.04 |
| **I-Anteile in EUR Abgesichert - Ausschüttend** | | | | |
| Anzahl Anteile | | 696.000 | 696.000 | 8 196.000 |
| Nettoinventarwert je Anteil | EUR | 9 365.50 | 9 665.90 | 9 407.07 |
| **I-Anteile in EUR Abgesichert- Thesaurierend** | | | | |
| Anzahl Anteile | | 4 888.743 | 5 012.423 | 4 618.000 |
| Nettoinventarwert je Anteil | EUR | 11 356.16 | 11 211.35 | 10 401.39 |
| **R-Anteile in CHF Abgesichert - Thesaurierend** | | | | |
| Anzahl Anteile | | 185 924.407 | 157 968.407 | 106 475.407 |
| Nettoinventarwert je Anteil | CHF | 106.06 | 105.26 | 98.78 |
| **R-Anteile in CHF Abgesichert - Thesaurierend** | | | | |
| Anzahl Anteile | | 92 437.840 | 96 304.520 | 19 633.573 |
| Nettoinventarwert je Anteil | EUR | 109.22 | 108.17 | 101.04 |
| **S-Anteile - in EUR Abgesichert Thesaurierend** | | | | |
| Anzahl Anteile | | 1 690.000 | 1 600.000 | 1 575.000 |
| Nettoinventarwert je Anteil | EUR | 10 712.57 | 10 537.76 | 9 708.90 |
| Gesamtvermögen | USD | 483 441 742 | 462 451 770 | 425 594 596 |

# Statistische Informationen (Fortsetzung)

## Swiss Life Funds (LUX) Bond Emerging Markets Corporates Short Term

| | Währung | 29.02.2020 | 31.08.2019 | 31.08.2018 |
|---|---|---|---|---|
| **AM-Anteile - in CHF Abgesichert Thesaurierend** | | | | |
| Anzahl Anteile | | 24 286.000 | 23 234.000 | 13 644.000 |
| Nettoinventarwert je Anteil | CHF | 9 970.71 | 9 944.04 | 9 744.63 |
| **F-Anteile - Thesaurierend** | | | | |
| Anzahl Anteile | | 30 700.000 | 30 000.000 | - |
| Nettoinventarwert je Anteil | USD | 106.49 | 104.80 | - |
| **I-Anteile - Thesaurierend** | | | | |
| Anzahl Anteile | | 2 747.000 | 3 250.000 | 2 996.000 |
| Nettoinventarwert je Anteil | USD | 10 715.37 | 10 535.83 | 9 994.91 |
| **I-Anteile - in EUR Abgesichert - Thesaurierend** | | | | |
| Anzahl Anteile | | 712.439 | - | - |
| Nettoinventarwert je Anteil | EUR | 10 029.62 | - | - |
| **I-Anteile in CHF Abgesichert - Thesaurierend** | | | | |
| Anzahl Anteile | | 100.000 | 100.000 | 100.000 |
| Nettoinventarwert je Anteil | CHF | 10 179.88 | 10 168.02 | 9 991.29 |
| Gesamtvermögen | USD | 291 770 261 | 271 912 686 | 168 453 014 |

## Swiss Life Funds (LUX) Bond Euro Corporates

| | Währung | 29.02.2020 | 31.08.2019 | 31.08.2018 |
|---|---|---|---|---|
| **Q-Anteile - Thesaurierend** | | | | |
| Anzahl Anteile | | 28 590.394 | 15 604.991 | 15 627.191 |
| Nettoinventarwert je Anteil | EUR | 1 572.85 | 1 578.46 | 1 497.73 |
| **R-Anteile - Thesaurierend** | | | | |
| Anzahl Anteile | | 28 910.710 | 32 271.100 | 56 618.018 |
| Nettoinventarwert je Anteil | EUR | 151.91 | 152.82 | 145.69 |
| **R-Anteile in CHF Abgesichert - Thesaurierend** | | | | |
| Anzahl Anteile | | 92 564.165 | 92 716.160 | 93 539.664 |
| Nettoinventarwert je Anteil | CHF | 146.35 | 147.51 | 141.39 |
| Gesamtvermögen | EUR | 62 101 002 | 42 114 739 | 43 407 699 |

# Statistische Informationen (Fortsetzung)

## Swiss Life Funds (LUX) Bond Global Corporates

| | Währung | 29.02.2020 | 31.08.2019 | 31.08.2018 |
|---|---|---|---|---|
| **AM-Anteile - Thesaurierend** | | | | |
| Anzahl Anteile | | 2 560.000 | 2 290.000 | 3 100.000 |
| Nettoinventarwert je Anteil | EUR | 10 814.25 | 10 589.65 | 9 713.91 |
| **I-Anteile - Thesaurierend** | | | | |
| Anzahl Anteile | | 500.000 | - | - |
| Nettoinventarwert je Anteil | EUR | 10 190.38 | - | - |
| **I-Anteile - Ausschüttend** | | | | |
| Anzahl Anteile | | 719.000 | 703.000 | 1 090.000 |
| Nettoinventarwert je Anteil | EUR | 10 499.15 | 10 603.23 | 10 062.14 |
| **I-Anteile in USD Abgesichert - Thesaurierend** | | | | |
| Anzahl Anteile | | 500.000 | 500.000 | - |
| Nettoinventarwert je Anteil | USD | 11 725.20 | 11 347.30 | - |
| **R-Anteile - Thesaurierend** | | | | |
| Anzahl Anteile | | 335 349.742 | 350 447.270 | 353 851.153 |
| Nettoinventarwert je Anteil | EUR | 155.12 | 152.50 | 140.99 |
| **R-Anteile in CHF Abgesichert - Thesaurierend** | | | | |
| Anzahl Anteile | | 557 666.185 | 569 925.185 | 490 793.223 |
| Nettoinventarwert je Anteil | CHF | 131.38 | 129.41 | 120.20 |
| **S-Anteile - Thesaurierend** | | | | |
| Anzahl Anteile | | 3 535.000 | 6 660.000 | 8 035.000 |
| Nettoinventarwert je Anteil | EUR | 10 876.42 | 10 642.46 | 9 747.74 |
| Gesamtvermögen | EUR | 205 040 066 | 228 864 692 | 221 719 904 |

# Statistische Informationen (Fortsetzung)

## Swiss Life Funds (LUX) Bond Global Corporates Short Term

| | Währung | 29.02.2020 | 31.08.2019 | 31.08.2018 |
|---|---|---|---|---|
| **I-Anteile - Thesaurierend** | | | | |
| Anzahl Anteile | | 500.000 | - | - |
| Nettoinventarwert je Anteil | EUR | 10 023.67 | - | - |
| **I-Anteile - Ausschüttend** | | | | |
| Anzahl Anteile | | 6 724.000 | 9 577.000 | 9 986.000 |
| Nettoinventarwert je Anteil | EUR | 8 939.59 | 9 165.63 | 9 291.54 |
| **R-Anteile - Ausschüttend** | | | | |
| Anzahl Anteile | | 50 224.000 | 50 450.000 | 50 431.000 |
| Nettoinventarwert je Anteil | EUR | 90.71 | 93.12 | 94.62 |
| Gesamtvermögen | EUR | 69 677 573 | 92 477 190 | 97 557 271 |

## Swiss Life Funds (LUX) Bond Global High Yield

| | Währung | 29.02.2020 | 31.08.2019 | 31.08.2018 |
|---|---|---|---|---|
| **AM-Anteile - Thesaurierend** | | | | |
| Anzahl Anteile | | 3 475.000 | 3 625.000 | 4 195.000 |
| Nettoinventarwert je Anteil | EUR | 10 200.13 | 10 254.82 | 9 871.51 |
| **AM-Anteile in CHF Abgesichert - Thesaurierend** | | | | |
| Anzahl Anteile | | 3 500.000 | 3 980.000 | 3 840.000 |
| Nettoinventarwert je Anteil | CHF | 10 183.90 | 10 259.89 | 9 914.31 |
| **F-Anteile - Thesaurierend** | | | | |
| Anzahl Anteile | | 30 000.000 | 30 000.000 | - |
| Nettoinventarwert je Anteil | EUR | 105.75 | 106.65 | - |
| **I-Anteile - Thesaurierend** | | | | |
| Anzahl Anteile | | 854.815 | 854.815 | 988.271 |
| Nettoinventarwert je Anteil | EUR | 13 473.56 | 13 576.17 | 13 127.24 |
| **I-Anteile - Ausschüttend** | | | | |
| Anzahl Anteile | | 2 305.000 | 2 305.000 | 2 305.000 |
| Nettoinventarwert je Anteil | EUR | 8 920.49 | 9 371.67 | 9 458.31 |
| **I-Anteile in CHF Abgesichert - Thesaurierend** | | | | |
| Anzahl Anteile | | 4 351.525 | 4 320.104 | 4 284.476 |
| Nettoinventarwert je Anteil | CHF | 13 111.60 | 13 241.62 | 12 841.85 |
| **R-Anteile - Thesaurierend** | | | | |
| Anzahl Anteile | | 15 177.061 | 16 575.770 | 26 376.713 |
| Nettoinventarwert je Anteil | EUR | 128.30 | 129.69 | 126.16 |

# Statistische Informationen (Fortsetzung)

## Swiss Life Funds (LUX) Bond Global High Yield

| | Währung | 29.02.2020 | 31.08.2019 | 31.08.2018 |
|---|---|---|---|---|
| **R-Anteile in CHF Abgesichert - Thesaurierend** | | | | |
| Anzahl Anteile | | 99 774.433 | 83 819.433 | 71 583.433 |
| Nettoinventarwert je Anteil | CHF | 124.55 | 126.18 | 123.30 |
| **S-Anteile - Thesaurierend** | | | | |
| Anzahl Anteile | | 8 325.000 | 8 445.000 | 8 695.000 |
| Nettoinventarwert je Anteil | EUR | 14 085.78 | 14 150.76 | 13 601.53 |
| Gesamtvermögen | EUR | 288 780 403 | 294 912 874 | 288 352 132 |

## Swiss Life Funds (LUX) Bond Inflation Protection

| | Währung | 29.02.2020 | 31.08.2019 | 31.08.2018 |
|---|---|---|---|---|
| **I-Anteile - Thesaurierend** | | | | |
| Anzahl Anteile | | 2 531.300 | 2 076.300 | 3 236.392 |
| Nettoinventarwert je Anteil | EUR | 7 721.76 | 7 907.86 | 8 511.70 |
| **R-Anteile - Thesaurierend** | | | | |
| Anzahl Anteile | | 14 217.808 | 15 824.812 | 103 955.271 |
| Nettoinventarwert je Anteil | EUR | 73.24 | 75.19 | 81.26 |
| Gesamtvermögen | EUR | 20 587 426 | 17 608 944 | 35 995 070 |

## Swiss Life Funds (LUX) Equity Euro Zone

| | Währung | 29.02.2020 | 31.08.2019 | 31.08.2018 |
|---|---|---|---|---|
| **AM-Anteile - Thesaurierend** | | | | |
| Anzahl Anteile | | 2 983.000 | 3 161.486 | 3 128.486 |
| Nettoinventarwert je Anteil | EUR | 9 048.52 | 9 256.42 | 9 480.82 |
| **F-Anteile - Thesaurierend** | | | | |
| Anzahl Anteile | | 30 000.000 | 30 000.000 | - |
| Nettoinventarwert je Anteil | EUR | 103.21 | 105.97 | - |
| **I-Anteile - Thesaurierend** | | | | |
| Anzahl Anteile | | 3 862.336 | 3 741.946 | 508.536 |
| Nettoinventarwert je Anteil | EUR | 11 018.21 | 11 296.63 | 11 623.74 |
| **R-Anteile - Thesaurierend** | | | | |
| Anzahl Anteile | | 603 458.212 | 618 884.816 | 630 069.437 |
| Nettoinventarwert je Anteil | EUR | 151.30 | 155.85 | 161.86 |

# Statistische Informationen (Fortsetzung)

## Swiss Life Funds (LUX) Equity Euro Zone

| | Währung | 29.02.2020 | 31.08.2019 | 31.08.2018 |
|---|---|---|---|---|
| **S-Anteile - Thesaurierend** | | | | |
| Anzahl Anteile | | 3 755.000 | 3 575.000 | 3 260.000 |
| Nettoinventarwert je Anteil | EUR | 12 200.19 | 12 471.22 | 12 754.41 |
| Gesamtvermögen | EUR | 209 760 787 | 215 753 694 | 179 133 687 |

## Swiss Life Funds (LUX) Equity Global

| | Währung | 29.02.2020 | 31.08.2019 | 31.08.2018 |
|---|---|---|---|---|
| **AM-Anteile in EUR - Thesaurierend** | | | | |
| Anzahl Anteile | | 2 885.000 | 3 020.000 | 2 792.000 |
| Nettoinventarwert je Anteil | EUR | 11 055.64 | 11 012.89 | 10 692.31 |
| **F-Anteile in CHF - Thesaurierend** | | | | |
| Anzahl Anteile | | 77 610.000 | 55 510.000 | - |
| Nettoinventarwert je Anteil | CHF | 92.96 | 95.24 | - |
| **I-Anteile EUR - Thesaurierend** | | | | |
| Anzahl Anteile | | 5 072.000 | 5 072.000 | 5 072.000 |
| Nettoinventarwert je Anteil | EUR | 13 745.56 | 13 723.08 | 13 383.61 |
| **I-Anteile - Thesaurierend** | | | | |
| Anzahl Anteile | | 367.373 | 367.373 | 367.373 |
| Nettoinventarwert je Anteil | USD | 13 935.27 | 13 947.96 | 14 370.94 |
| **S-Anteile EUR - Thesaurierend** | | | | |
| Anzahl Anteile | | 1 875.000 | 1 890.000 | 1 735.000 |
| Nettoinventarwert je Anteil | EUR | 14 089.24 | 14 024.30 | 13 595.47 |
| Gesamtvermögen | USD | 153 208 056 | 152 934 287 | 146 438 520 |

## Swiss Life Funds (LUX) Equity Global High Dividend

| | Währung | 29.02.2020 | 31.08.2019 | 31.08.2018 |
|---|---|---|---|---|
| **AM-Anteile - Thesaurierend** | | | | |
| Anzahl Anteile | | 2 235.000 | 2 300.000 | 2 495.000 |
| Nettoinventarwert je Anteil | EUR | 10 536.06 | 10 674.13 | 10 168.01 |
| **I-Anteile - Thesaurierend** | | | | |
| Anzahl Anteile | | 572.573 | 474.886 | 405.774 |
| Nettoinventarwert je Anteil | EUR | 16 211.08 | 16 459.73 | 15 749.62 |

# Statistische Informationen (Fortsetzung)

## Swiss Life Funds (LUX) Equity Global High Dividend

| | Währung | 29.02.2020 | 31.08.2019 | 31.08.2018 |
|---|---|---|---|---|
| **I-Anteile - Ausschüttend** | | | | |
| Anzahl Anteile | | 5 434.000 | 5 434.000 | 5 434.000 |
| Nettoinventarwert je Anteil | EUR | 9 900.09 | 10 421.55 | 10 348.49 |
| **R-Anteile - Thesaurierend** | | | | |
| Anzahl Anteile | | 98 013.978 | 88 517.500 | 107 954.619 |
| Nettoinventarwert je Anteil | EUR | 159.83 | 163.05 | 157.48 |
| **R-Anteile - Ausschüttend CHF** | | | | |
| Anzahl Anteile | | 323 167.759 | 273 230.940 | 383 246.275 |
| Nettoinventarwert je Anteil | CHF | 66.10 | 71.68 | 74.44 |
| **S-Anteile - Thesaurierend** | | | | |
| Anzahl Anteile | | 4 395.000 | 4 360.000 | 4 190.000 |
| Nettoinventarwert je Anteil | EUR | 16 137.90 | 16 337.21 | 15 539.39 |
| Gesamtvermögen | EUR | 193 310 493 | 192 634 352 | 195 459 495 |

## Swiss Life Funds (LUX) Equity Global Long/Short

| | Währung | 29.02.2020 | 31.08.2019 | 31.08.2018 |
|---|---|---|---|---|
| **AM-Anteile - Thesaurierend** | | | | |
| Anzahl Anteile | | 6 075.000 | 6 075.000 | 5 550.000 |
| Nettoinventarwert je Anteil | EUR | 9 701.44 | 9 737.41 | 9 961.55 |
| **I-Anteile - Thesaurierend** | | | | |
| Anzahl Anteile | | 4 791.000 | 4 883.504 | 4 776.488 |
| Nettoinventarwert je Anteil | EUR | 9 605.65 | 9 648.45 | 9 885.30 |
| **S-Anteile - Thesaurierend** | | | | |
| Anzahl Anteile | | 5 780.000 | 5 305.000 | 3 840.000 |
| Nettoinventarwert je Anteil | EUR | 9 735.89 | 9 764.70 | 9 974.49 |
| Gesamtvermögen | EUR | 161 230 312 | 158 074 719 | 140 805 629 |

## Swiss Life Funds (LUX) Equity Global Minimum Volatility

| | Währung | 29.02.2020 | 31.08.2019 | 31.08.2018 |
|---|---|---|---|---|
| **AM-Anteile in EUR - Thesaurierend** | | | | |
| Anzahl Anteile | | 4 170.000 | 4 520.000 | 4 843.000 |
| Nettoinventarwert je Anteil | EUR | 12 579.46 | 12 753.18 | 10 719.75 |

# Statistische Informationen (Fortsetzung)

## Swiss Life Funds (LUX) Equity Global Minimum Volatility

| | Währung | 29.02.2020 | 31.08.2019 | 31.08.2018 |
|---|---|---|---|---|
| **I-Anteile - Thesaurierend** | | | | |
| Anzahl Anteile | | 430.056 | 430.056 | 430.056 |
| Nettoinventarwert je Anteil | USD | 13 562.46 | 13 815.70 | 12 324.02 |
| **I-Anteile EUR - Thesaurierend** | | | | |
| Anzahl Anteile | | 500.000 | - | - |
| Nettoinventarwert je Anteil | EUR | 9 746.62 | - | - |
| **I-Anteile EUR - Ausschüttend** | | | | |
| Anzahl Anteile | | 2 344.000 | 2 939.000 | 2 000.000 |
| Nettoinventarwert je Anteil | EUR | 12 275.93 | 12 734.37 | 11 013.01 |
| **R-Anteile EUR - Ausschüttend** | | | | |
| Anzahl Anteile | | 100 339.337 | 100 675.841 | 100 000.000 |
| Nettoinventarwert je Anteil | EUR | 119.02 | 124.07 | 108.32 |
| **S-Anteile EUR - Thesaurierend** | | | | |
| Anzahl Anteile | | 4 255.000 | 4 035.000 | 4 050.000 |
| Nettoinventarwert je Anteil | EUR | 13 260.89 | 13 434.02 | 11 275.07 |
| Gesamtvermögen | USD | 175 512 532 | 184 087 906 | 157 064 620 |

## Swiss Life Funds (LUX) Equity Global Protect

| | Währung | 29.02.2020 | 31.08.2019 | 31.08.2018 |
|---|---|---|---|---|
| **I-Anteile - Thesaurierend** | | | | |
| Anzahl Anteile | | 15 062.000 | 17 348.000 | 19 328.000 |
| Nettoinventarwert je Anteil | EUR | 11 504.79 | 11 244.29 | 11 390.78 |
| **S-Anteile - Thesaurierend** | | | | |
| Anzahl Anteile | | 10 160.000 | 9 740.000 | 5 150.000 |
| Nettoinventarwert je Anteil | EUR | 11 792.00 | 11 490.66 | 11 570.99 |
| Gesamtvermögen | EUR | 293 091 906 | 306 984 950 | 279 751 654 |

## Swiss Life Funds (LUX) Equity USA

| | Währung | 29.02.2020 | 31.08.2019 | 31.08.2018 |
|---|---|---|---|---|
| **AM-Anteile in EUR - Thesaurierend** | | | | |
| Anzahl Anteile | | 7 119.167 | 8 014.501 | 8 419.501 |
| Nettoinventarwert je Anteil | EUR | 11 801.19 | 11 819.05 | 11 057.48 |

# Statistische Informationen (Fortsetzung)

## Swiss Life Funds (LUX) Equity USA

| | Währung | 29.02.2020 | 31.08.2019 | 31.08.2018 |
|---|---|---|---|---|
| **F-Anteile - Thesaurierend** | | | | |
| Anzahl Anteile | | 30 000.000 | 30 000.000 | - |
| Nettoinventarwert je Anteil | USD | 103.26 | 104.07 | - |
| **I-Anteile - Thesaurierend** | | | | |
| Anzahl Anteile | | 2 160.114 | 1 841.780 | 1 827.392 |
| Nettoinventarwert je Anteil | USD | 22 526.00 | 22 668.33 | 22 507.14 |
| **I-Anteile EUR - Thesaurierend** | | | | |
| Anzahl Anteile | | 500.000 | - | - |
| Nettoinventarwert je Anteil | EUR | 9 958.53 | - | - |
| **R-Anteile - Thesaurierend** | | | | |
| Anzahl Anteile | | 13 995.331 | 13 609.085 | 12 613.000 |
| Nettoinventarwert je Anteil | USD | 156.36 | 158.08 | 158.41 |
| **SL-Anteile in EUR - Ausschüttend** | | | | |
| Anzahl Anteile | | 5 200.000 | 5 200.000 | 1 000.000 |
| Nettoinventarwert je Anteil | EUR | 10 482.70 | 10 671.88 | 10 000.00 |
| **S-Anteile - Thesaurierend** | | | | |
| Anzahl Anteile | | 4 800.000 | 4 860.000 | 4 890.000 |
| Nettoinventarwert je Anteil | USD | 23 551.92 | 23 630.08 | 23 322.12 |
| Gesamtvermögen | USD | 324 626 008 | 327 292 640 | 277 127 627 |

## Swiss Life Funds (LUX) Fixed Income Alpha Select[1]

| | Währung | 29.02.2020 | 31.08.2019 | 31.08.2018 |
|---|---|---|---|---|
| **AM-Anteile - Thesaurierend** | | | | |
| Anzahl Anteile | | 1 125.000 | - | - |
| Nettoinventarwert je Anteil | EUR | 10 101.25 | - | - |
| **I-Anteile - Thesaurierend** | | | | |
| Anzahl Anteile | | 400.000 | - | - |
| Nettoinventarwert je Anteil | EUR | 10 074.27 | - | - |
| **S-Anteile - Thesaurierend** | | | | |
| Anzahl Anteile | | 3 820.000 | - | - |
| Nettoinventarwert je Anteil | EUR | 10 108.62 | - | - |
| Gesamtvermögen | EUR | 54 008 529 | - | - |

[1] Dieser Teilfonds wurde zum 3. September 2019 aufgelegt.

# Statistische Informationen (Fortsetzung)

## Swiss Life Funds (LUX) Multi Asset Risk Premia

| | Währung | 29.02.2020 | 31.08.2019 | 31.08.2018 |
|---|---|---|---|---|
| **AM-Anteile - Thesaurierend** | | | | |
| Anzahl Anteile | | 2 930.000 | 2 930.000 | 4 395.000 |
| Nettoinventarwert je Anteil | EUR | 9 143.50 | 9 194.14 | 9 795.10 |
| **AM-Anteile in CHF Abgesichert - Thesaurierend** | | | | |
| Anzahl Anteile | | 12 780.000 | 18 651.000 | 14 650.000 |
| Nettoinventarwert je Anteil | CHF | 8 907.44 | 8 975.11 | 9 615.34 |
| **I-Anteile - Thesaurierend** | | | | |
| Anzahl Anteile | | 500.000 | 500.000 | 500.000 |
| Nettoinventarwert je Anteil | EUR | 9 063.56 | 9 129.64 | 9 758.76 |
| **I-Anteile in CHF Abgesichert - Thesaurierend** | | | | |
| Anzahl Anteile | | 2 150.000 | 2 641.000 | 1 844.000 |
| Nettoinventarwert je Anteil | CHF | 8 836.97 | 8 923.86 | 9 598.55 |
| **R-Anteile in CHF Abgesichert - Thesaurierend** | | | | |
| Anzahl Anteile | | 50 000.000 | 50 000.000 | 50 000.000 |
| Nettoinventarwert je Anteil | CHF | 88.35 | 89.54 | 97.08 |
| **S-Anteile - Thesaurierend** | | | | |
| Anzahl Anteile | | 9 110.000 | 9 110.000 | 12 880.000 |
| Nettoinventarwert je Anteil | EUR | 9 199.08 | 9 238.54 | 9 818.11 |
| Gesamtvermögen | EUR | 244 214 897 | 295 026 951 | 319 614 694 |

# Statistische Informationen (Fortsetzung)

## Swiss Life Funds (LUX) Prudent (EUR)

| | Währung | 29.02.2020 | 31.08.2019 | 31.08.2018 |
|---|---|---|---|---|
| **F-Anteile - Thesaurierend** | | | | |
| Anzahl Anteile | | 30 000.000 | 30 000.000 | - |
| Nettoinventarwert je Anteil | EUR | 105.92 | 105.97 | - |
| **I-Anteile - Thesaurierend** | | | | |
| Anzahl Anteile | | 1 111.950 | 1 090.000 | 1 090.000 |
| Nettoinventarwert je Anteil | EUR | 10 998.19 | 10 991.42 | 10 596.79 |
| **M-Anteile - Thesaurierend** | | | | |
| Anzahl Anteile | | 140 428.000 | 112 896.000 | 73 222.000 |
| Nettoinventarwert je Anteil | EUR | 103.21 | 103.09 | 99.29 |
| **R-Anteile - Thesaurierend** | | | | |
| Anzahl Anteile | | 9 515 046.965 | 8 964 747.700 | 8 964 959.618 |
| Nettoinventarwert je Anteil | EUR | 153.38 | 153.90 | 149.29 |
| Gesamtvermögen | EUR | 1 489 361 316 | 1 406 438 782 | 1 357 235 390 |

## Swiss Life Funds (LUX) Harmony (EUR)

| | Währung | 29.02.2020 | 31.08.2019 | 31.08.2018 |
|---|---|---|---|---|
| **M-Anteile - Thesaurierend** | | | | |
| Anzahl Anteile | | 227 917.000 | 156 150.000 | 96 479.000 |
| Nettoinventarwert je Anteil | EUR | 102.25 | 102.55 | 99.57 |
| **R-Anteile - Thesaurierend** | | | | |
| Anzahl Anteile | | 2 817 930.308 | 2 598 845.298 | 2 199 174.098 |
| Nettoinventarwert je Anteil | EUR | 148.14 | 149.39 | 146.39 |
| Gesamtvermögen | EUR | 440 748 572 | 404 241 929 | 331 538 976 |

## Swiss Life Funds (LUX) Income Equity Euro Zone[1]

| | Währung | 29.02.2020 | 31.08.2019 | 31.08.2018 |
|---|---|---|---|---|
| **AM-Anteile - Ausschüttend** | | | | |
| Anzahl Anteile | | 2 065.000 | - | - |
| Nettoinventarwert je Anteil | EUR | 9 772.92 | - | - |
| **SL-Anteile - Ausschüttend** | | | | |
| Anzahl Anteile | | 2 000.000 | - | - |
| Nettoinventarwert je Anteil | EUR | 9 768.19 | - | - |

[1] Dieser Teilfonds wurde zum 19. Dezember 2019 aufgelegt.

# Statistische Informationen (Fortsetzung)

## Swiss Life Funds (LUX) Income Equity Euro Zone[1]

| | Währung | 29.02.2020 | 31.08.2019 | 31.08.2018 |
|---|---|---|---|---|
| **S-Anteile - Thesaurierend** | | | | |
| Anzahl Anteile | | 6 445.000 | - | - |
| Nettoinventarwert je Anteil | EUR | 9 775.77 | - | - |
| Gesamtvermögen | EUR | 102 722 284 | - | - |

## Swiss Life Funds (LUX) Portfolio Global Growth (CHF)

| | Währung | 29.02.2020 | 31.08.2019 | 31.08.2018 |
|---|---|---|---|---|
| **R-Anteile - Thesaurierend** | | | | |
| Anzahl Anteile | | 376 988.481 | 399 936.399 | 443 303.237 |
| Nettoinventarwert je Anteil | CHF | 129.13 | 131.12 | 124.42 |
| Gesamtvermögen | CHF | 48 681 537 | 52 441 375 | 55 157 742 |

## Swiss Life Funds (LUX) Vitality (EUR)

| | Währung | 29.02.2020 | 31.08.2019 | 31.08.2018 |
|---|---|---|---|---|
| **M-Anteile - Thesaurierend** | | | | |
| Anzahl Anteile | | 207 977.000 | 137 980.000 | 102 580.000 |
| Nettoinventarwert je Anteil | EUR | 100.52 | 101.43 | 99.57 |
| **R-Anteile - Thesaurierend** | | | | |
| Anzahl Anteile | | 867 092.836 | 780 580.111 | 648 468.801 |
| Nettoinventarwert je Anteil | EUR | 148.47 | 150.80 | 149.69 |
| Gesamtvermögen | EUR | 149 646 724 | 131 706 239 | 107 285 737 |

[1] Dieser Teilfonds wurde zum 19. Dezember 2019 aufgelegt.

# Wertentwicklung

## Swiss Life Funds (LUX) Bond Emerging Markets Corporates

| | | Rechnungsjahr | | | Kalenderjahr | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | Währung | 28.02.2020 | 31.08.2019 | 31.08.2018 | 31.12.2019 | 31.12.2018 | 31.12.2017 |
| **AM-Anteile - in CHF Abgesichert Thesaurierend** | | | | | | | |
| Performance | CHF | 1.4% | 7.8% | (3.4%) | 8.0% | (3.7%) | (0.5%) |
| **AM-Anteile - in EUR Abgesichert Thesaurierend** | | | | | | | |
| Performance | EUR | 1.6% | 8.3% | (2.8%) | 8.6% | (3.4%) | - |
| **F-Anteile - Thesaurierend** | | | | | | | |
| Performance | USD | 2.6% | 11.9% | - | 11.0% | (1.1%) | - |
| **I-Anteile - Thesaurierend** | | | | | | | |
| Performance | USD | 2.7% | 11.1% | (1.0%) | 11.3% | 1.1% | 6.0% |
| **I-Anteile - in CHF Abgesichert Thesaurierend** | | | | | | | |
| Performance | CHF | 1.1% | 7.2% | (4.0%) | 7.4% | (4.3%) | 3.3% |
| **I-Anteile - in EUR Abgesichert Thesaurierend** | | | | | | | |
| Performance | EUR | 1.3% | 7.8% | (3.5%) | 8.0% | (8.3%) | 3.9% |
| **I-Anteile - in EUR Abgesichert Ausschüttend** | | | | | | | |
| Performance | EUR | (3.1%) | 2.8% | (7.5%) | 3.2% | (3.8%) | (0.5%) |
| **R-Anteile - in CHF Abgesichert Thesaurierend** | | | | | | | |
| Performance | CHF | 0.8% | 6.6% | (4.7%) | 6.7% | (5.0%) | 2.7% |
| **R-Anteile - in EUR Abgesichert Thesaurierend** | | | | | | | |
| Performance | EUR | 1.0% | 7.1% | (4.2%) | 7.3% | (4.6%) | 3.2% |
| **S-Anteile - in EUR Abgesichert Thesaurierend** | | | | | | | |
| Performance | EUR | 1.7% | 8.5% | (2.9%) | 8.7% | (3.2%) | (0.3%) |

## Swiss Life Funds (LUX) Bond Emerging Markets Corporates Short Term

| | | Rechnungsjahr | | | Kalenderjahr | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | Währung | 28.02.2020 | 31.08.2019 | 31.08.2018 | 31.12.2019 | 31.12.2018 | 31.12.2017 |
| **AM-Anteile - in CHF Abgesichert Thesaurierend** | | | | | | | |
| Performance | CHF | 0.3% | 2% | (2.6%) | 1.9% | (1.8%) | (1.0%) |
| **F-Anteile - Thesaurierend** | | | | | | | |
| Performance | USD | 1.6% | 4.8% | - | 5.0% | 0.4% | - |
| **I-Anteile - Thesaurierend** | | | | | | | |
| Performance | USD | 1.7% | 5.4% | (0.1%) | 5.2% | 1.1% | (0.3%) |
| **I-Anteile - in EUR Abgesichert Thesaurierend** | | | | | | | |
| Performance | EUR | 0.3% | - | - | (0.3%) | - | - |
| **I-Anteile - in CHF Abgesichert Thesaurierend** | | | | | | | |
| Performance | CHF | 0.1% | 1.7% | (0.1%) | 1.7% | (0.5%) | - |

Die historische Performance ist kein Indikator für die laufende oder zukünftige Performance.
Die Performancedaten berücksichtigen keine etwaigen erhobenen Provisionen und Kosten bei Ausgabe und Rücknahme der Anteile.

# **Wertentwicklung** (Fortsetzung)

## Swiss Life Funds (LUX) Bond Euro Corporates

| | | Rechnungsjahr | | | Kalenderjahr | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | Währung | 28.02.2020 | 31.08.2019 | 31.08.2018 | 31.12.2019 | 31.12.2018 | 31.12.2017 |
| **Q-Anteile - Thesaurierend** | | | | | | | |
| Performance | EUR | (0.4%) | 5.3% | (0.5%) | 5.7% | (2.6%) | 3.6% |
| **R-Anteile - Thesaurierend** | | | | | | | |
| Performance | EUR | (0.6%) | 4.8% | (1.0%) | 5.2% | (3.0%) | 3.1% |
| **R-Anteile - in CHF Abgesichert - Thesaurierend** | | | | | | | |
| Performance | CHF | (0.8%) | 4.3% | (1.4%) | 4.7% | (3.5%) | 2.6% |

## Swiss Life Funds (LUX) Bond Global Corporates

| | | Rechnungsjahr | | | Kalenderjahr | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | Währung | 28.02.2020 | 31.08.2019 | 31.08.2018 | 31.12.2019 | 31.12.2018 | 31.12.2017 |
| **AM-Anteile - Thesaurierend** | | | | | | | |
| Performance | EUR | 2.1% | 9% | (2.9%) | 10.3% | (4.4%) | - |
| **I-Anteile - Ausschüttend** | | | | | | | |
| Performance | EUR | (1.0%) | 5.3% | (6.1%) | 6.9% | (7.0%) | 0.7% |
| **I-Anteile - Thesaurierend** | | | | | | | |
| Performance | EUR | 1.9% | - | - | (0.5%) | - | - |
| **I-Anteile in USD Abgesichert - Thesaurierend** | | | | | | | |
| Performance | USD | 3.3% | 13.4% | - | 13.2% | 0.8% | - |
| **R-Anteile - Thesaurierend** | | | | | | | |
| Performance | EUR | 1.7% | 8.1% | (3.7%) | 9.5% | (5.1%) | 3.3% |
| **R-Anteile in CHF Abgesichert - Thesaurierend** | | | | | | | |
| Performance | CHF | 1.5% | 7.6% | (4.1%) | 9.01% | (5.6%) | 2.8% |
| **S-Anteile - Thesaurierend** | | | | | | | |
| Performance | EUR | 2.2% | 9.1% | (2.5%) | 10.5% | (4.2%) | 0.6% |

## Swiss Life Funds (LUX) Bond Global Corporates Short Term

| | | Rechnungsjahr | | | Kalenderjahr | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | Währung | 28.02.2020 | 31.08.2019 | 31.08.2018 | 31.12.2019 | 31.12.2018 | 31.12.2017 |
| **I-Anteile - Ausschüttend** | | | | | | | |
| Performance | EUR | (2.5%) | (1.3%) | (4.4%) | (1.1%) | (4.14%) | (3.1%) |
| **I-Anteile - Thesaurierend** | | | | | | | |
| Performance | EUR | (0.2%) | - | - | (0.2%) | - | - |
| **R-Anteile - Ausschüttend** | | | | | | | |
| Performance | EUR | (2.6%) | (1.5%) | (4.7%) | (1.3%) | (4.41%) | (3.3%) |



Die historische Performance ist kein Indikator für die laufende oder zukünftige Performance.
Die Performancedaten berücksichtigen keine etwaigen erhobenen Provisionen und Kosten bei Ausgabe und Rücknahme der Anteile.

# **Wertentwicklung** (Fortsetzung)

## Swiss Life Funds (LUX) Bond Global High Yield

| | | Rechnungsjahr | | | Kalenderjahr | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | Währung | 28.02.2020 | 31.08.2019 | 31.08.2018 | 31.12.2019 | 31.12.2018 | 31.12.2017 |
| **AM-Anteile - Thesaurierend** | | | | | | | |
| Performance | EUR | (0.5%) | 3.9% | (1.3%) | 11.0% | (5.6%) | - |
| **AM-Anteile in CHF Abgesichert - Thesaurierend** | | | | | | | |
| Performance | CHF | (0.7%) | 3.5% | (0.9%) | 10.5% | (5.2%) | - |
| **F-Anteile - Thesaurierend** | | | | | | | |
| Performance | EUR | (0.8%) | 3.4% | - | 10.2% | (1.3%) | - |
| **I-Anteile - Thesaurierend** | | | | | | | |
| Performance | EUR | (0.8%) | 3.1% | 0.2% | 10.5% | (9.6%) | 5.6% |
| **I-Anteile - Ausschüttend** | | | | | | | |
| Performance | EUR | (4.8%) | (0.9%) | (4.5%) | 6.0% | (5.7%) | 0.6% |
| **I-Anteile in CHF Abgesichert - Thesaurierend** | | | | | | | |
| Performance | CHF | (1.0%) | 3.4% | (0.3%) | 10.1% | (6.0%) | 5.0% |
| **R-Anteile - Thesaurierend** | | | | | | | |
| Performance | EUR | (1.1%) | 2.7% | (0.4%) | 9.8% | (6.3%) | 4.9% |
| **R-Anteile in CHF Abgesichert - Thesaurierend** | | | | | | | |
| Performance | CHF | (1.3%) | (1.0%) | 5.7% | 9.3% | (6.8%) | 4.3% |
| **S-Anteile - Thesaurierend** | | | | | | | |
| Performance | EUR | (0.5%) | 4.0% | 0.9% | 11.2% | (5.0%) | 6.2% |

## Swiss Life Funds (LUX) Bond Inflation Protection

| | | Rechnungsjahr | | | Kalenderjahr | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | Währung | 28.02.2020 | 31.08.2019 | 31.08.2018 | 31.12.2019 | 31.12.2018 | 31.12.2017 |
| **I-Anteile - Thesaurierend** | | | | | | | |
| Performance | EUR | (2.4%) | (7.5%) | 1.6% | (1.7%) | (4.0%) | (1.4%) |
| **R-Anteile - Thesaurierend** | | | | | | | |
| Performance | EUR | (2.6%) | (7.4%) | 1.1% | (2.1%) | (4.5%) | (1.9%) |

Die historische Performance ist kein Indikator für die laufende oder zukünftige Performance.
Die Performancedaten berücksichtigen keine etwaigen erhobenen Provisionen und Kosten bei Ausgabe und Rücknahme der Anteile.

# **Wertentwicklung** (Fortsetzung)

## Swiss Life Funds (LUX) Equity Euro Zone

| | | Rechnungsjahr | | | Kalenderjahr | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | Währung | 28.02.2020 | 31.08.2019 | 31.08.2018 | 31.12.2019 | 31.12.2018 | 31.12.2017 |
| **AM-Anteile - Thesaurierend** | | | | | | | |
| Performance | EUR | (2.2%) | (2.4%) | (5.2%) | 22.6% | (18.8%) | - |
| **F-Anteile - Thesaurierend** | | | | | | | |
| Performance | EUR | (2.6%) | (2.8%) | - | 21.6% | (6.5%) | - |
| **I-Anteile - Thesaurierend** | | | | | | | |
| Performance | EUR | (2.5%) | (2.8%) | 0.2% | 22.0% | (17.3%) | 12.1% |
| **R-Anteile - Thesaurierend** | | | | | | | |
| Performance | EUR | (2.9%) | (3.7%) | (0.7%) | 20.9% | (18.0%) | 11.1% |
| **S-Anteile - Thesaurierend** | | | | | | | |
| Performance | EUR | (2.2%) | (2.2%) | 0.8% | 22.8% | (16.8%) | 12.8% |

## Swiss Life Funds (LUX) Equity Global

| | | Rechnungsjahr | | | Kalenderjahr | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | Währung | 28.02.2020 | 31.08.2019 | 31.08.2018 | 31.12.2019 | 31.12.2018 | 31.12.2017 |
| **AM-Anteile in EUR - Thesaurierend** | | | | | | | |
| Performance | EUR | 0.4% | 2.9% | 6.9% | 25.4% | (4.7%) | - |
| **F-Anteile in CHF - Thesaurierend** | | | | | | | |
| Performance | CHF | (2.4%) | (4.7%) | - | 2.8% | - | - |
| **I-Anteile - Thesaurierend** | | | | | | | |
| Performance | USD | (0.1%) | 2.5% | 11.8% | 22.6% | (9.1%) | 23.5% |
| **I-Anteile EUR - Thesaurierend** | | | | | | | |
| Performance | EUR | 0.2% | (2.9%) | 14.3% | 24.8% | (4.2%) | 8.5% |
| **S-Anteile EUR - Thesaurierend** | | | | | | | |
| Performance | EUR | 0.5% | 3.1% | 14.9% | 25.6% | (3.6%) | 9.1% |

Die historische Performance ist kein Indikator für die laufende oder zukünftige Performance.
Die Performancedaten berücksichtigen keine etwaigen erhobenen Provisionen und Kosten bei Ausgabe und Rücknahme der Anteile.

# **Wertentwicklung** (Fortsetzung)

## Swiss Life Funds (LUX) Equity Global High Dividend

| | | Rechnungsjahr | | | Kalenderjahr | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | Währung | 28.02.2020 | 31.08.2019 | 31.08.2018 | 31.12.2019 | 31.12.2018 | 31.12.2017 |
| **AM-Anteile - Thesaurierend** | | | | | | | |
| Performance | EUR | (1.3%) | 4.9% | 1.7% | 21.9% | (5.0%) | - |
| **I-Anteile - Thesaurierend** | | | | | | | |
| Performance | EUR | (1.5%) | 0.7% | 6.2% | 21.3% | (8.4%) | 1.7% |
| **I-Anteile - Ausschüttend** | | | | | | | |
| Performance | EUR | (5.0%) | 4.5% | 3.5% | 17.0% | (5.0%) | 1.7% |
| **R-Anteile Thesaurierend** | | | | | | | |
| Performance | EUR | (2.0%) | 3.5% | 5.2% | 20.1% | (5.9%) | 0.8% |
| **R-Anteile in CHF - Ausschüttend** | | | | | | | |
| Performance | CHF | (7.8%) | (3.7%) | 0.1% | 11.8% | (13.0%) | 6.3% |
| **S-Anteile - Thesaurierend** | | | | | | | |
| Performance | EUR | (1.2%) | 5.1% | 6.9% | 22.1% | (4.4%) | 2.4% |

## Swiss Life Funds (LUX) Equity Global Long/Short

| | | Rechnungsjahr | | | Kalenderjahr | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | Währung | 28.02.2020 | 31.08.2019 | 31.08.2018 | 31.12.2019 | 31.12.2018 | 31.12.2017 |
| **AM-Anteile - Thesaurierend** | | | | | | | |
| Performance | EUR | (0.4%) | (2.2%) | 0.7% | (1.8%) | (1.0%) | 1.5% |
| **I-Anteile - Thesaurierend** | | | | | | | |
| Performance | EUR | (0.4%) | (2.4%) | 0.5% | (1.9%) | (1.1%) | 1.4% |
| **S-Anteile - Thesaurierend** | | | | | | | |
| Performance | EUR | (0.3%) | (2.1%) | 0.8% | (1.6%) | (0.8%) | 1.7% |

Die historische Performance ist kein Indikator für die laufende oder zukünftige Performance.
Die Performancedaten berücksichtigen keine etwaigen erhobenen Provisionen und Kosten bei Ausgabe und Rücknahme der Anteile.

# **Wertentwicklung** (Fortsetzung)

## Swiss Life Funds (LUX) Equity Global Minimum Volatility

| | | Rechnungsjahr | | | Kalenderjahr | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | Währung | 28.02.2020 | 31.08.2019 | 31.08.2018 | 31.12.2019 | 31.12.2018 | 31.12.2017 |
| **AM-Anteile in EUR - Thesaurierend** | | | | | | | |
| Performance | EUR | (1.4%) | 19.0% | 7.2% | 27.7% | 3.0% | - |
| **I-Anteile - Thesaurierend** | | | | | | | |
| Performance | USD | (1.8%) | 12.1% | 5.9% | 24.8% | (3.3%) | 18.2% |
| **I-Anteile EUR - Thesaurierend** | | | | | | | |
| Performance | EUR | (2.5%) | - | - | 2.0% | - | - |
| **I-Anteile EUR - Ausschüttend** | | | | | | | |
| Performance | EUR | (3.6%) | 15.6% | 6.8% | 24.5% | (0.5%) | 2.5% |
| **R-Anteile EUR - Ausschüttend** | | | | | | | |
| Performance | EUR | (4.1%) | 14.5% | 5.7% | 23.3% | (1.5%) | 1.5% |
| **S-Anteile EUR - Thesaurierend** | | | | | | | |
| Performance | EUR | (1.3%) | 19.1% | 8.8% | 27.9% | 2.5% | 4.5% |

## Swiss Life Funds (LUX) Equity Global Protect

| | | Rechnungsjahr | | | Kalenderjahr | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | Währung | 28.02.2020 | 31.08.2019 | 31.08.2018 | 31.12.2019 | 31.12.2018 | 31.12.2017 |
| **I-Anteile - Thesaurierend** | | | | | | | |
| Performance | EUR | 2.3% | (1.3%) | 5.1% | 14.3% | (7.4%) | 11.8% |
| **S-Anteile - Thesaurierend** | | | | | | | |
| Performance | EUR | 2.6% | (0.7%) | 5.7% | 15.0% | (6.8%) | 12.5% |

## Swiss Life Funds (LUX) Equity USA

| | | Rechnungsjahr | | | Kalenderjahr | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | Währung | 28.02.2020 | 31.08.2019 | 31.08.2018 | 31.12.2019 | 31.12.2018 | 31.12.2017 |
| **AM-Anteile in EUR - Thesaurierend** | | | | | | | |
| Performance | EUR | (0.2%) | 6.9% | 10.6% | 28.7% | (1.4%) | - |
| **F-Anteile - Thesaurierend** | | | | | | | |
| Performance | USD | (0.8%) | 4.1% | - | 25.4% | (9.4%) | - |
| **I-Anteile - Thesaurierend** | | | | | | | |
| Performance | USD | (0.6%) | 0.7% | 18.0% | 25.8% | (5.7%) | 23.4% |
| **I-Anteile - EUR - Thesaurierend** | | | | | | | |
| Performance | EUR | (0.4%) | - | - | 7.1% | - | - |
| **R-Anteile - Thesaurierend** | | | | | | | |
| Performance | USD | (1.1%) | (0.2%) | 16.7% | 24.7% | (6.7%) | 22.2% |
| **SL-Anteile in EUR - Ausschüttend** | | | | | | | |
| Performance | EUR | (1.8%) | 6.7% | 0.0% | 26.5% | (10.9%) | - |

Die historische Performance ist kein Indikator für die laufende oder zukünftige Performance.
Die Performancedaten berücksichtigen keine etwaigen erhobenen Provisionen und Kosten bei Ausgabe und Rücknahme der Anteile.

# **Wertentwicklung** (Fortsetzung)

## Swiss Life Funds (LUX) Equity USA

| | | Rechnungsjahr | | | Kalenderjahr | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | Währung | 28.02.2020 | 31.08.2019 | 31.08.2018 | 31.12.2019 | 31.12.2018 | 31.12.2017 |
| **S-Anteile - Thesaurierend** | | | | | | | |
| Performance | USD | (0.3%) | 1.3% | 18.7% | 26.6% | (5.2%) | 24.2% |

## Swiss Life Funds (LUX) Fixed Income Alpha Select [1]

| | | Rechnungsjahr | | | Kalenderjahr | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | Währung | 28.02.2020 | 31.08.2019 | 31.08.2018 | 31.12.2019 | 31.12.2018 | 31.12.2017 |
| **AM-Anteile - Thesaurierend** | | | | | | | |
| Performance | EUR | 1.0% | - | - | (0.3%) | - | - |
| **I-Anteile - Thesaurierend** | | | | | | | |
| Performance | EUR | 0.7% | - | - | (0.5%) | - | - |
| **S-Anteile - Thesaurierend** | | | | | | | |
| Performance | EUR | 1.1% | - | - | (0.2%) | - | - |

## Swiss Life Funds (LUX) Multi Asset Risk Premia

| | | Rechnungsjahr | | | Kalenderjahr | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | Währung | 28.02.2020 | 31.08.2019 | 31.08.2018 | 31.12.2019 | 31.12.2018 | 31.12.2017 |
| **AM-Anteile - Thesaurierend** | | | | | | | |
| Performance | EUR | (0.6%) | (6.1%) | (2.0%) | (1.6%) | (8.9%) | 2.3% |
| **AM-Anteile in CHF Abgesichert - Thesaurierend** | | | | | | | |
| Performance | CHF | (0.8%) | (6.6%) | (3.8%) | (2.1%) | (8.7%) | - |
| **I-Anteile - Thesaurierend** | | | | | | | |
| Performance | EUR | (0.7%) | (6.4%) | (2.4%) | (1.9%) | (9.3%) | 2.2% |
| **I-Anteile in CHF Abgesichert - Thesaurierend** | | | | | | | |
| Performance | CHF | (1.0%) | (7.0%) | (4.0%) | (2.5%) | (9.0%) | - |
| **R-Anteile in CHF Abgesichert - Thesaurierend** | | | | | | | |
| Performance | CHF | (1.3%) | (7.8%) | (2.9%) | (3.3%) | (8.2%) | - |
| **S-Anteile - Thesaurierend** | | | | | | | |
| Performance | EUR | (0.4%) | (5.9%) | (1.8%) | (1.4%) | (8.7%) | 2.4% |

[1] Dieser Teilfonds wurde zum 3. September 2019 aufgelegt.
Die historische Performance ist kein Indikator für die laufende oder zukünftige Performance.
Die Performancedaten berücksichtigen keine etwaigen erhobenen Provisionen und Kosten bei Ausgabe und Rücknahme der Anteile.

# **Wertentwicklung** (Fortsetzung)

## Swiss Life Funds (LUX) Prudent (EUR)

| | | Rechnungsjahr | | | Kalenderjahr | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | Währung | 28.02.2020 | 31.08.2019 | 31.08.2018 | 31.12.2019 | 31.12.2018 | 31.12.2017 |
| **F-Anteile - Thesaurierend** | | | | | | | |
| Performance | EUR | (0.0%) | 6.0% | - | 9.2% | (1.8%) | - |
| **I-Anteile - Thesaurierend** | | | | | | | |
| Performance | EUR | 0.1% | 3.7% | 1.1% | 9.5% | (4.4%) | 5.3% |
| **M-Anteile - Thesaurierend** | | | | | | | |
| Performance | EUR | 0.1% | 3.8% | (0.7%) | 9.6% | (4.7%) | - |
| **R-Anteile - Thesaurierend** | | | | | | | |
| Performance | EUR | (0.3%) | 3.1% | 0.4% | 8.8% | (4.9%) | 4.6% |

## Swiss Life Funds (LUX) Harmony (EUR)

| | | Rechnungsjahr | | | Kalenderjahr | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | Währung | 28.02.2020 | 31.08.2019 | 31.08.2018 | 31.12.2019 | 31.12.2018 | 31.12.2017 |
| **M-Anteile - Thesaurierend** | | | | | | | |
| Performance | EUR | (0.3%) | 3.0% | (0.4%) | 13.0% | (6.5%) | - |
| **R-Anteile - Thesaurierend** | | | | | | | |
| Performance | EUR | (0.8%) | 2.0% | 2.0% | 11.9% | (6.4%) | 6.5% |

## Swiss Life Funds (LUX) Income Equity Euro Zone [1]

| | | Rechnungsjahr | | | Kalenderjahr | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | Währung | 28.02.2020 | 31.08.2019 | 31.08.2018 | 31.12.2019 | 31.12.2018 | 31.12.2017 |
| **AM-Anteile - Thesaurierend** | | | | | | | |
| Performance | EUR | (2.3%) | - | - | (0.2%) | - | - |
| **S-Anteile - Thesaurierend** | | | | | | | |
| Performance | EUR | (2.2%) | - | - | (0.2%) | - | - |
| **SL-Anteile - Ausschüttend** | | | | | | | |
| Performance | EUR | (2.3%) | - | - | (0.2%) | - | - |

[1] Dieser Teilfonds wurde zum 19. Dezember 2019 aufgelegt.
Die historische Performance ist kein Indikator für die laufende oder zukünftige Performance.
Die Performancedaten berücksichtigen keine etwaigen erhobenen Provisionen und Kosten bei Ausgabe und Rücknahme der Anteile.

# **Wertentwicklung** (Fortsetzung)

## Swiss Life Funds (LUX) Portfolio Global Growth (CHF)

| | | Rechnungsjahr | | | Kalenderjahr | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | Währung | **28.02.2020** | **31.08.2019** | **31.08.2018** | **31.12.2019** | **31.12.2018** | **31.12.2017** |
| **R-Anteile - Thesaurierend** | | | | | | | |
| Performance | CHF | (1.5%) | 5.4% | 4.8% | 17.9% | (7.3%) | 12.0% |

## Swiss Life Funds (LUX) Vitality (EUR)

| | | Rechnungsjahr | | | Kalenderjahr | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | Währung | **28.02.2020** | **31.08.2019** | **31.08.2018** | **31.12.2019** | **31.12.2018** | **31.12.2017** |
| **M-Anteile - Thesaurierend** | | | | | | | |
| Performance | EUR | (0.9%) | 1.9% | (0.4%) | 16.5% | (8.5%) | - |
| **R-Anteile - Thesaurierend** | | | | | | | |
| Performance | EUR | (1.5%) | 0.7% | 3.4% | 15.1% | (8.3%) | 8.3% |

Die historische Performance ist kein Indikator für die laufende oder zukünftige Performance.
Die Performancedaten berücksichtigen keine etwaigen erhobenen Provisionen und Kosten bei Ausgabe und Rücknahme der Anteile.

# Swiss Life Funds (LUX) Bond Emerging Markets Corporates

## Anlagenübersicht

| Nominalwert/ Menge | Bezeichnung | Kurs Währung | Kosten USD | Marktwert USD | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| **Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumenten, die an einer amtlichen Börse zugelassen sind oder auf einem anderen geregelten Markt gehandelt werden** | | | | | |
| | **Anleihen** | | | | |
| 2 000 000 | ABQ FINANCE LTD 3.125% 24/09/2024 | USD | 1 990 640 | 2 039 720 | 0.42 |
| 1 000 000 | ABU DHABI NATIONAL ENERGY CO PJSC - REGS - 3.875% 06/05/2024 | USD | 1 027 875 | 1 063 110 | 0.22 |
| 1 500 000 | ABU DHABI NATIONAL ENERGY CO PJSC - REGS - 4% 03/10/2049 | USD | 1 511 000 | 1 668 375 | 0.35 |
| 1 000 000 | ABU DHABI NATIONAL ENERGY CO PJSC - REGS - 4.375% 22/06/2026 | USD | 1 034 000 | 1 114 900 | 0.23 |
| 1 000 000 | ABU DHABI NATIONAL ENERGY CO PJSC - REGS - 4.875% 23/04/2030 | USD | 1 016 875 | 1 189 800 | 0.25 |
| 1 500 000 | ABU DHABI NATIONAL ENERGY CO PJSC - REGS - 6.5% 27/10/2036 | USD | 1 817 475 | 2 109 750 | 0.44 |
| 1 800 000 | ABY TRANSMISION SUR SA - REGS - 6.875% 30/04/2043 | USD | 1 972 468 | 2 264 190 | 0.47 |
| 2 125 000 | ADCB FINANCE CAYMAN LTD - REGS - 4% 29/03/2023 | USD | 2 149 688 | 2 227 955 | 0.46 |
| 2 000 000 | AIA GROUP LTD - REGS - 3.2% 11/03/2025 | USD | 1 924 800 | 2 109 820 | 0.44 |
| 1 000 000 | ALROSA FINANCE SA - REGS - 4.65% 09/04/2024 | USD | 1 000 000 | 1 060 440 | 0.22 |
| 312 000 | ALROSA FINANCE SA - REGS - 7.75% 03/11/2020 | USD | 329 784 | 322 945 | 0.07 |
| 1 400 000 | AMERICA MOVIL SAB DE CV 4.375% 22/04/2049 | USD | 1 392 118 | 1 733 088 | 0.36 |
| 600 000 | AMERICA MOVIL SAB DE CV 5% 30/03/2020 | USD | 615 924 | 601 182 | 0.12 |
| 1 500 000 | AMERICA MOVIL SAB DE CV 6.125% 30/03/2040 | USD | 1 794 345 | 2 180 025 | 0.45 |
| 1 000 000 | BANCO BBVA PERU SA - REGS - FRN 22/09/2029 | USD | 1 022 333 | 1 093 220 | 0.23 |
| 1 000 000 | BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA COLOMBIA SA - REGS - 4.875% 21/04/2025 | USD | 994 900 | 1 072 900 | 0.22 |
| 1 350 000 | BANCO DE BOGOTA SA - REGS - 4.375% 03/08/2027 | USD | 1 425 938 | 1 438 776 | 0.30 |
| 1 000 000 | BANCO DE CREDITO DEL PERU - REGS - 4.25% 01/04/2023 | USD | 1 002 500 | 1 052 630 | 0.22 |
| 900 000 | BANCO DE CREDITO DEL PERU/PANAMA - REGS - FRN 16/09/2026 | USD | 993 375 | 948 888 | 0.20 |
| 1 250 000 | BANCO DE CREDITO DEL PERU/PANAMA - REGS - FRN 24/04/2027 | USD | 1 354 063 | 1 330 725 | 0.28 |
| 2 000 000 | BANCO DE CREDITO E INVERSIONES SA - REGS - 3.5% 12/10/2027 | USD | 1 908 750 | 2 088 480 | 0.43 |
| 1 500 000 | BANCO DE CREDITO E INVERSIONES SA - REGS - 4% 11/02/2023 | USD | 1 523 350 | 1 565 670 | 0.32 |
| 1 700 000 | BANCO DEL ESTADO DE CHILE 2.704% 09/01/2025 | USD | 1 700 000 | 1 717 510 | 0.36 |
| 1 000 000 | BANCO GENERAL SA - REGS - 4.125% 07/08/2027 | USD | 1 052 500 | 1 061 620 | 0.22 |
| 1 082 000 | BANCO INTERNACIONAL DEL PERU SAA INTERBANK - 144A - 3.375% 18/01/2023 | USD | 1 068 750 | 1 102 060 | 0.23 |
| 1 000 000 | BANCO INTERNACIONAL DEL PERU SAA INTERBANK 3.25% 04/10/2026 | USD | 1 000 000 | 1 018 260 | 0.21 |
| 1 000 000 | BANGKOK BANK PCL/HONG KONG - REGS - FRN 25/09/2034 | USD | 1 000 000 | 1 034 040 | 0.21 |
| 1 000 000 | BANGKOK BANK PCL/HONG KONG - REGS - 4.05% 19/03/2024 | USD | 998 540 | 1 081 970 | 0.22 |
| 1 000 000 | BANGKOK BANK PCL/HONG KONG - REGS - 4.45% 19/09/2028 | USD | 997 440 | 1 152 480 | 0.24 |
| 2 500 000 | BANGKOK BANK PCL/HONG KONG - REGS - 9.025% 15/03/2029 | USD | 3 498 250 | 3 694 775 | 0.76 |
| 2 000 000 | BANK MANDIRI PERSERO TBK PT 3.75% 11/04/2024 | USD | 1 979 960 | 2 083 220 | 0.43 |
| 2 000 000 | BANK OF CHINA LTD - REGS - 5% 13/11/2024 | USD | 2 106 400 | 2 217 000 | 0.46 |
| 1 500 000 | BANK OF THE PHILIPPINE ISLANDS 4.25% 04/09/2023 | USD | 1 493 655 | 1 596 450 | 0.33 |
| 1 000 000 | BDO UNIBANK INC 2.95% 06/03/2023 | USD | 988 450 | 1 017 480 | 0.21 |
| 1 000 000 | BHARAT PETROLEUM CORP LTD 4.375% 24/01/2022 | USD | 998 860 | 1 031 100 | 0.21 |
| 2 000 000 | BLUESTAR FINANCE HOLDINGS LTD FRN PERPETUAL | USD | 1 993 280 | 2 102 720 | 0.43 |
| 2 500 000 | BLUESTAR FINANCE HOLDINGS LTD 3.5% 30/09/2021 | USD | 2 435 475 | 2 553 450 | 0.53 |
| 2 200 000 | BOUBYAN SUKUK LTD 2.593% 18/02/2025 | USD | 2 200 000 | 2 208 800 | 0.46 |
| 500 000 | BRASKEM NETHERLANDS FINANCE BV - REGS - 5.875% 31/01/2050 | USD | 516 875 | 492 775 | 0.10 |
| 1 000 000 | BUSAN BANK CO LTD 3.625% 25/07/2026 | USD | 1 015 460 | 1 060 280 | 0.22 |
| 2 000 000 | CBQ FINANCE LTD 3.25% 13/06/2021 | USD | 1 969 600 | 2 016 540 | 0.42 |
| 2 000 000 | CCCI TREASURE LTD FRN PERPETUAL | USD | 1 990 500 | 2 000 180 | 0.41 |
| 3 000 000 | CCCI TREASURE LTD FRN PERPETUAL | USD | 3 000 000 | 2 996 310 | 0.62 |

# Swiss Life Funds (LUX) Bond Emerging Markets Corporates

## Anlagenübersicht (Fortsetzung)

| Nominalwert/ Menge | Bezeichnung | Kurs Währung | Kosten USD | Marktwert USD | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| **Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumenten, die an einer amtlichen Börse zugelassen sind oder auf einem anderen geregelten Markt gehandelt werden (Fortsetzung)** | | | | | |
| | **Anleihen (Fortsetzung)** | | | | |
| 500 000 | CELEO REDES OPERACION CHILE SA - REGS - 5.2% 22/06/2047 | USD | 496 335 | 537 702 | 0.11 |
| 1 100 000 | CEZ AS 0.875% 02/12/2026 | EUR | 1 207 712 | 1 231 108 | 0.25 |
| 2 000 000 | CHALCO HK INVESTMENT 4.875% 07/09/2021 | USD | 1 994 402 | 2 077 240 | 0.43 |
| 1 000 000 | CHALCO HONG KONG INVESTMENT CO LTD FRN PERPETUAL | USD | 1 014 500 | 1 013 610 | 0.21 |
| 1 000 000 | CHARMING LIGHT INVESTMENTS LTD 4.375% 21/12/2027 | USD | 948 760 | 1 126 890 | 0.23 |
| 1 000 000 | CHINA CINDA FINANCE 2017 I LTD 3% 09/03/2020 | USD | 987 600 | 1 000 130 | 0.21 |
| 1 500 000 | CHINA CLEAN ENERGY DEVELOPMENT LTD 4% 05/11/2025 | USD | 1 454 940 | 1 639 065 | 0.34 |
| 2 000 000 | CHINA CONSTRUCTION BANK CORP FRN 13/05/2025 | USD | 1 985 440 | 2 004 940 | 0.41 |
| 1 250 000 | CHINA GREAT WALL INTERNATIONAL HOLDINGS IV LTD 3.125% 31/07/2024 | USD | 1 256 275 | 1 301 738 | 0.27 |
| 500 000 | CHINA OVERSEAS FINANCE CAYMAN V LTD 5.35% 15/11/2042 | USD | 583 095 | 661 950 | 0.14 |
| 1 000 000 | CHINA OVERSEAS FINANCE CAYMAN VI LTD 5.95% 08/05/2024 | USD | 1 188 000 | 1 147 890 | 0.24 |
| 1 000 000 | CHINA OVERSEAS FINANCE CAYMAN VII LTD 4.75% 26/04/2028 | USD | 996 460 | 1 159 430 | 0.24 |
| 1 500 000 | CHINA OVERSEAS FINANCE CAYMAN VIII LTD 3.05% 27/11/2029 | USD | 1 487 595 | 1 547 250 | 0.32 |
| 1 300 000 | CHOUZHOU INTERNATIONAL INVESTMENT LTD 4% 05/12/2020 | USD | 1 297 348 | 1 307 566 | 0.27 |
| 1 400 000 | CK HUTCHISON CAPITAL SECURITIES 17 LTD - REGS - FRN PERPETUAL | USD | 1 360 000 | 1 418 620 | 0.29 |
| 600 000 | CK HUTCHISON INTERNATIONAL 17 II LTD - REGS - 3.25% 29/09/2027 | USD | 581 866 | 647 550 | 0.13 |
| 2 500 000 | CK HUTCHISON INTERNATIONAL 17 LTD - REGS - 3.5% 05/04/2027 | USD | 2 522 480 | 2 728 875 | 0.56 |
| 1 500 000 | CK HUTCHISON INTERNATIONAL 19 II LTD - REGS - 2.75% 06/09/2029 | USD | 1 491 690 | 1 573 950 | 0.33 |
| 1 000 000 | CK HUTCHISON INTERNATIONAL 19 LTD 3.25% 11/04/2024 | USD | 998 990 | 1 057 270 | 0.22 |
| 1 000 000 | CNAC HK FINBRIDGE CO LTD 3.5% 19/07/2022 | USD | 1 005 500 | 1 029 220 | 0.21 |
| 1 735 000 | CNAC HK FINBRIDGE CO LTD 4.125% 14/03/2021 | USD | 1 736 284 | 1 769 301 | 0.37 |
| 3 000 000 | CNOOC CURTIS FUNDING NO 1 PTY LTD - REGS - 4.5% 03/10/2023 | USD | 3 079 740 | 3 269 640 | 0.68 |
| 1 000 000 | CNOOC FINANCE 2015 USA LLC 3.5% 05/05/2025 | USD | 1 019 950 | 1 076 280 | 0.22 |
| 3 000 000 | CNOOC FINANCE 2015 USA LLC 4.375% 02/05/2028 | USD | 3 029 900 | 3 466 320 | 0.72 |
| 1 000 000 | COLBUN SA - REGS - 3.95% 11/10/2027 | USD | 1 001 500 | 1 060 470 | 0.22 |
| 1 000 000 | COMPETITION TEAM TECHNOLOGIES LTD 3.75% 12/03/2024 | USD | 997 740 | 1 058 850 | 0.22 |
| 1 300 000 | COMPETITION TEAM TECHNOLOGIES LTD 4.25% 12/03/2029 | USD | 1 295 814 | 1 468 350 | 0.30 |
| 1 000 000 | CONSORCIO TRANSMANTARO SA - REGS - 4.375% 07/05/2023 | USD | 1 002 800 | 1 057 710 | 0.22 |
| 1 000 000 | CORP FINANCIERA DE DESARROLLO SA - REGS - 4.75% 15/07/2025 | USD | 1 072 500 | 1 099 370 | 0.23 |
| 500 000 | CORP NACIONAL DEL COBRE DE CHILE 3% 30/09/2029 | USD | 491 050 | 508 745 | 0.11 |
| 900 000 | COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO LTD 5.125% 14/01/2027 | USD | 900 000 | 899 163 | 0.19 |
| 1 500 000 | DBS GROUP HOLDINGS LTD - REGS - FRN 11/12/2028 | USD | 1 506 750 | 1 628 145 | 0.34 |
| 2 000 000 | DBS GROUP HOLDINGS LTD FRN PERPETUAL | USD | 1 992 925 | 2 016 040 | 0.42 |
| 1 000 000 | DELEK & AVNER TAMAR BOND LTD 5.082% 30/12/2023 | USD | 1 035 000 | 1 036 020 | 0.21 |
| 800 000 | DELEK & AVNER TAMAR BOND LTD 5.412% 30/12/2025 | USD | 844 000 | 837 392 | 0.17 |
| 1 000 000 | DIANJIAN HAIYU LTD 3% 20/06/2022 | USD | 997 780 | 1 019 040 | 0.21 |
| 3 000 000 | DIB SUKUK LTD 3.664% 14/02/2022 | USD | 2 972 000 | 3 062 220 | 0.63 |
| 500 000 | DP WORLD LTD - REGS - 5.625% 25/09/2048 | USD | 532 554 | 560 003 | 0.12 |
| 500 000 | DP WORLD PLC - REGS - 6.85% 02/07/2037 | USD | 591 785 | 631 635 | 0.13 |
| 500 000 | ECOPETROL SA 4.125% 16/01/2025 | USD | 481 179 | 527 655 | 0.11 |
| 4 000 000 | ECOPETROL SA 5.375% 26/06/2026 | USD | 4 275 000 | 4 478 200 | 0.92 |
| 1 500 000 | ECOPETROL SA 5.875% 18/09/2023 | USD | 1 644 375 | 1 658 070 | 0.34 |
| 1 000 000 | ECOPETROL SA 5.875% 28/05/2045 | USD | 1 098 000 | 1 192 910 | 0.25 |
| 2 500 000 | ECOPETROL SA 7.375% 18/09/2043 | USD | 2 817 127 | 3 425 950 | 0.71 |

# Swiss Life Funds (LUX) Bond Emerging Markets Corporates

## Anlagenübersicht (Fortsetzung)

| Nominalwert/ Menge | Bezeichnung | Kurs Währung | Kosten USD | Marktwert USD | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| **Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumenten, die an einer amtlichen Börse zugelassen sind oder auf einem anderen geregelten Markt gehandelt werden (Fortsetzung)** | | | | | |
| | **Anleihen (Fortsetzung)** | | | | |
| 1 000 000 | EIB SUKUK CO LTD 3.542% 31/05/2021 | USD | 1 028 530 | 1 012 020 | 0.21 |
| 1 000 000 | EMAAR SUKUK LTD 3.635% 15/09/2026 | USD | 989 000 | 1 014 350 | 0.21 |
| 516 000 | EMBOTELLADORA ANDINA SA - REGS - 5% 01/10/2023 | USD | 554 700 | 555 557 | 0.11 |
| 2 000 000 | EMIRATES NBD BANK PJSC 2.625% 18/02/2025 | USD | 1 998 320 | 2 013 300 | 0.42 |
| 1 500 000 | EMIRATES SEMB CORP WATER & POWER CO PJSC - REGS - 4.45% 01/08/2035 | USD | 1 500 000 | 1 664 385 | 0.34 |
| 500 000 | EMIRATES TELECOMMUNICATIONS GROUP CO PJSC 3.5% 18/06/2024 | USD | 514 610 | 524 125 | 0.11 |
| 2 700 000 | EMPRESA NACIONAL DE TELECOMUNICACIONES SA - REGS - 4.75% 01/08/2026 | USD | 2 749 500 | 2 879 982 | 0.60 |
| 2 000 000 | EMPRESA NACIONAL DEL PETROLEO - REGS - 4.75% 06/12/2021 | USD | 2 047 500 | 2 074 360 | 0.43 |
| 1 000 000 | ENEL AMERICAS SA 4% 25/10/2026 | USD | 991 535 | 1 071 610 | 0.22 |
| 2 000 000 | ENGIE ENERGIA CHILE SA - REGS - 4.5% 29/01/2025 | USD | 2 118 750 | 2 141 640 | 0.44 |
| 1 000 000 | ENN ENERGY HOLDINGS LTD - REGS - 6% 13/05/2021 | USD | 1 040 780 | 1 043 960 | 0.22 |
| 1 000 000 | EP INFRASTRUCTURE AS 1.698% 30/07/2026 | EUR | 1 115 000 | 1 123 242 | 0.23 |
| 1 250 000 | EQUATE PETROCHEMICAL BV - REGS - 3% 03/03/2022 | USD | 1 238 125 | 1 257 750 | 0.26 |
| 3 000 000 | EQUATE PETROCHEMICAL BV - REGS - 4.25% 03/11/2026 | USD | 3 065 875 | 3 237 360 | 0.67 |
| 1 000 000 | FAB SUKUK CO LTD 3.875% 22/01/2024 | USD | 998 380 | 1 058 290 | 0.22 |
| 1 000 000 | FERMACA ENTERPRISES S DE RL DE CV - REGS - 6.375% 30/03/2038 | USD | 899 822 | 976 899 | 0.20 |
| 1 000 000 | FIRST ABU DHABI BANK PJSC 3% 30/03/2022 | USD | 999 950 | 1 017 500 | 0.21 |
| 1 150 000 | FORMOSA GROUP CAYMAN LTD 3.375% 22/04/2025 | USD | 1 171 996 | 1 217 574 | 0.25 |
| 2 500 000 | GAS NATURAL DE LIMA Y CALLAO SA - REGS - 4.375% 01/04/2023 | USD | 2 553 250 | 2 619 325 | 0.54 |
| 2 000 000 | GAZPROM OAO VIA GAZ CAPITAL SA - REGS - 5.15% 11/02/2026 | USD | 2 000 000 | 2 215 100 | 0.46 |
| 1 518 000 | GAZPROM OAO VIA GAZ CAPITAL SA - REGS - 5.999% 23/01/2021 | USD | 1 589 522 | 1 564 861 | 0.32 |
| 1 000 000 | GAZPROM OAO VIA GAZ CAPITAL SA - REGS - 7.288% 16/08/2037 | USD | 1 192 500 | 1 385 030 | 0.29 |
| 2 000 000 | GAZPROM OAO VIA GAZ CAPITAL SA - REGS - 8.625% 28/04/2034 | USD | 3 070 000 | 2 973 760 | 0.62 |
| 750 000 | GLOBAL BANK CORP - REGS - 4.5% 20/10/2021 | USD | 736 795 | 769 313 | 0.16 |
| 1 000 000 | GLOBAL LOGISTIC PROPERTIES LTD 3.875% 04/06/2025 | USD | 880 000 | 1 041 940 | 0.22 |
| 2 500 000 | GNL QUINTERO SA - REGS - 4.634% 31/07/2029 | USD | 2 585 600 | 2 683 800 | 0.56 |
| 2 500 000 | GOHL CAPITAL LTD 4.25% 24/01/2027 | USD | 2 580 102 | 2 632 525 | 0.54 |
| 1 000 000 | GRUPO BIMBO SAB DE CV - REGS - 3.875% 27/06/2024 | USD | 977 500 | 1 072 910 | 0.22 |
| 1 075 000 | GRUPO TELEVISA SAB 4.625% 30/01/2026 | USD | 1 149 491 | 1 205 172 | 0.25 |
| 2 000 000 | GRUPOSURA FINANCE SA - REGS - 5.5% 29/04/2026 | USD | 2 119 750 | 2 238 440 | 0.46 |
| 2 000 000 | HPHT FINANCE 17 LTD 2.75% 11/09/2022 | USD | 1 927 510 | 2 037 880 | 0.42 |
| 1 000 000 | HYUNDAI CAPITAL AMERICA - REGS - 3% 18/03/2021 | USD | 1 036 680 | 1 012 460 | 0.21 |
| 1 100 000 | HYUNDAI CAPITAL AMERICA - REGS - 3.45% 12/03/2021 | USD | 1 099 505 | 1 118 359 | 0.23 |
| 1 000 000 | HYUNDAI CAPITAL AMERICA - REGS - 3.75% 08/07/2021 | USD | 996 800 | 1 025 530 | 0.21 |
| 1 000 000 | HYUNDAI CAPITAL SERVICES INC - REGS - 3% 29/08/2022 | USD | 994 940 | 1 025 060 | 0.21 |
| 1 000 000 | INDIAN OIL CORP LTD 4.75% 16/01/2024 | USD | 1 042 000 | 1 077 650 | 0.22 |
| 1 000 000 | INDIAN RAILWAY FINANCE CORP LTD 3.249% 13/02/2030 | USD | 1 000 000 | 997 450 | 0.21 |
| 2 000 000 | INDIAN RAILWAY FINANCE CORP LTD 3.95% 13/02/2050 | USD | 2 000 000 | 2 083 140 | 0.43 |
| 1 000 000 | INDONESIA ASAHAN ALUMINIUM PERSERO PT - REGS - 5.23% 15/11/2021 | USD | 992 630 | 1 046 830 | 0.22 |
| 1 000 000 | INDONESIA ASAHAN ALUMINIUM PERSERO PT - REGS - 5.71% 15/11/2023 | USD | 1 015 000 | 1 106 650 | 0.23 |
| 1 000 000 | INDUSTRIAL & COMMERCIAL BANK OF CHINA MACAU LTD FRN 12/09/2029 | USD | 992 260 | 1 016 080 | 0.21 |
| 1 000 000 | INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV - REGS - 4.15% 12/09/2029 | USD | 998 620 | 1 042 350 | 0.22 |
| 800 000 | INTERCORP FINANCIAL SERVICES INC - REGS - 4.125% 19/10/2027 | USD | 793 656 | 839 704 | 0.17 |

# Swiss Life Funds (LUX) Bond Emerging Markets Corporates

## Anlagenübersicht (Fortsetzung)

| Nominalwert/ Menge | Bezeichnung | Kurs Währung | Kosten USD | Marktwert USD | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| **Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumenten, die an einer amtlichen Börse zugelassen sind oder auf einem anderen geregelten Markt gehandelt werden (Fortsetzung)** | | | | | |
| | **Anleihen (Fortsetzung)** | | | | |
| 1 400 000 | INVERSIONES CMPC SA 3.85% 13/01/2030 | USD | 1 424 340 | 1 432 396 | 0.30 |
| 2 000 000 | INVERSIONES CMPC SA/CAYMAN ISLANDS BRANCH - REGS - 4.375% 15/05/2023 | USD | 2 032 571 | 2 089 500 | 0.43 |
| 1 000 000 | ISRAEL CHEMICALS LTD 6.375% 31/05/2038 | USD | 1 000 000 | 1 259 500 | 0.26 |
| 2 000 000 | ISRAEL ELECTRIC CORP LTD - REGS - 6.875% 21/06/2023 | USD | 2 253 906 | 2 280 740 | 0.47 |
| 2 600 000 | ISRAEL ELECTRIC CORP LTD - REGS - 7.75% 15/12/2027 | USD | 3 215 500 | 3 506 932 | 0.73 |
| 2 000 000 | ISRAEL ELECTRIC CORP LTD 5% 12/11/2024 | USD | 2 166 000 | 2 227 060 | 0.46 |
| 1 250 000 | JD.COM INC 3.125% 29/04/2021 | USD | 1 225 750 | 1 265 275 | 0.26 |
| 500 000 | JD.COM INC 4.125% 14/01/2050 | USD | 494 900 | 539 880 | 0.11 |
| 1 000 000 | JOY TREASURE ASSETS HOLDINGS INC 3.5% 24/09/2029 | USD | 987 690 | 1 058 590 | 0.22 |
| 1 750 000 | KALLPA GENERACION SA - REGS - 4.125% 16/08/2027 | USD | 1 744 238 | 1 834 840 | 0.38 |
| 2 000 000 | KASIKORNBANK PCL/HONG KONG 3.256% 12/07/2023 | USD | 2 000 000 | 2 085 480 | 0.43 |
| 1 000 000 | KEB HANA BANK - REGS - 4.375% 30/09/2024 | USD | 1 041 660 | 1 089 020 | 0.23 |
| 1 500 000 | KEB HANA BANK 3.375% 30/01/2022 | USD | 1 496 655 | 1 547 280 | 0.32 |
| 1 000 000 | KING POWER CAPITAL LTD 5.625% 03/11/2024 | USD | 1 054 228 | 1 153 640 | 0.24 |
| 1 000 000 | KOOKMIN BANK 4.5% 01/02/2029 | USD | 989 140 | 1 139 760 | 0.24 |
| 2 000 000 | KOREA EAST-WEST POWER CO LTD - REGS - 3.875% 19/07/2023 | USD | 1 990 120 | 2 143 660 | 0.44 |
| 1 200 000 | KOREA GAS CORP - REGS - 2.875% 16/07/2029 | USD | 1 189 380 | 1 299 312 | 0.27 |
| 1 500 000 | KOREA GAS CORP - REGS - 3.125% 20/07/2027 | USD | 1 475 059 | 1 632 000 | 0.34 |
| 1 500 000 | KOREA GAS CORP - REGS - 3.5% 02/07/2026 | USD | 1 521 900 | 1 659 000 | 0.34 |
| 1 500 000 | KOREA GAS CORP - REGS - 3.5% 21/07/2025 | USD | 1 531 185 | 1 642 830 | 0.34 |
| 1 000 000 | KOREA HYDRO & NUCLEAR POWER CO LTD - REGS - 3.25% 15/06/2025 | USD | 999 540 | 1 076 030 | 0.22 |
| 1 000 000 | KOREA HYDRO & NUCLEAR POWER CO LTD - REGS - 3.75% 25/07/2023 | USD | 1 000 370 | 1 068 982 | 0.22 |
| 1 000 000 | KOREA MIDLAND POWER CO LTD 2.5% 21/07/2021 | USD | 991 960 | 1 012 850 | 0.21 |
| 1 550 000 | KOREA MIDLAND POWER CO LTD 3.375% 22/01/2022 | USD | 1 549 644 | 1 599 631 | 0.33 |
| 900 000 | KT CORP - REGS - 2.5% 18/07/2026 | USD | 844 317 | 925 938 | 0.19 |
| 1 000 000 | KUWAIT PROJECTS CO SPC LTD 4.229% 29/10/2026 | USD | 1 000 000 | 1 029 820 | 0.21 |
| 500 000 | KUWAIT PROJECTS CO 5% 15/03/2023 | USD | 525 625 | 528 015 | 0.11 |
| 1 000 000 | KYOBO LIFE INSURANCE CO LTD - REGS - FRN 24/07/2047 | USD | 1 005 760 | 1 010 800 | 0.21 |
| 1 000 000 | LG CHEM LTD - REGS - 3.25% 15/10/2024 | USD | 998 550 | 1 062 845 | 0.22 |
| 1 750 000 | LIMA METRO LINE 2 FINANCE LTD - REGS - 4.35% 05/04/2036 | USD | 1 773 500 | 1 901 672 | 0.39 |
| 2 000 000 | LIMA METRO LINE 2 FINANCE LTD - REGS - 5.875% 05/07/2034 | USD | 1 295 498 | 1 284 720 | 0.27 |
| 1 500 000 | LLPL CAPITAL PTE LTD - REGS - 6.875% 04/02/2039 | USD | 1 717 723 | 1 695 286 | 0.35 |
| 3 500 000 | LUKOIL INTERNATIONAL FINANCE BV - REGS - 4.75% 02/11/2026 | USD | 3 739 450 | 3 882 655 | 0.80 |
| 3 000 000 | LUKOIL INTERNATIONAL FINANCE BV - REGS - 6.125% 09/11/2020 | USD | 3 156 750 | 3 077 070 | 0.64 |
| 1 000 000 | MAF GLOBAL SECURITIES LTD 4.75% 07/05/2024 | USD | 1 017 000 | 1 067 450 | 0.22 |
| 1 500 000 | MAF SUKUK LTD 4.638% 14/05/2029 | USD | 1 500 000 | 1 624 830 | 0.34 |
| 2 000 000 | MALAYAN BANKING BHD FRN 29/10/2026 | USD | 1 988 400 | 2 050 240 | 0.42 |
| 2 000 000 | MINEJESA CAPITAL BV - REGS - 4.625% 10/08/2030 | USD | 2 056 000 | 2 084 880 | 0.43 |
| 2 000 000 | MINEJESA CAPITAL BV - REGS - 5.625% 10/08/2037 | USD | 2 153 000 | 2 204 540 | 0.46 |
| 1 000 000 | MIRAE ASSET DAEWOO CO LTD 3.375% 07/05/2024 | USD | 997 860 | 1 042 660 | 0.22 |
| 1 500 000 | MMC NORILSK NICKEL OJSC VIA MMC FINANCE DAC - REGS - 5.55% 28/10/2020 | USD | 1 535 700 | 1 529 490 | 0.32 |
| 3 500 000 | MMC NORILSK NICKEL OJSC VIA MMC FINANCE DAC 3.375% 28/10/2024 | USD | 3 530 000 | 3 557 365 | 0.74 |
| 1 300 000 | MULTIBANK INC - REGS - 4.375% 09/11/2022 | USD | 1 313 000 | 1 351 805 | 0.28 |

# Swiss Life Funds (LUX) Bond Emerging Markets Corporates

## Anlagenübersicht (Fortsetzung)

| Nominalwert/ Menge | Bezeichnung | Kurs Währung | Kosten USD | Marktwert USD | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| **Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumenten, die an einer amtlichen Börse zugelassen sind oder auf einem anderen geregelten Markt gehandelt werden (Fortsetzung)** | | | | | |
| | **Anleihen (Fortsetzung)** | | | | |
| 2 000 000 | NAKILAT INC - REGS - 6.067% 31/12/2033 | USD | 2 312 375 | 2 437 060 | 0.50 |
| 750 000 | NBK TIER 1 FINANCING LTD FRN PERPETUAL | USD | 774 375 | 768 720 | 0.16 |
| 1 500 000 | NBK TIER 1 FINANCING 2 LTD - REGS - FRN PERPETUAL | USD | 1 500 000 | 1 528 800 | 0.32 |
| 1 500 000 | NONGHYUP BANK - REGS - 2.875% 17/07/2022 | USD | 1 484 400 | 1 541 430 | 0.32 |
| 1 000 000 | OCP SA - REGS - 4.5% 22/10/2025 | USD | 978 000 | 1 080 110 | 0.22 |
| 1 315 000 | OCP SA - REGS - 5.625% 25/04/2024 | USD | 1 395 340 | 1 457 349 | 0.30 |
| 1 000 000 | OIL & NATURAL GAS CORP LTD 3.375% 05/12/2029 | USD | 997 250 | 1 015 210 | 0.21 |
| 825 000 | OIL INDIA INTERNATIONAL PTE LTD 4% 21/04/2027 | USD | 812 625 | 870 515 | 0.18 |
| 1 000 000 | OLEODUCTO CENTRAL SA - REGS - 4% 07/05/2021 | USD | 1 000 000 | 1 017 330 | 0.21 |
| 1 500 000 | ONGC VIDESH VANKORNEFT PTE LTD 3.75% 27/07/2026 | USD | 1 424 855 | 1 580 685 | 0.33 |
| 1 500 000 | OOREDOO INTERNATIONAL FINANCE LTD - REGS - 3.25% 21/02/2023 | USD | 1 488 750 | 1 537 920 | 0.32 |
| 2 000 000 | OOREDOO INTERNATIONAL FINANCE LTD - REGS - 3.75% 22/06/2026 | USD | 1 963 700 | 2 135 900 | 0.44 |
| 1 500 000 | OOREDOO INTERNATIONAL FINANCE LTD - REGS - 3.875% 31/01/2028 | USD | 1 450 650 | 1 634 295 | 0.34 |
| 3 000 000 | OOREDOO INTERNATIONAL FINANCE LTD - REGS - 5% 19/10/2025 | USD | 3 227 500 | 3 381 720 | 0.70 |
| 1 000 000 | ORBIA ADVANCE CORP SAB DE CV - REGS - 5.875% 17/09/2044 | USD | 1 099 125 | 1 149 000 | 0.24 |
| 1 000 000 | OVERSEA-CHINESE BANKING CORP LTD - REGS - 4.25% 19/06/2024 | USD | 1 008 220 | 1 088 990 | 0.23 |
| 600 000 | PERTAMINA PERSERO PT - REGS - 3.65% 30/07/2029 | USD | 600 000 | 623 826 | 0.13 |
| 1 500 000 | PERTAMINA PERSERO PT 3.1% 25/08/2030 | USD | 1 500 000 | 1 476 420 | 0.31 |
| 1 000 000 | PERTAMINA PERSERO PT 4.15% 25/02/2060 | USD | 1 000 000 | 969 080 | 0.20 |
| 1 000 000 | PERTAMINA PERSERO PT 4.175% 21/01/2050 | USD | 1 000 000 | 995 580 | 0.21 |
| 2 500 000 | PERUSAHAAN GAS NEGARA TBK PT - REGS - 5.125% 16/05/2024 | USD | 2 481 000 | 2 719 025 | 0.56 |
| 1 000 000 | POLY REAL ESTATE FINANCE LTD 4.75% 17/09/2023 | USD | 988 230 | 1 079 740 | 0.22 |
| 1 500 000 | POSCO 2.75% 15/07/2024 | USD | 1 491 390 | 1 538 595 | 0.32 |
| 1 000 000 | POWER GRID CORP OF INDIA LTD 3.875% 17/01/2023 | USD | 997 310 | 1 041 710 | 0.22 |
| 1 750 000 | PROSUS NV - REGS - 4.85% 06/07/2027 | USD | 1 794 347 | 1 938 842 | 0.40 |
| 1 750 000 | PROSUS NV - REGS - 5.5% 21/07/2025 | USD | 1 891 622 | 1 959 020 | 0.41 |
| 1 000 000 | PTT PCL - REGS - 4.5% 25/10/2042 | USD | 948 700 | 1 228 470 | 0.25 |
| 3 000 000 | PTTEP CANADA INTERNATIONAL FINANCE LTD - REGS - 6.35% 12/06/2042 | USD | 3 751 125 | 4 471 140 | 0.91 |
| 1 000 000 | PTTEP TREASURY CENTER CO LTD 3.903% 06/12/2059 | USD | 1 000 000 | 1 111 980 | 0.23 |
| 1 000 000 | QATAR REINSURANCE CO LTD FRN PERPETUAL | USD | 1 018 300 | 1 025 500 | 0.21 |
| 1 000 000 | QNB FINANCE LTD 2.125% 07/09/2021 | USD | 979 214 | 998 600 | 0.21 |
| 4 100 000 | QNB FINANCE LTD 2.75% 12/02/2027 | USD | 4 091 964 | 4 136 203 | 0.85 |
| 2 000 000 | QNB FINANCE LTD 2.875% 29/04/2020 | USD | 1 992 500 | 2 000 700 | 0.41 |
| 3 000 000 | QNB FINANCE LTD 3.5% 28/03/2024 | USD | 2 974 320 | 3 144 030 | 0.65 |
| 1 000 000 | RAS LAFFAN LIQUEFIED NATURAL GAS CO LTD III - REGS - 5.838% 30/09/2027 | USD | 1 131 000 | 1 151 180 | 0.24 |
| 1 000 000 | RAS LAFFAN LIQUEFIED NATURAL GAS CO LTD III - REGS - 6.332% 30/09/2027 | USD | 1 138 750 | 1 165 310 | 0.24 |
| 1 000 000 | RELIANCE HOLDING USA INC - REGS - 4.5% 19/10/2020 | USD | 1 075 850 | 1 015 920 | 0.21 |
| 2 000 000 | RELIANCE HOLDING USA INC - REGS - 5.4% 14/02/2022 | USD | 2 203 020 | 2 125 380 | 0.44 |
| 1 750 000 | RELIANCE HOLDING USA INC - REGS - 6.25% 19/10/2040 | USD | 2 194 707 | 2 538 025 | 0.52 |
| 1 000 000 | RELIANCE INDUSTRIES LTD - REGS - 3.667% 30/11/2027 | USD | 1 000 000 | 1 064 360 | 0.22 |
| 1 000 000 | RELIANCE INDUSTRIES LTD - REGS - 4.125% 28/01/2025 | USD | 1 006 560 | 1 078 200 | 0.22 |
| 1 500 000 | RH INTERNATIONAL SINGAPORE CORP PTE LTD 4.5% 27/03/2028 | USD | 1 499 640 | 1 729 740 | 0.36 |
| 1 000 000 | RONGSHI INTERNATIONAL FINANCE LTD 3.75% 21/05/2029 | USD | 994 880 | 1 116 860 | 0.23 |

# Swiss Life Funds (LUX) Bond Emerging Markets Corporates

## Anlagenübersicht (Fortsetzung)

| Nominalwert/ Menge | Bezeichnung | Kurs Währung | Kosten USD | Marktwert USD | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| **Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumenten, die an einer amtlichen Börse zugelassen sind oder auf einem anderen geregelten Markt gehandelt werden (Fortsetzung)** | | | | | |
| | **Anleihen (Fortsetzung)** | | | | |
| 1 320 000 | RUWAIS POWER CO PJSC - REGS - 6% 31/08/2036 | USD | 1 470 258 | 1 671 080 | 0.35 |
| 1 000 000 | SABIC CAPITAL II BV - REGS - 4% 10/10/2023 | USD | 995 920 | 1 056 060 | 0.22 |
| 2 000 000 | SABIC CAPITAL II BV - REGS - 4.5% 10/10/2028 | USD | 2 083 000 | 2 262 740 | 0.47 |
| 1 000 000 | SACI FALABELLA - REGS - 3.75% 30/04/2023 | USD | 1 024 500 | 1 031 850 | 0.21 |
| 2 000 000 | SANDS CHINA LTD 4.6% 08/08/2023 | USD | 2 017 800 | 2 149 760 | 0.44 |
| 1 000 000 | SANDS CHINA LTD 5.4% 08/08/2028 | USD | 1 005 335 | 1 137 550 | 0.24 |
| 2 000 000 | SASOL FINANCING USA LLC 5.875% 27/03/2024 | USD | 2 184 000 | 2 116 400 | 0.44 |
| 2 000 000 | SASOL FINANCING USA LLC 6.5% 27/09/2028 | USD | 2 247 500 | 2 185 080 | 0.45 |
| 4 000 000 | SAUDI ARABIAN OIL CO - REGS - 3.5% 16/04/2029 | USD | 4 225 500 | 4 249 960 | 0.87 |
| 3 500 000 | SAUDI ARABIAN OIL CO - REGS - 4.25% 16/04/2039 | USD | 3 878 500 | 3 880 870 | 0.80 |
| 4 000 000 | SAUDI ARABIAN OIL CO - REGS - 4.375% 16/04/2049 | USD | 4 485 000 | 4 520 840 | 0.93 |
| 1 100 000 | SAUDI ELECTRICITY GLOBAL SUKUK CO 4.222% 27/01/2024 | USD | 1 100 000 | 1 171 632 | 0.24 |
| 3 000 000 | SAUDI ELECTRICITY GLOBAL SUKUK CO 2 - REGS - 5.06% 08/04/2043 | USD | 3 333 000 | 3 493 350 | 0.72 |
| 2 000 000 | SAUDI ELECTRICITY GLOBAL SUKUK CO 3 - REGS - 4% 08/04/2044 | USD | 2 064 000 | 2 124 000 | 0.44 |
| 1 000 000 | SAUDI ELECTRICITY GLOBAL SUKUK CO 3 - REGS - 5.5% 08/04/2044 | USD | 1 080 625 | 1 231 790 | 0.25 |
| 2 000 000 | SHINHAN BANK CO LTD - REGS - 3.875% 05/11/2023 | USD | 1 988 860 | 2 151 600 | 0.45 |
| 1 500 000 | SHINHAN BANK CO LTD - REGS - 3.875% 24/03/2026 | USD | 1 453 025 | 1 619 175 | 0.33 |
| 1 000 000 | SHINHAN FINANCIAL GROUP CO LTD FRN 05/02/2030 | USD | 1 000 000 | 1 040 560 | 0.22 |
| 1 000 000 | SHINHAN FINANCIAL GROUP CO LTD FRN PERPETUAL | USD | 1 000 000 | 1 078 170 | 0.22 |
| 1 000 000 | SIAM COMMERCIAL BANK PCL/CAYMAN ISLANDS 2.75% 16/05/2023 | USD | 990 170 | 1 024 680 | 0.21 |
| 1 000 000 | SIAM COMMERCIAL BANK PCL/CAYMAN ISLANDS 3.2% 26/07/2022 | USD | 999 900 | 1 029 840 | 0.21 |
| 650 000 | SIAM COMMERCIAL BANK PCL/CAYMAN ISLANDS 3.9% 11/02/2024 | USD | 648 863 | 696 202 | 0.14 |
| 1 000 000 | SIAM COMMERCIAL BANK PCL/CAYMAN ISLANDS 4.4% 11/02/2029 | USD | 999 920 | 1 155 240 | 0.24 |
| 1 000 000 | SIBUR SECURITIES DAC 3.45% 23/09/2024 | USD | 1 000 000 | 1 017 610 | 0.21 |
| 2 000 000 | SINGTEL GROUP TREASURY PTE LTD 2.375% 03/10/2026 | USD | 1 842 860 | 2 067 660 | 0.43 |
| 1 500 000 | SINGTEL GROUP TREASURY PTE LTD 2.375% 28/08/2029 | USD | 1 488 885 | 1 539 555 | 0.32 |
| 1 500 000 | SINGTEL GROUP TREASURY PTE LTD 3.875% 28/08/2028 | USD | 1 498 275 | 1 715 490 | 0.35 |
| 1 000 000 | SINO-OCEAN LAND TREASURE IV LTD 4.75% 14/01/2030 | USD | 988 464 | 1 012 700 | 0.21 |
| 1 000 000 | SINOPEC GROUP OVERSEAS DEVELOPMENT 2016 LTD - REGS - 2.75% 29/09/2026 | USD | 902 400 | 1 044 010 | 0.22 |
| 1 500 000 | SINOPEC GROUP OVERSEAS DEVELOPMENT 2018 LTD 2.95% 12/11/2029 | USD | 1 492 785 | 1 576 110 | 0.33 |
| 2 000 000 | SK TELECOM CO LTD - REGS - 3.75% 16/04/2023 | USD | 1 995 660 | 2 111 600 | 0.44 |
| 2 000 000 | SOUTHERN COPPER CORP 5.875% 23/04/2045 | USD | 2 482 500 | 2 555 420 | 0.53 |
| 2 000 000 | SOUTHERN COPPER CORP 7.5% 27/07/2035 | USD | 2 390 166 | 2 818 540 | 0.58 |
| 1 500 000 | SPIC LUXEMBOURG LATIN AMERICA RENEWABLE ENERGY INVESTMENT CO SARL 4.25% 30/10/2021 | USD | 1 499 535 | 1 549 005 | 0.32 |
| 1 000 000 | STATE BANK OF INDIA/LONDON 4.375% 24/01/2024 | USD | 1 053 170 | 1 070 420 | 0.22 |
| 2 500 000 | SURA ASSET MANAGEMENT SA - REGS - 4.875% 17/04/2024 | USD | 2 579 500 | 2 695 200 | 0.56 |
| 1 000 000 | SUZANO AUSTRIA GMBH - REGS - 7% 16/03/2047 | USD | 1 194 900 | 1 190 440 | 0.25 |
| 500 000 | TENCENT HOLDINGS LTD FRN 11/04/2024 | USD | 500 000 | 502 870 | 0.10 |
| 1 000 000 | TENCENT HOLDINGS LTD 3.975% 11/04/2029 | USD | 1 002 454 | 1 118 050 | 0.23 |
| 2 000 000 | THAIOIL TREASURY CENTER CO LTD - REGS - 5.375% 20/11/2048 | USD | 2 082 940 | 2 705 100 | 0.56 |
| 1 000 000 | THAIOIL TREASURY CENTER CO LTD 3.5% 17/10/2049 | USD | 986 990 | 1 006 100 | 0.21 |
| 1 000 000 | THAIOIL TREASURY CENTER CO LTD 4.625% 20/11/2028 | USD | 1 128 230 | 1 169 720 | 0.24 |
| 2 000 000 | TNB GLOBAL VENTURES CAPITAL BHD 3.244% 19/10/2026 | USD | 1 930 575 | 2 106 580 | 0.44 |

# Swiss Life Funds (LUX) Bond Emerging Markets Corporates

## Anlagenübersicht (Fortsetzung)

| Nominalwert/ Menge | Bezeichnung | Kurs Währung | Kosten USD | Marktwert USD | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| **Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumenten, die an einer amtlichen Börse zugelassen sind oder auf einem anderen geregelten Markt gehandelt werden (Fortsetzung)** | | | | | |
| | **Anleihen (Fortsetzung)** | | | | |
| 1 000 000 | TRANSELEC SA - REGS - 3.875% 12/01/2029 | USD | 988 570 | 1 053 860 | 0.22 |
| 1 500 000 | TRANSPORTADORA DE GAS DEL PERU SA - REGS - 4.25% 30/04/2028 | USD | 1 489 125 | 1 622 865 | 0.34 |
| 1 000 000 | TRUST F/1401 - REGS - 4.869% 15/01/2030 | USD | 1 088 750 | 1 091 260 | 0.23 |
| 2 000 000 | TRUST F/1401 - REGS - 5.25% 15/12/2024 | USD | 2 077 250 | 2 198 240 | 0.45 |
| 1 000 000 | UNION BANK OF THE PHILIPPINES 3.369% 29/11/2022 | USD | 1 007 861 | 1 027 550 | 0.21 |
| 3 000 000 | UNITED OVERSEAS BANK LTD FRN 08/03/2027 | USD | 2 959 180 | 3 044 370 | 0.63 |
| 1 000 000 | UNITED OVERSEAS BANK LTD FRN 15/04/2029 | USD | 996 570 | 1 060 390 | 0.22 |
| 2 000 000 | UNITED OVERSEAS BANK LTD FRN PERPETUAL | USD | 1 875 000 | 2 046 920 | 0.42 |
| 1 000 000 | VALE OVERSEAS LTD 6.25% 10/08/2026 | USD | 1 105 944 | 1 169 530 | 0.24 |
| 1 500 000 | VANKE REAL ESTATE HONG KONG CO LTD 3.5% 12/11/2029 | USD | 1 490 115 | 1 521 435 | 0.31 |
| 1 000 000 | VANKE REAL ESTATE HONG KONG CO LTD 3.975% 09/11/2027 | USD | 883 675 | 1 063 710 | 0.22 |
| 1 000 000 | VANKE REAL ESTATE HONG KONG CO LTD 4.2% 07/06/2024 | USD | 1 006 900 | 1 067 180 | 0.22 |
| | **Gesamtsumme der Anleihen** | | **408 897 789** | **431 092 963** | **89.17** |
| | **Supranationale Institutionen, Regierungen und örtliche Behörden, Schuldtitel** | | | | |
| 1 000 000 | AFRICA FINANCE CORP - REGS - 3.875% 13/04/2024 | USD | 987 465 | 1 053 580 | 0.22 |
| 1 500 000 | AFRICA FINANCE CORP - REGS - 4.375% 17/04/2026 | USD | 1 488 855 | 1 621 935 | 0.34 |
| 1 100 000 | AFRICA FINANCE CORP 3.75% 30/10/2029 | USD | 1 086 888 | 1 138 467 | 0.24 |
| 1 500 000 | AFRICAN EXPORT-IMPORT BANK - REGS - 3.994% 21/09/2029 | USD | 1 500 000 | 1 565 595 | 0.32 |
| 1 000 000 | AFRICAN EXPORT-IMPORT BANK 4.125% 20/06/2024 | USD | 994 590 | 1 051 680 | 0.22 |
| 1 000 000 | AFRICAN EXPORT-IMPORT BANK 5.25% 11/10/2023 | USD | 1 047 500 | 1 083 720 | 0.22 |
| 1 000 000 | ARAB PETROLEUM INVESTMENTS CORP - REGS - 4.125% 18/09/2023 | USD | 999 173 | 1 066 880 | 0.22 |
| 1 000 000 | BANQUE OUEST AFRICAINE DE DEVELOPPEMENT - REGS - 5% 27/07/2027 | USD | 1 012 120 | 1 083 980 | 0.22 |
| 500 000 | BANQUE OUEST AFRICAINE DE DEVELOPPEMENT - REGS - 5.5% 06/05/2021 | USD | 502 087 | 519 205 | 0.11 |
| 1 500 000 | BANQUE OUEST AFRICAINE DE DEVELOPPEMENT 4.7% 22/10/2031 | USD | 1 500 000 | 1 596 690 | 0.33 |
| 1 000 000 | BLACK SEA TRADE & DEVELOPMENT BANK - REGS - 4.875% 06/05/2021 | USD | 1 051 250 | 1 027 710 | 0.21 |
| 450 000 | STATE OF ISRAEL 2.5% 15/01/2030 | USD | 448 025 | 467 424 | 0.10 |
| 2 000 000 | UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 1.5% 15/02/2030 | USD | 2 055 390 | 2 065 313 | 0.43 |
| 2 000 000 | UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 2% 15/02/2050 | USD | 2 133 437 | 2 156 875 | 0.44 |
| | **Summe supranationale Institutionen, Regierungen und örtliche Behörden, Schuldtitel** | | **16 806 780** | **17 499 054** | **3.62** |
| | **Gesamtsumme übertragbarer Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer amtlichen Börse zugelassen sind oder auf einem anderen geregelten Markt gehandelt werden** | | **425 704 569** | **448 592 017** | **92.79** |
| | **Gesamtsumme der Anlagen** | | **425 704 569** | **448 592 017** | **92.79** |

# Swiss Life Funds (LUX) Bond Emerging Markets Corporates

## Sektorstruktur und geographische Verteilung der Anlagen

| Sektorstruktur | % |
|---|---|
| Finanzdienstleistungen | 25.42 |
| Banken | 15.60 |
| Öl- und Gasproduzenten | 11.85 |
| Elektrizität | 6.37 |
| Gas-, Wasser- und Mehrfachversorgungsunternehmen | 6.14 |
| Behörden | 3.62 |
| Chemikalien | 2.86 |
| Allgemeine Industrie | 2.14 |
| Mobilfunk | 2.07 |
| Festnetz-Telekommunikation | 1.99 |
| Industriemetalle und Bergbau | 1.75 |
| Software- und Computerdienstleistungen | 1.68 |
| Real Estate Investment & Services | 1.60 |
| Bauwirtschaft und Baustoffe | 1.41 |
| Industrietransport | 1.33 |
| Lebensmittel- und Arzneimittelhandel | 1.11 |
| Forst- und Papierindustrie | 0.97 |
| Bergbau | 0.97 |
| Reise, Freizeit und Catering | 0.68 |
| Lebensversicherung | 0.65 |
| Allgemeiner Einzelhandel | 0.59 |
| Alternative Energie | 0.34 |
| Medien | 0.25 |
| Lebensmittelhersteller | 0.22 |
| Anlageinstrumente, die keine Aktien sind | 0.22 |
| Immobilienbezogene Anlagefonds | 0.22 |
| Industrietechnik | 0.21 |
| Versicherungen (ohne Lebensversicherung) | 0.21 |
| Ölbranche: Maschinen, Dienstleistungen und Vertrieb | 0.21 |
| Getränke | 0.11 |
| | **92.79** |

| Geographische Verteilung | % |
|---|---|
| Kaimaninseln | 13.77 |
| Südkorea | 7.06 |
| Vereinigte Staaten von Amerika | 5.94 |
| Britisch Virgin Islands | 5.49 |
| Chile | 5.07 |
| Niederlande | 4.85 |
| Singapur | 4.78 |
| HongKong (China) | 3.98 |
| Vereinigte Arabische Emirate | 3.95 |
| Peru | 3.25 |
| Kolumbien | 3.06 |
| Saudi-Arabien | 2.84 |
| Mexiko | 2.74 |
| Bermuda | 2.43 |
| Israel | 2.40 |
| Luxemburg | 2.29 |
| Indonesien | 2.28 |
| Indien | 1.94 |
| Thailand | 1.49 |
| Panama | 1.11 |
| Katar | 0.98 |
| Kanada | 0.92 |
| China | 0.87 |
| Malaysia | 0.86 |
| Nigeria | 0.79 |
| Ägypten | 0.77 |
| Philippines | 0.75 |
| Russland | 0.74 |
| Australien | 0.68 |
| Togo | 0.66 |
| Curacao | 0.56 |
| Isle of Man | 0.54 |
| Irland | 0.53 |
| Bahamas | 0.52 |
| Marokko | 0.52 |
| Czech Republic | 0.49 |
| Österreich | 0.25 |
| Großbritannien | 0.22 |
| Griechenland | 0.21 |
| Macao (China) | 0.21 |
| | **92.79** |

# Swiss Life Funds (LUX) Bond Emerging Markets Corporates Short Term

## Anlagenübersicht

| Nominalwert/ Menge | Bezeichnung | Kurs Währung | Kosten USD | Marktwert USD | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| **Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumenten, die an einer amtlichen Börse zugelassen sind oder auf einem anderen geregelten Markt gehandelt werden** | | | | | |
| | **Anleihen** | | | | |
| 2 365 000 | ABQ FINANCE LTD 3.5% 22/02/2022 | USD | 2 401 658 | 2 409 722 | 0.83 |
| 1 500 000 | ABQ FINANCE LTD 3.625% 13/04/2021 | USD | 1 485 000 | 1 518 465 | 0.52 |
| 3 000 000 | ABU DHABI NATIONAL ENERGY CO PJSC - REGS - 3.625% 12/01/2023 | USD | 3 118 050 | 3 115 950 | 1.07 |
| 4 000 000 | ABU DHABI NATIONAL ENERGY CO PJSC - REGS - 3.625% 22/06/2021 | USD | 4 012 300 | 4 071 680 | 1.40 |
| 2 000 000 | ABU DHABI NATIONAL ENERGY CO PJSC - REGS - 5.875% 13/12/2021 | USD | 2 132 500 | 2 132 000 | 0.73 |
| 1 481 000 | ADANI PORTS & SPECIAL ECONOMIC ZONE LTD - REGS - 3.95% 19/01/2022 | USD | 1 515 952 | 1 523 149 | 0.52 |
| 2 000 000 | ADCB FINANCE CAYMAN LTD - REGS - 4% 29/03/2023 | USD | 2 044 400 | 2 096 900 | 0.72 |
| 1 300 000 | AGRICULTURAL BANK OF CHINA LTD/HONG KONG FRN 07/11/2021 | USD | 1 300 000 | 1 303 757 | 0.45 |
| 1 500 000 | AL AHLI BANK OF KUWAIT KSCP 3.5% 05/04/2022 | USD | 1 527 825 | 1 532 130 | 0.53 |
| 1 500 000 | ALPEK SAB DE CV - REGS - 4.5% 20/11/2022 | USD | 1 571 250 | 1 561 590 | 0.54 |
| 957 000 | BANCO BBVA PERU SA - REGS - 5% 26/08/2022 | USD | 1 015 109 | 1 016 056 | 0.35 |
| 1 000 000 | BANCO CONTINENTAL SA VIA CONTINENTAL SENIOR TRUSTEES CAYMAN LTD - REGS - 5.5% 18/11/2020 | USD | 1 053 500 | 1 022 830 | 0.35 |
| 1 460 000 | BANCO DE CREDITO E INVERSIONES SA - REGS - 4% 11/02/2023 | USD | 1 522 050 | 1 523 919 | 0.52 |
| 1 400 000 | BANCO DEL ESTADO DE CHILE 2.704% 09/01/2025 | USD | 1 400 000 | 1 414 420 | 0.48 |
| 1 950 000 | BANCO SANTANDER MEXICO SA INSTITUCION DE BANCA MULTIPLE GRUPO FINANCIERO SANTAND - REGS - 4.125% 09/11/2022 | USD | 2 034 660 | 2 026 128 | 0.69 |
| 1 265 000 | BANGKOK BANK PCL/HONG KONG - REGS - 3.875% 27/09/2022 | USD | 1 284 038 | 1 328 010 | 0.46 |
| 3 000 000 | BANGKOK BANK PCL/HONG KONG - REGS - 4.8% 18/10/2020 | USD | 3 126 140 | 3 056 670 | 1.05 |
| 2 000 000 | BANK OF BARODA/LONDON 3.5% 04/04/2022 | USD | 1 993 240 | 2 045 900 | 0.70 |
| 1 000 000 | BANK OF CHINA LTD/HONG KONG FRN 08/03/2021 | USD | 1 000 000 | 1 002 040 | 0.34 |
| 1 000 000 | BANK OF COMMUNICATIONS CO LTD/HONG KONG FRN 17/05/2021 | USD | 1 000 000 | 1 001 980 | 0.34 |
| 1 000 000 | BANK OF INDIA/JERSEY 3.125% 06/05/2020 | USD | 999 600 | 1 000 580 | 0.34 |
| 1 000 000 | BDO UNIBANK INC 2.95% 06/03/2023 | USD | 984 500 | 1 017 480 | 0.35 |
| 1 000 000 | BHARAT PETROLEUM CORP LTD 4.375% 24/01/2022 | USD | 998 860 | 1 031 100 | 0.35 |
| 750 000 | BLUESTAR FINANCE HOLDINGS LTD 3.5% 30/09/2021 | USD | 731 775 | 766 035 | 0.26 |
| 1 200 000 | BLUESTAR FINANCE HOLDINGS LTD 4.375% 11/06/2020 | USD | 1 241 160 | 1 207 536 | 0.41 |
| 1 500 000 | BOS FUNDING LTD - EMTN - 4.23% 07/03/2022 | USD | 1 515 500 | 1 529 520 | 0.52 |
| 800 000 | BOUBYAN SUKUK LTD 2.593% 18/02/2025 | USD | 800 000 | 803 200 | 0.28 |
| 1 000 000 | CDBL FUNDING 1 FRN 15/11/2021 | USD | 1 000 000 | 1 003 460 | 0.34 |
| 1 000 000 | CHALCO HK INVESTMENT 4.875% 07/09/2021 | USD | 996 838 | 1 038 620 | 0.36 |
| 500 000 | CHARMING LIGHT INVESTMENTS LTD FRN 21/12/2020 | USD | 500 000 | 501 025 | 0.17 |
| 1 000 000 | CHARMING LIGHT INVESTMENTS LTD 2.375% 30/08/2021 | USD | 960 460 | 1 004 620 | 0.34 |
| 1 200 000 | CHINA CINDA FINANCE 2015 I LTD - REGS - 3.125% 23/04/2020 | USD | 1 206 960 | 1 201 908 | 0.41 |
| 900 000 | CHINA CINDA FINANCE 2017 I LTD 3% 09/03/2020 | USD | 888 840 | 900 117 | 0.31 |
| 2 000 000 | CHINA CONSTRUCTION BANK CORP/HONG KONG FRN 22/10/2022 | USD | 2 000 000 | 2 005 260 | 0.69 |
| 1 000 000 | CHINA CONSTRUCTION BANK CORP/HONG KONG FRN 31/05/2020 | USD | 1 000 860 | 1 000 730 | 0.34 |
| 1 780 000 | CHINA GREAT WALL INTERNATIONAL HOLDINGS III LTD 4.375% 25/05/2023 | USD | 1 868 644 | 1 905 401 | 0.65 |
| 750 000 | CHINA GREAT WALL INTERNATIONAL HOLDINGS IV LTD 3.125% 31/07/2024 | USD | 753 765 | 781 043 | 0.27 |
| 2 000 000 | CHINA OVERSEAS FINANCE CAYMAN II LTD 5.5% 10/11/2020 | USD | 2 061 610 | 2 047 100 | 0.70 |
| 1 500 000 | CIA MINERA MILPO SAA - REGS - 4.625% 28/03/2023 | USD | 1 573 125 | 1 570 380 | 0.54 |
| 1 500 000 | CK HUTCHISON INTERNATIONAL 17 II LTD - REGS - 2.25% 29/09/2020 | USD | 1 497 030 | 1 504 980 | 0.52 |
| 1 000 000 | CK HUTCHISON INTERNATIONAL 19 LTD 3.25% 11/04/2024 | USD | 998 990 | 1 057 270 | 0.36 |
| 2 000 000 | CNAC HK FINBRIDGE CO LTD 3.5% 19/07/2022 | USD | 2 011 000 | 2 058 440 | 0.71 |
| 2 500 000 | CNOOC FINANCE 2011 LTD - REGS - 4.25% 26/01/2021 | USD | 2 547 160 | 2 556 425 | 0.88 |

# Swiss Life Funds (LUX) Bond Emerging Markets Corporates Short Term

## Anlagenübersicht (Fortsetzung)

| Nominalwert/ Menge | Bezeichnung | Kurs Währung | Kosten USD | Marktwert USD | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| **Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumenten, die an einer amtlichen Börse zugelassen sind oder auf einem anderen geregelten Markt gehandelt werden (Fortsetzung)** | | | | | |
| | **Anleihen (Fortsetzung)** | | | | |
| 1 200 000 | CNPC GENERAL CAPITAL LTD - REGS - 3.95% 19/04/2022 | USD | 1 239 060 | 1 255 344 | 0.43 |
| 950 000 | CNPC HK OVERSEAS CAPITAL 4.5% 28/04/2021 | USD | 972 629 | 980 305 | 0.34 |
| 1 480 000 | COSL SINGAPORE CAPITAL LTD 3.5% 30/07/2020 | USD | 1 510 784 | 1 487 607 | 0.51 |
| 600 000 | COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO LTD 5.125% 14/01/2027 | USD | 600 000 | 599 442 | 0.21 |
| 1 500 000 | DBS GROUP HOLDINGS LTD - REGS - 2.85% 16/04/2022 | USD | 1 499 190 | 1 540 440 | 0.53 |
| 1 000 000 | DELEK & AVNER TAMAR BOND LTD 5.082% 30/12/2023 | USD | 1 035 000 | 1 036 020 | 0.36 |
| 1 000 000 | DIANJIAN HAIYU LTD 3% 20/06/2022 | USD | 997 780 | 1 019 040 | 0.35 |
| 3 500 000 | DOLPHIN ENERGY LTD LLC - REGS - 5.5% 15/12/2021 | USD | 3 712 100 | 3 690 190 | 1.26 |
| 500 000 | EASTERN CREATION II INVESTMENT HOLDINGS LTD 2.8% 15/07/2022 | USD | 499 600 | 509 055 | 0.17 |
| 475 000 | EMBRAER OVERSEAS LTD - REGS - 5.696% 16/09/2023 | USD | 521 788 | 519 831 | 0.18 |
| 1 000 000 | EMIRATES NBD BANK PJSC 2.625% 18/02/2025 | USD | 999 160 | 1 006 650 | 0.35 |
| 1 000 000 | EMIRATES NBD PJSC 3% 06/05/2020 | USD | 991 500 | 1 000 330 | 0.34 |
| 1 000 000 | EMPRESA NACIONAL DEL PETROLEO - REGS - 4.75% 06/12/2021 | USD | 1 031 500 | 1 037 180 | 0.36 |
| 1 000 000 | ENN CLEAN ENERGY INTERNATIONAL INVESTMENT LTD 7.5% 27/02/2021 | USD | 1 036 250 | 1 029 600 | 0.35 |
| 1 000 000 | ENN ENERGY HOLDINGS LTD - REGS - 6% 13/05/2021 | USD | 1 040 780 | 1 043 960 | 0.36 |
| 1 000 000 | ENN ENERGY HOLDINGS LTD 3.25% 24/07/2022 | USD | 1 004 550 | 1 020 910 | 0.35 |
| 5 000 000 | EQUATE PETROCHEMICAL BV - REGS - 3% 03/03/2022 | USD | 4 917 700 | 5 031 000 | 1.72 |
| 1 500 000 | FIRST ABU DHABI BANK PJSC FRN 16/04/2022 | USD | 1 500 000 | 1 508 205 | 0.52 |
| 4 000 000 | GAZPROM OAO VIA GAZ CAPITAL SA - REGS - 4.95% 19/07/2022 | USD | 4 181 000 | 4 213 720 | 1.44 |
| 2 000 000 | GAZPROM OAO VIA GAZ CAPITAL SA - REGS - 5.999% 23/01/2021 | USD | 2 086 600 | 2 061 740 | 0.71 |
| 3 000 000 | GAZPROM OAO VIA GAZ CAPITAL SA - REGS - 6.51% 07/03/2022 | USD | 3 208 500 | 3 234 510 | 1.11 |
| 807 000 | GC TREASURY CENTER CO LTD 4.25% 19/09/2022 | USD | 840 942 | 849 037 | 0.29 |
| 3 750 000 | GLOBAL BANK CORP - REGS - 4.5% 20/10/2021 | USD | 3 835 356 | 3 846 563 | 1.32 |
| 1 500 000 | GLOBO COMUNICACAO E PARTICIPACOES SA - REGS - 4.875% 11/04/2022 | USD | 1 560 000 | 1 553 490 | 0.53 |
| 2 000 000 | GRUPO BIMBO SAB DE CV - REGS - 4.5% 25/01/2022 | USD | 2 060 000 | 2 094 080 | 0.72 |
| 508 000 | GRUPO BIMBO SAB DE CV - REGS - 4.875% 30/06/2020 | USD | 529 717 | 511 973 | 0.18 |
| 2 000 000 | GRUPO DE INVERSIONES SURAMERICANA SA - REGS - 5.7% 18/05/2021 | USD | 2 116 250 | 2 077 640 | 0.71 |
| 1 200 000 | HAITONG INTERNATIONAL FINANCE 2015 LTD 4.2% 29/07/2020 | USD | 1 236 960 | 1 210 212 | 0.41 |
| 1 000 000 | HPHT FINANCE 17 LTD 2.75% 11/09/2022 | USD | 991 900 | 1 018 940 | 0.35 |
| 1 500 000 | HUARONG FINANCE II CO LTD 3.25% 03/06/2021 | USD | 1 452 240 | 1 521 345 | 0.52 |
| 3 600 000 | HUARONG FINANCE II CO LTD 3.625% 22/11/2021 | USD | 3 657 312 | 3 692 016 | 1.27 |
| 1 000 000 | HUARONG FINANCE 2017 CO LTD 3.75% 27/04/2022 | USD | 985 220 | 1 034 070 | 0.35 |
| 1 500 000 | HUARONG FINANCE 2019 CO LTD FRN 24/02/2025 | USD | 1 500 000 | 1 494 780 | 0.51 |
| 2 000 000 | HUARONG FINANCE 2019 CO LTD 2.5% 24/02/2023 | USD | 1 995 060 | 2 013 620 | 0.69 |
| 2 000 000 | HUTCHISON WHAMPOA INTERNATIONAL 12 II LTD - REGS - 3.25% 08/11/2022 | USD | 1 990 500 | 2 079 900 | 0.71 |
| 970 000 | HYUNDAI CAPITAL AMERICA - REGS - 2.45% 15/06/2021 | USD | 941 201 | 977 993 | 0.34 |
| 2 000 000 | HYUNDAI CAPITAL AMERICA - REGS - 2.6% 19/03/2020 | USD | 1 974 000 | 1 999 020 | 0.69 |
| 1 200 000 | HYUNDAI CAPITAL AMERICA - REGS - 3% 18/03/2021 | USD | 1 205 076 | 1 214 952 | 0.42 |
| 900 000 | HYUNDAI CAPITAL AMERICA - REGS - 3.45% 12/03/2021 | USD | 899 595 | 915 021 | 0.31 |
| 1 000 000 | HYUNDAI CAPITAL AMERICA - REGS - 3.75% 08/07/2021 | USD | 996 800 | 1 025 530 | 0.35 |
| 300 000 | HYUNDAI CAPITAL AMERICA 2.375% 10/02/2023 | USD | 299 871 | 303 648 | 0.10 |
| 700 000 | HYUNDAI CAPITAL AMERICA 2.65% 10/02/2025 | USD | 698 698 | 711 396 | 0.24 |
| 1 400 000 | HYUNDAI CAPITAL AMERICA 2.85% 01/11/2022 | USD | 1 399 846 | 1 434 244 | 0.49 |

# Swiss Life Funds (LUX) Bond Emerging Markets Corporates Short Term

## Anlagenübersicht (Fortsetzung)

| Nominalwert/ Menge | Bezeichnung | Kurs Währung | Kosten USD | Marktwert USD | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| **Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumenten, die an einer amtlichen Börse zugelassen sind oder auf einem anderen geregelten Markt gehandelt werden (Fortsetzung)** | | | | | |
| | **Anleihen (Fortsetzung)** | | | | |
| 1 000 000 | ICBCIL FINANCE CO LTD FRN 15/05/2021 | USD | 1 000 000 | 1 000 290 | 0.34 |
| 654 000 | ICICI BANK LTD/DUBAI - REGS - 3.5% 18/03/2020 | USD | 661 848 | 654 314 | 0.22 |
| 2 000 000 | ICICI BANK LTD/DUBAI 3.25% 09/09/2022 | USD | 2 028 000 | 2 048 440 | 0.70 |
| 2 493 000 | IND & COM BK OF CHINA /DUBAI 2.5% 16/06/2021 | USD | 2 468 070 | 2 512 620 | 0.86 |
| 1 000 000 | INDIAN OIL CORP LTD 4.75% 16/01/2024 | USD | 1 042 000 | 1 077 650 | 0.37 |
| 2 000 000 | INDONESIA ASAHAN ALUMINIUM PERSERO PT - REGS - 5.23% 15/11/2021 | USD | 2 006 380 | 2 093 660 | 0.72 |
| 1 000 000 | INDUSIND BANK LTD/GIFT CITY 3.875% 15/04/2022 | USD | 992 480 | 1 019 000 | 0.35 |
| 2 127 000 | INDUSTRIAL & COMMERCIAL BANK OF CHINA ASIA LTD 5.125% 30/11/2020 | USD | 2 236 956 | 2 172 177 | 0.74 |
| 1 000 000 | INDUSTRIAL & COMMERCIAL BANK OF CHINA LTD/LONDON FRN 14/06/2021 | USD | 1 000 000 | 1 001 940 | 0.34 |
| 1 500 000 | INVENTIVE GLOBAL INVESTMENTS LTD 2.5% 19/09/2020 | USD | 1 498 545 | 1 506 105 | 0.52 |
| 330 000 | INVERSIONES CMPC SA - REGS - 4.5% 25/04/2022 | USD | 341 055 | 341 857 | 0.12 |
| 2 500 000 | INVERSIONES CMPC SA/CAYMAN ISLANDS BRANCH - REGS - 4.375% 15/05/2023 | USD | 2 602 075 | 2 611 875 | 0.90 |
| 2 026 000 | IOI INVESTMENT L BHD 4.375% 27/06/2022 | USD | 2 116 010 | 2 119 399 | 0.73 |
| 800 000 | ISRAEL CHEMICALS LTD 4.5% 02/12/2024 | USD | 860 800 | 853 248 | 0.29 |
| 2 000 000 | ISRAEL ELECTRIC CORP LTD 5% 12/11/2024 | USD | 2 191 000 | 2 227 060 | 0.76 |
| 750 000 | JD.COM INC 3.125% 29/04/2021 | USD | 735 450 | 759 165 | 0.26 |
| 2 500 000 | KEB HANA BANK 3.375% 30/01/2022 | USD | 2 494 425 | 2 578 800 | 0.88 |
| 1 700 000 | KOREA EAST-WEST POWER CO LTD - REGS - 2.5% 02/06/2020 | USD | 1 697 586 | 1 703 621 | 0.58 |
| 1 000 000 | KOREA GAS CORP - REGS - 2.75% 20/07/2022 | USD | 968 280 | 1 027 610 | 0.35 |
| 2 000 000 | KOREA HYDRO & NUCLEAR POWER CO LTD - REGS - 3% 19/09/2022 | USD | 2 052 100 | 2 069 480 | 0.71 |
| 1 700 000 | KOREA HYDRO & NUCLEAR POWER CO LTD - REGS - 4.75% 13/07/2021 | USD | 1 822 740 | 1 772 012 | 0.61 |
| 1 500 000 | KOREA MIDLAND POWER CO LTD 3.375% 22/01/2022 | USD | 1 499 014 | 1 548 030 | 0.53 |
| 1 500 000 | LUKOIL INTERNATIONAL FINANCE BV - REGS - 4.563% 24/04/2023 | USD | 1 589 850 | 1 579 200 | 0.54 |
| 3 700 000 | LUKOIL INTERNATIONAL FINANCE BV - REGS - 6.125% 09/11/2020 | USD | 3 947 600 | 3 795 053 | 1.30 |
| 2 000 000 | LUKOIL INTERNATIONAL FINANCE BV - REGS - 6.656% 07/06/2022 | USD | 2 154 800 | 2 181 180 | 0.75 |
| 1 000 000 | MIRAE ASSET DAEWOO CO LTD 3.125% 07/05/2022 | USD | 997 790 | 1 023 480 | 0.35 |
| 3 000 000 | MMC NORILSK NICKEL OJSC VIA MMC FINANCE DAC - REGS - 5.55% 28/10/2020 | USD | 3 131 250 | 3 058 980 | 1.05 |
| 4 500 000 | MMC NORILSK NICKEL OJSC VIA MMC FINANCE DAC - REGS - 6.625% 14/10/2022 | USD | 4 912 425 | 4 930 335 | 1.69 |
| 1 700 000 | MULTIBANK INC - REGS - 4.375% 09/11/2022 | USD | 1 749 500 | 1 767 745 | 0.61 |
| 2 000 000 | NOVATEK OAO VIA NOVATEK FINANCE DAC - REGS - 4.422% 13/12/2022 | USD | 2 072 500 | 2 091 220 | 0.72 |
| 1 500 000 | NOVATEK OAO VIA NOVATEK FINANCE DAC - REGS - 6.604% 03/02/2021 | USD | 1 619 790 | 1 556 760 | 0.53 |
| 4 000 000 | OLEODUCTO CENTRAL SA - REGS - 4% 07/05/2021 | USD | 4 064 250 | 4 069 320 | 1.39 |
| 2 000 000 | OOREDOO INTERNATIONAL FINANCE LTD - REGS - 3.25% 21/02/2023 | USD | 2 022 920 | 2 050 560 | 0.70 |
| 3 000 000 | OOREDOO INTERNATIONAL FINANCE LTD - REGS - 4.75% 16/02/2021 | USD | 3 095 100 | 3 079 770 | 1.06 |
| 2 000 000 | POSCO 2.375% 12/11/2022 | USD | 1 989 100 | 2 024 920 | 0.69 |
| 2 000 000 | POSCO 2.75% 15/07/2024 | USD | 1 988 520 | 2 051 460 | 0.70 |
| 6 005 000 | POWSZECHNA KASA OSZCZEDNOSCI BANK POLSKI SA VIA PKO FINANCE AB - REGS - 4.63% 26/09/2022 | USD | 6 356 917 | 6 383 374 | 2.20 |
| 2 000 000 | PTT GLOBAL CHEMICAL PCL - REGS - 4.25% 19/09/2022 | USD | 2 084 840 | 2 103 780 | 0.72 |
| 5 000 000 | QNB FINANCE LTD 2.125% 07/09/2021 | USD | 4 817 725 | 4 993 000 | 1.71 |
| 4 000 000 | QNB FINANCE LTD 2.875% 29/04/2020 | USD | 3 977 000 | 4 001 400 | 1.37 |

# Swiss Life Funds (LUX) Bond Emerging Markets Corporates Short Term

## Anlagenübersicht (Fortsetzung)

| Nominalwert/ Menge | Bezeichnung | Kurs Währung | Kosten USD | Marktwert USD | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| **Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumenten, die an einer amtlichen Börse zugelassen sind oder auf einem anderen geregelten Markt gehandelt werden (Fortsetzung)** | | | | | |
| | **Anleihen (Fortsetzung)** | | | | |
| 1 000 000 | QNB FINANCE LTD 3.5% 28/03/2024 | USD | 991 440 | 1 048 010 | 0.36 |
| 3 150 000 | RAS LAFFAN LIQUEFIED NATURAL GAS CO LTD II - REGS - 5.298% 30/09/2020 | USD | 365 951 | 356 056 | 0.12 |
| 1 000 000 | REC LTD 3.068% 18/12/2020 | USD | 1 000 000 | 1 006 540 | 0.34 |
| 2 200 000 | RELIANCE HOLDING USA INC - REGS - 4.5% 19/10/2020 | USD | 2 274 600 | 2 235 024 | 0.77 |
| 5 150 000 | RELIANCE HOLDING USA INC - REGS - 5.4% 14/02/2022 | USD | 5 405 137 | 5 472 853 | 1.89 |
| 1 000 000 | RHB BANK BHD 2.503% 06/10/2021 | USD | 964 500 | 1 010 900 | 0.35 |
| 7 000 000 | ROSNEFT OIL CO VIA ROSNEFT INTERNATIONAL FINANCE DAC - REGS - 4.199% 06/03/2022 | USD | 6 983 500 | 7 119 140 | 2.45 |
| 1 000 000 | SACI FALABELLA - REGS - 3.75% 30/04/2023 | USD | 1 024 500 | 1 031 850 | 0.35 |
| 4 000 000 | SASOL FINANCING INTERNATIONAL LTD 4.5% 14/11/2022 | USD | 4 125 000 | 4 115 160 | 1.41 |
| 3 960 000 | SAUDI ELECTRICITY GLOBAL SUKUK CO 4.211% 03/04/2022 | USD | 4 125 125 | 4 119 192 | 1.41 |
| 1 500 000 | SEVERSTAL OAO VIA STEEL CAPITAL SA - REGS - 3.85% 27/08/2021 | USD | 1 531 875 | 1 527 105 | 0.52 |
| 1 000 000 | SHINHAN BANK CO LTD - REGS - 2.25% 15/04/2020 | USD | 979 290 | 1 000 680 | 0.34 |
| 200 000 | SHOUGANG GROUP CO LTD 4% 23/05/2024 | USD | 198 702 | 212 350 | 0.07 |
| 350 000 | SIAM COMMERCIAL BANK PCL/CAYMAN ISLANDS 3.9% 11/02/2024 | USD | 349 388 | 374 878 | 0.13 |
| 1 200 000 | SIB SUKUK CO III LTD 3.084% 08/09/2021 | USD | 1 170 000 | 1 207 584 | 0.41 |
| 500 000 | SINO-OCEAN LAND TREASURE IV LTD FRN 31/07/2021 | USD | 505 025 | 505 320 | 0.17 |
| 1 000 000 | SINO-OCEAN LAND TREASURE IV LTD 5.25% 30/04/2022 | USD | 1 017 000 | 1 048 410 | 0.36 |
| 2 000 000 | STATE BANK OF INDIA/LONDON - REGS - 4% 24/01/2022 | USD | 2 015 200 | 2 066 040 | 0.71 |
| 1 500 000 | STATE BANK OF INDIA/LONDON FRN 06/04/2020 | USD | 1 504 050 | 1 500 810 | 0.51 |
| 1 000 000 | STATE BANK OF INDIA/LONDON 3.25% 24/01/2022 | USD | 987 920 | 1 018 660 | 0.35 |
| 1 500 000 | SWIRE PACIFIC MTN FINANCING LTD 4.5% 28/02/2022 | USD | 1 546 575 | 1 577 085 | 0.54 |
| 3 500 000 | TELEFONICA CHILE SA - REGS - 3.875% 12/10/2022 | USD | 3 561 285 | 3 602 900 | 1.23 |
| 1 000 000 | TENCENT HOLDINGS LTD FRN 11/04/2024 | USD | 1 000 000 | 1 005 740 | 0.34 |
| 1 000 000 | TMB BANK PCL/CAYMAN ISLANDS 3.108% 01/10/2021 | USD | 986 050 | 1 014 850 | 0.35 |
| 1 000 000 | TRUST F/1401 - REGS - 5.25% 15/12/2024 | USD | 1 098 750 | 1 099 120 | 0.38 |
| 2 233 000 | UNION BANK OF THE PHILIPPINES 3.369% 29/11/2022 | USD | 2 267 505 | 2 294 519 | 0.79 |
| 1 200 000 | UNION NATIONAL BANK PJSC 2.75% 05/10/2021 | USD | 1 167 000 | 1 205 364 | 0.41 |
| 2 500 000 | UNITED OVERSEAS BANK LTD FRN 08/03/2027 | USD | 2 461 100 | 2 536 975 | 0.87 |
| 500 000 | VANKE REAL ESTATE HONG KONG CO LTD FRN 25/05/2023 | USD | 500 000 | 502 765 | 0.17 |
| | **Gesamtsumme der Anleihen** | | **272 419 523** | **274 855 845** | **94.20** |
| | **Supranationale Institutionen, Regierungen und örtliche Behörden, Schuldtitel** | | | | |
| 3 800 000 | AFRICAN EXPORT-IMPORT BANK 4% 24/05/2021 | USD | 3 840 600 | 3 866 196 | 1.34 |
| 1 500 000 | BANQUE OUEST AFRICAINE DE DEVELOPPEMENT - REGS - 5.5% 06/05/2021 | USD | 1 584 345 | 1 557 615 | 0.53 |
| 1 000 000 | BLACK SEA TRADE & DEVELOPMENT BANK 3.5% 25/06/2024 | USD | 1 012 000 | 1 034 390 | 0.35 |
| | **Summe supranationale Institutionen, Regierungen und örtliche Behörden, Schuldtitel** | | **6 436 945** | **6 458 201** | **2.22** |
| | **Gesamtsumme übertragbarer Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer amtlichen Börse zugelassen sind oder auf einem anderen geregelten Markt gehandelt werden** | | **278 856 468** | **281 314 046** | **96.42** |
| | **Gesamtsumme der Anlagen** | | **278 856 468** | **281 314 046** | **96.42** |

# Swiss Life Funds (LUX) Bond Emerging Markets Corporates Short Term

## Sektorstruktur und geographische Verteilung der Anlagen

| Sektorstruktur | % |
|---|---|
| Finanzdienstleistungen | 40.69 |
| Banken | 22.09 |
| Öl- und Gasproduzenten | 4.10 |
| Gas-, Wasser- und Mehrfachversorgungsunternehmen | 3.55 |
| Allgemeine Industrie | 3.53 |
| Festnetz-Telekommunikation | 2.99 |
| Bauwirtschaft und Baustoffe | 2.64 |
| Chemikalien | 2.61 |
| Behörden | 2.21 |
| Elektrizität | 1.69 |
| Industriemetalle und Bergbau | 1.47 |
| Ölbranche: Maschinen, Dienstleistungen und Vertrieb | 1.39 |
| Forst- und Papierindustrie | 1.01 |
| Immobilienbezogene Dienstleistungen und Investitionen | 0.91 |
| Lebensmittelhersteller | 0.89 |
| Software- und Computerdienstleistungen | 0.88 |
| Industrietransport | 0.87 |
| Anlageinstrumente, die keine Aktien sind | 0.87 |
| Allgemeiner Einzelhandel | 0.61 |
| Bergbau | 0.54 |
| Medien | 0.53 |
| Industrietechnik | 0.35 |
| | **96.42** |

| Geographische Verteilung | % |
|---|---|
| Kaimaninseln | 14.67 |
| Britisch Virgin Islands | 10.52 |
| Vereinigte Arabische Emirate | 7.86 |
| Irland | 6.43 |
| Südkorea | 5.76 |
| HongKong (China) | 5.63 |
| Vereinigte Staaten von Amerika | 5.58 |
| Niederlande | 4.31 |
| Chile | 3.85 |
| Luxemburg | 3.78 |
| Großbritannien | 2.96 |
| Mexiko | 2.50 |
| Schweden | 2.19 |
| Indien | 1.94 |
| Panama | 1.92 |
| Singapur | 1.91 |
| Bermuda | 1.76 |
| Isle of Man | 1.41 |
| Israel | 1.41 |
| Kolumbien | 1.39 |
| Thailand | 1.36 |
| Ägypten | 1.33 |
| Philippinen | 1.14 |
| Malaysia | 1.07 |
| Peru | 0.89 |
| Indonesien | 0.72 |
| Brasilien | 0.53 |
| Kuwait | 0.53 |
| Togo | 0.53 |
| Griechenland | 0.35 |
| Katar | 0.12 |
| China | 0.07 |
| | **96.42** |

# Swiss Life Funds (LUX) Bond Euro Corporates

## Anlagenübersicht

| Nominalwert/ Menge | Bezeichnung | Kurs Währung | Kosten EUR | Marktwert EUR | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| **Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumenten, die an einer amtlichen Börse zugelassen sind oder auf einem anderen geregelten Markt gehandelt werden** | | | | | |
| | **Anleihen** | | | | |
| 600 000 | ABBOTT IRELAND FINANCING DAC 0.375% 19/11/2027 | EUR | 597 291 | 602 832 | 0.97 |
| 200 000 | ABBVIE INC 1.375% 17/05/2024 | EUR | 210 228 | 208 032 | 0.33 |
| 100 000 | ABBVIE INC 2.125% 17/11/2028 | EUR | 99 801 | 111 899 | 0.18 |
| 200 000 | ABERTIS INFRAESTRUCTURAS SA 1.125% 26/03/2028 | EUR | 191 610 | 196 538 | 0.32 |
| 200 000 | ABERTIS INFRAESTRUCTURAS SA 1.5% 27/06/2024 | EUR | 202 216 | 205 778 | 0.33 |
| 200 000 | ABN AMRO BANK NV 0.6% 15/01/2027 | EUR | 199 590 | 200 483 | 0.32 |
| 200 000 | ABN AMRO BANK NV 7.125% 06/07/2022 | EUR | 234 010 | 232 194 | 0.37 |
| 200 000 | AEGON BANK NV 0.625% 21/06/2024 | EUR | 201 346 | 203 560 | 0.33 |
| 100 000 | AIRBUS FINANCE BV 1.375% 13/05/2031 | EUR | 98 464 | 110 620 | 0.18 |
| 200 000 | ALBEMARLE CORP 1.875% 08/12/2021 | EUR | 206 750 | 205 550 | 0.33 |
| 300 000 | ALD SA - REGS - 0.375% 18/07/2023 | EUR | 300 944 | 298 284 | 0.48 |
| 100 000 | ALD SA 0.875% 18/07/2022 | EUR | 99 776 | 101 365 | 0.16 |
| 100 000 | ALD SA 1.25% 11/10/2022 | EUR | 99 915 | 102 993 | 0.17 |
| 100 000 | ALLERGAN FUNDING SCS 1.25% 01/06/2024 | EUR | 99 355 | 104 075 | 0.17 |
| 100 000 | ALLIANZ SE FRN 06/07/2047 | EUR | 100 012 | 113 987 | 0.18 |
| 200 000 | ALLIANZ SE FRN 07/07/2045 | EUR | 215 330 | 213 976 | 0.34 |
| 100 000 | ALLIANZ SE FRN PERPETUAL | EUR | 101 263 | 112 502 | 0.18 |
| 200 000 | ALSTOM SA 0.25% 14/10/2026 | EUR | 198 260 | 200 068 | 0.32 |
| 200 000 | AMERICA MOVIL SAB DE CV 0.75% 26/06/2027 | EUR | 199 490 | 205 280 | 0.33 |
| 200 000 | ANHEUSER-BUSCH INBEV NV 1.5% 18/04/2030 | EUR | 206 506 | 214 258 | 0.35 |
| 300 000 | APPLE INC 1.375% 24/05/2029 | EUR | 318 766 | 333 906 | 0.54 |
| 300 000 | APRR SA 1.125% 09/01/2026 | EUR | 310 783 | 320 286 | 0.52 |
| 300 000 | ARION BANKI HF 1.625% 01/12/2021 | EUR | 307 800 | 308 058 | 0.50 |
| 200 000 | AROUNDTOWN SA 1.45% 09/07/2028 | EUR | 205 880 | 207 150 | 0.33 |
| 200 000 | ATLAS COPCO FINANCE DAC 0.125% 03/09/2029 | EUR | 196 155 | 198 638 | 0.32 |
| 100 000 | AT&T INC 1.05% 05/09/2023 | EUR | 99 459 | 103 102 | 0.17 |
| 100 000 | AUSTRALIA & NEW ZEALAND BANKING GROUP LTD 0.75% 29/09/2026 | EUR | 99 540 | 104 854 | 0.17 |
| 100 000 | AUTOROUTES DU SUD DE LA FRANCE SA 1% 13/05/2026 | EUR | 98 899 | 105 820 | 0.17 |
| 100 000 | AUTOROUTES DU SUD DE LA FRANCE SA 1.125% 20/04/2026 | EUR | 99 711 | 106 653 | 0.17 |
| 100 000 | AVINOR AS 1.25% 09/02/2027 | EUR | 99 534 | 107 352 | 0.17 |
| 200 000 | AXA SA FRN 06/07/2047 | EUR | 230 210 | 229 020 | 0.37 |
| 200 000 | BACARDI LTD 2.75% 03/07/2023 | EUR | 215 290 | 215 640 | 0.35 |
| 300 000 | BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA SA 0.5% 14/01/2027 | EUR | 297 642 | 293 106 | 0.47 |
| 300 000 | BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA SA 1.125% 28/02/2024 | EUR | 302 265 | 307 872 | 0.50 |
| 300 000 | BANCO SANTANDER SA 3.125% 19/01/2027 | EUR | 326 470 | 336 099 | 0.54 |
| 300 000 | BANK OF AMERICA CORP FRN 09/05/2030 | EUR | 300 000 | 317 625 | 0.51 |
| 200 000 | BANK OF AMERICA CORP FRN 25/04/2028 | EUR | 205 066 | 215 514 | 0.35 |
| 200 000 | BANK OF AMERICA CORP 1.625% 14/09/2022 | EUR | 208 505 | 208 098 | 0.34 |
| 400 000 | BANK OF NOVA SCOTIA 0.5% 30/04/2024 | EUR | 401 057 | 405 224 | 0.65 |
| 100 000 | BANQUE FEDERATIVE DU CREDIT MUTUEL SA 1.25% 26/05/2027 | EUR | 99 256 | 107 380 | 0.17 |
| 100 000 | BANQUE FEDERATIVE DU CREDIT MUTUEL SA 1.625% 15/11/2027 | EUR | 99 143 | 105 525 | 0.17 |
| 100 000 | BANQUE FEDERATIVE DU CREDIT MUTUEL SA 2.375% 24/03/2026 | EUR | 99 098 | 109 628 | 0.18 |
| 100 000 | BANQUE FEDERATIVE DU CREDIT MUTUEL SA 2.625% 18/03/2024 | EUR | 110 271 | 110 293 | 0.18 |
| 500 000 | BERKSHIRE HATHAWAY INC 2.15% 15/03/2028 | EUR | 554 955 | 570 710 | 0.92 |

# Swiss Life Funds (LUX) Bond Euro Corporates

## Anlagenübersicht (Fortsetzung)

| Nominalwert/ Menge | Bezeichnung | Kurs Währung | Kosten EUR | Marktwert EUR | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| **Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumenten, die an einer amtlichen Börse zugelassen sind oder auf einem anderen geregelten Markt gehandelt werden (Fortsetzung)** | | | | | |
| | **Anleihen (Fortsetzung)** | | | | |
| 500 000 | BHP BILLITON FINANCE LTD FRN 22/04/2076 | EUR | 535 646 | 523 550 | 0.84 |
| 500 000 | BLACKSTONE PROPERTY PARTNERS EUROPE HOLDINGS SARL 0.5% 12/09/2023 | EUR | 499 882 | 503 954 | 0.81 |
| 100 000 | BNP PARIBAS CARDIF SA FRN PERPETUAL | EUR | 100 000 | 110 836 | 0.18 |
| 100 000 | BNP PARIBAS SA FRN 20/03/2026 | EUR | 99 308 | 102 487 | 0.17 |
| 300 000 | BNP PARIBAS SA 1.125% 10/10/2023 | EUR | 305 880 | 309 375 | 0.50 |
| 100 000 | BNP PARIBAS SA 1.125% 11/06/2026 | EUR | 99 484 | 103 626 | 0.17 |
| 100 000 | BNP PARIBAS SA 1.5% 17/11/2025 | EUR | 99 963 | 105 851 | 0.17 |
| 100 000 | BNP PARIBAS SA 2.75% 27/01/2026 | EUR | 111 405 | 110 680 | 0.18 |
| 100 000 | BNP PARIBAS SA 2.875% 01/10/2026 | EUR | 99 947 | 112 638 | 0.18 |
| 300 000 | BP CAPITAL MARKETS PLC 1.637% 26/06/2029 | EUR | 318 130 | 329 298 | 0.53 |
| 100 000 | BPCE SA 0.375% 05/10/2023 | EUR | 99 904 | 101 399 | 0.16 |
| 200 000 | BPCE SA 1.125% 18/01/2023 | EUR | 205 770 | 205 284 | 0.33 |
| 100 000 | BPCE SA 2.875% 22/04/2026 | EUR | 98 968 | 113 322 | 0.18 |
| 100 000 | BRISA CONCESSAO RODOVIARIA SA - EMTN - 2.375% 10/05/2027 | EUR | 99 894 | 111 462 | 0.18 |
| 100 000 | BRISA CONCESSAO RODOVIARIA SA 1.875% 30/04/2025 | EUR | 99 083 | 106 974 | 0.17 |
| 200 000 | CADENT FINANCE PLC 0.625% 22/09/2024 | EUR | 198 498 | 204 582 | 0.33 |
| 100 000 | CAISSE FEDERALE DU CREDIT MUTUEL NORD EUROPE SCOFAV 2.125% 12/09/2026 | EUR | 98 997 | 105 015 | 0.17 |
| 200 000 | CAISSE NATIONALE DE REASSURANCE MUTUELLE AGRICOLE GROUPAMA 2.125% 16/09/2029 | EUR | 197 924 | 204 800 | 0.33 |
| 400 000 | CAIXABANK SA 0.625% 01/10/2024 | EUR | 398 161 | 398 700 | 0.64 |
| 100 000 | CAP GEMINI SA 2.5% 01/07/2023 | EUR | 99 857 | 107 664 | 0.17 |
| 300 000 | CARREFOUR SA 1% 17/05/2027 | EUR | 309 741 | 308 955 | 0.50 |
| 500 000 | CETIN FINANCE BV 1.423% 06/12/2021 | EUR | 514 230 | 512 575 | 0.83 |
| 500 000 | CEZ AS 0.875% 02/12/2026 | EUR | 501 176 | 509 440 | 0.82 |
| 100 000 | CHUBB INA HOLDINGS INC 1.4% 15/06/2031 | EUR | 99 508 | 105 950 | 0.17 |
| 100 000 | CIE FINANCIERE ET INDUSTRIELLE DES AUTOROUTES SA 1.125% 13/10/2027 | EUR | 106 725 | 108 031 | 0.17 |
| 100 000 | CITIGROUP INC 0.75% 26/10/2023 | EUR | 99 634 | 101 954 | 0.16 |
| 200 000 | COCA-COLA HBC FINANCE BV 0.625% 21/11/2029 | EUR | 198 192 | 200 036 | 0.32 |
| 100 000 | COENTREPRISE DE TRANSPORT D'ELECTRICITE SA 0.875% 29/09/2024 | EUR | 99 698 | 104 010 | 0.17 |
| 200 000 | COLGATE-PALMOLIVE CO 1.375% 06/03/2034 | EUR | 198 818 | 221 516 | 0.36 |
| 250 000 | COMCAST CORP 0.25% 20/05/2027 | EUR | 249 053 | 250 784 | 0.40 |
| 300 000 | COMMERZBANK AG 0.25% 16/09/2024 | EUR | 297 660 | 295 536 | 0.48 |
| 100 000 | COMMERZBANK AG 0.5% 28/08/2023 | EUR | 99 435 | 101 519 | 0.16 |
| 200 000 | COMMERZBANK AG 1.125% 19/09/2025 | EUR | 205 610 | 205 694 | 0.33 |
| 100 000 | COMMERZBANK AG 1.125% 24/05/2024 | EUR | 99 479 | 102 983 | 0.17 |
| 100 000 | COMMERZBANK AG 1.25% 23/10/2023 | EUR | 99 486 | 103 060 | 0.17 |
| 200 000 | COOPERATIEVE RABOBANK UA FRN 26/05/2026 | EUR | 207 386 | 205 282 | 0.33 |
| 100 000 | COOPERATIEVE RABOBANK UA 0.625% 27/02/2024 | EUR | 99 804 | 101 878 | 0.16 |
| 200 000 | CREDIT AGRICOLE SA 2.625% 17/03/2027 | EUR | 224 650 | 224 198 | 0.36 |
| 100 000 | CREDIT AGRICOLE SA/LONDON 1% 16/09/2024 | EUR | 99 994 | 104 302 | 0.17 |
| 100 000 | CREDIT AGRICOLE SA/LONDON 1.375% 13/03/2025 | EUR | 99 920 | 104 557 | 0.17 |
| 100 000 | CREDIT AGRICOLE SA/LONDON 1.75% 05/03/2029 | EUR | 99 212 | 109 106 | 0.18 |

# Swiss Life Funds (LUX) Bond Euro Corporates

## Anlagenübersicht (Fortsetzung)

| Nominalwert/ Menge | Bezeichnung | Kurs Währung | Kosten EUR | Marktwert EUR | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| **Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumenten, die an einer amtlichen Börse zugelassen sind oder auf einem anderen geregelten Markt gehandelt werden (Fortsetzung)** | | | | | |
| | **Anleihen (Fortsetzung)** | | | | |
| 100 000 | CREDIT AGRICOLE SA/LONDON 1.875% 20/12/2026 | EUR | 99 504 | 108 476 | 0.17 |
| 300 000 | DAIMLER INTERNATIONAL FINANCE BV 0.875% 09/04/2024 | EUR | 294 816 | 306 180 | 0.49 |
| 300 000 | DASSAULT SYSTEMES SE 0.125% 16/09/2026 | EUR | 298 584 | 301 329 | 0.49 |
| 200 000 | DEUTSCHE PFANDBRIEFBANK AG 0.75% 07/02/2023 | EUR | 201 474 | 203 918 | 0.33 |
| 100 000 | DIGITAL DUTCH FINCO BV 0.125% 15/10/2022 | EUR | 99 910 | 100 413 | 0.16 |
| 200 000 | DNB BANK ASA FRN 01/03/2027 | EUR | 205 610 | 203 928 | 0.33 |
| 600 000 | DNB BANK ASA 0.05% 14/11/2023 | EUR | 598 706 | 601 722 | 0.97 |
| 200 000 | DOW CHEMICAL CO 0.5% 15/03/2027 | EUR | 198 884 | 197 650 | 0.32 |
| 100 000 | EDP FINANCE BV 1.625% 26/01/2026 | EUR | 106 165 | 107 540 | 0.17 |
| 100 000 | EDP FINANCE BV 2% 22/04/2025 | EUR | 99 919 | 109 031 | 0.18 |
| 1 150 000 | ELECTRICITE DE FRANCE SA 8.75% 30/06/2022 | EUR | 242 536 | 209 869 | 0.34 |
| 200 000 | EMERSON ELECTRIC CO 0.375% 22/05/2024 | EUR | 201 066 | 203 256 | 0.33 |
| 200 000 | EMIRATES TELECOMMUNICATIONS GROUP CO PJSC 2.75% 18/06/2026 | EUR | 229 966 | 229 514 | 0.37 |
| 200 000 | ENBW ENERGIE BADEN-WUERTTEMBERG FRN 05/11/2079 | EUR | 200 000 | 198 604 | 0.32 |
| 100 000 | ENEL FINANCE INTERNATIONAL NV 0.375% 17/06/2027 | EUR | 99 257 | 100 105 | 0.16 |
| 100 000 | ENEL FINANCE INTERNATIONAL NV 1% 16/09/2024 | EUR | 99 001 | 104 190 | 0.17 |
| 100 000 | ENEL FINANCE INTERNATIONAL NV 1.5% 21/07/2025 | EUR | 98 565 | 107 157 | 0.17 |
| 100 000 | ENEL SPA FRN 24/05/2080 | EUR | 103 250 | 106 461 | 0.17 |
| 200 000 | ENEXIS HOLDING NV 0.75% 02/07/2031 | EUR | 201 732 | 210 796 | 0.34 |
| 400 000 | ENGIE SA FRN PERPETUAL | EUR | 400 053 | 398 560 | 0.64 |
| 200 000 | ENGIE SA 1.25% 24/10/2041 | EUR | 200 000 | 213 868 | 0.34 |
| 400 000 | ENI SPA 0.625% 19/09/2024 | EUR | 408 293 | 410 896 | 0.66 |
| 300 000 | ENI SPA 1.125% 19/09/2028 | EUR | 296 472 | 321 378 | 0.52 |
| 300 000 | ERSTE GROUP BANK AG FRN 10/06/2030 | EUR | 298 725 | 294 327 | 0.47 |
| 200 000 | ERSTE GROUP BANK AG 0.375% 16/04/2024 | EUR | 200 703 | 202 988 | 0.33 |
| 150 000 | ESSITY AB 0.5% 03/02/2030 | EUR | 148 809 | 150 572 | 0.24 |
| 100 000 | ESSITY AB 1.125% 27/03/2024 | EUR | 99 786 | 104 124 | 0.17 |
| 100 000 | EUROCLEAR BANK SA/NV 0.25% 07/09/2022 | EUR | 99 536 | 101 000 | 0.16 |
| 100 000 | EUROCLEAR INVESTMENTS SA 1.125% 07/12/2026 | EUR | 101 001 | 106 952 | 0.17 |
| 400 000 | EUROCLEAR INVESTMENTS SA 1.5% 11/04/2030 | EUR | 417 106 | 447 124 | 0.72 |
| 100 000 | EXPERIAN FINANCE PLC 1.375% 25/06/2026 | EUR | 99 847 | 106 915 | 0.17 |
| 400 000 | FASTIGHETS AB BALDER 1.25% 28/01/2028 | EUR | 400 640 | 404 648 | 0.65 |
| 100 000 | FCA BANK SPA/IRELAND 1% 15/11/2021 | EUR | 99 565 | 101 655 | 0.16 |
| 300 000 | FCA BANK SPA/IRELAND 1.25% 21/06/2022 | EUR | 307 515 | 307 302 | 0.49 |
| 100 000 | FCC AQUALIA SA 1.413% 08/06/2022 | EUR | 100 000 | 102 469 | 0.17 |
| 200 000 | FIDELITY NATIONAL INFORMATION SERVICES INC 0.75% 21/05/2023 | EUR | 201 814 | 204 114 | 0.33 |
| 100 000 | FISERV INC 1.625% 01/07/2030 | EUR | 99 412 | 106 772 | 0.17 |
| 100 000 | GAS NETWORKS IRELAND 1.375% 05/12/2026 | EUR | 99 537 | 108 588 | 0.17 |
| 300 000 | GLAXOSMITHKLINE CAPITAL PLC 1.375% 12/09/2029 | EUR | 328 875 | 330 168 | 0.53 |
| 300 000 | GLOBAL SWITCH HOLDINGS LTD 1.5% 31/01/2024 | EUR | 309 375 | 311 622 | 0.50 |
| 300 000 | GOLDMAN SACHS GROUP INC FRN 21/04/2023 | EUR | 300 000 | 300 066 | 0.48 |
| 200 000 | GOLDMAN SACHS GROUP INC 0.125% 19/08/2024 | EUR | 198 514 | 198 000 | 0.32 |
| 300 000 | GOLDMAN SACHS GROUP INC 0.875% 21/01/2030 | EUR | 296 562 | 299 035 | 0.48 |
| 200 000 | GOLDMAN SACHS GROUP INC 1.625% 27/07/2026 | EUR | 216 364 | 212 794 | 0.34 |

# Swiss Life Funds (LUX) Bond Euro Corporates

## Anlagenübersicht (Fortsetzung)

| Nominalwert/ Menge | Bezeichnung | Kurs Währung | Kosten EUR | Marktwert EUR | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| **Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumenten, die an einer amtlichen Börse zugelassen sind oder auf einem anderen geregelten Markt gehandelt werden (Fortsetzung)** | | | | | |
| | **Anleihen (Fortsetzung)** | | | | |
| 100 000 | HEIDELBERGCEMENT AG 1.5% 07/02/2025 | EUR | 98 529 | 105 103 | 0.17 |
| 100 000 | HEIDELBERGCEMENT FINANCE LUXEMBOURG SA 0.5% 09/08/2022 | EUR | 99 335 | 100 967 | 0.16 |
| 200 000 | HERA SPA 0.875% 05/07/2027 | EUR | 200 872 | 209 201 | 0.34 |
| 200 000 | HITACHI CAPITAL UK PLC 0.125% 29/11/2022 | EUR | 199 748 | 200 314 | 0.32 |
| 100 000 | ICADE SANTE SAS 0.875% 04/11/2029 | EUR | 99 392 | 101 213 | 0.16 |
| 100 000 | IE2 HOLDCO SAU 2.875% 01/06/2026 | EUR | 99 786 | 112 992 | 0.18 |
| 200 000 | ILLINOIS TOOL WORKS INC 0.25% 05/12/2024 | EUR | 199 324 | 202 416 | 0.33 |
| 200 000 | ILLINOIS TOOL WORKS INC 3% 19/05/2034 | EUR | 258 356 | 267 110 | 0.43 |
| 100 000 | IMPERIAL BRANDS FINANCE PLC 1.375% 27/01/2025 | EUR | 99 617 | 103 366 | 0.17 |
| 100 000 | INMOBILIARIA COLONIAL SA 2.728% 05/06/2023 | EUR | 100 000 | 109 041 | 0.18 |
| 200 000 | INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI SA 1.45% 28/10/2024 | EUR | 209 550 | 210 906 | 0.34 |
| 100 000 | INNOGY FINANCE BV 1.25% 19/10/2027 | EUR | 106 291 | 108 008 | 0.17 |
| 100 000 | INTERNATIONAL BUSINESS MACHINES CORP 0.375% 31/01/2023 | EUR | 101 164 | 101 414 | 0.16 |
| 100 000 | INTERNATIONAL BUSINESS MACHINES CORP 0.95% 23/05/2025 | EUR | 99 831 | 104 726 | 0.17 |
| 200 000 | JAB HOLDINGS BV 1% 20/12/2027 | EUR | 200 261 | 203 761 | 0.33 |
| 800 000 | JOHNSON & JOHNSON 1.15% 20/11/2028 | EUR | 874 159 | 868 416 | 1.39 |
| 200 000 | JPMORGAN CHASE & CO FRN 04/11/2032 | EUR | 200 000 | 202 438 | 0.33 |
| 500 000 | JPMORGAN CHASE & CO FRN 24/02/2028 | EUR | 500 000 | 492 945 | 0.79 |
| 200 000 | JPMORGAN CHASE & CO FRN 25/07/2031 | EUR | 200 000 | 203 636 | 0.33 |
| 200 000 | JPMORGAN CHASE & CO 0.625% 25/01/2024 | EUR | 196 666 | 203 140 | 0.33 |
| 400 000 | JT INTERNATIONAL FINANCIAL SERVICES BV 1.125% 28/09/2025 | EUR | 406 822 | 419 308 | 0.68 |
| 100 000 | KBC GROUP NV FRN 18/09/2029 | EUR | 102 554 | 103 446 | 0.17 |
| 200 000 | KBC GROUP NV 0.75% 18/10/2023 | EUR | 204 190 | 204 022 | 0.33 |
| 200 000 | KBC GROUP NV 1.125% 25/01/2024 | EUR | 199 700 | 206 674 | 0.33 |
| 100 000 | KELLOGG CO 1% 17/05/2024 | EUR | 99 459 | 103 617 | 0.17 |
| 200 000 | KELLOGG CO 1.25% 10/03/2025 | EUR | 209 610 | 210 386 | 0.34 |
| 100 000 | LA BANQUE POSTALE SA 1% 16/10/2024 | EUR | 99 892 | 102 901 | 0.17 |
| 600 000 | LANDESBANK BADEN-WUERTTEMBERG 0.375% 18/02/2027 | EUR | 599 544 | 596 214 | 0.96 |
| 400 000 | LANDSBANKINN HF 0.5% 20/05/2024 | EUR | 399 584 | 399 700 | 0.64 |
| 100 000 | LANDSBANKINN HF 1.625% 15/03/2021 | EUR | 102 211 | 101 703 | 0.16 |
| 300 000 | LLOYDS BANK CORPORATE MARKETS PLC 0.25% 04/10/2022 | EUR | 300 215 | 301 566 | 0.49 |
| 400 000 | LLOYDS BANKING GROUP PLC FRN 12/11/2025 | EUR | 397 845 | 397 958 | 0.64 |
| 200 000 | LUNAR FUNDING V FOR SWISSCOM AG 1.125% 12/10/2026 | EUR | 202 926 | 214 866 | 0.35 |
| 800 000 | LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE 0% 11/02/2026 | EUR | 796 744 | 796 688 | 1.28 |
| 400 000 | LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE 0.375% 11/02/2031 | EUR | 396 832 | 395 360 | 0.64 |
| 100 000 | MCDONALD'S CORP 0.625% 29/01/2024 | EUR | 99 832 | 102 395 | 0.16 |
| 300 000 | MEDIOBANCA BANCA DI CREDITO FINANZIARIO SPA 1.125% 15/07/2025 | EUR | 301 137 | 306 354 | 0.49 |
| 200 000 | MERCK KGAA FRN 25/06/2079 | EUR | 202 321 | 201 980 | 0.33 |
| 100 000 | MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA 1.75% 26/05/2025 | EUR | 99 417 | 106 988 | 0.17 |
| 200 000 | MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA 1.875% 02/11/2026 | EUR | 213 930 | 216 172 | 0.35 |
| 200 000 | METROPOLITAN LIFE GLOBAL FUNDING I 2.375% 11/01/2023 | EUR | 214 378 | 213 132 | 0.34 |
| 200 000 | MITSUBISHI UFJ FINANCIAL GROUP INC 0.68% 26/01/2023 | EUR | 199 236 | 203 730 | 0.33 |
| 600 000 | MIZUHO FINANCIAL GROUP INC 0.118% 06/09/2024 | EUR | 598 230 | 597 972 | 0.96 |
| 100 000 | MIZUHO FINANCIAL GROUP INC 0.956% 16/10/2024 | EUR | 103 107 | 103 481 | 0.17 |

# Swiss Life Funds (LUX) Bond Euro Corporates

## Anlagenübersicht (Fortsetzung)

| Nominalwert/ Menge | Bezeichnung | Kurs Währung | Kosten EUR | Marktwert EUR | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| **Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumenten, die an einer amtlichen Börse zugelassen sind oder auf einem anderen geregelten Markt gehandelt werden (Fortsetzung)** | | | | | |
| | **Anleihen (Fortsetzung)** | | | | |
| 300 000 | MOODY'S CORP 0.95% 25/02/2030 | EUR | 303 292 | 311 411 | 0.50 |
| 300 000 | MORGAN STANLEY FRN 26/07/2024 | EUR | 301 373 | 303 615 | 0.49 |
| 300 000 | MORGAN STANLEY 1.75% 11/03/2024 | EUR | 307 482 | 318 399 | 0.51 |
| 200 000 | MORGAN STANLEY 1.875% 30/03/2023 | EUR | 211 172 | 210 902 | 0.34 |
| 400 000 | MOTABILITY OPERATIONS GROUP PLC 0.375% 03/01/2026 | EUR | 399 635 | 404 748 | 0.65 |
| 100 000 | NASDAQ INC 1.75% 28/03/2029 | EUR | 99 610 | 109 496 | 0.18 |
| 200 000 | NASDAQ INC 3.875% 07/06/2021 | EUR | 210 890 | 210 118 | 0.34 |
| 300 000 | NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD 1.25% 18/05/2026 | EUR | 302 151 | 321 831 | 0.52 |
| 300 000 | NIDEC CORP 0.487% 27/09/2021 | EUR | 301 285 | 302 283 | 0.49 |
| 300 000 | NORDEA BANK ABP 0.875% 26/06/2023 | EUR | 299 679 | 307 110 | 0.49 |
| 100 000 | NYKREDIT REALKREDIT A/S 0.125% 10/07/2024 | EUR | 99 634 | 98 576 | 0.16 |
| 500 000 | NYKREDIT REALKREDIT A/S 0.875% 17/01/2024 | EUR | 505 121 | 509 480 | 0.82 |
| 600 000 | OMV AG FRN PERPETUAL | EUR | 650 400 | 645 168 | 1.04 |
| 100 000 | ORANGE SA 1% 12/05/2025 | EUR | 98 953 | 104 545 | 0.17 |
| 100 000 | ORLEN CAPITAL AB 2.5% 30/06/2021 | EUR | 99 135 | 103 106 | 0.17 |
| 400 000 | PERNOD RICARD SA 0.5% 24/10/2027 | EUR | 405 075 | 405 820 | 0.65 |
| 200 000 | PHILIP MORRIS INTERNATIONAL INC 2.875% 14/05/2029 | EUR | 217 228 | 237 608 | 0.38 |
| 200 000 | POSTNL NV 1% 21/11/2024 | EUR | 202 972 | 207 920 | 0.33 |
| 300 000 | PROSEGUR CASH SA 1.375% 04/02/2026 | EUR | 309 208 | 309 225 | 0.50 |
| 300 000 | RAI-RADIOTELEVISIONE ITALIANA SPA 1.375% 04/12/2024 | EUR | 301 733 | 309 024 | 0.50 |
| 300 000 | ROYAL BANK OF CANADA 0.125% 23/07/2024 | EUR | 300 239 | 300 102 | 0.48 |
| 100 000 | RTE RESEAU DE TRANSPORT D'ELECTRICITE SADIR 2.75% 20/06/2029 | EUR | 98 913 | 123 597 | 0.20 |
| 300 000 | SAMHALLSBYGGNADSBOLAGET I NORDEN AB 1.125% 04/09/2026 | EUR | 298 075 | 305 597 | 0.49 |
| 200 000 | SANEF SA 0.95% 19/10/2028 | EUR | 193 745 | 201 480 | 0.32 |
| 200 000 | SANOFI 1% 21/03/2026 | EUR | 211 928 | 212 636 | 0.34 |
| 600 000 | SANTANDER CONSUMER BANK AG 0.25% 15/10/2024 | EUR | 599 710 | 603 510 | 0.97 |
| 100 000 | SANTANDER CONSUMER BANK AS 0.125% 11/09/2024 | EUR | 99 871 | 99 823 | 0.16 |
| 100 000 | SANTANDER CONSUMER FINANCE SA 1% 27/02/2024 | EUR | 99 555 | 103 149 | 0.17 |
| 200 000 | SANTANDER UK GROUP HOLDINGS PLC FRN 18/05/2023 | EUR | 200 000 | 201 036 | 0.32 |
| 500 000 | SANTANDER UK GROUP HOLDINGS PLC FRN 28/02/2025 | EUR | 500 000 | 496 505 | 0.80 |
| 300 000 | SAP SE 1.625% 10/03/2031 | EUR | 305 667 | 341 418 | 0.55 |
| 100 000 | SECURITAS AB 1.125% 20/02/2024 | EUR | 99 753 | 103 677 | 0.17 |
| 200 000 | SHELL INTERNATIONAL FINANCE BV 1.25% 12/05/2028 | EUR | 202 320 | 216 946 | 0.35 |
| 200 000 | SIEMENS FINANCIERINGSMAATSCHAPPIJ NV 1.25% 28/02/2031 | EUR | 207 118 | 216 588 | 0.35 |
| 100 000 | SNAM SPA 0.875% 25/10/2026 | EUR | 99 506 | 104 149 | 0.17 |
| 100 000 | SOCIETE GENERALE SA 0.5% 13/01/2023 | EUR | 99 604 | 100 743 | 0.16 |
| 100 000 | SOCIETE GENERALE SA 2.625% 27/02/2025 | EUR | 93 077 | 108 725 | 0.18 |
| 200 000 | SOUTHERN POWER CO 1% 20/06/2022 | EUR | 204 514 | 204 529 | 0.33 |
| 200 000 | STRYKER CORP 1% 03/12/2031 | EUR | 198 342 | 203 238 | 0.33 |
| 100 000 | STRYKER CORP 1.125% 30/11/2023 | EUR | 101 800 | 103 899 | 0.17 |
| 500 000 | SUEZ ENVIRONNEMENT CO FRN PERPETUAL | EUR | 513 940 | 514 265 | 0.83 |
| 100 000 | SUMITOMO MITSUI FINANCIAL GROUP INC 0.934% 11/10/2024 | EUR | 102 885 | 103 349 | 0.17 |
| 200 000 | SVENSKA HANDELSBANKEN AB 0.05% 03/09/2026 | EUR | 199 610 | 195 824 | 0.32 |
| 300 000 | SWEDBANK AB FRN 18/09/2028 | EUR | 295 578 | 306 981 | 0.49 |

# Swiss Life Funds (LUX) Bond Euro Corporates

## Anlagenübersicht (Fortsetzung)

| Nominalwert/ Menge | Bezeichnung | Kurs Währung | Kosten EUR | Marktwert EUR | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| **Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumenten, die an einer amtlichen Börse zugelassen sind oder auf einem anderen geregelten Markt gehandelt werden (Fortsetzung)** | | | | | |
| | **Anleihen (Fortsetzung)** | | | | |
| 200 000 | TALENT YIELD EURO LTD 1.435% 07/05/2020 | EUR | 202 144 | 200 348 | 0.32 |
| 100 000 | TELEFONICA EMISIONES SA 1.715% 12/01/2028 | EUR | 100 003 | 110 337 | 0.18 |
| 100 000 | TELEFONICA EMISIONES SA 1.93% 17/10/2031 | EUR | 100 000 | 113 229 | 0.18 |
| 600 000 | TELENOR ASA 0.25% 14/02/2028 | EUR | 598 530 | 602 136 | 0.97 |
| 200 000 | TERNA RETE ELETTRICA NAZIONALE SPA 0.125% 25/07/2025 | EUR | 198 674 | 200 626 | 0.32 |
| 100 000 | TOTAL CAPITAL INTERNATIONAL SA 0.75% 12/07/2028 | EUR | 96 193 | 104 541 | 0.17 |
| 300 000 | TOTAL SA FRN PERPETUAL | EUR | 303 707 | 305 457 | 0.49 |
| 300 000 | TOTAL SA FRN PERPETUAL | EUR | 316 200 | 319 128 | 0.51 |
| 500 000 | TOYOTA FINANCE AUSTRALIA LTD 0.25% 09/04/2024 | EUR | 501 755 | 506 090 | 0.81 |
| 600 000 | TOYOTA MOTOR CREDIT CORP 0.25% 16/07/2026 | EUR | 604 199 | 601 278 | 0.97 |
| 300 000 | UBS GROUP AG 1.5% 30/11/2024 | EUR | 301 506 | 313 044 | 0.50 |
| 400 000 | UBS GROUP FUNDING JERSEY LTD 2.125% 04/03/2024 | EUR | 431 542 | 429 204 | 0.69 |
| 100 000 | UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD SE 1.5% 29/05/2029 | EUR | 99 826 | 108 452 | 0.17 |
| 300 000 | UNILEVER NV 1% 14/02/2027 | EUR | 318 345 | 321 108 | 0.52 |
| 200 000 | UNITED PARCEL SERVICE INC 0.375% 15/11/2023 | EUR | 200 743 | 203 340 | 0.33 |
| 100 000 | UNITED PARCEL SERVICE INC 1% 15/11/2028 | EUR | 99 853 | 106 263 | 0.17 |
| 100 000 | VATTENFALL AB 0.5% 24/06/2026 | EUR | 99 637 | 102 678 | 0.17 |
| 200 000 | VEOLIA ENVIRONNEMENT SA 0.927% 04/01/2029 | EUR | 193 161 | 211 930 | 0.34 |
| 350 000 | VERIZON COMMUNICATIONS INC 0.875% 02/04/2025 | EUR | 352 174 | 363 398 | 0.59 |
| 200 000 | VERIZON COMMUNICATIONS INC 1.375% 02/11/2028 | EUR | 213 650 | 215 168 | 0.35 |
| 100 000 | VODAFONE GROUP PLC 0.5% 30/01/2024 | EUR | 99 221 | 101 953 | 0.16 |
| 200 000 | VODAFONE GROUP PLC 2.2% 25/08/2026 | EUR | 221 760 | 225 554 | 0.36 |
| 300 000 | VOLKSWAGEN FINANCIAL SERVICES AG 0.625% 01/04/2022 | EUR | 300 381 | 302 700 | 0.49 |
| 100 000 | VOLKSWAGEN INTERNATIONAL FINANCE NV 1.125% 02/10/2023 | EUR | 99 169 | 102 468 | 0.17 |
| 100 000 | VONOVIA FINANCE BV 1.25% 06/12/2024 | EUR | 104 610 | 104 973 | 0.17 |
| 300 000 | WENDEL SA 1.375% 26/04/2026 | EUR | 304 367 | 315 438 | 0.51 |
| 100 000 | WESTPAC BANKING CORP 1.125% 05/09/2027 | EUR | 105 143 | 106 762 | 0.17 |
| 100 000 | XYLEM INC/NY 2.25% 11/03/2023 | EUR | 98 905 | 105 742 | 0.17 |
| | **Gesamtsumme der Anleihen** | | **54 741 246** | **55 803 988** | **89.86** |
| | **Supranationale Institutionen, Regierungen und örtliche Behörden, Schuldtitel** | | | | |
| 300 000 | CORP ANDINA DE FOMENTO 0.625% 20/11/2026 | EUR | 299 550 | 306 141 | 0.49 |
| | **Summe supranationale Institutionen, Regierungen und örtliche Behörden, Schuldtitel** | | **299 550** | **306 141** | **0.49** |
| | **Gesamtsumme übertragbarer Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer amtlichen Börse zugelassen sind oder auf einem anderen geregelten Markt gehandelt werden** | | **55 040 796** | **56 110 129** | **90.35** |
| | **Gesamtsumme der Anlagen** | | **55 040 796** | **56 110 129** | **90.35** |

# Swiss Life Funds (LUX) Bond Euro Corporates

## Sektorstruktur und geographische Verteilung der Anlagen

| Sektorstruktur | % |
|---|---|
| Banken | 26.75 |
| Finanzdienstleistungen | 22.86 |
| Gas-, Wasser- und Mehrfachversorgungsunternehmen | 3.49 |
| Industrietransport | 3.36 |
| Öl- und Gasproduzenten | 3.22 |
| Persönliche Güter | 3.20 |
| Elektrizität | 2.64 |
| Pharmazeutik und Biotechnologie | 2.58 |
| Mobilfunk | 2.56 |
| Versicherungen (ohne Lebensversicherung) | 2.51 |
| Software- und Computerdienstleistungen | 2.04 |
| Immobilienbezogene Anlagefonds | 1.86 |
| Getränke | 1.35 |
| Geräte und Dienstleistungen im Gesundheitswesen | 1.30 |
| Festnetz-Telekommunikation | 1.27 |
| Industrietechnik | 1.25 |
| Immobilienbezogene Dienstleistungen und Investitionen | 1.16 |
| Allgemeiner Einzelhandel | 0.98 |
| Medien | 0.90 |
| Elektronische und elektrische Geräte | 0.81 |
| Kundenbetreuung | 0.66 |
| Chemikalien | 0.65 |
| Technologie Hardware und Geräte | 0.54 |
| Lebensmittelhersteller | 0.51 |
| Lebensmittel- und Arzneimittelhandel | 0.50 |
| Behörden | 0.49 |
| Tabak | 0.38 |
| Alternative Energie | 0.20 |
| Bauwirtschaft und Baustoffe | 0.17 |
| Reise, Freizeit und Catering | 0.16 |
| | **90.35** |

| Geographische Verteilung | % |
|---|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika | 18.93 |
| Frankreich | 16.43 |
| Niederlande | 7.75 |
| Deutschland | 6.12 |
| Großbritannien | 5.99 |
| Spanien | 5.21 |
| Italien | 3.66 |
| Schweden | 2.86 |
| Norwegen | 2.60 |
| Australien | 2.52 |
| Luxemburg | 2.37 |
| Japan | 2.11 |
| Irland | 1.98 |
| Österreich | 1.84 |
| Belgien | 1.34 |
| Island | 1.30 |
| Schweiz | 1.20 |
| Kanada | 1.14 |
| Dänemark | 0.98 |
| Britisch Virgin Islands | 0.82 |
| Tschechische Republik | 0.82 |
| Finnland | 0.49 |
| Panama | 0.49 |
| Vereinigte Arabische Emirate | 0.37 |
| Bermuda | 0.35 |
| Portugal | 0.35 |
| Mexiko | 0.33 |
| | **90.35** |

# Swiss Life Funds (LUX) Bond Global Corporates

## Anlagenübersicht

| Nominalwert/ Menge | Bezeichnung | Kurs Währung | Kosten EUR | Marktwert EUR | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| **Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumenten, die an einer amtlichen Börse zugelassen sind oder auf einem anderen geregelten Markt gehandelt werden** | | | | | |
| | **Anleihen** | | | | |
| 700 000 | KEURIG DR PEPPER SNAPPLE GROUP INC 3.4% 15/11/2025 | USD | 626 756 | 685 802 | 0.33 |
| 400 000 | ABBOTT LABORATORIES 4.9% 30/11/2046 | USD | 477 117 | 504 398 | 0.25 |
| 1 100 000 | ABBVIE INC - 144A - 2.95% 21/11/2026 | USD | 997 676 | 1 047 125 | 0.51 |
| 600 000 | ABBVIE INC - 144A - 4.25% 21/11/2049 | USD | 542 454 | 617 575 | 0.30 |
| 500 000 | ABBVIE INC 4.875% 14/11/2048 | USD | 465 071 | 560 065 | 0.27 |
| 200 000 | ABERTIS INFRAESTRUCTURAS SA 1.5% 27/06/2024 | EUR | 199 822 | 205 778 | 0.10 |
| 700 000 | ABERTIS INFRAESTRUCTURAS SA 3% 27/03/2031 | EUR | 718 608 | 782 943 | 0.38 |
| 200 000 | ABN AMRO BANK NV FRN 27/03/2028 | USD | 189 677 | 192 233 | 0.09 |
| 400 000 | ABU DHABI NATIONAL ENERGY CO PJSC - REGS - 4% 03/10/2049 | USD | 365 581 | 405 025 | 0.20 |
| 200 000 | ACTIVISION BLIZZARD INC 2.3% 15/09/2021 | USD | 175 226 | 183 997 | 0.09 |
| 100 000 | AEGON BANK NV 0.625% 21/06/2024 | EUR | 99 491 | 101 780 | 0.05 |
| 400 000 | ALCON FINANCE CORP 3.8% 23/09/2049 | USD | 363 072 | 403 066 | 0.20 |
| 400 000 | ALD SA - REGS - 0.375% 18/07/2023 | EUR | 398 624 | 397 712 | 0.19 |
| 300 000 | ALIMENTATION COUCHE-TARD INC 2.95% 25/01/2030 | USD | 270 543 | 281 450 | 0.14 |
| 600 000 | ALIMENTATION COUCHE-TARD INC 3.8% 25/01/2050 | USD | 539 618 | 548 830 | 0.27 |
| 1 000 000 | ALLIANZ SE 5.5% PERPETUAL | USD | 746 523 | 919 987 | 0.45 |
| 500 000 | ALSTOM SA 0.25% 14/10/2026 | EUR | 497 960 | 500 170 | 0.24 |
| 900 000 | ALTAGAS LTD 4.4% 15/03/2024 | CAD | 625 012 | 658 090 | 0.32 |
| 200 000 | ALTRIA GROUP INC 5.95% 14/02/2049 | USD | 202 523 | 229 569 | 0.11 |
| 500 000 | AMAZON.COM INC 4.8% 05/12/2034 | USD | 399 819 | 599 982 | 0.29 |
| 900 000 | AMERICA MOVIL SAB DE CV FRN 06/09/2073 | GBP | 1 073 859 | 1 068 341 | 0.52 |
| 400 000 | AMERICA MOVIL SAB DE CV 3.625% 22/04/2029 | USD | 351 308 | 404 075 | 0.20 |
| 700 000 | AMERICAN EXPRESS CREDIT CORP 3.3% 03/05/2027 | USD | 626 762 | 695 323 | 0.34 |
| 950 000 | AMERICAN TOWER CORP 3.125% 15/01/2027 | USD | 833 979 | 910 848 | 0.44 |
| 1 000 000 | AMGEN INC 2.45% 21/02/2030 | USD | 923 635 | 922 418 | 0.45 |
| 750 000 | AMGEN INC 2.65% 11/05/2022 | USD | 671 097 | 698 368 | 0.34 |
| 500 000 | ANALOG DEVICES INC 3.5% 05/12/2026 | USD | 461 024 | 494 911 | 0.24 |
| 200 000 | ANGLO AMERICAN CAPITAL PLC - 144A - 4% 11/09/2027 | USD | 186 084 | 195 204 | 0.10 |
| 650 000 | ANHEUSER-BUSCH COS LLC / ANHEUSER-BUSCH INBEV WORLDWIDE INC 4.9% 01/02/2046 | USD | 605 280 | 729 529 | 0.36 |
| 200 000 | ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV 1.15% 22/01/2027 | EUR | 210 397 | 209 478 | 0.10 |
| 200 000 | ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV 1.65% 28/03/2031 | EUR | 211 560 | 216 284 | 0.11 |
| 600 000 | AQUARIUS & INVESTMENTS PLC FOR ZURICH INSURANCE CO LTD FRN 02/10/2043 | EUR | 611 645 | 677 484 | 0.33 |
| 400 000 | ASTRAZENECA PLC 3.125% 12/06/2027 | USD | 349 885 | 390 660 | 0.19 |
| 300 000 | ATLAS COPCO FINANCE DAC 0.125% 03/09/2029 | EUR | 297 360 | 297 957 | 0.15 |
| 200 000 | AT&T INC 3.15% 04/09/2036 | EUR | 235 710 | 242 462 | 0.12 |
| 1 250 000 | AT&T INC 4.3% 15/02/2030 | USD | 1 088 676 | 1 302 644 | 0.64 |
| 1 050 000 | AT&T INC 5.15% 15/02/2050 | USD | 1 035 922 | 1 186 700 | 0.58 |
| 100 000 | AUCHAN HOLDING SADIR 2.375% 25/04/2025 | EUR | 99 448 | 102 834 | 0.05 |
| 700 000 | AXA SA FRN 17/01/2047 | USD | 615 234 | 701 695 | 0.34 |
| 400 000 | BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA SA FRN 16/01/2030 | EUR | 397 564 | 387 068 | 0.19 |
| 800 000 | BANCO DEL ESTADO DE CHILE 2.704% 09/01/2025 | USD | 714 956 | 735 800 | 0.36 |
| 850 000 | BANCO SANTANDER CHILE 2.7% 10/01/2025 | USD | 762 913 | 781 239 | 0.38 |
| 600 000 | BANCO SANTANDER SA 3.5% 11/04/2022 | USD | 548 476 | 565 435 | 0.28 |

# Swiss Life Funds (LUX) Bond Global Corporates

## Anlagenübersicht (Fortsetzung)

| Nominalwert/ Menge | Bezeichnung | Kurs Währung | Kosten EUR | Marktwert EUR | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| **Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumenten, die an einer amtlichen Börse zugelassen sind oder auf einem anderen geregelten Markt gehandelt werden (Fortsetzung)** | | | | | |
| | **Anleihen (Fortsetzung)** | | | | |
| 1 400 000 | BANK OF AMERICA CORP FRN 01/10/2025 | USD | 1 179 561 | 1 342 264 | 0.65 |
| 650 000 | BANK OF AMERICA CORP FRN 07/02/2025 | EUR | 652 370 | 678 041 | 0.33 |
| 600 000 | BANK OF NEW YORK MELLON CORP 2.45% 17/08/2026 | USD | 529 596 | 571 733 | 0.28 |
| 800 000 | BANK OF NEW YORK MELLON CORP 3.85% 28/04/2028 | USD | 653 184 | 835 570 | 0.41 |
| 1 000 000 | BANK OF NOVA SCOTIA 2.29% 28/06/2024 | CAD | 650 685 | 692 798 | 0.34 |
| 800 000 | BANQUE FEDERATIVE DU CREDIT MUTUEL SA 2.5% 25/05/2028 | EUR | 799 088 | 900 824 | 0.44 |
| 700 000 | BARCLAYS PLC 3.2% 10/08/2021 | USD | 620 261 | 648 324 | 0.32 |
| 1 700 000 | BAT CAPITAL CORP 1.125% 16/11/2023 | EUR | 1 752 460 | 1 746 546 | 0.86 |
| 1 000 000 | BAT CAPITAL CORP 3.557% 15/08/2027 | USD | 853 771 | 963 667 | 0.47 |
| 950 000 | BAT CAPITAL CORP 4.54% 15/08/2047 | USD | 814 499 | 900 234 | 0.44 |
| 900 000 | BAYER US FINANCE II LLC - 144A - 4.25% 15/12/2025 | USD | 773 496 | 912 880 | 0.45 |
| 400 000 | BAYER US FINANCE II LLC - 144A - 4.625% 25/06/2038 | USD | 339 040 | 439 241 | 0.21 |
| 650 000 | BEAM SUNTORY INC 3.25% 15/06/2023 | USD | 457 107 | 615 602 | 0.30 |
| 500 000 | BERKSHIRE HATHAWAY FINANCE CORP 2.375% 19/06/2039 | GBP | 553 192 | 632 967 | 0.31 |
| 600 000 | BERKSHIRE HATHAWAY FINANCE CORP 4.25% 15/01/2049 | USD | 605 234 | 672 031 | 0.33 |
| 100 000 000 | BERKSHIRE HATHAWAY INC 1.108% 13/09/2049 | JPY | 845 876 | 886 125 | 0.43 |
| 800 000 | BLACKROCK INC 3.25% 30/04/2029 | USD | 702 075 | 801 580 | 0.39 |
| 1 400 000 | BLACKSTONE PROPERTY PARTNERS EUROPE HOLDINGS SARL 0.5% 12/09/2023 | EUR | 1 398 866 | 1 411 071 | 0.69 |
| 300 000 | BNP PARIBAS SA - REGS - 2.95% 23/05/2022 | USD | 270 334 | 280 773 | 0.14 |
| 200 000 | BNP PARIBAS SA FRN 23/01/2027 | EUR | 218 110 | 217 656 | 0.11 |
| 1 500 000 | BNP PARIBAS SA 1.125% 11/06/2026 | EUR | 1 492 260 | 1 554 390 | 0.76 |
| 1 900 000 | BPCE SA - 144A - 3.25% 11/01/2028 | USD | 1 569 323 | 1 852 313 | 0.91 |
| 700 000 | BPCE SA - 144A - 4.875% 01/04/2026 | USD | 623 871 | 717 518 | 0.35 |
| 500 000 | BPCE SA FRN 31/05/2022 | USD | 444 936 | 460 403 | 0.22 |
| 50 000 | BRISTOL-MYERS SQUIBB CO - 144A - 4.25% 26/10/2049 | USD | 44 314 | 58 223 | 0.03 |
| 1 300 000 | BRISTOL-MYERS SQUIBB CO - 144A - 4.55% 20/02/2048 | USD | 1 054 212 | 1 547 468 | 0.75 |
| 1 500 000 | BRISTOL-MYERS SQUIBB CO 4.35% 15/11/2047 | USD | 1 284 171 | 1 745 215 | 0.85 |
| 700 000 | BURLINGTON NORTHERN SANTA FE LLC 4.15% 15/12/2048 | USD | 595 163 | 775 719 | 0.38 |
| 850 000 | BURLINGTON NORTHERN SANTA FE LLC 4.4% 15/03/2042 | USD | 696 998 | 952 461 | 0.46 |
| 1 100 000 | CAIXABANK SA 0.625% 01/10/2024 | EUR | 1 092 454 | 1 096 425 | 0.53 |
| 400 000 | CAMPBELL SOUP CO 4.8% 15/03/2048 | USD | 323 179 | 442 726 | 0.22 |
| 1 000 000 | CANADIAN NATURAL RESOURCES LTD 3.42% 01/12/2026 | CAD | 660 959 | 710 621 | 0.35 |
| 500 000 | CAPITAL ONE FINANCIAL CORP 0.8% 12/06/2024 | EUR | 499 705 | 510 690 | 0.25 |
| 1 000 000 | CBOE GLOBAL MARKETS INC 3.65% 12/01/2027 | USD | 916 168 | 1 007 693 | 0.49 |
| 1 500 000 | CBS CORP 2.9% 01/06/2023 | USD | 1 274 752 | 1 418 667 | 0.69 |
| 800 000 | CETIN FINANCE BV 1.423% 06/12/2021 | EUR | 812 466 | 820 120 | 0.40 |
| 600 000 | CEZ AS 0.875% 02/12/2026 | EUR | 594 756 | 611 328 | 0.30 |
| 1 700 000 | CEZ AS 5% 19/10/2021 | EUR | 1 903 830 | 1 838 584 | 0.91 |
| 750 000 | CHEVRON PHILLIPS CHEMICAL CO LLC / CHEVRON PHILLIPS CHEMICAL CO LP - 144A - 3.4% 01/12/2026 | USD | 691 661 | 743 527 | 0.36 |
| 500 000 | CHORUS LTD 1.125% 18/10/2023 | EUR | 500 350 | 518 575 | 0.25 |
| 500 000 | CHUBB INA HOLDINGS INC 0.3% 15/12/2024 | EUR | 499 380 | 502 176 | 0.24 |
| 200 000 | CHUBB INA HOLDINGS INC 1.55% 15/03/2028 | EUR | 214 086 | 215 104 | 0.10 |
| 1 500 000 | CITIBANK NA FRN 23/07/2021 | USD | 1 281 230 | 1 372 006 | 0.67 |

# Swiss Life Funds (LUX) Bond Global Corporates

## Anlagenübersicht (Fortsetzung)

| Nominal wert/ Menge | Bezeichnung | Kurs Währung | Kosten EUR | Marktwert EUR | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| **Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumenten, die an einer amtlichen Börse zugelassen sind oder auf einem anderen geregelten Markt gehandelt werden (Fortsetzung)** | | | | | |
| | **Anleihen (Fortsetzung)** | | | | |
| 1 100 000 | CITIGROUP INC 3.5% 15/05/2023 | USD | 847 039 | 1 054 085 | 0.51 |
| 200 000 | CITIGROUP INC 5.15% 21/05/2026 | GBP | 268 944 | 281 623 | 0.14 |
| 1 100 000 | CK HUTCHISON GROUP TELECOM FINANCE SA 0.375% 17/10/2023 | EUR | 1 097 129 | 1 107 106 | 0.54 |
| 1 300 000 | CK HUTCHISON INTERNATIONAL 17 II LTD - REGS - 3.25% 29/09/2027 | USD | 1 099 546 | 1 277 277 | 0.62 |
| 400 000 | CNH INDUSTRIAL FINANCE EUROPE SA 1.875% 19/01/2026 | EUR | 419 400 | 421 304 | 0.21 |
| 200 000 | COLGATE-PALMOLIVE CO 0.875% 12/11/2039 | EUR | 194 778 | 199 764 | 0.10 |
| 600 000 | COMCAST CORP 3.45% 01/02/2050 | USD | 538 497 | 601 120 | 0.29 |
| 750 000 | COOPERATIEVE RABOBANK 4.375% 04/08/2025 | USD | 677 240 | 756 876 | 0.37 |
| 500 000 | CPI PROPERTY GROUP SA 1.625% 23/04/2027 | EUR | 491 831 | 505 470 | 0.25 |
| 1 150 000 | CREDIT SUISSE GROUP AG - REGS - 3.574% 09/01/2023 | USD | 1 077 195 | 1 079 604 | 0.53 |
| 200 000 | CREDIT SUISSE GROUP FUNDING GUERNSEY LTD 1.25% 14/04/2022 | EUR | 205 688 | 204 590 | 0.10 |
| 750 000 | CREDIT SUISSE GROUP FUNDING GUERNSEY LTD 3.45% 16/04/2021 | USD | 661 815 | 696 108 | 0.34 |
| 700 000 | CREDIT SUISSE GROUP FUNDING GUERNSEY LTD 4.55% 17/04/2026 | USD | 592 668 | 720 596 | 0.35 |
| 850 000 | CSX CORP 3.25% 01/06/2027 | USD | 771 012 | 837 379 | 0.41 |
| 500 000 | CVS HEALTH CORP 2.625% 15/08/2024 | USD | 444 110 | 469 803 | 0.23 |
| 900 000 | DAIMLER AG 1.125% 06/11/2031 | EUR | 889 944 | 886 392 | 0.43 |
| 700 000 | DANSKE BANK A/S 2.25% 14/01/2028 | GBP | 821 757 | 821 962 | 0.40 |
| 900 000 | DEUTSCHE BANK AG 2.625% 16/12/2024 | GBP | 1 053 494 | 1 062 156 | 0.52 |
| 1 150 000 | DEUTSCHE TELEKOM INTERNATIONAL FINANCE BV - 144A - 4.875% 06/03/2042 | USD | 896 983 | 1 317 645 | 0.64 |
| 1 000 000 | DNB BANK ASA 0.05% 14/11/2023 | EUR | 997 930 | 1 002 870 | 0.49 |
| 300 000 | DOMINION ENERGY GAS HOLDINGS LLC 3.9% 15/11/2049 | USD | 270 593 | 297 293 | 0.14 |
| 400 000 | DOW CHEMICAL CO 3.625% 15/05/2026 | USD | 357 663 | 395 525 | 0.19 |
| 500 000 | DUKE ENERGY INDIANA LLC 3.25% 01/10/2049 | USD | 446 080 | 489 126 | 0.24 |
| 300 000 | EDISON INTERNATIONAL 3.55% 15/11/2024 | USD | 272 319 | 288 877 | 0.14 |
| 600 000 | ELECTRICITE DE FRANCE SA 4.5% 04/12/2069 | USD | 545 479 | 617 829 | 0.30 |
| 400 000 | ENBRIDGE INC 2.99% 03/10/2029 | CAD | 269 198 | 276 121 | 0.13 |
| 500 000 | ENEL FINANCE INTERNATIONAL NV - 144A - 4.75% 25/05/2047 | USD | 490 851 | 539 428 | 0.26 |
| 500 000 | ENEL FINANCE INTERNATIONAL NV 0.375% 17/06/2027 | EUR | 496 285 | 500 525 | 0.24 |
| 800 000 | ENGIE SA FRN PERPETUAL | EUR | 796 608 | 797 120 | 0.39 |
| 200 000 | ENGIE SA 1.375% 28/02/2029 | EUR | 217 235 | 219 877 | 0.11 |
| 500 000 | EOG RESOURCES INC 2.625% 15/03/2023 | USD | 411 521 | 469 675 | 0.23 |
| 600 000 | ERSTE GROUP BANK AG FRN 10/06/2030 | EUR | 596 610 | 588 654 | 0.29 |
| 600 000 | ESSILORLUXOTTICA SA 0.125% 27/05/2025 | EUR | 595 878 | 602 676 | 0.29 |
| 500 000 | ESSITY AB 0.5% 03/02/2030 | EUR | 496 030 | 501 905 | 0.24 |
| 350 000 | EXXON MOBIL CORP 4.114% 01/03/2046 | USD | 321 936 | 377 915 | 0.18 |
| 500 000 | FASTIGHETS AB BALDER 1.25% 28/01/2028 | EUR | 497 735 | 505 810 | 0.25 |
| 600 000 | FCA BANK SPA/IRELAND 0.25% 28/02/2023 | EUR | 599 298 | 598 380 | 0.29 |
| 400 000 | FIDELITY NATIONAL INFORMATION SERVICES INC 0.75% 21/05/2023 | EUR | 400 000 | 408 228 | 0.20 |
| 800 000 | FOMENTO ECONOMICO MEXICANO SAB DE CV 3.5% 16/01/2050 | USD | 704 372 | 763 825 | 0.37 |
| 800 000 | FORTIVE CORP 4.3% 15/06/2046 | USD | 763 116 | 846 072 | 0.41 |
| 1 050 000 | FRESENIUS MEDICAL CARE US FINANCE INC - 144A - 5.75% 15/02/2021 | USD | 985 777 | 991 748 | 0.48 |
| 650 000 | GILEAD SCIENCES INC 4.15% 01/03/2047 | USD | 573 611 | 709 180 | 0.35 |
| 700 000 | GOLDMAN SACHS GROUP INC - QS8 A1 - FRN 29/11/2023 | USD | 607 642 | 656 114 | 0.32 |

# Swiss Life Funds (LUX) Bond Global Corporates

## Anlagenübersicht (Fortsetzung)

| Nominalwert/ Menge | Bezeichnung | Kurs Währung | Kosten EUR | Marktwert EUR | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| **Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumenten, die an einer amtlichen Börse zugelassen sind oder auf einem anderen geregelten Markt gehandelt werden (Fortsetzung)** | | | | | |
| | **Anleihen (Fortsetzung)** | | | | |
| 900 000 | GOLDMAN SACHS GROUP INC FRN 21/04/2023 | EUR | 900 000 | 900 198 | 0.44 |
| 500 000 | GOLDMAN SACHS GROUP INC 0.125% 19/08/2024 | EUR | 497 445 | 495 000 | 0.24 |
| 900 000 | GOLDMAN SACHS GROUP INC 0.875% 21/01/2030 | EUR | 889 686 | 897 106 | 0.44 |
| 200 000 | GOLDMAN SACHS GROUP INC 1.25% 01/05/2025 | EUR | 207 210 | 206 434 | 0.10 |
| 500 000 | GOLDMAN SACHS GROUP INC 3.5% 16/11/2026 | USD | 452 141 | 488 593 | 0.24 |
| 300 000 | HEWLETT PACKARD ENTERPRISE CO FRN 15/10/2020 | USD | 264 928 | 276 070 | 0.13 |
| 1 000 000 | HOLDING D'INFRASTRUCTURES DE TRANSPORT SAS 0.625% 27/03/2023 | EUR | 1 007 300 | 1 000 790 | 0.49 |
| 1 400 000 | HOME DEPOT INC 2.8% 14/09/2027 | USD | 1 171 403 | 1 358 731 | 0.66 |
| 450 000 | HOME DEPOT INC 3.9% 15/06/2047 | USD | 397 387 | 486 051 | 0.24 |
| 1 000 000 | HSBC HOLDINGS PLC FRN 12/09/2026 | USD | 860 178 | 930 420 | 0.45 |
| 500 000 | HYUNDAI CAPITAL AMERICA 2.85% 01/11/2022 | USD | 450 705 | 466 321 | 0.23 |
| 400 000 | ICADE SANTE SAS 0.875% 04/11/2029 | EUR | 397 568 | 404 852 | 0.20 |
| 300 000 | IMPERIAL BRANDS FINANCE PLC 3.5% 26/07/2026 | USD | 266 618 | 287 226 | 0.14 |
| 700 000 | ING BANK NV - REGS - 5.8% 25/09/2023 | USD | 715 660 | 724 241 | 0.35 |
| 700 000 | ING GROEP NV FRN 03/09/2025 | EUR | 699 825 | 688 247 | 0.34 |
| 500 000 | ING GROEP NV FRN 13/11/2030 | EUR | 499 130 | 503 155 | 0.25 |
| 200 000 | ING GROEP NV FRN 15/02/2029 | EUR | 214 328 | 213 962 | 0.10 |
| 400 000 | ING GROEP NV FRN 22/03/2028 | USD | 337 892 | 389 137 | 0.19 |
| 900 000 | INTER PIPELINE LTD 2.734% 18/04/2024 | CAD | 586 414 | 622 816 | 0.30 |
| 550 000 | INTERNATIONAL BUSINESS MACHINES CORP 4.25% 15/05/2049 | USD | 487 432 | 618 772 | 0.30 |
| 400 000 | INTESA SANPAOLO SPA 0.75% 04/12/2024 | EUR | 399 864 | 403 420 | 0.20 |
| 100 000 | INTESA SANPAOLO SPA 1% 04/07/2024 | EUR | 99 855 | 101 998 | 0.05 |
| 200 000 | ISLANDSBANKI HF 1.125% 12/04/2022 | EUR | 199 748 | 204 056 | 0.10 |
| 500 000 | JAB HOLDINGS BV 1% 20/12/2027 | EUR | 495 090 | 509 403 | 0.25 |
| 700 000 | JAB HOLDINGS BV 1.75% 25/06/2026 | EUR | 694 582 | 752 444 | 0.37 |
| 200 000 | JAPAN TOBACCO INC 2.8% 13/04/2026 | USD | 175 503 | 189 826 | 0.09 |
| 400 000 | JEFFERIES GROUP LLC 1% 19/07/2024 | EUR | 400 273 | 405 388 | 0.20 |
| 250 000 | JOHNSON & JOHNSON 4.375% 05/12/2033 | USD | 235 114 | 285 409 | 0.14 |
| 900 000 | JPMORGAN CHASE & CO FRN 01/03/2025 | USD | 796 347 | 864 523 | 0.42 |
| 400 000 | JPMORGAN CHASE & CO FRN 04/11/2032 | EUR | 400 000 | 404 876 | 0.20 |
| 1 500 000 | JPMORGAN CHASE & CO FRN 23/01/2029 | USD | 1 224 015 | 1 492 667 | 0.73 |
| 1 100 000 | JPMORGAN CHASE & CO FRN 24/02/2028 | EUR | 1 100 000 | 1 084 479 | 0.53 |
| 200 000 | JPMORGAN CHASE & CO FRN 25/07/2031 | EUR | 203 410 | 203 636 | 0.10 |
| 600 000 | JPMORGAN CHASE & CO 3.875% 10/09/2024 | USD | 467 259 | 592 440 | 0.29 |
| 700 000 | JT INTERNATIONAL FINANCIAL SERVICES BV 1% 26/11/2029 | EUR | 696 101 | 730 268 | 0.36 |
| 500 000 | JT INTERNATIONAL FINANCIAL SERVICES BV 3.875% 28/09/2028 | USD | 438 066 | 516 915 | 0.25 |
| 400 000 | JUNIPER NETWORKS INC 5.95% 15/03/2041 | USD | 375 054 | 443 749 | 0.22 |
| 200 000 | KERRY GROUP FINANCIAL SERVICES UNLTD CO 0.625% 20/09/2029 | EUR | 197 982 | 201 272 | 0.10 |
| 300 000 | KEURIG DR PEPPER INC 4.5% 15/11/2045 | USD | 277 393 | 316 892 | 0.15 |
| 1 000 000 | KEYCORP 2.9% 15/09/2020 | USD | 847 406 | 915 963 | 0.45 |
| 1 000 000 | KINDER MORGAN INC/DE 3.15% 15/01/2023 | USD | 846 614 | 941 590 | 0.46 |
| 600 000 | KKR GROUP FINANCE CO VI LLC 3.75% 01/07/2029 | USD | 532 972 | 606 090 | 0.30 |
| 1 000 000 | LANDSBANKINN HF 0.5% 20/05/2024 | EUR | 998 960 | 999 250 | 0.49 |
| 600 000 | LEASEPLAN CORP NV 2.875% 24/10/2024 | USD | 538 543 | 563 408 | 0.27 |

# Swiss Life Funds (LUX) Bond Global Corporates

## Anlagenübersicht (Fortsetzung)

| Nominalwert/ Menge | Bezeichnung | Kurs Währung | Kosten EUR | Marktwert EUR | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| **Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumenten, die an einer amtlichen Börse zugelassen sind oder auf einem anderen geregelten Markt gehandelt werden (Fortsetzung)** | | | | | |
| | **Anleihen (Fortsetzung)** | | | | |
| 600 000 | LIBERTY MUTUAL GROUP INC - REGS - 2.75% 04/05/2026 | EUR | 657 580 | 672 511 | 0.33 |
| 500 000 | LLOYDS BANK CORPORATE MARKETS PLC 0.25% 04/10/2022 | EUR | 499 315 | 502 610 | 0.25 |
| 800 000 | LLOYDS BANK CORPORATE MARKETS PLC 1.75% 11/07/2024 | GBP | 889 919 | 938 538 | 0.46 |
| 300 000 | LLOYDS BANKING GROUP PLC FRN 05/02/2026 | USD | 272 764 | 276 966 | 0.14 |
| 500 000 | LLOYDS BANKING GROUP PLC FRN 12/11/2025 | EUR | 496 442 | 497 446 | 0.24 |
| 600 000 | LOWE'S COS INC 4.05% 03/05/2047 | USD | 550 186 | 612 377 | 0.30 |
| 850 000 | LUMINOR BANK AS/ESTONIA 1.375% 21/10/2022 | EUR | 860 739 | 863 787 | 0.42 |
| 1 000 000 | LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE 0.125% 11/02/2028 | EUR | 991 610 | 990 587 | 0.48 |
| 800 000 | LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE 0.375% 11/02/2031 | EUR | 793 664 | 790 719 | 0.39 |
| 1 100 000 | LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE 1.125% 11/02/2027 | GBP | 1 288 160 | 1 266 711 | 0.62 |
| 800 000 | LYB INTERNATIONAL FINANCE BV 4% 15/07/2023 | USD | 737 854 | 781 297 | 0.38 |
| 600 000 | LYB INTERNATIONAL FINANCE II BV 0.875% 17/09/2026 | EUR | 597 852 | 607 632 | 0.30 |
| 600 000 | MADRILENA RED DE GAS FINANCE BV - EMTN - 2.25% 11/04/2029 | EUR | 621 110 | 661 086 | 0.32 |
| 450 000 | MARSH & MCLENNAN COS INC 4.375% 15/03/2029 | USD | 393 167 | 477 337 | 0.23 |
| 997 000 | MCKESSON CORP 3.125% 17/02/2029 | GBP | 1 159 800 | 1 217 118 | 0.59 |
| 800 000 | MERCK FINANCIAL SERVICES GMBH 0.875% 05/07/2031 | EUR | 797 648 | 825 248 | 0.40 |
| 300 000 | MERCK KGAA FRN 25/06/2079 | EUR | 298 065 | 302 970 | 0.15 |
| 400 000 | MICROSOFT CORP 3.7% 08/08/2046 | USD | 353 656 | 440 483 | 0.21 |
| 1 400 000 | MITSUBISHI UFJ FINANCIAL GROUP INC FRN 26/07/2021 | USD | 1 198 322 | 1 277 811 | 0.62 |
| 900 000 | MIZUHO FINANCIAL GROUP INC FRN 25/05/2024 | USD | 831 562 | 817 476 | 0.40 |
| 1 400 000 | MIZUHO FINANCIAL GROUP INC 3.663% 28/02/2027 | USD | 1 299 031 | 1 397 884 | 0.68 |
| 700 000 | MONDELEZ INTERNATIONAL HOLDINGS NETHERLANDS BV - 144A - 2% 28/10/2021 | USD | 621 576 | 641 773 | 0.31 |
| 500 000 | MOODY'S CORP 0.95% 25/02/2030 | EUR | 498 210 | 519 019 | 0.25 |
| 550 000 | MOODY'S CORP 2.75% 15/12/2021 | USD | 504 584 | 511 050 | 0.25 |
| 400 000 | MOODY'S CORP 3.25% 15/01/2028 | USD | 349 292 | 394 560 | 0.19 |
| 200 000 | MORGAN STANLEY FRN 23/10/2026 | EUR | 209 210 | 209 284 | 0.10 |
| 800 000 | MORGAN STANLEY FRN 26/07/2024 | EUR | 800 318 | 809 640 | 0.39 |
| 200 000 | MORGAN STANLEY 1% 02/12/2022 | EUR | 205 410 | 205 338 | 0.10 |
| 500 000 | MORGAN STANLEY 4.1% 22/05/2023 | USD | 355 483 | 487 796 | 0.24 |
| 800 000 | MOTABILITY OPERATIONS GROUP PLC 2.375% 03/07/2039 | GBP | 875 534 | 993 248 | 0.48 |
| 650 000 | MPLX LP FRN 09/09/2022 | USD | 589 329 | 593 033 | 0.29 |
| 400 000 | MPLX LP 5.5% 15/02/2049 | USD | 419 348 | 415 025 | 0.20 |
| 750 000 | NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD/NEW YORK 2.5% 12/07/2026 | USD | 649 672 | 707 224 | 0.34 |
| 500 000 | NATIONAL GRID NORTH AMERICA INC 2.375% 30/09/2020 | USD | 427 379 | 455 587 | 0.22 |
| 500 000 | NATIONWIDE BUILDING SOCIETY - 144A - FRN 26/04/2023 | USD | 442 380 | 473 212 | 0.23 |
| 300 000 | NATIONWIDE BUILDING SOCIETY FRN 18/07/2030 | USD | 266 476 | 301 778 | 0.15 |
| 800 000 | NEW YORK LIFE GLOBAL FUNDING 0.25% 23/01/2027 | EUR | 795 856 | 802 986 | 0.39 |
| 200 000 | NEXTERA ENERGY CAPITAL HOLDINGS INC 3.5% 01/04/2029 | USD | 177 332 | 200 319 | 0.10 |
| 400 000 | NGG FINANCE PLC FRN 05/09/2082 | EUR | 400 000 | 408 940 | 0.20 |
| 200 000 | NGG FINANCE PLC FRN 05/12/2079 | EUR | 200 000 | 200 292 | 0.10 |
| 500 000 | NIBC BANK NV 0.875% 08/07/2025 | EUR | 498 690 | 509 845 | 0.25 |
| 500 000 | NIKE INC 3.375% 01/11/2046 | USD | 400 477 | 520 738 | 0.25 |
| 900 000 | NOMURA HOLDINGS INC 3.103% 16/01/2030 | USD | 810 628 | 843 826 | 0.41 |

# Swiss Life Funds (LUX) Bond Global Corporates

## Anlagenübersicht (Fortsetzung)

| Nominalwert/ Menge | Bezeichnung | Kurs Währung | Kosten EUR | Marktwert EUR | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| **Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumenten, die an einer amtlichen Börse zugelassen sind oder auf einem anderen geregelten Markt gehandelt werden (Fortsetzung)** | | | | | |
| | **Anleihen (Fortsetzung)** | | | | |
| 900 000 | NORDEA BANK ABP - REGS - 4.25% 21/09/2022 | USD | 706 426 | 870 463 | 0.42 |
| 200 000 | NYKREDIT REALKREDIT A/S 0.125% 10/07/2024 | EUR | 196 785 | 197 152 | 0.10 |
| 600 000 | NYKREDIT REALKREDIT A/S 0.25% 20/01/2023 | EUR | 598 722 | 600 594 | 0.29 |
| 1 100 000 | NYKREDIT REALKREDIT A/S 0.875% 17/01/2024 | EUR | 1 094 764 | 1 120 856 | 0.55 |
| 100 000 | OCCIDENTAL PETROLEUM CORP FRN 15/08/2022 | USD | 89 393 | 91 337 | 0.04 |
| 900 000 | OMV AG FRN PERPETUAL | EUR | 998 640 | 967 752 | 0.47 |
| 700 000 | ONEOK INC 2.75% 01/09/2024 | USD | 622 737 | 657 412 | 0.32 |
| 600 000 | OP CORPORATE BANK PLC 0.375% 19/06/2024 | EUR | 597 930 | 602 952 | 0.29 |
| 400 000 | PARKER-HANNIFIN CORP 3.25% 14/06/2029 | USD | 354 065 | 393 278 | 0.19 |
| 1 000 000 | PEPSICO INC 4% 02/05/2047 | USD | 910 661 | 1 137 785 | 0.55 |
| 400 000 | PETROLEOS DEL PERU SA - REGS - 5.625% 19/06/2047 | USD | 413 793 | 439 787 | 0.21 |
| 600 000 | PHILIP MORRIS INTERNATIONAL INC 0.8% 01/08/2031 | EUR | 592 122 | 584 328 | 0.28 |
| 700 000 | PHILLIPS 66 4.875% 15/11/2044 | USD | 653 787 | 766 409 | 0.37 |
| 200 000 | PRAXAIR INC 3.55% 07/11/2042 | USD | 175 359 | 209 734 | 0.10 |
| 1 000 000 | PROCTER & GAMBLE CO 3.5% 25/10/2047 | USD | 840 385 | 1 119 924 | 0.55 |
| 800 000 | PROSEGUR CASH SA 1.375% 04/02/2026 | EUR | 794 016 | 824 600 | 0.40 |
| 700 000 | QNB FINANCE LTD 2.125% 07/09/2021 | USD | 608 667 | 636 369 | 0.31 |
| 1 200 000 | QNB FINANCE LTD 2.75% 12/02/2027 | USD | 1 088 573 | 1 102 095 | 0.54 |
| 300 000 | RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL AG FRN 12/03/2030 | EUR | 298 425 | 297 771 | 0.15 |
| 2 000 000 | RALPH LAUREN CORP 3.75% 15/09/2025 | USD | 1 717 064 | 2 007 921 | 0.99 |
| 200 000 | SANTANDER ISSUANCES SAU 2.5% 18/03/2025 | EUR | 215 970 | 213 898 | 0.10 |
| 1 100 000 | SANTANDER UK GROUP HOLDINGS PLC FRN 28/02/2025 | EUR | 1 100 000 | 1 092 311 | 0.53 |
| 1 600 000 | SAUDI ELECTRICITY GLOBAL SUKUK CO 4.222% 27/01/2024 | USD | 1 361 528 | 1 551 453 | 0.76 |
| 1 221 000 | SCHLUMBERGER HOLDINGS CORP 3.9% 17/05/2028 | USD | 1 062 917 | 1 191 621 | 0.58 |
| 1 000 000 | SERVICE PROPERTIES TRUST 4.35% 01/10/2024 | USD | 904 646 | 959 661 | 0.47 |
| 300 000 | SIEMENS FINANCIERINGSMAATSCHAPPIJ NV - 144A - 3.3% 15/09/2046 | USD | 236 733 | 301 136 | 0.15 |
| 200 000 | SIKA CAPITAL BV 0.875% 29/04/2027 | EUR | 199 432 | 208 566 | 0.10 |
| 1 350 000 | SIMON PROPERTY GROUP LP 3.375% 15/06/2027 | USD | 1 185 931 | 1 337 390 | 0.65 |
| 700 000 | SINOPEC GROUP OVERSEAS DEVELOPMENT 2017 LTD - 144A - 2.25% 13/09/2020 | USD | 585 718 | 639 250 | 0.31 |
| 800 000 | SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN AB - 144A - FRN 17/05/2021 | USD | 674 821 | 730 214 | 0.36 |
| 1 350 000 | SOCIETE GENERALE SA - REGS - 3.25% 12/01/2022 | USD | 1 244 093 | 1 263 318 | 0.62 |
| 700 000 | SOCIETE GENERALE SA - REGS - 4.25% 14/04/2025 | USD | 631 027 | 682 717 | 0.33 |
| 200 000 | SOCIETE GENERALE SA 2.625% 27/02/2025 | EUR | 218 930 | 217 450 | 0.11 |
| 1 000 000 | SOUTHERN CALIFORNIA EDISON CO 4.875% 01/03/2049 | USD | 885 591 | 1 162 675 | 0.57 |
| 1 000 000 | STANDARD CHARTERED PLC FRN 30/01/2026 | USD | 897 536 | 927 616 | 0.45 |
| 500 000 | STRYKER CORP 1% 03/12/2031 | EUR | 495 855 | 508 095 | 0.25 |
| 100 000 | SWISS RE TREASURY US CORP 7% 15/02/2026 | USD | 108 725 | 116 600 | 0.06 |
| 600 000 | TAKEDA PHARMACEUTICAL CO LTD 3% 21/11/2030 | EUR | 596 784 | 726 186 | 0.35 |
| 650 000 | TARGET CORP 3.625% 15/04/2046 | USD | 558 157 | 680 836 | 0.33 |
| 540 000 | TELEFONICA EMISIONES SA 5.134% 27/04/2020 | USD | 471 165 | 493 893 | 0.24 |
| 600 000 | TORONTO-DOMINION BANK 0.375% 25/04/2024 | EUR | 598 164 | 606 696 | 0.30 |
| 200 000 | TOTAL SA - PERPETUAL - FRN PERPETUAL | EUR | 213 210 | 209 796 | 0.10 |
| 200 000 | TOTAL SA FRN PERPETUAL | EUR | 200 156 | 203 638 | 0.10 |

# Swiss Life Funds (LUX) Bond Global Corporates

## Anlagenübersicht (Fortsetzung)

| Nominalwert/ Menge | Bezeichnung | Kurs Währung | Kosten EUR | Marktwert EUR | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| **Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumenten, die an einer amtlichen Börse zugelassen sind oder auf einem anderen geregelten Markt gehandelt werden (Fortsetzung)** | | | | | |
| | **Anleihen (Fortsetzung)** | | | | |
| 800 000 | TRANSCANADA TRUST FRN 18/05/2077 | CAD | 527 864 | 534 717 | 0.26 |
| 1 150 000 | TRINITY ACQUISITION PLC 2.125% 26/05/2022 | EUR | 1 187 320 | 1 191 458 | 0.58 |
| 900 000 | UBS GROUP AG FRN 13/08/2030 | USD | 804 541 | 864 293 | 0.42 |
| 200 000 | UBS GROUP AG 1.5% 30/11/2024 | EUR | 209 967 | 208 696 | 0.10 |
| 700 000 | UBS GROUP FUNDING SWITZERLAND AG - REGS - FRN 15/08/2023 | USD | 593 634 | 654 404 | 0.32 |
| 1 200 000 | UBS GROUP FUNDING SWITZERLAND AG - REGS - 3.491% 23/05/2023 | USD | 1 040 207 | 1 133 350 | 0.55 |
| 1 000 000 | UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD SE 0.875% 29/03/2032 | EUR | 987 100 | 1 009 170 | 0.49 |
| 300 000 | UNION PACIFIC CORP 2.15% 05/02/2027 | USD | 272 521 | 277 780 | 0.14 |
| 500 000 | UNION PACIFIC CORP 3.55% 15/08/2039 | USD | 447 896 | 497 656 | 0.24 |
| 500 000 | UNION PACIFIC CORP 4.25% 15/04/2043 | USD | 379 402 | 540 990 | 0.26 |
| 400 000 | UNITED PARCEL SERVICE INC 3.4% 15/11/2046 | USD | 352 851 | 381 432 | 0.19 |
| 200 000 | VERIZON COMMUNICATIONS INC FRN 15/05/2025 | USD | 168 705 | 185 618 | 0.09 |
| 550 000 | VERIZON COMMUNICATIONS INC 2.5% 08/04/2031 | GBP | 637 200 | 677 729 | 0.33 |
| 700 000 | VERIZON COMMUNICATIONS INC 5.5% 16/03/2047 | USD | 657 481 | 913 017 | 0.45 |
| 300 000 | VF CORP 0.25% 25/02/2028 | EUR | 298 086 | 300 621 | 0.15 |
| 350 000 | VIACOM INC 4.5% 01/03/2021 | USD | 297 196 | 327 380 | 0.16 |
| 500 000 | VODAFONE GROUP PLC 3% 12/08/2056 | GBP | 553 201 | 578 743 | 0.28 |
| 500 000 | VODAFONE GROUP PLC 4.125% 30/05/2025 | USD | 423 056 | 505 025 | 0.25 |
| 1 200 000 | VOLKSWAGEN FINANCIAL SERVICES NV 2.75% 10/07/2023 | GBP | 1 364 253 | 1 443 168 | 0.70 |
| 200 000 | VOLKSWAGEN INTERNATIONAL FINANCE NV FRN PERPETUAL | EUR | 206 551 | 202 268 | 0.10 |
| 600 000 | WALES & WEST UTILITIES FINANCE PLC 1.875% 28/05/2041 | GBP | 700 117 | 667 867 | 0.33 |
| 1 000 000 | WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC 3.45% 01/06/2026 | USD | 806 446 | 957 423 | 0.47 |
| 700 000 | WILLIAMS COS INC 3.75% 15/06/2027 | USD | 615 019 | 679 244 | 0.33 |
| 1 000 000 | WILLIS NORTH AMERICA INC 4.5% 15/09/2028 | USD | 859 894 | 1 039 374 | 0.51 |
| 800 000 | WINTERSHALL DEA FINANCE BV 0.452% 25/09/2023 | EUR | 800 000 | 804 376 | 0.39 |
| 800 000 | WINTERSHALL DEA FINANCE BV 0.84% 25/09/2025 | EUR | 800 000 | 806 955 | 0.39 |
| 600 000 | WPC EUROBOND BV 2.125% 15/04/2027 | EUR | 595 944 | 646 955 | 0.32 |
| 300 000 | ZF EUROPE FINANCE BV 2% 23/02/2026 | EUR | 296 712 | 303 510 | 0.15 |
| 400 000 | ZOETIS INC 3% 12/09/2027 | USD | 333 635 | 389 633 | 0.19 |
| | **Gesamtsumme der Anleihen** | | **176 561 046** | **191 597 424** | **93.45** |
| | **Durch Immobilien und Anlagen gesicherte Wertpapiere** | | | | |
| 1 000 000 | CANADIAN NATIONAL RAILWAY CO 3% 08/02/2029 | CAD | 666 955 | 725 290 | 0.35 |
| | **Durch Immobilien und Anlagen gesicherte Wertpapiere gesamt** | | **666 955** | **725 290** | **0.35** |
| **Gesamtsumme übertragbarer Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer amtlichen Börse zugelassen sind oder auf einem anderen geregelten Markt gehandelt werden** | | | **177 228 001** | **192 322 714** | **93.80** |
| **Gesamtsumme der Anlagen** | | | **177 228 001** | **192 322 714** | **93.80** |

# Swiss Life Funds (LUX) Bond Global Corporates

## Sektorstruktur und geographische Verteilung der Anlagen

| Sektorstruktur | % |
|---|---|
| Banken | 24.32 |
| Finanzdienstleistungen | 24.15 |
| Pharmazeutik und Biotechnologie | 4.88 |
| Versicherungen (ohne Lebensversicherung) | 3.51 |
| Persönliche Güter | 3.21 |
| Industrietransport | 2.92 |
| Öl- und Gasproduzenten | 2.70 |
| Festnetz-Telekommunikation | 2.45 |
| Elektrizität | 2.30 |
| Gas-, Wasser- und Mehrfachversorgungsunternehmen | 2.26 |
| Ölbranche: Maschinen, Dienstleistungen und Vertrieb | 2.10 |
| Allgemeiner Einzelhandel | 2.02 |
| Getränke | 1.92 |
| Lebensmittel- und Arzneimittelhandel | 1.74 |
| Immobilienbezogene Dienstleistungen und Investitionen | 1.56 |
| Mobilfunk | 1.49 |
| Geräte und Dienstleistungen im Gesundheitswesen | 1.28 |
| Immobilienbezogene Anlagefonds | 1.18 |
| Medien | 1.14 |
| Chemikalien | 1.04 |
| Tabak | 0.85 |
| Allgemeine Industrie | 0.81 |
| Software- und Computerdienstleistungen | 0.72 |
| Technologie Hardware und Geräte | 0.59 |
| Haushaltswaren und Heimwerkerbedarf | 0.55 |
| Automobilbau und -teile | 0.43 |
| Elektronische und elektrische Geräte | 0.41 |
| Kundenbetreuung | 0.40 |
| Alternative Energie | 0.32 |
| Industrietechnik | 0.24 |
| Lebensmittelhersteller | 0.22 |
| Freizeitartikel | 0.09 |
| | **93.80** |

| Geographische Verteilung | % |
|---|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika | 43.45 |
| Frankreich | 8.77 |
| Niederlande | 8.65 |
| Großbritannien | 5.86 |
| Kanada | 2.76 |
| Japan | 2.56 |
| Kaimaninseln | 2.23 |
| Spanien | 2.23 |
| Deutschland | 1.95 |
| Schweiz | 1.92 |
| Luxemburg | 1.68 |
| Dänemark | 1.34 |
| Schweden | 1.27 |
| Tschechische Republik | 1.19 |
| Mexiko | 1.09 |
| Österreich | 0.90 |
| Guernsey | 0.79 |
| Chile | 0.74 |
| Island | 0.59 |
| Irland | 0.57 |
| Italien | 0.54 |
| Norwegen | 0.49 |
| Estland | 0.42 |
| Australien | 0.34 |
| Britisch Virgin Islands | 0.31 |
| Finnland | 0.29 |
| Neuseeland | 0.25 |
| Belgien | 0.21 |
| Peru | 0.21 |
| Vereinigte Arabische Emirate | 0.20 |
| | **93.80** |

# Swiss Life Funds (LUX) Bond Global Corporates Short Term

## Anlagenübersicht

| Nominalwert/ Menge | Bezeichnung | Kurs Währung | Kosten EUR | Marktwert EUR | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| **Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumenten, die an einer amtlichen Börse zugelassen sind oder auf einem anderen geregelten Markt gehandelt werden** | | | | | |
| | **Anleihen** | | | | |
| 500 000 | AAREAL BANK AG 2.75% 09/10/2020 | USD | 434 722 | 457 322 | 0.66 |
| 500 000 | ABBOTT IRELAND FINANCING DAC 0.1% 19/11/2024 | EUR | 498 210 | 498 970 | 0.72 |
| 200 000 | ABBOTT IRELAND FINANCING DAC 0.875% 27/09/2023 | EUR | 199 824 | 205 552 | 0.30 |
| 600 000 | ABBVIE INC 2.6% 21/11/2024 | USD | 544 351 | 564 026 | 0.81 |
| 300 000 | ABN AMRO BANK NV - 144A - 3.4% 27/08/2021 | USD | 260 249 | 280 658 | 0.40 |
| 300 000 | ABN AMRO BANK NV 6.25% 27/04/2022 | USD | 274 599 | 296 469 | 0.43 |
| 620 000 | ACCOR SA 1.75% 27/06/2022 | CHF | 574 829 | 606 128 | 0.87 |
| 400 000 | ALBEMARLE CORP 1.875% 08/12/2021 | EUR | 415 950 | 411 100 | 0.59 |
| 300 000 | ALD SA - REGS - 0.375% 18/07/2023 | EUR | 299 607 | 298 284 | 0.43 |
| 700 000 | ALIBABA GROUP HOLDING LTD 3.125% 28/11/2021 | USD | 601 608 | 653 238 | 0.94 |
| 400 000 | ALLERGAN FUNDING SCS 0.5% 01/06/2021 | EUR | 398 491 | 402 848 | 0.58 |
| 400 000 | AMERICA MOVIL SAB DE CV FRN 06/09/2073 | GBP | 469 899 | 474 818 | 0.68 |
| 200 000 | AMERICA MOVIL SAB DE CV 3% 12/07/2021 | EUR | 219 800 | 208 090 | 0.30 |
| 500 000 | AMERICAN EXPRESS CO 2.5% 30/07/2024 | USD | 446 646 | 471 701 | 0.68 |
| 500 000 | AMGEN INC 0.41% 08/03/2023 | CHF | 465 167 | 480 734 | 0.69 |
| 200 000 | AMGEN INC 1.9% 21/02/2025 | USD | 184 415 | 184 360 | 0.26 |
| 400 000 | AMP GROUP FINANCE SERVICES LTD 0.2031% 03/06/2024 | CHF | 376 879 | 377 059 | 0.54 |
| 200 000 | ANGLO AMERICAN CAPITAL PLC 1.5% 01/04/2020 | EUR | 202 260 | 200 184 | 0.29 |
| 200 000 | ARES CAPITAL CORP 3.25% 15/07/2025 | USD | 179 299 | 183 661 | 0.26 |
| 700 000 | ARION BANKI HF 1.625% 01/12/2021 | EUR | 718 200 | 718 802 | 1.03 |
| 500 000 | AUTOLIV INC 0.75% 26/06/2023 | EUR | 507 350 | 508 175 | 0.73 |
| 500 000 | AVI FUNDING CO LTD - REGS - 2.85% 16/09/2020 | USD | 425 055 | 458 282 | 0.66 |
| 300 000 | AXA SA FRN 16/04/2040 | EUR | 319 290 | 301 704 | 0.43 |
| 200 000 | BAIC INALFA HK INVESTMENT CO LTD 1.9% 02/11/2020 | EUR | 203 660 | 201 414 | 0.29 |
| 670 000 | BAIDU INC 2.875% 06/07/2022 | USD | 548 785 | 624 174 | 0.90 |
| 600 000 | BAKER HUGHES A GE CO LLC / BAKER HUGHES CO-OBLIGOR INC 2.773% 15/12/2022 | USD | 508 949 | 558 285 | 0.80 |
| 200 000 | BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA SA 0.75% 11/09/2022 | EUR | 197 800 | 203 122 | 0.29 |
| 250 000 | BANK OF AMERICA CORP FRN 07/02/2022 | EUR | 249 950 | 251 623 | 0.36 |
| 500 000 | BANK OF AMERICA CORP 5.875% 05/01/2021 | USD | 456 046 | 470 968 | 0.68 |
| 300 000 | BANK OF CHINA LUXEMBOURG SA 0.125% 16/01/2023 | EUR | 299 954 | 300 129 | 0.43 |
| 500 000 | BANK OF MONTREAL 0.05% 30/12/2022 | CHF | 439 822 | 478 279 | 0.69 |
| 600 000 | BANK OF NOVA SCOTIA 1.375% 05/12/2023 | GBP | 701 884 | 701 218 | 1.01 |
| 300 000 | BANK OF THE PHILIPPINE ISLANDS 0% 24/09/2021 | CHF | 275 428 | 280 972 | 0.40 |
| 400 000 | BANQUE FEDERATIVE DU CREDIT MUTUEL SA - REGS - 3.75% 20/07/2023 | USD | 340 168 | 389 367 | 0.56 |
| 200 000 | BAYER US FINANCE II LLC - 144A - 3.5% 25/06/2021 | USD | 172 112 | 186 197 | 0.27 |
| 500 000 | BHP BILLITON FINANCE LTD FRN 22/04/2076 | EUR | 553 500 | 523 550 | 0.75 |
| 500 000 | BLACKSTONE PROPERTY PARTNERS EUROPE HOLDINGS SARL 0.5% 12/09/2023 | EUR | 499 820 | 503 954 | 0.72 |
| 400 000 | BMW FINANCE NV 0% 14/04/2023 | EUR | 399 896 | 399 608 | 0.57 |
| 500 000 | BNP PARIBAS SA 1.125% 22/11/2023 | EUR | 511 725 | 515 845 | 0.74 |
| 300 000 | BOOKING HOLDINGS INC 0.8% 10/03/2022 | EUR | 304 566 | 304 956 | 0.44 |
| 950 000 | BPCE SA FRN 31/05/2022 | USD | 845 378 | 874 766 | 1.26 |
| 500 000 | BRITISH TRANSCO INTERNATIONAL FINANCE BV 0% 04/11/2021 | USD | 415 022 | 441 172 | 0.63 |
| 400 000 | BROADCOM CORP / BROADCOM CAYMAN FINANCE LTD 2.2% 15/01/2021 | USD | 338 127 | 365 504 | 0.52 |

# Swiss Life Funds (LUX) Bond Global Corporates Short Term

## Anlagenübersicht (Fortsetzung)

| Nominalwert/ Menge | Bezeichnung | Kurs Währung | Kosten EUR | Marktwert EUR | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| **Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumenten, die an einer amtlichen Börse zugelassen sind oder auf einem anderen geregelten Markt gehandelt werden (Fortsetzung)** | | | | | |
| | **Anleihen (Fortsetzung)** | | | | |
| 300 000 | CANADIAN IMPERIAL BANK OF COMMERCE FRN 17/03/2023 | USD | 270 538 | 274 773 | 0.39 |
| 300 000 | CAPGEMINI SE 0.5% 09/11/2021 | EUR | 302 220 | 302 526 | 0.43 |
| 500 000 | CETIN FINANCE BV 1.423% 06/12/2021 | EUR | 514 660 | 512 575 | 0.74 |
| 200 000 | CIGNA CORP FRN 17/09/2021 | USD | 171 947 | 182 233 | 0.26 |
| 400 000 | CNAC HK FINBRIDGE CO LTD 3% 19/07/2020 | USD | 356 927 | 365 358 | 0.52 |
| 450 000 | CNOOC FINANCE 2011 LTD - REGS - 4.25% 26/01/2021 | USD | 418 956 | 418 914 | 0.60 |
| 400 000 | CNP ASSURANCES 1.875% 20/10/2022 | EUR | 418 800 | 417 000 | 0.60 |
| 500 000 | COMMERZBANK AG 0.5% 06/12/2021 | EUR | 499 985 | 505 665 | 0.73 |
| 250 000 | COOPERATIEVE RABOBANK UA - REGS - 2.625% 22/07/2024 | USD | 221 459 | 236 178 | 0.34 |
| 500 000 | COOPERATIEVE RABOBANK UA 1.875% 19/07/2021 | USD | 439 513 | 457 290 | 0.66 |
| 500 000 | CREDIT AGRICOLE SA/LONDON - REGS - 3.375% 10/01/2022 | USD | 443 900 | 468 861 | 0.67 |
| 400 000 | CREDIT SUISSE GROUP FUNDING GUERNSEY LTD 3.8% 15/09/2022 | USD | 339 188 | 382 674 | 0.55 |
| 750 000 | DAIMLER FINANCE NORTH AMERICA LLC - 144A - 2.3% 12/02/2021 | USD | 643 813 | 685 859 | 0.98 |
| 400 000 | DAIMLER INTERNATIONAL FINANCE BV 1.25% 05/09/2022 | GBP | 440 459 | 463 901 | 0.67 |
| 500 000 | DANSKE BANK A/S 2.7% 02/03/2022 | USD | 454 459 | 463 316 | 0.66 |
| 200 000 | DASSAULT SYSTEMES SE 0% 16/09/2022 | EUR | 200 716 | 200 796 | 0.29 |
| 200 000 | DEUTSCHE PFANDBRIEFBANK AG 0.75% 07/02/2023 | EUR | 199 358 | 203 918 | 0.29 |
| 300 000 | DEUTSCHE PFANDBRIEFBANK AG 1.75% 21/11/2022 | GBP | 355 917 | 351 299 | 0.50 |
| 500 000 | DIAGEO CAPITAL PLC 3% 18/05/2020 | USD | 421 295 | 456 325 | 0.65 |
| 300 000 | DIGITAL DUTCH FINCO BV 0.125% 15/10/2022 | EUR | 300 370 | 301 239 | 0.43 |
| 500 000 | DNB BANK ASA 0.05% 14/11/2023 | EUR | 498 965 | 501 435 | 0.72 |
| 500 000 | EATON CAPITAL UNLIMITED CO 0.697% 14/05/2025 | EUR | 508 750 | 515 230 | 0.74 |
| 200 000 | ECOLAB INC 2.375% 10/08/2022 | USD | 156 851 | 185 656 | 0.27 |
| 200 000 | EDISON INTERNATIONAL 3.125% 15/11/2022 | USD | 181 686 | 187 423 | 0.27 |
| 242 000 | EDP FINANCE BV - REGS - 5.25% 14/01/2021 | USD | 223 322 | 226 545 | 0.33 |
| 200 000 | EMIRATES NBD PJSC FRN 12/10/2020 | USD | 177 553 | 183 377 | 0.26 |
| 200 000 | EMIRATES NBD PJSC 3.25% 14/11/2022 | USD | 184 111 | 186 130 | 0.27 |
| 300 000 | ENEL FINANCE INTERNATIONAL NV 0% 17/06/2024 | EUR | 297 369 | 298 536 | 0.43 |
| 500 000 | E.ON SE 0% 24/10/2022 | EUR | 500 285 | 501 460 | 0.72 |
| 200 000 | ERSTE GROUP BANK AG FRN 26/05/2025 | USD | 171 218 | 183 489 | 0.26 |
| 200 000 | EXPORT-IMPORT BANK OF CHINA 0.3% 06/03/2022 | EUR | 199 316 | 201 330 | 0.29 |
| 400 000 | FCA BANK SPA/IRELAND 1.25% 21/06/2022 | EUR | 406 578 | 409 736 | 0.59 |
| 200 000 | FERROVIAL EMISIONES SA 0.375% 14/09/2022 | EUR | 201 870 | 202 336 | 0.29 |
| 522 000 | FIDELITY INTERNATIONAL LTD 6.75% 19/10/2020 | GBP | 638 528 | 626 849 | 0.90 |
| 300 000 | FIDELITY NATIONAL INFORMATION SERVICES INC 0.125% 03/12/2022 | EUR | 298 899 | 301 273 | 0.43 |
| 300 000 | FIDELITY NATIONAL INFORMATION SERVICES INC 0.4% 15/01/2021 | EUR | 300 810 | 301 041 | 0.43 |
| 500 000 | FIRST ABU DHABI BANK PJSC FRN 16/04/2022 | USD | 457 488 | 457 677 | 0.66 |
| 200 000 | FOMENTO ECONOMICO MEXICANO SAB DE CV 1.75% 20/03/2023 | EUR | 206 500 | 209 340 | 0.30 |
| 400 000 | FRESENIUS MEDICAL CARE US FINANCE II INC - 144A - 4.125% 15/10/2020 | USD | 355 015 | 367 074 | 0.53 |
| 600 000 | GENERAL ELECTRIC CAPITAL CORP 2.5% 28/03/2020 | USD | 546 912 | 546 355 | 0.78 |
| 500 000 | GLENCORE FINANCE EUROPE LTD 1.25% 17/03/2021 | EUR | 506 833 | 504 345 | 0.72 |
| 433 000 | GLOBAL BANK CORP - REGS - 4.5% 20/10/2021 | USD | 404 912 | 404 342 | 0.58 |
| 300 000 | GOLDMAN SACHS GROUP INC FRN 21/04/2023 | EUR | 300 000 | 300 066 | 0.43 |
| 400 000 | GOLDMAN SACHS GROUP INC FRN 31/10/2022 | USD | 340 107 | 371 232 | 0.53 |

# Swiss Life Funds (LUX) Bond Global Corporates Short Term

## Anlagenübersicht (Fortsetzung)

| Nominalwert/ Menge | Bezeichnung | Kurs Währung | Kosten EUR | Marktwert EUR | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| **Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumenten, die an einer amtlichen Börse zugelassen sind oder auf einem anderen geregelten Markt gehandelt werden (Fortsetzung)** | | | | | |
| | **Anleihen (Fortsetzung)** | | | | |
| 500 000 | HELVETIA SCHWEIZERISCHE VERSICHERUNGSGESELLSCHAFT AG FRN PERPETUAL | CHF | 454 725 | 471 940 | 0.68 |
| 600 000 | HEWLETT PACKARD ENTERPRISE CO 2.25% 01/04/2023 | USD | 543 881 | 555 346 | 0.80 |
| 300 000 | HITACHI CAPITAL UK PLC 0.125% 29/11/2022 | EUR | 299 139 | 300 471 | 0.43 |
| 250 000 | HSBC FINANCE CORP 6.676% 15/01/2021 | USD | 220 030 | 236 440 | 0.34 |
| 200 000 | HYUNDAI CAPITAL AMERICA 2.85% 01/11/2022 | USD | 180 282 | 186 528 | 0.27 |
| 200 000 | HYUNDAI CAPITAL SERVICES INC - REGS - 2.875% 16/03/2021 | USD | 182 594 | 183 892 | 0.26 |
| 300 000 | IMPERIAL BRANDS FINANCE PLC 3.125% 26/07/2024 | USD | 267 726 | 281 527 | 0.40 |
| 400 000 | INGERSOLL-RAND GLOBAL HOLDING CO LTD 2.9% 21/02/2021 | USD | 323 205 | 368 432 | 0.53 |
| 400 000 | INTERNATIONAL BUSINESS MACHINES CORP 3% 15/05/2024 | USD | 355 715 | 385 452 | 0.55 |
| 1 000 000 | JPMORGAN CHASE & CO FRN 01/04/2023 | USD | 882 924 | 940 597 | 1.35 |
| 300 000 | KOOKMIN BANK 3.625% 23/10/2021 | USD | 258 051 | 281 844 | 0.40 |
| 400 000 | KOREA DEVELOPMENT BANK FRN 18/02/2023 | USD | 366 166 | 363 913 | 0.52 |
| 500 000 | KOREA GAS CORP - REGS - 1.875% 18/07/2021 | USD | 451 684 | 457 294 | 0.66 |
| 500 000 | KOREA MIDLAND POWER CO LTD 3.375% 22/01/2022 | USD | 449 218 | 469 762 | 0.67 |
| 900 000 | KOREAN AIR LINES CO LTD 2% 04/09/2022 | USD | 809 687 | 827 390 | 1.19 |
| 200 000 | LANDESBANK BADEN-WUERTTEMBERG 1.5% 03/02/2025 | GBP | 237 043 | 231 702 | 0.33 |
| 200 000 | LANDSBANKINN HF 0.5% 20/05/2024 | EUR | 199 792 | 199 850 | 0.29 |
| 100 000 | LANDSBANKINN HF 1.625% 15/03/2021 | EUR | 102 370 | 101 703 | 0.15 |
| 315 000 | LEASEPLAN CORP NV 2.375% 15/10/2020 | CHF | 290 382 | 300 519 | 0.43 |
| 1 000 000 | LLOYDS BANK PLC - 144A - 6.5% 14/09/2020 | USD | 929 737 | 930 683 | 1.34 |
| 800 000 | LLOYDS BANKING GROUP PLC FRN 17/03/2023 | USD | 724 572 | 742 309 | 1.07 |
| 200 000 | LOTTE PROPERTY & DEVELOPMENT CO LTD FRN 06/08/2022 | USD | 181 634 | 182 825 | 0.26 |
| 200 000 | LUMINOR BANK AS/ESTONIA 1.5% 18/10/2021 | EUR | 202 880 | 203 550 | 0.29 |
| 500 000 | LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE 0% 11/02/2024 | EUR | 501 380 | 500 160 | 0.72 |
| 400 000 | LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE 1% 11/02/2023 | GBP | 471 858 | 464 278 | 0.67 |
| 500 000 | MACQUARIE BANK LTD 6% 21/09/2020 | EUR | 590 317 | 515 945 | 0.74 |
| 300 000 | MEDTRONIC GLOBAL HOLDINGS SCA 0.375% 07/03/2023 | EUR | 299 052 | 303 498 | 0.44 |
| 400 000 | MERCK KGAA FRN 12/12/2074 | EUR | 416 640 | 408 612 | 0.59 |
| 300 000 | MITSUBISHI UFJ FINANCIAL GROUP INC 3.218% 07/03/2022 | USD | 264 119 | 281 849 | 0.40 |
| 1 000 000 | MIZUHO FINANCIAL GROUP INC - REGS - 2.632% 12/04/2021 | USD | 859 232 | 921 289 | 1.32 |
| 700 000 | MIZUHO FINANCIAL GROUP INC FRN 25/05/2024 | USD | 646 771 | 635 815 | 0.91 |
| 300 000 | MORGAN STANLEY FRN 24/10/2023 | USD | 283 690 | 279 123 | 0.40 |
| 350 000 | MPLX LP FRN 09/09/2022 | USD | 317 331 | 319 325 | 0.46 |
| 450 000 | NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD FRN 13/12/2022 | USD | 402 163 | 410 242 | 0.59 |
| 200 000 | NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD 0.625% 30/08/2023 | EUR | 199 990 | 204 716 | 0.29 |
| 400 000 | NATIONWIDE BUILDING SOCIETY - 144A - FRN 26/04/2023 | USD | 357 575 | 378 569 | 0.54 |
| 400 000 | NATIONWIDE BUILDING SOCIETY 2% 27/01/2023 | USD | 359 903 | 368 698 | 0.53 |
| 500 000 | NATWEST MARKETS PLC - REGS - 3.625% 29/09/2022 | USD | 442 999 | 474 496 | 0.68 |
| 200 000 | NATWEST MARKETS PLC 0.125% 13/09/2023 | CHF | 184 353 | 189 607 | 0.27 |
| 300 000 | NESTLE HOLDINGS INC - 144A - 3.35% 24/09/2023 | USD | 256 594 | 291 050 | 0.42 |
| 1 000 000 | NEW YORK LIFE GLOBAL FUNDING - 144A - 2.875% 10/04/2024 | USD | 908 365 | 961 008 | 1.39 |
| 500 000 | NEWCREST FINANCE PTY LTD - 144A - 4.45% 15/11/2021 | USD | 481 456 | 473 995 | 0.68 |
| 300 000 | NIDEC CORP 0.487% 27/09/2021 | EUR | 300 280 | 302 283 | 0.43 |

# Swiss Life Funds (LUX) Bond Global Corporates Short Term

## Anlagenübersicht (Fortsetzung)

| Nominalwert/ Menge | Bezeichnung | Kurs Währung | Kosten EUR | Marktwert EUR | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| **Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumenten, die an einer amtlichen Börse zugelassen sind oder auf einem anderen geregelten Markt gehandelt werden (Fortsetzung)** | | | | | |
| | **Anleihen (Fortsetzung)** | | | | |
| 200 000 | NISSAN MOTOR ACCEPTANCE CORP - REGS - 2.15% 13/07/2020 | USD | 175 495 | 182 404 | 0.26 |
| 300 000 | NTT FINANCE CORP 1.9% 21/07/2021 | USD | 236 296 | 274 246 | 0.39 |
| 200 000 | NUCOR CORP 4.125% 15/09/2022 | USD | 168 659 | 191 339 | 0.27 |
| 200 000 | NYKREDIT REALKREDIT A/S 0.25% 20/01/2023 | EUR | 199 574 | 200 198 | 0.29 |
| 600 000 | OMV AG FRN PERPETUAL | EUR | 654 240 | 645 168 | 0.93 |
| 328 000 | ORANGE SA FRN PERPETUAL | EUR | 349 137 | 345 276 | 0.50 |
| 300 000 | ORLEN CAPITAL AB 2.5% 30/06/2021 | EUR | 316 440 | 309 318 | 0.44 |
| 500 000 | PHILIP MORRIS INTERNATIONAL INC 2.5% 02/11/2022 | USD | 427 362 | 467 008 | 0.67 |
| 200 000 | QNB FINANCE LTD 2.125% 07/09/2021 | USD | 180 689 | 181 820 | 0.26 |
| 500 000 | REYNOLDS AMERICAN INC 4% 12/06/2022 | USD | 431 182 | 478 410 | 0.69 |
| 500 000 | ROYAL BANK OF CANADA FRN 05/10/2023 | USD | 431 611 | 459 325 | 0.66 |
| 500 000 | RUSSIAN RAILWAYS VIA RZD CAPITAL PLC 2.73% 26/02/2021 | CHF | 456 732 | 482 210 | 0.69 |
| 500 000 | SAN DIEGO GAS & ELECTRIC CO 3% 15/08/2021 | USD | 438 788 | 464 473 | 0.67 |
| 300 000 | SANTANDER UK PLC 2.1% 13/01/2023 | USD | 267 945 | 276 463 | 0.40 |
| 500 000 | SINOPEC GROUP OVERSEAS DEVELOPMENT 2016 LTD 2.5% 13/09/2022 | USD | 414 190 | 463 749 | 0.67 |
| 500 000 | SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN AB 3.05% 25/03/2022 | USD | 440 653 | 468 588 | 0.67 |
| 200 000 | STANDARD CHARTERED PLC - 144A - FRN 20/01/2023 | USD | 171 277 | 183 566 | 0.26 |
| 500 000 | STATE GRID OVERSEAS INVESTMENT 2016 LTD - REGS - 2.75% 04/05/2022 | USD | 426 371 | 465 588 | 0.67 |
| 300 000 | STRYKER CORP 1.125% 30/11/2023 | EUR | 305 400 | 311 697 | 0.45 |
| 400 000 | SUMITOMO MITSUI FINANCE & LEASING CO LTD 2.512% 22/01/2025 | USD | 358 696 | 371 148 | 0.53 |
| 500 000 | SUMITOMO MITSUI FINANCIAL GROUP INC FRN 18/10/2022 | USD | 443 766 | 456 552 | 0.66 |
| 500 000 | SWEDBANK AB - REGS - 2.65% 10/03/2021 | USD | 436 629 | 460 972 | 0.66 |
| 680 000 | TALENT YIELD EURO LTD 1.435% 07/05/2020 | EUR | 690 401 | 681 183 | 0.98 |
| 250 000 | TANNER SERVICIOS FINANCIEROS SA 0.6% 07/11/2022 | CHF | 232 275 | 237 517 | 0.34 |
| 500 000 | TELEKOM FINANZMANAGEMENT GMBH 3.125% 03/12/2021 | EUR | 580 000 | 528 895 | 0.76 |
| 575 000 | TORONTO-DOMINION BANK 0.625% 20/07/2023 | EUR | 576 748 | 589 881 | 0.85 |
| 500 000 | TORONTO-DOMINION BANK 3.25% 11/03/2024 | USD | 441 072 | 485 716 | 0.70 |
| 200 000 | TOTAL SA FRN PERPETUAL | EUR | 205 950 | 202 716 | 0.29 |
| 500 000 | TOTAL SA FRN PERPETUAL | EUR | 540 500 | 531 880 | 0.76 |
| 400 000 | TOYOTA FINANCE AUSTRALIA LTD 0.25% 09/04/2024 | EUR | 399 820 | 404 872 | 0.58 |
| 300 000 | TOYOTA MOTOR CREDIT CORP 3.45% 20/09/2023 | USD | 256 138 | 291 883 | 0.42 |
| 500 000 | VOLKSWAGEN FINANCIAL SERVICES AG 0.625% 01/04/2022 | EUR | 498 390 | 504 500 | 0.72 |
| 300 000 | VOLKSWAGEN FINANCIAL SERVICES NV 1.625% 30/11/2022 | GBP | 338 566 | 349 785 | 0.50 |
| 200 000 | VOLVO TREASURY AB FRN 10/06/2075 | EUR | 213 980 | 201 640 | 0.29 |
| 500 000 | WALMART INC 2.85% 08/07/2024 | USD | 441 938 | 482 230 | 0.69 |
| 250 000 | WESTPAC BANKING CORP 2.8% 11/01/2022 | USD | 240 632 | 233 033 | 0.33 |
| 500 000 | ZF NORTH AMERICA CAPITAL INC - 144A - 4% 29/04/2020 | USD | 430 057 | 456 106 | 0.65 |
| | **Gesamtsumme der Anleihen** | | **64 032 754** | **65 850 127** | **94.51** |
| | **Supranationale Institutionen, Regierungen und örtliche Behörden, Schuldtitel** | | | | |
| 200 000 | BLACK SEA TRADE & DEVELOPMENT BANK - REGS - 4.875% 06/05/2021 | USD | 186 080 | 187 120 | 0.27 |
| 400 000 | CORP ANDINA DE FOMENTO 3.25% 11/02/2022 | USD | 350 763 | 375 085 | 0.54 |

# Swiss Life Funds (LUX) Bond Global Corporates Short Term

## Anlagenübersicht (Fortsetzung)

| Nominalwert/ Menge | Bezeichnung | Kurs Währung | Kosten EUR | Marktwert EUR | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| **Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumenten, die an einer amtlichen Börse zugelassen sind oder auf einem anderen geregelten Markt gehandelt werden (Fortsetzung)** | | | | | |
| | **Supranationale Institutionen, Regierungen und örtliche Behörden, Schuldtitel (Fortsetzung)** | | | | |
| 500 000 | KOREA WATER RESOURCES CORP 2.75% 23/05/2022 | USD | 424 168 | 466 899 | 0.66 |
| | **Summe supranationale Institutionen, Regierungen und örtliche Behörden, Schuldtitel** | | **961 011** | **1 029 104** | **1.47** |
| **Gesamtsumme übertragbarer Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer amtlichen Börse zugelassen sind oder auf einem anderen geregelten Markt gehandelt werden** | | | **64 993 765** | **66 879 231** | **95.98** |
| **Gesamtsumme der Anlagen** | | | **64 993 765** | **66 879 231** | **95.98** |

# Swiss Life Funds (LUX) Bond Global Corporates Short Term

## Sektorstruktur und geographische Verteilung der Anlagen

| Sektorstruktur | % |
|---|---|
| Banken | 34.06 |
| Finanzdienstleistungen | 26.36 |
| Software- und Computerdienstleistungen | 3.71 |
| Gas-, Wasser- und Mehrfachversorgungsunternehmen | 3.02 |
| Pharmazeutik und Biotechnologie | 2.79 |
| Öl- und Gasproduzenten | 2.65 |
| Reise, Freizeit und Catering | 2.50 |
| Allgemeiner Einzelhandel | 2.06 |
| Geräte und Dienstleistungen im Gesundheitswesen | 1.67 |
| Allgemeine Industrie | 1.59 |
| Behörden | 1.48 |
| Persönliche Güter | 1.38 |
| Tabak | 1.36 |
| Festnetz-Telekommunikation | 1.25 |
| Chemikalien | 1.11 |
| Versicherungen (ohne Lebensversicherung) | 1.11 |
| Automobilbau und -teile | 1.02 |
| Industrietechnik | 0.98 |
| Industrietransport | 0.98 |
| Mobilfunk | 0.98 |
| Technologie Hardware und Geräte | 0.80 |
| Lebensversicherung | 0.60 |
| Ölbranche: Maschinen, Dienstleistungen und Vertrieb | 0.46 |
| Elektronische und elektrische Geräte | 0.43 |
| Getränke | 0.30 |
| Elektrizität | 0.27 |
| Industriemetalle und Bergbau | 0.27 |
| Kundenbetreuung | 0.27 |
| Aktien Anlageinstrumente | 0.26 |
| Immobilienbezogene Dienstleistungen und Investitionen | 0.26 |
| | **95.98** |

| Geographische Verteilung | % |
|---|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika | 23.29 |
| Frankreich | 8.54 |
| Großbritannien | 7.54 |
| Niederlande | 6.55 |
| Japan | 4.65 |
| Südkorea | 4.64 |
| Deutschland | 4.54 |
| Australien | 4.51 |
| Kanada | 4.29 |
| Britisch Virgin Islands | 2.91 |
| Kaimaninseln | 2.75 |
| Irland | 2.44 |
| Luxemburg | 2.17 |
| Schweden | 2.07 |
| Österreich | 1.95 |
| Island | 1.46 |
| Mexiko | 1.28 |
| Vereinigte Arabische Emirate | 1.19 |
| Panama | 1.12 |
| Dänemark | 0.95 |
| Bermuda | 0.90 |
| HongKong (China) | 0.81 |
| Jersey Inseln | 0.72 |
| Norwegen | 0.72 |
| Schweiz | 0.68 |
| Italien | 0.59 |
| Spanien | 0.58 |
| Guernsey | 0.55 |
| Philippinen | 0.40 |
| Chile | 0.34 |
| China | 0.29 |
| Estland | 0.29 |
| Griechenland | 0.27 |
| | **95.98** |

# Swiss Life Funds (LUX) Bond Global High Yield

## Anlagenübersicht

| Nominalwert/ Menge | Bezeichnung | Kurs Währung | Kosten EUR | Marktwert EUR | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| **Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumenten, die an einer amtlichen Börse zugelassen sind oder auf einem anderen geregelten Markt gehandelt werden** | | | | | |
| | **Anleihen** | | | | |
| 900 000 | AA BOND CO LTD - REGS - 5.5% 31/07/2022 | GBP | 1 242 315 | 912 946 | 0.32 |
| 800 000 | ACCOR SA FRN PERPETUAL | EUR | 795 560 | 815 456 | 0.28 |
| 2 700 000 | ACCOR SA FRN PERPETUAL | EUR | 2 698 011 | 2 554 092 | 0.88 |
| 1 000 000 | AECOM 5.125% 15/03/2027 | USD | 951 929 | 941 782 | 0.33 |
| 1 800 000 | AIR FRANCE-KLM 1.875% 16/01/2025 | EUR | 1 789 398 | 1 719 108 | 0.60 |
| 3 000 000 | ALCOA NEDERLAND HOLDING BV - 144A - 6.125% 15/05/2028 | USD | 2 726 585 | 2 802 649 | 0.97 |
| 650 000 | ALTICE FRANCE SA/FRANCE - REGS - 3.375% 15/01/2028 | EUR | 650 000 | 631 222 | 0.22 |
| 650 000 | ALTICE FRANCE SA/FRANCE - 144A - 5.5% 15/01/2028 | USD | 586 431 | 593 246 | 0.21 |
| 3 000 000 | AMC NETWORKS INC 4.75% 01/08/2025 | USD | 2 672 344 | 2 714 898 | 0.94 |
| 500 000 | AMERICAN GREETINGS CORP - 144A - 7.875% 15/02/2025 | USD | 459 316 | 421 344 | 0.15 |
| 1 000 000 | AMERIGAS PARTNERS LP / AMERIGAS FINANCE CORP 5.625% 20/05/2024 | USD | 890 560 | 945 988 | 0.33 |
| 2 500 000 | AMKOR TECHNOLOGY INC 6.625% 15/09/2027 | USD | 2 228 316 | 2 483 477 | 0.86 |
| 2 000 000 | AMSTED INDUSTRIES INC - 144A - 4.625% 15/05/2030 | USD | 1 816 024 | 1 831 818 | 0.63 |
| 500 000 | ARAMARK INTERNATIONAL FINANCE SARL - REGS - 3.125% 01/04/2025 | EUR | 514 700 | 502 730 | 0.17 |
| 800 000 | ARCELORMITTAL SA 1.75% 19/11/2025 | EUR | 795 280 | 807 576 | 0.28 |
| 1 000 000 | ARCELORMITTAL 3.6% 16/07/2024 | USD | 887 399 | 942 037 | 0.33 |
| 2 000 000 | ARCELORMITTAL 4.25% 16/07/2029 | USD | 1 759 602 | 1 882 270 | 0.65 |
| 100 000 | ARCONIC ROLLED PRODUCTS CORP 6.125% 15/02/2028 | USD | 90 592 | 93 551 | 0.03 |
| 1 500 000 | ARKEMA SA FRN PERPETUAL | EUR | 1 499 835 | 1 559 715 | 0.54 |
| 500 000 | ARROW GLOBAL FINANCE PLC - REGS - FRN 01/03/2026 | EUR | 500 000 | 499 185 | 0.17 |
| 1 900 000 | ARROW GLOBAL FINANCE PLC - REGS - 5.125% 15/09/2024 | GBP | 2 117 851 | 2 224 897 | 0.77 |
| 1 000 000 | ASHLAND SERVICES BV - REGS - 2% 30/01/2028 | EUR | 1 000 000 | 961 600 | 0.33 |
| 2 000 000 | ASHTEAD CAPITAL INC - 144A - 5.25% 01/08/2026 | USD | 1 715 793 | 1 945 560 | 0.67 |
| 500 000 | AVON INTERNATIONAL CAPITAL PLC - 144A - 6.5% 15/08/2022 | USD | 439 271 | 468 201 | 0.16 |
| 1 000 000 | BALL CORP 1.5% 15/03/2027 | EUR | 1 000 000 | 993 010 | 0.34 |
| 100 000 | BAUSCH HEALTH COS INC - 144A - 5% 30/01/2028 | USD | 89 658 | 88 990 | 0.03 |
| 1 000 000 | BELDEN INC - REGS - 3.875% 15/03/2028 | EUR | 1 000 000 | 1 050 690 | 0.36 |
| 2 400 000 | BGC PARTNERS INC 5.375% 24/07/2023 | USD | 2 059 484 | 2 388 617 | 0.83 |
| 1 500 000 | BOISE CASCADE CO - 144A - 5.625% 01/09/2024 | USD | 1 342 014 | 1 417 602 | 0.49 |
| 500 000 | BRINKER INTERNATIONAL INC - 144A - 5% 01/10/2024 | USD | 447 608 | 477 482 | 0.17 |
| 2 000 000 | B2HOLDING ASA FRN 28/05/2024 | EUR | 2 012 375 | 1 941 500 | 0.67 |
| 500 000 | CASINO GUICHARD PERRACHON SA FRN 07/03/2024 | EUR | 431 450 | 421 520 | 0.15 |
| 2 600 000 | CASINO GUICHARD PERRACHON SA FRN PERPETUAL | EUR | 2 144 267 | 1 341 626 | 0.46 |
| 1 800 000 | CASINO GUICHARD PERRACHON SA 1.865% 13/06/2022 | EUR | 1 828 260 | 1 676 916 | 0.58 |
| 2 000 000 | CBR FASHION FINANCE BV - REGS - 5.125% 01/10/2022 | EUR | 1 822 050 | 1 968 020 | 0.68 |
| 1 000 000 | CCO HOLDINGS LLC / CCO HOLDINGS CAPITAL CORP - 144A - 5.125% 01/05/2027 | USD | 935 148 | 948 163 | 0.33 |
| 500 000 | CENTENE CORP - 144A - 4.25% 15/12/2027 | USD | 447 635 | 474 159 | 0.16 |
| 100 000 | CGG HOLDING US INC - REGS - 7.875% 01/05/2023 | EUR | 100 000 | 104 435 | 0.04 |
| 1 500 000 | CHARLES RIVER LABORATORIES INTERNATIONAL INC 4.25% 01/05/2028 | USD | 1 366 806 | 1 374 205 | 0.48 |
| 1 500 000 | CITRIX SYSTEMS INC 4.5% 01/12/2027 | USD | 1 283 091 | 1 510 747 | 0.52 |
| 1 000 000 | CLEARWAY ENERGY OPERATING LLC 5% 15/09/2026 | USD | 890 578 | 934 471 | 0.32 |
| 1 900 000 | CMA CGM SA - REGS - 5.25% 15/01/2025 | EUR | 1 929 789 | 1 220 826 | 0.42 |
| 1 000 000 | CMA CGM SA - REGS - 6.5% 15/07/2022 | EUR | 1 009 000 | 741 850 | 0.26 |

# Swiss Life Funds (LUX) Bond Global High Yield

## Anlagenübersicht (Fortsetzung)

| Nominalwert/ Menge | Bezeichnung | Kurs Währung | Kosten EUR | Marktwert EUR | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| **Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumenten, die an einer amtlichen Börse zugelassen sind oder auf einem anderen geregelten Markt gehandelt werden (Fortsetzung)** | | | | | |
| | **Anleihen (Fortsetzung)** | | | | |
| 2 000 000 | CONTOURGLOBAL POWER HOLDINGS SA - REGS - 4.125% 01/08/2025 | EUR | 2 000 000 | 2 061 100 | 0.71 |
| 400 000 | COTY INC - REGS - 4% 15/04/2023 | EUR | 400 000 | 392 964 | 0.14 |
| 1 000 000 | COTY INC - 144A - 6.5% 15/04/2026 | USD | 864 857 | 935 172 | 0.32 |
| 1 300 000 | CREDIT ACCEPTANCE CORP 7.375% 15/03/2023 | USD | 1 174 478 | 1 205 830 | 0.42 |
| 1 500 000 | CROWN EUROPEAN HOLDINGS SA - REGS - 2.875% 01/02/2026 | EUR | 1 509 975 | 1 601 010 | 0.55 |
| 1 100 000 | DARLING GLOBAL FINANCE BV - REGS - 3.625% 15/05/2026 | EUR | 1 100 000 | 1 140 590 | 0.39 |
| 760 000 | DELL INTERNATIONAL LLC / EMC CORP - 144A - 5.875% 15/06/2021 | USD | 674 906 | 696 153 | 0.24 |
| 1 150 000 | DELL INTERNATIONAL LLC / EMC CORP - 144A - 7.125% 15/06/2024 | USD | 1 025 579 | 1 095 350 | 0.38 |
| 2 750 000 | DENBURY RESOURCES INC - 144A - 7.75% 15/02/2024 | USD | 1 958 557 | 1 399 497 | 0.48 |
| 1 500 000 | DIAMOND OFFSHORE DRILLING INC 7.875% 15/08/2025 | USD | 1 265 050 | 912 153 | 0.32 |
| 750 000 | DIAMOND SPORTS GROUP LLC / DIAMOND SPORTS FINANCE CO - 144A - 5.375% 15/08/2026 | USD | 695 763 | 640 509 | 0.22 |
| 900 000 | DONNELLEY FINANCIAL SOLUTIONS INC 8.25% 15/10/2024 | USD | 806 637 | 841 417 | 0.29 |
| 1 250 000 | DRAWBRIDGE SPECIAL OPPORTUNITIES FUND LP / DRAWBRIDGE SPECIAL OPPORTUNITIES FIN 5% 01/08/2021 | USD | 905 774 | 1 160 715 | 0.40 |
| 1 500 000 | DRAX FINCO PLC - REGS - 4.25% 01/05/2022 | GBP | 1 815 275 | 1 755 503 | 0.61 |
| 1 000 000 | DUFRY ONE BV 2% 15/02/2027 | EUR | 1 000 000 | 926 847 | 0.32 |
| 800 000 | EDP - ENERGIAS DE PORTUGAL SA FRN 30/04/2079 | EUR | 800 000 | 879 416 | 0.30 |
| 1 000 000 | EIRCOM FINANCE DAC 3.5% 15/05/2026 | EUR | 1 000 000 | 1 025 410 | 0.36 |
| 2 300 000 | ELECTRICITE DE FRANCE SA FRN PERPETUAL | EUR | 2 242 336 | 2 468 820 | 0.85 |
| 400 000 | ELECTRICITE DE FRANCE SA FRN PERPETUAL | EUR | 396 508 | 411 284 | 0.14 |
| 1 000 000 | ELIS SA 2.875% 15/02/2026 | EUR | 1 000 000 | 1 064 640 | 0.37 |
| 3 000 000 | ERAMET 5.875% 21/05/2025 | EUR | 2 984 130 | 2 709 600 | 0.94 |
| 3 000 000 | EUROPCAR MOBILITY DRIVE DESIGNATED ACTIVITY CO - REGS - 4% 30/04/2026 | EUR | 3 016 250 | 2 612 550 | 0.90 |
| 2 900 000 | FERROVIAL NL BV FRN PERPETUAL | EUR | 2 594 400 | 2 813 783 | 0.97 |
| 3 000 000 | FMG RESOURCES AUGUST 2006 PTY LTD - 144A - 5.125% 15/05/2024 | USD | 2 816 686 | 2 828 486 | 0.98 |
| 3 000 000 | FORD MOTOR CREDIT CO LLC 3.021% 06/03/2024 | EUR | 3 018 960 | 3 122 460 | 1.08 |
| 250 000 | FRONTDOOR INC - 144A - 6.75% 15/08/2026 | USD | 219 829 | 249 841 | 0.09 |
| 2 000 000 | GESTAMP AUTOMOCION SA - REGS - 3.25% 30/04/2026 | EUR | 1 981 290 | 1 881 900 | 0.65 |
| 500 000 | GOODYEAR TIRE & RUBBER CO 5% 31/05/2026 | USD | 451 471 | 445 054 | 0.15 |
| 500 000 | GREIF INC - 144A - 6.5% 01/03/2027 | USD | 437 618 | 490 182 | 0.17 |
| 1 000 000 | GRIFOLS SA - REGS - 2.25% 15/11/2027 | EUR | 1 000 000 | 1 013 570 | 0.35 |
| 500 000 | GROUP 1 AUTOMOTIVE INC - 144A - 5.25% 15/12/2023 | USD | 460 766 | 460 981 | 0.16 |
| 250 000 | HAT HOLDINGS I LLC / HAT HOLDINGS II LLC 5.25% 15/07/2024 | USD | 219 751 | 237 883 | 0.08 |
| 500 000 | HCA INC 3.5% 01/09/2030 | USD | 458 064 | 443 885 | 0.15 |
| 1 000 000 | HEATHROW FINANCE PLC 4.125% 01/09/2029 | GBP | 1 165 841 | 1 166 068 | 0.40 |
| 900 000 | HILCORP ENERGY I LP / HILCORP FINANCE CO - 144A - 5.75% 01/10/2025 | USD | 778 813 | 660 836 | 0.23 |
| 500 000 | HILL-ROM HOLDINGS INC - 144A - 5% 15/02/2025 | USD | 468 845 | 472 006 | 0.16 |
| 2 500 000 | HOIST FINANCE AB 2.75% 03/04/2023 | EUR | 2 493 850 | 2 584 525 | 0.89 |
| 1 000 000 | HOLOGIC INC - 144A - 4.375% 15/10/2025 | USD | 856 049 | 927 862 | 0.32 |
| 750 000 | HUGHES SATELLITE SYSTEMS CORP 5.25% 01/08/2026 | USD | 687 937 | 747 733 | 0.26 |
| 750 000 | HUGHES SATELLITE SYSTEMS CORP 6.625% 01/08/2026 | USD | 686 710 | 751 700 | 0.26 |
| 1 000 000 | IBERDROLA INTERNATIONAL BV FRN PERPETUAL | EUR | 1 000 000 | 1 083 750 | 0.38 |

# Swiss Life Funds (LUX) Bond Global High Yield

## Anlagenübersicht (Fortsetzung)

| Nominalwert/ Menge | Bezeichnung | Kurs Währung | Kosten EUR | Marktwert EUR | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| **Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumenten, die an einer amtlichen Börse zugelassen sind oder auf einem anderen geregelten Markt gehandelt werden (Fortsetzung)** | | | | | |
| | **Anleihen (Fortsetzung)** | | | | |
| 1 500 000 | ICAHN ENTERPRISES LP / ICAHN ENTERPRISES FINANCE CORP 5.25% 15/05/2027 | USD | 1 359 732 | 1 372 265 | 0.48 |
| 1 500 000 | ICAHN ENTERPRISES LP / ICAHN ENTERPRISES FINANCE CORP 6.25% 15/05/2026 | USD | 1 340 722 | 1 400 655 | 0.49 |
| 1 500 000 | IHO VERWALTUNGS GMBH - REGS - 3.875% 15/05/2027 | EUR | 1 510 270 | 1 498 290 | 0.52 |
| 1 000 000 | IHO VERWALTUNGS GMBH - 144A - 6% 15/05/2027 | USD | 893 495 | 943 438 | 0.33 |
| 1 000 000 | IHO VERWALTUNGS GMBH 6.375% 15/05/2029 | USD | 896 539 | 984 160 | 0.34 |
| 500 000 | INEOS FINANCE PLC - REGS - 2.125% 15/11/2025 | EUR | 500 000 | 473 290 | 0.16 |
| 1 500 000 | INEOS FINANCE PLC - REGS - 2.875% 01/05/2026 | EUR | 1 500 000 | 1 440 000 | 0.50 |
| 2 300 000 | INFINEON TECHNOLOGIES AG FRN PERPETUAL | EUR | 2 298 905 | 2 294 089 | 0.79 |
| 2 000 000 | INTERNATIONAL DESIGN GROUP SPA - REGS - 6.5% 15/11/2025 | EUR | 1 971 000 | 1 960 920 | 0.68 |
| 1 300 000 | INTERNATIONAL GAME TECHNOLOGY PLC - 144A - 6.25% 15/02/2022 | USD | 1 166 563 | 1 218 919 | 0.42 |
| 250 000 | INTERTRUST GROUP BV - REGS - 3.375% 15/11/2025 | EUR | 250 000 | 254 810 | 0.09 |
| 1 500 000 | INTRUM AB - REGS - 3.125% 15/07/2024 | EUR | 1 508 438 | 1 433 040 | 0.50 |
| 2 500 000 | INTRUM AB - REGS - 3.5% 15/07/2026 | EUR | 2 522 350 | 2 387 775 | 0.83 |
| 2 500 000 | IPSOS 2.875% 21/09/2025 | EUR | 2 479 600 | 2 583 250 | 0.89 |
| 1 000 000 | IQVIA INC - REGS - 3.25% 15/03/2025 | EUR | 1 001 250 | 1 004 460 | 0.35 |
| 1 000 000 | IRON MOUNTAIN INC 6% 15/08/2023 | USD | 1 006 188 | 926 305 | 0.32 |
| 1 650 000 | JERROLD FINCO PLC - REGS - 6.125% 15/01/2024 | GBP | 1 954 977 | 1 958 261 | 0.68 |
| 1 500 000 | JERROLD FINCO PLC 4.875% 15/01/2026 | GBP | 1 780 944 | 1 747 375 | 0.61 |
| 1 650 000 | KAEFER ISOLIERTECHNIK GMBH & CO KG - REGS - 5.5% 10/01/2024 | EUR | 1 681 625 | 1 674 717 | 0.58 |
| 1 500 000 | KAISER ALUMINUM CORP 4.625% 01/03/2028 | USD | 1 367 949 | 1 364 222 | 0.47 |
| 1 000 000 | KRATON POLYMERS LLC / KRATON POLYMERS CAPITAL CORP - REGS - 5.25% 15/05/2026 | EUR | 1 016 900 | 950 780 | 0.33 |
| 1 000 000 | KRONOS INTERNATIONAL INC - REGS - 3.75% 15/09/2025 | EUR | 1 002 000 | 983 630 | 0.34 |
| 1 000 000 | L BRANDS INC 5.25% 01/02/2028 | USD | 839 047 | 875 943 | 0.30 |
| 1 500 000 | LA POSTE SA FRN PERPETUAL | EUR | 1 487 490 | 1 600 920 | 0.55 |
| 1 700 000 | LAGARDERE SCA 2.125% 16/10/2026 | EUR | 1 693 659 | 1 723 613 | 0.60 |
| 1 500 000 | LENNAR CORP 4.125% 15/01/2022 | USD | 1 424 075 | 1 394 838 | 0.48 |
| 2 500 000 | LHC3 PLC - REGS - 4.125% 15/08/2024 | EUR | 2 534 582 | 2 539 000 | 0.88 |
| 2 000 000 | LHMC FINCO 2 SARL - REGS - 7.25% 02/10/2025 | EUR | 2 020 250 | 1 971 560 | 0.68 |
| 350 000 | LINCOLN FINANCING SARL - REGS - 3.625% 01/04/2024 | EUR | 350 000 | 339 934 | 0.12 |
| 1 750 000 | LKQ EUROPEAN HOLDINGS BV - REGS - 3.625% 01/04/2026 | EUR | 1 751 742 | 1 756 108 | 0.61 |
| 1 000 000 | LOUISIANA-PACIFIC CORP 4.875% 15/09/2024 | USD | 889 482 | 917 238 | 0.32 |
| 3 200 000 | LOUVRE BIDCO SAS - REGS - 4.25% 30/09/2024 | EUR | 3 180 605 | 3 262 496 | 1.14 |
| 1 000 000 | LOXAM SAS 3.75% 15/07/2026 | EUR | 1 023 500 | 1 012 290 | 0.35 |
| 2 000 000 | LOXAM SAS 5.75% 15/07/2027 | EUR | 1 985 000 | 1 916 400 | 0.66 |
| 2 000 000 | MAGELLAN HEALTH INC FRN 22/09/2024 | USD | 1 809 504 | 1 873 549 | 0.65 |
| 1 000 000 | MATCH GROUP INC 6.375% 01/06/2024 | USD | 916 330 | 945 250 | 0.33 |
| 2 500 000 | MEDNAX INC 6.25% 15/01/2027 | USD | 2 263 647 | 2 189 858 | 0.76 |
| 1 000 000 | MILLICOM INTERNATIONAL CELLULAR SA - REGS - 6% 15/03/2025 | USD | 933 925 | 932 723 | 0.32 |
| 1 000 000 | MOTOR OIL FINANCE PLC 3.25% 01/04/2022 | EUR | 1 016 110 | 1 007 190 | 0.35 |
| 1 750 000 | MSCI INC 4% 15/11/2029 | USD | 1 588 049 | 1 650 810 | 0.57 |
| 2 500 000 | MULHACEN PTE LTD - REGS - 6.5% 01/08/2023 | EUR | 2 488 750 | 2 121 300 | 0.73 |
| 3 000 000 | NETFLIX INC - REGS - 3.625% 15/06/2030 | EUR | 2 989 750 | 3 080 460 | 1.07 |

# Swiss Life Funds (LUX) Bond Global High Yield

## Anlagenübersicht (Fortsetzung)

| Nominalwert/ Menge | Bezeichnung | Kurs Währung | Kosten EUR | Marktwert EUR | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| **Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumenten, die an einer amtlichen Börse zugelassen sind oder auf einem anderen geregelten Markt gehandelt werden (Fortsetzung)** | | | | | |
| | **Anleihen (Fortsetzung)** | | | | |
| 200 000 | NETFLIX INC 3.625% 15/05/2027 | EUR | 200 000 | 210 012 | 0.07 |
| 2 500 000 | NIELSEN CO LUXEMBOURG SARL - 144A - 5% 01/02/2025 | USD | 2 247 372 | 2 247 826 | 0.78 |
| 800 000 | NORDEX SE - REGS - 6.5% 01/02/2023 | EUR | 780 933 | 813 720 | 0.28 |
| 500 000 | NOVA CHEMICALS CORP - 144A - 4.875% 01/06/2024 | USD | 445 911 | 441 336 | 0.15 |
| 1 000 000 | NUSTAR LOGISTICS LP 5.625% 28/04/2027 | USD | 928 807 | 925 240 | 0.32 |
| 2 000 000 | OCI NV - REGS - 3.125% 01/11/2024 | EUR | 2 008 750 | 1 992 340 | 0.69 |
| 1 500 000 | OMEGA HEALTHCARE INVESTORS INC 4.375% 01/08/2023 | USD | 1 361 429 | 1 467 295 | 0.51 |
| 300 000 | ORANGE SA FRN PERPETUAL | EUR | 297 933 | 311 871 | 0.11 |
| 3 000 000 | ORANO SA 3.375% 23/04/2026 | EUR | 2 998 160 | 3 162 750 | 1.10 |
| 750 000 | ORSTED A/S FRN 31/12/3017 | EUR | 744 023 | 781 043 | 0.27 |
| 3 000 000 | PAPREC HOLDING SA - REGS - 4% 31/03/2025 | EUR | 2 841 620 | 2 714 520 | 0.94 |
| 1 750 000 | PARSLEY ENERGY LLC / PARSLEY FINANCE CORP - 144A - 5.625% 15/10/2027 | USD | 1 500 657 | 1 578 497 | 0.55 |
| 1 500 000 | PICARD GROUPE SAS - REGS - FRN 30/11/2023 | EUR | 1 500 900 | 1 385 310 | 0.48 |
| 500 000 | PILGRIM'S PRIDE CORP - 144A - 5.875% 30/09/2027 | USD | 435 920 | 472 370 | 0.16 |
| 1 000 000 | PITNEY BOWES INC 4.625% 15/03/2024 | USD | 731 374 | 860 513 | 0.30 |
| 2 000 000 | PRIME SECURITY SERVICES BORROWER LLC / PRIME FINANCE INC - 144A - 5.75% 15/04/2026 | USD | 1 848 711 | 1 896 126 | 0.66 |
| 3 000 000 | PRIME SECURITY SERVICES BORROWER LLC / PRIME FINANCE INC 6.25% 15/01/2028 | USD | 2 733 585 | 2 645 091 | 0.92 |
| 1 000 000 | QEP RESOURCES INC 5.25% 01/05/2023 | USD | 833 935 | 815 267 | 0.28 |
| 1 100 000 | QEP RESOURCES INC 5.625% 01/03/2026 | USD | 944 279 | 801 780 | 0.28 |
| 1 500 000 | Q-PARK HOLDING I BV 2% 01/03/2027 | EUR | 1 500 000 | 1 477 875 | 0.51 |
| 400 000 | QUATRIM SASU - REGS - 5.875% 15/01/2024 | EUR | 400 000 | 399 700 | 0.14 |
| 500 000 | QUICKEN LOANS INC - 144A - 5.25% 15/01/2028 | USD | 418 489 | 472 420 | 0.16 |
| 2 000 000 | QVC INC 4.75% 15/02/2027 | USD | 1 818 430 | 1 792 508 | 0.62 |
| 2 000 000 | RANGE RESOURCES CORP 5% 15/08/2022 | USD | 1 700 325 | 1 516 009 | 0.52 |
| 3 000 000 | RCS & RDS SA 3.25% 05/02/2028 | EUR | 3 005 000 | 2 902 320 | 1.01 |
| 2 150 000 | REKEEP SPA - REGS - 9% 15/06/2022 | EUR | 2 117 750 | 1 987 654 | 0.69 |
| 600 000 | RR DONNELLEY & SONS CO 7.875% 15/03/2021 | USD | 467 884 | 564 643 | 0.20 |
| 1 000 000 | SABRA HEALTH CARE LP 5.125% 15/08/2026 | USD | 913 838 | 1 012 736 | 0.35 |
| 1 500 000 | SALINI IMPREGILO SPA 1.75% 26/10/2024 | EUR | 1 194 582 | 1 283 265 | 0.44 |
| 1 500 000 | SAMSONITE FINCO SARL - REGS - 3.5% 15/05/2026 | EUR | 1 412 500 | 1 438 500 | 0.50 |
| 2 000 000 | SAPPI PAPIER HOLDING GMBH - REGS - 3.125% 15/04/2026 | EUR | 1 961 200 | 1 864 080 | 0.65 |
| 1 000 000 | SARENS FINANCE CO NV 5.75% 21/02/2027 | EUR | 1 000 000 | 904 600 | 0.31 |
| 2 000 000 | SBA COMMUNICATIONS CORP 3.875% 15/02/2027 | USD | 1 820 546 | 1 851 117 | 0.64 |
| 2 000 000 | SCHOELLER PACKAGING BV - REGS - 6.375% 01/11/2024 | EUR | 2 007 700 | 2 076 640 | 0.72 |
| 650 000 | SCIENTIFIC GAMES INTERNATIONAL INC - REGS - 3.375% 15/02/2026 | EUR | 650 000 | 645 119 | 0.22 |
| 500 000 | SEAGATE HDD CAYMAN 4.75% 01/01/2025 | USD | 354 222 | 471 915 | 0.16 |
| 1 500 000 | SEAGATE HDD CAYMAN 4.875% 01/06/2027 | USD | 1 320 583 | 1 437 334 | 0.50 |
| 1 750 000 | SEVEN GENERATIONS ENERGY LTD - 144A - 5.375% 30/09/2025 | USD | 1 498 986 | 1 459 106 | 0.51 |
| 500 000 | SHELF DRILLING HOLDINGS LTD - 144A - 8.25% 15/02/2025 | USD | 432 771 | 377 864 | 0.13 |
| 2 000 000 | SINCLAIR TELEVISION GROUP INC 5.5% 01/03/2030 | USD | 1 805 136 | 1 802 504 | 0.62 |
| 2 600 000 | SISAL PAY SPA - REGS - FRN 17/12/2026 | EUR | 2 617 200 | 2 552 628 | 0.88 |
| 1 500 000 | SIX FLAGS ENTERTAINMENT CORP - 144A - 4.875% 31/07/2024 | USD | 1 363 135 | 1 349 215 | 0.47 |

# Swiss Life Funds (LUX) Bond Global High Yield

## Anlagenübersicht (Fortsetzung)

| Nominalwert/ Menge | Bezeichnung | Kurs Währung | Kosten EUR | Marktwert EUR | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| **Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumenten, die an einer amtlichen Börse zugelassen sind oder auf einem anderen geregelten Markt gehandelt werden (Fortsetzung)** | | | | | |
| | **Anleihen (Fortsetzung)** | | | | |
| 1 000 000 | SMURFIT KAPPA ACQUISITIONS ULC 2.875% 15/01/2026 | EUR | 1 007 500 | 1 085 100 | 0.38 |
| 500 000 | SMURFIT KAPPA TREASURY ULC 1.5% 15/09/2027 | EUR | 500 000 | 499 505 | 0.17 |
| 1 000 000 | SOFTBANK GROUP CORP FRN PERPETUAL | USD | 855 958 | 881 688 | 0.31 |
| 800 000 | SOFTBANK GROUP CORP 4% 20/04/2023 | EUR | 800 000 | 848 032 | 0.29 |
| 1 500 000 | SOFTBANK GROUP CORP 5% 15/04/2028 | EUR | 1 492 215 | 1 649 565 | 0.57 |
| 1 500 000 | SOUTHWESTERN ENERGY CO FRN 23/01/2025 | USD | 1 343 855 | 1 004 206 | 0.35 |
| 100 000 | SPCM SA - 144A - 4.875% 15/09/2025 | USD | 94 162 | 93 037 | 0.03 |
| 600 000 | SPRINT COMMUNICATIONS INC 11.5% 15/11/2021 | USD | 547 314 | 624 061 | 0.22 |
| 3 000 000 | SPRINT CORP 7.25% 01/02/2028 | USD | 2 687 255 | 2 738 686 | 0.95 |
| 600 000 | SSAB AB 2.875% 06/09/2023 | EUR | 596 568 | 612 054 | 0.21 |
| 1 000 000 | STANDARD INDUSTRIES INC/NJ - REGS - 2.25% 21/11/2026 | EUR | 1 000 000 | 1 006 282 | 0.35 |
| 2 000 000 | STANDARD INDUSTRIES INC/NJ - 144A - 4.75% 15/01/2028 | USD | 1 695 562 | 1 872 675 | 0.65 |
| 1 500 000 | STARWOOD PROPERTY TRUST INC 4.75% 15/03/2025 | USD | 1 255 325 | 1 410 201 | 0.49 |
| 1 250 000 | STENA INTERNATIONAL SA - 144A - 5.75% 01/03/2024 | USD | 945 350 | 1 141 290 | 0.40 |
| 1 500 000 | SUMMER BC HOLDCO A SARL - REGS - 9.25% 31/10/2027 | EUR | 1 334 851 | 1 386 369 | 0.48 |
| 1 000 000 | SUMMER BC HOLDCO B SARL - REGS - 5.75% 31/10/2026 | EUR | 1 000 000 | 1 029 630 | 0.36 |
| 900 000 | SUNOCO LP / SUNOCO FINANCE CORP 4.875% 15/01/2023 | USD | 736 599 | 817 829 | 0.28 |
| 1 250 000 | SUNOCO LP / SUNOCO FINANCE CORP 5.875% 15/03/2028 | USD | 1 031 039 | 1 172 425 | 0.41 |
| 1 500 000 | SUNSHINE MID BV - REGS - 6.5% 15/05/2026 | EUR | 1 534 450 | 1 474 560 | 0.51 |
| 2 000 000 | TCW 1149 COLL TV 25/11/2030 4.5% 01/02/2026 | USD | - | - | 0.00 |
| 1 000 000 | TELECOM ITALIA SPA/MILANO 2.375% 12/10/2027 | EUR | 991 850 | 1 040 430 | 0.36 |
| 3 000 000 | TELECOM ITALIA SPA/MILANO 2.875% 28/01/2026 | EUR | 3 000 000 | 3 206 790 | 1.11 |
| 1 000 000 | TELECOM ITALIA SPA/MILANO 4% 11/04/2024 | EUR | 994 360 | 1 090 510 | 0.38 |
| 1 000 000 | TELEFONICA EUROPE BV FRN PERPETUAL | EUR | 1 000 000 | 1 038 380 | 0.36 |
| 2 000 000 | TELEFONICA EUROPE BV FRN PERPETUAL | EUR | 1 799 000 | 2 139 800 | 0.74 |
| 2 000 000 | TIKEHAU CAPITAL SCA 2.25% 14/10/2026 | EUR | 1 997 180 | 2 070 420 | 0.72 |
| 750 000 | TITAN GLOBAL FINANCE PLC 2.375% 16/11/2024 | EUR | 750 000 | 756 788 | 0.26 |
| 1 000 000 | T-MOBILE USA INC 0% 01/03/2023 | USD | - | - | 0.00 |
| 2 000 000 | T-MOBILE USA INC 4.5% 01/02/2026 | USD | 1 634 263 | 1 845 236 | 0.64 |
| 1 000 000 | T-MOBILE USA INC 4.75% 01/02/2028 | USD | 818 474 | 947 927 | 0.33 |
| 1 250 000 | TRANSOCEAN INC - 144A - 7.25% 01/11/2025 | USD | 1 091 172 | 941 656 | 0.33 |
| 2 000 000 | TRANSPORTES AEREOS PORTUGUESES SA - REGS - 5.625% 02/12/2024 | EUR | 1 999 578 | 1 990 700 | 0.69 |
| 150 000 | TRIUMPH GROUP INC - 144A - 6.25% 15/09/2024 | USD | 135 661 | 140 429 | 0.05 |
| 900 000 | TRIUMPH GROUP INC 7.75% 15/08/2025 | USD | 774 582 | 811 274 | 0.28 |
| 1 900 000 | VALEANT PHARMACEUTICALS INTERNATIONAL INC - REGS - 4.5% 15/05/2023 | EUR | 1 682 925 | 1 890 310 | 0.65 |
| 1 000 000 | VICTORIA PLC 5.25% 15/07/2024 | EUR | 1 050 000 | 984 090 | 0.34 |
| 3 200 000 | VIVION INVESTMENTS SARL 3.5% 01/11/2025 | EUR | 3 318 748 | 3 278 688 | 1.15 |
| 1 500 000 | VMWARE INC 3.9% 21/08/2027 | USD | 1 277 307 | 1 469 666 | 0.51 |
| 1 500 000 | VOLKSWAGEN INTERNATIONAL FINANCE NV FRN PERPETUAL | EUR | 1 500 000 | 1 542 765 | 0.53 |
| 1 500 000 | VOLKSWAGEN INTERNATIONAL FINANCE NV FRN PERPETUAL | EUR | 1 500 000 | 1 647 120 | 0.57 |
| 1 500 000 | WALNUT BIDCO PLC - REGS - 6.75% 01/08/2024 | EUR | 1 537 464 | 1 440 030 | 0.50 |
| 500 000 | WMG ACQUISITION CORP - REGS - 3.625% 15/10/2026 | EUR | 500 000 | 518 970 | 0.18 |
| 1 000 000 | WOLVERINE WORLD WIDE INC - 144A - 5% 01/09/2026 | USD | 888 941 | 938 031 | 0.32 |

# Swiss Life Funds (LUX) Bond Global High Yield

## Anlagenübersicht (Fortsetzung)

| Nominalwert/ Menge | Bezeichnung | Kurs Währung | Kosten EUR | Marktwert EUR | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| **Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumenten, die an einer amtlichen Börse zugelassen sind oder auf einem anderen geregelten Markt gehandelt werden (Fortsetzung)** | | | | | |
| | **Anleihen (Fortsetzung)** | | | | |
| 2 000 000 | WPX ENERGY INC 5.25% 15/09/2024 | USD | 1 685 534 | 1 829 432 | 0.63 |
| 1 000 000 | WYNDHAM HOTELS & RESORTS INC - 144A - 5.375% 15/04/2026 | USD | 858 099 | 945 896 | 0.33 |
| 1 500 000 | XEROX CORP FRN 15/03/2023 | USD | 1 248 220 | 1 387 887 | 0.48 |
| | **Gesamtsumme der Anleihen** | | **279 250 161** | **281 018 422** | **97.31** |
| | **Optionsscheine** | | | | |
| 3 000 000 | OFFSHORE GROUP INVESTMENT LTD / WRT OFFSHORE - 01/11/2019 | USD | 2 693 | 2 731 | 0.00 |
| | **Gesamtsumme der Optionsscheine** | | **2 693** | **2 731** | **0.00** |
| **Gesamtsumme übertragbarer Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer amtlichen Börse zugelassen sind oder auf einem anderen geregelten Markt gehandelt werden** | | | **279 252 854** | **281 021 153** | **97.32** |
| **Sonstige übertragbare Wertpapiere** | | | | | |
| | **Anleihen** | | | | |
| 3 000 000 | SAMSON INV ESCROW 0% 15/02/2020 DEFAULTED | USD | - | - | 0.00 |
| | **Gesamtsumme der Anleihen** | | **-** | **-** | **0.00** |
| **Gesamtsumme sonstiger übertragbarer Wertpapiere** | | | **0** | **0** | **0.00** |
| **Investmentfonds** | | | | | |
| | **Offene Anlagefonds** | | | | |
| 1 | SWISS LIFE FUNDS F OPPORTUNITE HIGH YIELD 2023 - F | EUR | 100 | 103 | 0.00 |
| 1 | SWISS LIFE FUNDS F OPPORTUNITE HIGH YIELD 2023 - I-D | EUR | 10 000 | 10 388 | 0.00 |
| 1 | SWISS LIFE FUNDS F OPPORTUNITE HIGH YIELD 2023 - P-C | EUR | 100 | 103 | 0.00 |
| 1 | SWISS LIFE FUNDS F OPPORTUNITE HIGH YIELD 2023 - P-D | EUR | 100 | 101 | 0.00 |
| | **Gesamtsumme offene Anlagefonds** | | **10 300** | **10 695** | **0.00** |
| **Gesamtsumme der Anlagefonds** | | | **10 300** | **10 695** | **0.00** |
| **Gesamtsumme der Anlagen** | | | **279 263 154** | **281 031 848** | **97.32** |

# Swiss Life Funds (LUX) Bond Global High Yield

## Sektorstruktur und geographische Verteilung der Anlagen

| Sektorstruktur | % |
|---|---|
| Finanzdienstleistungen | 28.45 |
| Allgemeine Industrie | 5.87 |
| Öl- und Gasproduzenten | 5.38 |
| Reise, Freizeit und Catering | 4.73 |
| Festnetz-Telekommunikation | 4.59 |
| Medien | 4.37 |
| Kundenbetreuung | 3.87 |
| Elektrizität | 3.32 |
| Technologie Hardware und Geräte | 3.13 |
| Industriemetalle und Bergbau | 2.91 |
| Geräte und Dienstleistungen im Gesundheitswesen | 2.56 |
| Industrietransport | 2.45 |
| Mobilfunk | 2.45 |
| Bauwirtschaft und Baustoffe | 2.25 |
| Chemikalien | 2.08 |
| Gas-, Wasser- und Mehrfachversorgungsunternehmen | 1.69 |
| Lebensmittel- und Arzneimittelhandel | 1.67 |
| Industrietechnik | 1.65 |
| Immobilienbezogene Dienstleistungen und Investitionen | 1.64 |
| Software- und Computerdienstleistungen | 1.63 |
| Pharmazeutik und Biotechnologie | 1.51 |
| Immobilienbezogene Anlagefonds | 1.45 |
| Automobilbau und -teile | 1.41 |
| Allgemeiner Einzelhandel | 1.41 |
| Persönliche Güter | 1.28 |
| Haushaltswaren und Heimwerkerbedarf | 0.82 |
| Forst- und Papierindustrie | 0.65 |
| Ölbranche: Maschinen, Dienstleistungen und Vertrieb | 0.64 |
| Elektronische und elektrische Geräte | 0.36 |
| Luft- und Raumfahrt und Verteidigung | 0.33 |
| Freizeitartikel | 0.33 |
| Alternative Energie | 0.28 |
| Lebensmittelhersteller | 0.16 |
| | **97.32** |

| Geographische Verteilung | % |
|---|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika | 36.87 |
| Frankreich | 16.07 |
| Niederlande | 9.39 |
| Luxemburg | 6.91 |
| Großbritannien | 5.44 |
| Italien | 4.54 |
| Deutschland | 2.84 |
| Schweden | 2.43 |
| Jersey Inseln | 1.69 |
| Kanada | 1.34 |
| Japan | 1.17 |
| Kaimaninseln | 1.12 |
| Rumänien | 1.01 |
| Spanien | 1.00 |
| Portugal | 0.99 |
| Australien | 0.98 |
| Irland | 0.90 |
| Singapur | 0.73 |
| Norwegen | 0.67 |
| Österreich | 0.65 |
| Belgien | 0.31 |
| Dänemark | 0.27 |
| | **97.32** |

# Swiss Life Funds (LUX) Bond Inflation Protection

## Anlagenübersicht

| Nominalwert/ Menge | Bezeichnung | Kurs Währung | Kosten EUR | Marktwert EUR | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| **Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumenten, die an einer amtlichen Börse zugelassen sind oder auf einem anderen geregelten Markt gehandelt werden** | | | | | |
| | **Supranationale Institutionen, Regierungen und örtliche Behörden, Schuldtitel** | | | | |
| 1 100 000 | DEUTSCHE BUNDESREPUBLIK INFLATION LINKED BOND FRN 15/04/2030 | EUR | 1 375 089 | 1 410 244 | 6.85 |
| 2 520 000 | ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO FRN 15/05/2028 | EUR | 2 744 696 | 2 834 097 | 13.77 |
| 1 350 000 | UNITED STATES TREASURY INFLATION INDEXED BONDS FRN 15/01/2030 | USD | 1 245 523 | 1 281 780 | 6.23 |
| 4 610 000 | UNITED STATES TREASURY INFLATION INDEXED BONDS FRN 15/02/2045 | USD | 4 418 810 | 5 260 386 | 25.55 |
| 2 930 000 | UNITED STATES TREASURY INFLATION INDEXED BONDS FRN 15/02/2046 | USD | 3 165 996 | 3 521 166 | 17.10 |
| 5 790 000 | UNITED STATES TREASURY INFLATION INDEXED BONDS FRN 15/07/2029 | USD | 5 381 328 | 5 591 100 | 27.15 |
| | **Summe supranationale Institutionen, Regierungen und örtliche Behörden, Schuldtitel** | | **18 331 442** | **19 898 773** | **96.65** |
| | **Gesamtsumme übertragbarer Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer amtlichen Börse zugelassen sind oder auf einem anderen geregelten Markt gehandelt werden** | | **18 331 442** | **19 898 773** | **96.65** |
| | **Gesamtsumme der Anlagen** | | **18 331 442** | **19 898 773** | **96.65** |

## Swiss Life Funds (LUX) Bond Inflation Protection

### Sektorstruktur und geographische Verteilung der Anlagen

| Sektorstruktur | % |
|---|---|
| Behörden | 96.65 |
| | **96.65** |

| Geographische Verteilung | % |
|---|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika | 76.03 |
| Italien | 13.77 |
| Deutschland | 6.85 |
| | **96.65** |

# Swiss Life Funds (LUX) Equity Euro Zone

## Anlagenübersicht

| Nominalwert/ Menge | Bezeichnung | Kurs Währung | Kosten EUR | Marktwert EUR | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| **Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumenten, die an einer amtlichen Börse zugelassen sind oder auf einem anderen geregelten Markt gehandelt werden** | | | | | |
| **Aktien** | | | | | |
| 35 934 | AALBERTS NV | EUR | 1 416 602 | 1 212 773 | 0.58 |
| 44 928 | ACS ACTIVIDADES DE CONSTRUCCION Y SERVICIOS SA | EUR | 1 523 254 | 1 206 317 | 0.58 |
| 42 118 | ACS ACTIVIDADES DE CONSTRUCCION Y SERVICIOS SA - RIGHTS - 03/03/2020 | EUR | - | 16 776 | 0.01 |
| 14 049 | ADIDAS AG - REG - REG | EUR | 3 912 845 | 3 519 977 | 1.68 |
| 970 | ADYEN NV | EUR | 773 284 | 773 284 | 0.37 |
| 486 192 | AEGON NV | EUR | 1 493 096 | 1 493 096 | 0.71 |
| 5 451 | AENA SME SA | EUR | 895 489 | 790 395 | 0.38 |
| 14 889 | AGEAS | EUR | 725 660 | 623 551 | 0.30 |
| 398 401 | AIB GROUP PLC | EUR | 1 049 033 | 835 845 | 0.40 |
| 34 321 | AIR LIQUIDE SA | EUR | 4 177 121 | 4 218 051 | 2.01 |
| 16 233 | AIRBUS SE | EUR | 1 979 321 | 1 754 787 | 0.84 |
| 30 988 | ALLIANZ SE - REG | EUR | 6 483 122 | 6 036 462 | 2.87 |
| 14 243 | ALSTOM SA | EUR | 551 571 | 633 671 | 0.30 |
| 70 473 | ALSTRIA OFFICE REIT-AG | EUR | 1 112 186 | 1 208 612 | 0.58 |
| 245 354 | ALTICE EUROPE NV - A | EUR | 1 426 143 | 1 188 249 | 0.57 |
| 18 650 | AMUNDI SA | EUR | 1 199 964 | 1 205 723 | 0.57 |
| 9 996 | ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV | EUR | 867 049 | 507 097 | 0.24 |
| 57 189 | AROUNDTOWN SA | EUR | 488 737 | 447 675 | 0.21 |
| 11 447 | ASM INTERNATIONAL NV | EUR | 722 929 | 1 201 363 | 0.57 |
| 18 452 | ASML HOLDING NV | EUR | 4 243 218 | 4 577 941 | 2.18 |
| 39 686 | ASR NEDERLAND NV | EUR | 1 195 342 | 1 195 342 | 0.57 |
| 186 089 | ASSICURAZIONI GENERALI SPA | EUR | 3 015 385 | 3 025 807 | 1.44 |
| 15 912 | AXA SA | EUR | 375 708 | 333 436 | 0.16 |
| 635 633 | BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA SA | EUR | 3 194 492 | 2 755 151 | 1.31 |
| 327 077 | BANCO SANTANDER SA | EUR | 1 233 461 | 1 088 185 | 0.52 |
| 223 883 | BANKINTER SA | EUR | 1 309 146 | 1 195 535 | 0.57 |
| 14 794 | BASF SE - REG | EUR | 945 403 | 785 266 | 0.37 |
| 10 173 | BECHTLE AG | EUR | 1 202 499 | 1 209 570 | 0.58 |
| 8 256 | BEIERSDORF AG | EUR | 873 615 | 783 494 | 0.37 |
| 7 621 | BIOMERIEUX | EUR | 573 769 | 635 210 | 0.30 |
| 19 606 | BNP PARIBAS SA | EUR | 895 227 | 858 449 | 0.41 |
| 45 278 | BOUYGUES SA | EUR | 1 606 463 | 1 606 463 | 0.77 |
| 29 688 | BRENNTAG AG | EUR | 1 303 569 | 1 199 692 | 0.57 |
| 6 690 | CASINO GUICHARD PERRACHON SA | EUR | 235 421 | 235 421 | 0.11 |
| 3 642 | CIE GENERALE DES ETABLISSEMENTS MICHELIN SCA | EUR | 350 506 | 350 506 | 0.17 |
| 94 160 | CNP ASSURANCES | EUR | 1 549 512 | 1 332 364 | 0.64 |
| 54 251 | COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS PLC | USD | 2 629 936 | 2 516 847 | 1.20 |
| 3 212 | COFINIMMO SA | EUR | 417 144 | 463 170 | 0.22 |
| 43 448 | COLRUYT SA | EUR | 2 142 553 | 1 816 995 | 0.87 |
| 34 715 | COVESTRO AG | EUR | 1 304 201 | 1 197 320 | 0.57 |
| 25 186 | CTS EVENTIM AG & CO KGAA | EUR | 1 302 747 | 1 204 898 | 0.57 |
| 4 000 | DANONE SA | EUR | 295 282 | 254 880 | 0.12 |
| 16 965 | DEUTSCHE BOERSE AG | EUR | 2 416 650 | 2 409 878 | 1.15 |

# Swiss Life Funds (LUX) Equity Euro Zone

## Anlagenübersicht (Fortsetzung)

| Nominalwert/ Menge | Bezeichnung | Kurs Währung | Kosten EUR | Marktwert EUR | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| **Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumenten, die an einer amtlichen Börse zugelassen sind oder auf einem anderen geregelten Markt gehandelt werden (Fortsetzung)** | | | | | |
| | **Anteile (Fortsetzung)** | | | | |
| 79 807 | DEUTSCHE TELEKOM AG - REG | EUR | 1 227 784 | 1 177 632 | 0.56 |
| 33 167 | DEUTSCHE WOHNEN SE | EUR | 1 209 269 | 1 209 269 | 0.58 |
| 55 126 | DIALOG SEMICONDUCTOR PLC | EUR | 2 218 166 | 1 687 407 | 0.80 |
| 7 555 | EDENRED | EUR | 356 369 | 356 369 | 0.17 |
| 18 626 | EIFFAGE SA | EUR | 1 813 605 | 1 795 919 | 0.86 |
| 6 896 | ELIA GROUP SA/NV | EUR | 602 485 | 621 330 | 0.30 |
| 30 637 | ELISA OYJ | EUR | 1 245 443 | 1 591 286 | 0.76 |
| 53 502 | ENAGAS SA | EUR | 1 130 235 | 1 251 947 | 0.60 |
| 32 099 | ENDESA SA | EUR | 695 575 | 745 660 | 0.36 |
| 180 236 | ENEL SPA | EUR | 1 109 506 | 1 365 468 | 0.65 |
| 97 696 | ENI SPA | EUR | 1 330 062 | 1 090 092 | 0.52 |
| 9 512 | ESSILORLUXOTTICA SA | EUR | 1 284 144 | 1 170 927 | 0.56 |
| 24 088 | EURONEXT NV | EUR | 1 634 586 | 1 812 622 | 0.86 |
| 148 041 | EUTELSAT COMMUNICATIONS SA | EUR | 1 956 118 | 1 812 022 | 0.86 |
| 14 467 | FERRARI NV | EUR | 2 036 791 | 2 047 804 | 0.98 |
| 127 294 | FINECOBANK BANCA FINECO SPA | EUR | 1 319 514 | 1 208 529 | 0.58 |
| 84 708 | FORTUM OYJ | EUR | 1 832 502 | 1 633 170 | 0.78 |
| 12 547 | FRESENIUS MEDICAL CARE AG & CO KGAA | EUR | 869 758 | 869 758 | 0.41 |
| 1 965 | GECINA SA | EUR | 315 776 | 315 776 | 0.15 |
| 43 188 | GETLINK SE - REG | EUR | 629 681 | 629 681 | 0.30 |
| 3 186 | GLANBIA PLC | EUR | 34 765 | 33 612 | 0.02 |
| 21 624 | GRIFOLS SA | EUR | 688 019 | 627 096 | 0.30 |
| 11 272 | HANNOVER RUECK SE - REG | EUR | 1 752 754 | 1 814 792 | 0.87 |
| 32 660 | HELLA GMBH & CO KGAA | EUR | 1 383 778 | 1 219 524 | 0.58 |
| 10 337 | HENKEL AG & CO KGAA - PFD | EUR | 865 000 | 865 000 | 0.41 |
| 395 297 | HERA SPA | EUR | 1 352 668 | 1 532 962 | 0.73 |
| 818 | HOCHTIEF AG | EUR | 90 114 | 72 761 | 0.03 |
| 36 512 | HUGO BOSS AG | EUR | 1 576 643 | 1 444 415 | 0.69 |
| 40 273 | HUHTAMAKI OYJ | EUR | 1 497 724 | 1 502 183 | 0.72 |
| 299 055 | IBERDROLA SA | EUR | 2 734 225 | 3 086 248 | 1.47 |
| 139 721 | INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL SA | EUR | 3 986 099 | 3 930 352 | 1.87 |
| 324 186 | INTESA SANPAOLO SPA | EUR | 760 689 | 712 723 | 0.34 |
| 214 883 | ITALGAS SPA | EUR | 1 228 597 | 1 188 733 | 0.57 |
| 101 599 | JERONIMO MARTINS SGPS SA | EUR | 1 523 955 | 1 615 932 | 0.77 |
| 331 | KERING SA | EUR | 179 572 | 167 420 | 0.08 |
| 2 862 | KERRY GROUP PLC | EUR | 332 019 | 329 130 | 0.16 |
| 10 159 | KESKO OYJ - B | EUR | 635 194 | 623 153 | 0.30 |
| 21 154 | KINGSPAN GROUP PLC | EUR | 1 206 836 | 1 206 836 | 0.58 |
| 7 669 | KNORR-BREMSE AG | EUR | 705 471 | 705 471 | 0.34 |
| 83 577 | KOJAMO OYJ | EUR | 1 333 246 | 1 417 466 | 0.68 |
| 53 086 | KONE OYJ - B | EUR | 2 734 733 | 2 707 386 | 1.29 |
| 167 443 | KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV | EUR | 3 791 832 | 3 546 443 | 1.69 |
| 215 824 | KONINKLIJKE KPN NV | EUR | 522 062 | 475 029 | 0.23 |
| 17 383 | LEGRAND SA | EUR | 1 199 775 | 1 199 775 | 0.57 |

# Swiss Life Funds (LUX) Equity Euro Zone

## Anlagenübersicht (Fortsetzung)

| Nominalwert/ Menge | Bezeichnung | Kurs Währung | Kosten EUR | Marktwert EUR | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| **Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumenten, die an einer amtlichen Börse zugelassen sind oder auf einem anderen geregelten Markt gehandelt werden (Fortsetzung)** | | | | | |
| | **Anteile (Fortsetzung)** | | | | |
| 3 374 | LINDE PLC | EUR | 604 913 | 579 485 | 0.28 |
| 5 687 | L'OREAL SA | EUR | 1 477 733 | 1 370 567 | 0.65 |
| 19 343 | LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE | EUR | 7 376 309 | 7 173 352 | 3.41 |
| 588 079 | MAPFRE SA | EUR | 1 189 428 | 1 190 860 | 0.57 |
| 25 602 | MERCK KGAA | EUR | 2 624 870 | 2 791 898 | 1.33 |
| 175 209 | METRO AG | EUR | 2 337 857 | 1 837 066 | 0.88 |
| 5 546 | MTU AERO ENGINES AG | EUR | 1 224 002 | 1 224 002 | 0.58 |
| 17 698 | MUENCHENER RUECKVERSICHERUNGS-GESELLSCHAFT AG IN MUENCHEN - REG | EUR | 3 674 804 | 4 082 929 | 1.95 |
| 106 243 | NATURGY ENERGY GROUP SA | EUR | 2 269 414 | 2 234 290 | 1.07 |
| 12 576 | NESTE OYJ | EUR | 411 363 | 448 460 | 0.21 |
| 10 486 | OMV AG | EUR | 427 608 | 396 895 | 0.19 |
| 73 668 | ORANGE SA | EUR | 942 950 | 898 013 | 0.43 |
| 51 299 | ORION OYJ - B | EUR | 1 828 507 | 1 844 199 | 0.88 |
| 6 653 | PADDY POWER BETFAIR PLC | EUR | 695 524 | 638 555 | 0.30 |
| 68 852 | PEUGEOT SA | EUR | 1 397 353 | 1 205 254 | 0.57 |
| 123 055 | POSTE ITALIANE SPA | EUR | 1 181 788 | 1 183 051 | 0.56 |
| 110 659 | PROSIEBENSAT.1 MEDIA SE | EUR | 1 450 891 | 1 213 929 | 0.58 |
| 34 575 | PUBLICIS GROUPE SA | EUR | 1 209 434 | 1 209 434 | 0.58 |
| 25 967 | RANDSTAD NV | EUR | 1 297 732 | 1 212 919 | 0.58 |
| 36 347 | RED ELECTRICA CORP SA | EUR | 653 854 | 630 439 | 0.30 |
| 12 877 | RUBIS SCA | EUR | 676 752 | 628 398 | 0.30 |
| 2 576 | SAFRAN SA | EUR | 367 612 | 319 682 | 0.15 |
| 92 311 | SANOFI | EUR | 7 679 478 | 7 747 662 | 3.68 |
| 42 783 | SAP SE | EUR | 4 663 150 | 4 772 871 | 2.27 |
| 5 841 | SARTORIUS AG | EUR | 1 207 149 | 1 209 087 | 0.58 |
| 7 002 | SARTORIUS STEDIM BIOTECH | EUR | 1 193 841 | 1 202 243 | 0.57 |
| 42 300 | SCHNEIDER ELECTRIC SE | EUR | 3 440 574 | 3 828 150 | 1.83 |
| 19 161 | SCOR SE | EUR | 622 733 | 622 733 | 0.30 |
| 10 260 | SEB SA | EUR | 1 383 330 | 1 222 992 | 0.58 |
| 22 535 | SIEMENS AG - REG | EUR | 2 239 747 | 2 100 262 | 1.00 |
| 44 810 | SIGNIFY NV | EUR | 1 213 883 | 1 200 908 | 0.57 |
| 21 205 | SODEXO SA | EUR | 1 944 651 | 1 839 322 | 0.88 |
| 14 684 | SOLVAY SA | EUR | 1 205 263 | 1 205 263 | 0.57 |
| 8 269 | SOPRA GROUPE | EUR | 910 828 | 1 204 793 | 0.57 |
| 49 847 | STMICROELECTRONICS NV | EUR | 1 123 612 | 1 216 765 | 0.58 |
| 43 742 | SUEZ | EUR | 589 629 | 624 636 | 0.30 |
| 3 094 | SYMRISE AG | EUR | 272 705 | 272 705 | 0.13 |
| 82 580 | TAG IMMOBILIEN AG | EUR | 1 827 545 | 1 811 805 | 0.86 |
| 53 025 | TELENET GROUP HOLDING NV | EUR | 2 044 162 | 1 830 423 | 0.87 |
| 5 497 | TELEPERFORMANCE | EUR | 1 234 757 | 1 208 241 | 0.58 |
| 8 582 | THALES SA | EUR | 770 833 | 779 246 | 0.37 |
| 171 080 | TOTAL SA | EUR | 8 304 892 | 6 566 050 | 3.12 |
| 22 499 | UCB SA | EUR | 1 719 362 | 1 880 016 | 0.90 |

# Swiss Life Funds (LUX) Equity Euro Zone

## Anlagenübersicht (Fortsetzung)

| Nominalwert/ Menge | Bezeichnung | Kurs Währung | Kosten EUR | Marktwert EUR | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| **Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumenten, die an einer amtlichen Börse zugelassen sind oder auf einem anderen geregelten Markt gehandelt werden (Fortsetzung)** | | | | | |
| | **Anteile (Fortsetzung)** | | | | |
| 75 753 | UNILEVER NV | EUR | 4 013 573 | 3 606 979 | 1.72 |
| 56 425 | VALMET OYJ | EUR | 1 133 641 | 1 205 238 | 0.57 |
| 46 087 | VEOLIA ENVIRONNEMENT SA | EUR | 1 195 036 | 1 195 036 | 0.57 |
| 39 582 | VINCI SA | EUR | 3 945 413 | 3 601 170 | 1.72 |
| 38 083 | VIVENDI SA | EUR | 876 671 | 876 671 | 0.42 |
| 5 721 | WENDEL SA | EUR | 677 645 | 633 315 | 0.30 |
| 52 331 | WIENERBERGER AG | EUR | 1 339 345 | 1 207 799 | 0.58 |
| 10 760 | WOLTERS KLUWER NV | EUR | 713 651 | 713 603 | 0.34 |
| | **Gesamtsumme der Aktien** | | **217 149 591** | **210 022 295** | **100.12** |
| | **Gesamtsumme übertragbarer Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer amtlichen Börse zugelassen sind oder auf einem anderen geregelten Markt gehandelt werden** | | **217 149 591** | **210 022 295** | **100.12** |
| | **Gesamtsumme der Anlagen** | | **217 149 591** | **210 022 295** | **100.12** |

# Swiss Life Funds (LUX) Equity Euro Zone

## Sektorstruktur und geographische Verteilung der Anlagen

| Sektorstruktur | % |
|---|---|
| Versicherungen (ohne Lebensversicherung) | 8.72 |
| Persönliche Güter | 8.53 |
| Pharmazeutik und Biotechnologie | 7.10 |
| Bauwirtschaft und Baustoffe | 5.11 |
| Lebensmittel- und Arzneimittelhandel | 4.61 |
| Chemikalien | 4.51 |
| Gas-, Wasser- und Mehrfachversorgungsunternehmen | 4.48 |
| Medien | 4.22 |
| Technologie Hardware und Geräte | 4.14 |
| Banken | 4.13 |
| Öl- und Gasproduzenten | 4.05 |
| Industrietechnik | 3.66 |
| Elektrizität | 3.50 |
| Software- und Computerdienstleistungen | 3.43 |
| Elektronische und elektrische Geräte | 2.97 |
| Finanzdienstleistungen | 2.89 |
| Immobilienbezogene Dienstleistungen und Investitionen | 2.33 |
| Automobilbau und -teile | 2.30 |
| Allgemeine Industrie | 2.30 |
| Lebensversicherung | 2.21 |
| Festnetz-Telekommunikation | 1.98 |
| Allgemeiner Einzelhandel | 1.95 |
| Luft- und Raumfahrt und Verteidigung | 1.94 |
| Geräte und Dienstleistungen im Gesundheitswesen | 1.85 |
| Getränke | 1.44 |
| Reise, Freizeit und Catering | 1.18 |
| Kundenbetreuung | 1.11 |
| Haushaltswaren und Heimwerkerbedarf | 1.00 |
| Immobilienbezogene Anlagefonds | 0.95 |
| Industrietransport | 0.68 |
| Mobilfunk | 0.56 |
| Lebensmittelhersteller | 0.29 |
| | **100.12** |

| Geographische Verteilung | % |
|---|---|
| Frankreich | 31.02 |
| Deutschland | 23.96 |
| Niederlande | 13.93 |
| Spanien | 9.89 |
| Finnland | 6.18 |
| Italien | 5.39 |
| Belgien | 4.27 |
| Großbritannien | 2.00 |
| Irland | 1.73 |
| Österreich | 0.77 |
| Portugal | 0.77 |
| Luxemburg | 0.21 |
| | **100.12** |

# Swiss Life Funds (LUX) Equity Global

## Anlagenübersicht

| Nominalwert/ Menge | Bezeichnung | Kurs Währung | Kosten USD | Marktwert USD | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| **Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumenten, die an einer amtlichen Börse zugelassen sind oder auf einem anderen geregelten Markt gehandelt werden** | | | | | |
| **Aktien** | | | | | |
| 4 207 | ACCENTURE PLC - A | USD | 798 940 | 759 742 | 0.50 |
| 109 900 | ACOM CO LTD | JPY | 487 636 | 452 376 | 0.30 |
| 10 344 | ACTIVISION BLIZZARD INC | USD | 576 264 | 601 297 | 0.39 |
| 2 007 | ADIDAS AG - REG - REG | EUR | 648 693 | 552 360 | 0.36 |
| 21 471 | ADMIRAL GROUP PLC | GBP | 641 226 | 579 233 | 0.38 |
| 9 500 | ADVANTEST CORP | JPY | 399 918 | 432 879 | 0.28 |
| 13 488 | AGEAS | EUR | 738 935 | 620 490 | 0.40 |
| 38 284 | AGL ENERGY LTD | AUD | 512 148 | 472 440 | 0.31 |
| 14 623 | AIR CANADA | CAD | 477 552 | 373 106 | 0.24 |
| 17 549 | ALIMENTATION COUCHE-TARD INC - B | CAD | 527 860 | 532 871 | 0.35 |
| 3 975 | ALLEGION PLC | USD | 469 567 | 457 085 | 0.30 |
| 5 050 | ALLIANT ENERGY CORP | USD | 268 774 | 263 206 | 0.17 |
| 5 013 | ALLSTATE CORP | USD | 497 268 | 527 618 | 0.34 |
| 722 | ALPHABET CLASS - A | USD | 910 463 | 966 939 | 0.63 |
| 1 187 | ALPHABET INC | USD | 1 502 636 | 1 589 785 | 1.04 |
| 1 483 | ALSTOM SA | EUR | 66 681 | 72 474 | 0.05 |
| 338 269 | ALUMINA LTD | AUD | 494 485 | 423 108 | 0.28 |
| 926 | AMAZON.COM INC | USD | 1 611 092 | 1 744 353 | 1.13 |
| 3 174 | AMERICAN ELECTRIC POWER CO INC | USD | 298 865 | 283 311 | 0.18 |
| 4 742 | AMERICAN FINANCIAL GROUP INC/OH | USD | 519 344 | 438 256 | 0.29 |
| 3 352 | AMERIPRISE FINANCIAL INC | USD | 492 890 | 473 638 | 0.31 |
| 3 915 | AMGEN INC | USD | 839 415 | 781 943 | 0.51 |
| 6 334 | AMUNDI SA | EUR | 432 454 | 449 808 | 0.29 |
| 2 902 | AON PLC | USD | 602 600 | 603 616 | 0.39 |
| 16 538 | APPLE INC | USD | 3 660 102 | 4 520 827 | 2.94 |
| 10 761 | APPLIED MATERIALS INC | USD | 564 566 | 625 429 | 0.41 |
| 12 208 | ARCH CAPITAL GROUP LTD | USD | 429 696 | 493 569 | 0.32 |
| 5 406 | ARTHUR J GALLAGHER & CO | USD | 541 681 | 527 031 | 0.34 |
| 42 716 | ASSICURAZIONI GENERALI SPA | EUR | 783 719 | 762 942 | 0.50 |
| 33 000 | ASTELLAS PHARMA INC | JPY | 592 284 | 519 788 | 0.34 |
| 1 831 | ASTRAZENECA PLC | GBP | 177 275 | 158 899 | 0.10 |
| 13 275 | ATCO LTD/CANADA - CLASS 1 | CAD | 498 888 | 495 261 | 0.32 |
| 48 977 | AT&T INC | USD | 1 799 436 | 1 724 970 | 1.12 |
| 399 | AVALONBAY COMMUNITIES INC | USD | 83 075 | 80 035 | 0.05 |
| 4 075 | AVERY DENNISON CORP | USD | 532 399 | 466 547 | 0.30 |
| 67 532 | BAE SYSTEMS PLC | GBP | 562 197 | 524 815 | 0.34 |
| 112 871 | BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA SA | EUR | 586 459 | 537 405 | 0.35 |
| 4 145 | BANK OF AMERICA CORP | USD | 126 806 | 118 133 | 0.08 |
| 224 800 | BANK OF EAST ASIA LTD | HKD | 506 382 | 477 695 | 0.31 |
| 52 323 | BARRATT DEVELOPMENTS PLC | GBP | 521 730 | 506 070 | 0.33 |
| 5 729 | BCE INC | CAD | 277 577 | 251 593 | 0.16 |
| 7 405 | BERKELEY GROUP HOLDINGS | GBP | 436 799 | 449 667 | 0.29 |
| 2 861 | BERKSHIRE HATHAWAY INC - B | USD | 621 757 | 590 339 | 0.39 |
| 6 294 | BEST BUY CO INC | USD | 421 446 | 476 141 | 0.31 |

# Swiss Life Funds (LUX) Equity Global

## Anlagenübersicht (Fortsetzung)

| Nominalwert/ Menge | Bezeichnung | Kurs Währung | Kosten USD | Marktwert USD | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| **Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumenten, die an einer amtlichen Börse zugelassen sind oder auf einem anderen geregelten Markt gehandelt werden (Fortsetzung)** | | | | | |
| | **Anteile (Fortsetzung)** | | | | |
| 2 323 | BIOGEN INC | USD | 543 209 | 716 390 | 0.47 |
| 4 298 | BLACK KNIGHT INC | USD | 290 717 | 286 720 | 0.19 |
| 50 959 | BLUESCOPE STEEL LTD | AUD | 486 935 | 388 352 | 0.25 |
| 6 591 | BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDING CORP | USD | 483 911 | 469 938 | 0.31 |
| 14 434 | BORGWARNER INC | USD | 600 609 | 456 114 | 0.30 |
| 14 401 | BRISTOL-MYERS SQUIBB CO | USD | 710 655 | 850 523 | 0.56 |
| 2 171 | BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS INC | USD | 274 520 | 226 566 | 0.15 |
| 19 623 | BUNZL PLC | GBP | 506 866 | 468 721 | 0.31 |
| 2 304 | BURLINGTON STORES INC | USD | 537 132 | 498 263 | 0.33 |
| 15 500 | CALBEE INC | JPY | 511 506 | 397 038 | 0.26 |
| 5 643 | CAMPBELL SOUP CO | USD | 262 834 | 254 612 | 0.17 |
| 2 299 | CBOE GLOBAL MARKETS INC | USD | 270 511 | 262 086 | 0.17 |
| 8 790 | CBRE GROUP INC | USD | 543 925 | 493 471 | 0.32 |
| 4 704 | CELANESE CORP - A | USD | 569 419 | 440 953 | 0.29 |
| 7 107 | CH ROBINSON WORLDWIDE INC | USD | 519 061 | 489 672 | 0.32 |
| 13 777 | CHARLES SCHWAB CORP | USD | 660 056 | 561 413 | 0.37 |
| 2 122 | CHARTER COMMUNICATIONS INC | USD | 964 459 | 1 046 507 | 0.68 |
| 4 059 | CHEVRON CORP | USD | 459 197 | 378 867 | 0.25 |
| 307 | CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC | USD | 250 994 | 237 489 | 0.16 |
| 3 | CHOCOLADEFABRIKEN LINDT & SPRUENGLI AG - REG | CHF | 250 333 | 259 413 | 0.17 |
| 4 038 | CHURCH & DWIGHT CO INC | USD | 283 407 | 280 722 | 0.18 |
| 29 409 | CI FINANCIAL CORP | CAD | 510 976 | 488 344 | 0.32 |
| 25 686 | CIMIC GROUP LTD | AUD | 542 813 | 394 812 | 0.26 |
| 1 987 | CINTAS CORP | USD | 533 040 | 530 012 | 0.35 |
| 6 689 | CITRIX SYSTEMS INC | USD | 718 946 | 691 576 | 0.45 |
| 1 819 | CLOROX CO | USD | 287 849 | 289 985 | 0.19 |
| 1 370 | CME GROUP INC | USD | 284 931 | 272 383 | 0.18 |
| 17 833 | COCA-COLA AMATIL LTD | AUD | 130 884 | 132 109 | 0.09 |
| 5 324 | COCA-COLA CO | USD | 290 371 | 284 781 | 0.19 |
| 4 752 | COGNIZANT TECHNOLOGY SOLUTIONS CORP - A | USD | 288 589 | 289 539 | 0.19 |
| 47 392 | COLES GROUP LTD | AUD | 454 211 | 434 196 | 0.28 |
| 9 820 | COLRUYT SA | EUR | 542 258 | 451 103 | 0.29 |
| 12 445 | COMPASS GROUP PLC | GBP | 319 202 | 271 910 | 0.18 |
| 65 578 | COMPUTERSHARE LTD | AUD | 791 087 | 647 745 | 0.42 |
| 11 292 | CONOCOPHILLIPS | USD | 687 570 | 546 759 | 0.36 |
| 8 076 | COPART INC | USD | 777 314 | 682 260 | 0.45 |
| 2 417 | DARDEN RESTAURANTS INC | USD | 284 721 | 235 658 | 0.15 |
| 6 167 | DAVITA INC | USD | 465 794 | 478 683 | 0.31 |
| 4 720 | DENTSPLY SIRONA INC | USD | 265 731 | 232 413 | 0.15 |
| 1 858 | DEUTSCHE LUFTHANSA AG - REG | EUR | 33 059 | 23 858 | 0.02 |
| 16 237 | DEUTSCHE POST AG - REG | EUR | 598 412 | 483 700 | 0.32 |
| 18 698 | DEUTSCHE TELEKOM AG - REG | EUR | 312 848 | 303 071 | 0.20 |
| 23 155 | DEVON ENERGY CORP | USD | 520 756 | 376 037 | 0.25 |
| 17 492 | DISCOVERY COMMUNICATIONS INC - C | USD | 527 384 | 439 049 | 0.29 |

# Swiss Life Funds (LUX) Equity Global

## Anlagenübersicht (Fortsetzung)

| Nominalwert/ Menge | Bezeichnung | Kurs Währung | Kosten USD | Marktwert USD | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| **Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumenten, die an einer amtlichen Börse zugelassen sind oder auf einem anderen geregelten Markt gehandelt werden (Fortsetzung)** | | | | | |
| | **Anteile (Fortsetzung)** | | | | |
| 158 | DOMINO'S PIZZA INC | USD | 45 908 | 53 635 | 0.04 |
| 4 514 | DOVER CORP | USD | 493 651 | 463 768 | 0.30 |
| 8 968 | DR HORTON INC | USD | 540 770 | 477 725 | 0.31 |
| 2 252 | DTE ENERGY CO | USD | 299 854 | 251 481 | 0.16 |
| 6 536 | EATON CORP PLC | USD | 601 181 | 592 946 | 0.39 |
| 10 927 | EATON VANCE CORP | USD | 514 880 | 450 848 | 0.29 |
| 16 185 | EBAY INC | USD | 568 530 | 560 648 | 0.37 |
| 4 542 | EIFFAGE SA | EUR | 524 240 | 481 055 | 0.31 |
| 5 399 | ELECTRONIC ARTS INC | USD | 591 137 | 547 297 | 0.36 |
| 5 975 | ELI LILLY & CO | USD | 852 453 | 753 627 | 0.49 |
| 4 854 | ELISA OYJ | EUR | 242 925 | 276 938 | 0.18 |
| 7 904 | EMPIRE CO LTD | CAD | 214 817 | 176 587 | 0.12 |
| 2 347 | ENTERGY CORP | USD | 278 467 | 274 388 | 0.18 |
| 3 895 | EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES INC | USD | 265 964 | 266 145 | 0.17 |
| 3 561 | EQUITY RESIDENTIAL | USD | 303 612 | 267 431 | 0.17 |
| 16 738 | EUTELSAT COMMUNICATIONS SA | EUR | 266 477 | 225 043 | 0.15 |
| 4 309 | EVERGY INC | USD | 287 438 | 281 593 | 0.18 |
| 3 282 | EVERSOURCE ENERGY | USD | 305 915 | 283 762 | 0.19 |
| 2 571 | EXTRA SPACE STORAGE INC | USD | 297 545 | 258 026 | 0.17 |
| 1 008 | EXXON MOBIL CORP | USD | 69 871 | 51 852 | 0.03 |
| 9 565 | FACEBOOK INC | USD | 1 947 045 | 1 840 975 | 1.19 |
| 6 119 | FERGUSON PLC | GBP | 521 925 | 526 802 | 0.34 |
| 16 578 | FIDELITY NATIONAL FINANCIAL INC - A | USD | 751 729 | 642 563 | 0.42 |
| 5 346 | FIRSTENERGY CORP | USD | 254 042 | 238 057 | 0.16 |
| 22 908 | FLETCHER BUILDING LTD | NZD | 78 573 | 73 744 | 0.05 |
| 2 432 | FLIR SYSTEMS INC | USD | 130 331 | 103 287 | 0.07 |
| 68 022 | FORTESCUE METALS GROUP LTD | AUD | 375 596 | 442 076 | 0.29 |
| 4 527 | FORTINET INC | USD | 535 680 | 462 026 | 0.30 |
| 21 024 | FORTUM OYJ | EUR | 513 880 | 445 249 | 0.29 |
| 14 337 | FOX CORP | USD | 532 046 | 440 719 | 0.29 |
| 2 406 | FRANCO-NEVADA CORP | CAD | 225 891 | 258 283 | 0.17 |
| 5 300 | FUJIFILM HOLDINGS CORP | JPY | 235 036 | 259 288 | 0.17 |
| 1 572 | GEBERIT AG - REG | CHF | 837 421 | 777 916 | 0.51 |
| 5 445 | GENERAL MILLS INC | USD | 285 623 | 266 805 | 0.17 |
| 373 300 | GENTING SINGAPORE LTD | SGD | 251 343 | 217 984 | 0.14 |
| 50 969 | GLAXOSMITHKLINE PLC | GBP | 1 143 785 | 1 017 068 | 0.66 |
| 4 857 | GLOBE LIFE INC | USD | 467 672 | 450 050 | 0.29 |
| 10 938 | GREAT-WEST LIFECO INC | CAD | 283 754 | 257 246 | 0.17 |
| 35 023 | HANESBRANDS INC | USD | 499 778 | 463 705 | 0.30 |
| 2 919 | HANNOVER RUECK SE - REG | EUR | 497 370 | 516 226 | 0.34 |
| 9 032 | HARTFORD FINANCIAL SERVICES GROUP INC | USD | 464 851 | 451 148 | 0.29 |
| 1 073 | HENRY SCHEIN INC | USD | 72 189 | 65 389 | 0.04 |
| 5 527 | HERSHEY CO | USD | 612 935 | 795 833 | 0.52 |
| 7 200 | HITACHI HIGH-TECH CORP | JPY | 397 244 | 531 998 | 0.35 |

# Swiss Life Funds (LUX) Equity Global

## Anlagenübersicht (Fortsetzung)

| Nominalwert/ Menge | Bezeichnung | Kurs Währung | Kosten USD | Marktwert USD | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| **Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumenten, die an einer amtlichen Börse zugelassen sind oder auf einem anderen geregelten Markt gehandelt werden (Fortsetzung)** | | | | | |
| | **Anteile (Fortsetzung)** | | | | |
| 181 000 | HKT TRUST & HKT LTD | HKD | 282 156 | 270 814 | 0.18 |
| 5 874 | HORMEL FOODS CORP | USD | 281 247 | 244 358 | 0.16 |
| 5 500 | HOSHIZAKI CORP | JPY | 509 826 | 466 045 | 0.30 |
| 1 737 | HUMANA INC | USD | 587 540 | 555 284 | 0.36 |
| 1 974 | HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIES INC | USD | 530 927 | 405 716 | 0.26 |
| 9 268 | IA FINANCIAL CORP INC | CAD | 382 252 | 441 118 | 0.29 |
| 16 673 | IGM FINANCIAL INC | CAD | 489 597 | 444 540 | 0.29 |
| 3 738 | ILLINOIS TOOL WORKS INC | USD | 668 130 | 627 162 | 0.41 |
| 19 207 | IMPERIAL OIL LTD | CAD | 510 652 | 420 528 | 0.27 |
| 17 135 | INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL SA | EUR | 609 704 | 529 461 | 0.35 |
| 4 339 | INGENICO GROUP SA | EUR | 428 001 | 609 832 | 0.40 |
| 4 884 | INTACT FINANCIAL CORP | CAD | 510 295 | 529 352 | 0.35 |
| 20 348 | INTEL CORP | USD | 1 173 231 | 1 129 721 | 0.74 |
| 22 448 | INTERPUBLIC GROUP OF COS INC | USD | 520 794 | 479 489 | 0.31 |
| 10 063 | INVESTOR AB - B | SEK | 556 751 | 495 414 | 0.32 |
| 30 200 | ITOCHU CORP | JPY | 611 740 | 689 170 | 0.45 |
| 272 377 | ITV PLC | GBP | 506 286 | 405 499 | 0.26 |
| 1 833 | JACK HENRY & ASSOCIATES INC | USD | 262 543 | 278 139 | 0.18 |
| 4 609 | JAMES HARDIE INDUSTRIES PLC | AUD | 90 138 | 83 889 | 0.05 |
| 125 | JAPAN RETAIL FUND INVESTMENT CORP | JPY | 265 321 | 237 681 | 0.16 |
| 5 495 | JAZZ PHARMACEUTICALS PLC | USD | 807 356 | 629 617 | 0.41 |
| 8 679 | JERONIMO MARTINS SGPS SA | EUR | 140 630 | 151 629 | 0.10 |
| 2 640 | JM SMUCKER CO | USD | 278 332 | 271 894 | 0.18 |
| 10 856 | JOHNSON & JOHNSON | USD | 1 575 952 | 1 459 915 | 0.95 |
| 3 980 | JPMORGAN CHASE & CO | USD | 474 044 | 462 118 | 0.30 |
| 4 789 | JUNIPER NETWORKS INC | USD | 115 463 | 101 623 | 0.07 |
| 21 300 | KDDI CORP | JPY | 570 205 | 603 860 | 0.39 |
| 2 173 | KIMBERLY-CLARK CORP | USD | 298 331 | 285 076 | 0.19 |
| 43 844 | KINROSS GOLD CORP | CAD | 216 773 | 220 470 | 0.14 |
| 19 021 | KIRKLAND LAKE GOLD LTD | CAD | 818 741 | 613 418 | 0.40 |
| 3 330 | KLA CORP | USD | 542 746 | 511 854 | 0.33 |
| 25 862 | KROGER CO | USD | 702 922 | 727 498 | 0.47 |
| 3 178 | KUEHNE + NAGEL INTERNATIONAL AG - REG | CHF | 514 940 | 461 455 | 0.30 |
| 16 900 | KURITA WATER INDUSTRIES LTD | JPY | 513 370 | 437 913 | 0.29 |
| 1 143 | LABORATORY CORP OF AMERICA HOLDINGS | USD | 198 699 | 200 814 | 0.13 |
| 1 921 | LAM RESEARCH CORP | USD | 394 341 | 563 679 | 0.37 |
| 542 | LAMB WESTON HOLDINGS INC | USD | 49 929 | 47 094 | 0.03 |
| 829 | LEGRAND SA | EUR | 67 311 | 62 851 | 0.04 |
| 5 338 | LEIDOS HOLDINGS INC | USD | 463 945 | 547 946 | 0.36 |
| 7 956 | LENNAR CORP | USD | 471 870 | 480 065 | 0.31 |
| 1 182 | LIBERTY BROADBAND CORP | USD | 151 337 | 148 802 | 0.10 |
| 1 867 | LOBLAW COS LTD | CAD | 98 465 | 92 491 | 0.06 |
| 258 | LULULEMON ATHLETICA INC | USD | 62 893 | 56 092 | 0.04 |
| 11 321 | MAGELLAN FINANCIAL GROUP LTD | AUD | 510 671 | 407 000 | 0.27 |

# Swiss Life Funds (LUX) Equity Global

## Anlagenübersicht (Fortsetzung)

| Nominalwert/ Menge | Bezeichnung | Kurs Währung | Kosten USD | Marktwert USD | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| **Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumenten, die an einer amtlichen Börse zugelassen sind oder auf einem anderen geregelten Markt gehandelt werden (Fortsetzung)** | | | | | |
| | **Anteile (Fortsetzung)** | | | | |
| 30 860 | MANULIFE FINANCIAL CORP | CAD | 604 926 | 518 645 | 0.34 |
| 288 900 | MAPLETREE COMMERCIAL TRUST | SGD | 498 914 | 434 687 | 0.28 |
| 43 631 | MARATHON OIL CORP | USD | 517 464 | 361 265 | 0.24 |
| 236 | MARKEL CORP | USD | 272 042 | 278 858 | 0.18 |
| 210 944 | MARKS & SPENCER GROUP PLC | GBP | 499 271 | 426 805 | 0.28 |
| 5 916 | MARSH & MCLENNAN COS INC | USD | 658 096 | 618 577 | 0.40 |
| 11 449 | MASCO CORP | USD | 528 600 | 473 073 | 0.31 |
| 4 099 | MASTERCARD INC | USD | 1 244 267 | 1 189 735 | 0.78 |
| 6 012 | MATCH GROUP INC | USD | 411 341 | 390 780 | 0.26 |
| 1 899 | MCDONALD'S CORP | USD | 374 301 | 368 729 | 0.24 |
| 5 500 | MCDONALD'S HOLDINGS CO JAPAN LTD | JPY | 266 299 | 230 983 | 0.15 |
| 11 467 | MEDTRONIC PLC | USD | 1 319 964 | 1 154 383 | 0.75 |
| 12 911 | MERCK & CO INC | USD | 1 083 233 | 988 466 | 0.65 |
| 43 989 | METRO AG | EUR | 613 195 | 506 632 | 0.33 |
| 6 440 | METRO INC/CN | CAD | 265 113 | 250 817 | 0.16 |
| 25 903 | MICROSOFT CORP | USD | 3 596 060 | 4 196 544 | 2.73 |
| 2 108 | MID-AMERICA APARTMENT COMMUNITIES INC | USD | 274 904 | 272 480 | 0.18 |
| 25 100 | MINEBEA MITSUMI INC | JPY | 504 887 | 443 057 | 0.29 |
| 3 000 | MITSUBISHI MATERIALS CORP | JPY | 76 825 | 68 586 | 0.04 |
| 32 000 | MITSUI & CO LTD | JPY | 577 281 | 529 106 | 0.35 |
| 2 346 | MOODY'S CORP | USD | 488 413 | 563 110 | 0.37 |
| 5 900 | MS&AD INSURANCE GROUP HOLDINGS INC | JPY | 195 946 | 190 513 | 0.12 |
| 3 012 | MUENCHENER RUECKVERSICHERUNGS-GESELLSCHAFT AG IN MUENCHEN - REG | EUR | 748 520 | 763 278 | 0.50 |
| 4 513 | NASDAQ INC | USD | 523 327 | 462 808 | 0.30 |
| 1 953 | NESTLE SA | CHF | 212 399 | 199 445 | 0.13 |
| 9 428 | NETAPP INC | USD | 589 116 | 440 476 | 0.29 |
| 6 917 | NEWMONT CORP | USD | 273 720 | 308 706 | 0.20 |
| 5 650 | NEXT PLC | GBP | 477 979 | 438 937 | 0.29 |
| 8 503 | NIKE INC - B | USD | 834 910 | 759 998 | 0.50 |
| 62 | NIPPON PROLOGIS REIT INC | JPY | 167 190 | 168 242 | 0.11 |
| 1 600 | NIPPON TELEGRAPH & TELEPHONE CORP | JPY | 41 438 | 37 521 | 0.02 |
| 19 400 | NOMURA REAL ESTATE HOLDINGS INC | JPY | 420 421 | 418 701 | 0.27 |
| 23 700 | NOMURA RESEARCH INSTITUTE LTD | JPY | 502 327 | 517 438 | 0.34 |
| 12 906 | NORDSTROM INC | USD | 499 075 | 447 838 | 0.29 |
| 32 100 | NTT DOCOMO INC | JPY | 830 608 | 871 207 | 0.57 |
| 132 | NVR INC | USD | 445 771 | 484 068 | 0.32 |
| 445 000 | NWS HOLDINGS LTD | HKD | 609 522 | 544 185 | 0.36 |
| 46 500 | OBAYASHI CORP | JPY | 520 495 | 469 462 | 0.31 |
| 1 186 | OGE ENERGY CORP | USD | 54 888 | 45 187 | 0.03 |
| 96 300 | OJI HOLDINGS CORP | JPY | 501 549 | 459 783 | 0.30 |
| 5 848 | OMEGA HEALTHCARE INVESTORS INC | USD | 244 257 | 231 581 | 0.15 |
| 10 962 | OMNICOM GROUP INC | USD | 857 313 | 759 447 | 0.50 |
| 10 593 | ORION OYJ - B | EUR | 464 238 | 418 310 | 0.27 |

# Swiss Life Funds (LUX) Equity Global

## Anlagenübersicht (Fortsetzung)

| Nominalwert/ Menge | Bezeichnung | Kurs Währung | Kosten USD | Marktwert USD | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| **Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumenten, die an einer amtlichen Börse zugelassen sind oder auf einem anderen geregelten Markt gehandelt werden (Fortsetzung)** | | | | | |
| | **Anteile (Fortsetzung)** | | | | |
| 33 700 | ORIX CORP | JPY | 572 653 | 544 249 | 0.36 |
| 134 | ORIX JREIT INC | JPY | 284 985 | 254 670 | 0.17 |
| 31 554 | OVINTIV INC | USD | 644 950 | 364 449 | 0.24 |
| 7 031 | PACCAR INC | USD | 567 402 | 470 374 | 0.31 |
| 17 700 | PAN PACIFIC INTERNATIONAL HOLDINGS CORP | JPY | 280 544 | 293 400 | 0.19 |
| 9 455 | PANDORA A/S | DKK | 497 330 | 422 080 | 0.28 |
| 14 314 | PARKLAND FUEL CORP | CAD | 508 994 | 449 996 | 0.29 |
| 470 000 | PCCW LTD | HKD | 282 458 | 282 855 | 0.18 |
| 5 090 | PEPSICO INC | USD | 659 806 | 672 033 | 0.44 |
| 13 151 | PERSIMMON PLC | GBP | 427 038 | 476 904 | 0.31 |
| 6 392 | PHILLIPS 66 | USD | 619 439 | 478 505 | 0.31 |
| 4 496 | PPG INDUSTRIES INC | USD | 577 736 | 469 607 | 0.31 |
| 1 256 | PROCTER & GAMBLE CO | USD | 156 133 | 142 217 | 0.09 |
| 11 274 | PULTEGROUP INC | USD | 361 659 | 453 215 | 0.30 |
| 20 093 | QANTAS AIRWAYS LTD | AUD | 98 023 | 71 640 | 0.05 |
| 25 879 | QBE INSURANCE GROUP LTD | AUD | 232 254 | 226 754 | 0.15 |
| 4 761 | QORVO INC | USD | 490 240 | 478 861 | 0.31 |
| 19 862 | QUEBECOR INC | CAD | 507 041 | 464 018 | 0.30 |
| 2 607 | QUEST DIAGNOSTICS INC | USD | 276 374 | 276 498 | 0.18 |
| 5 386 | RAMSAY HEALTH CARE LTD | AUD | 286 040 | 236 171 | 0.15 |
| 8 459 | RANDSTAD NV | EUR | 520 339 | 434 019 | 0.28 |
| 3 590 | RAYTHEON CO | USD | 760 997 | 676 930 | 0.44 |
| 3 372 | RESMED INC | USD | 526 942 | 536 013 | 0.35 |
| 24 900 | RICOH CO LTD | JPY | 288 467 | 231 998 | 0.15 |
| 1 300 | RINNAI CORP | JPY | 100 300 | 88 824 | 0.06 |
| 8 739 | ROBERT HALF INTERNATIONAL INC | USD | 506 163 | 440 533 | 0.29 |
| 3 739 | ROCHE HOLDING AG | CHF | 1 092 185 | 1 196 304 | 0.78 |
| 2 777 | ROCKWELL AUTOMATION INC | USD | 570 340 | 509 580 | 0.33 |
| 5 181 | ROSS STORES INC | USD | 579 080 | 563 589 | 0.37 |
| 11 786 | SABRE CORP | USD | 266 835 | 160 466 | 0.10 |
| 7 700 | SANKYO CO LTD | JPY | 267 467 | 253 062 | 0.17 |
| 6 461 | SCHNEIDER ELECTRIC SE | EUR | 560 122 | 642 286 | 0.42 |
| 12 604 | SCHRODERS PLC | GBP | 474 281 | 459 483 | 0.30 |
| 9 414 | SEAGATE TECHNOLOGY PLC | USD | 509 027 | 451 401 | 0.29 |
| 7 757 | SEI INVESTMENTS CO | USD | 461 296 | 424 385 | 0.28 |
| 2 300 | SEIKO EPSON CORP | JPY | 30 478 | 32 581 | 0.02 |
| 24 500 | SEKISUI HOUSE LTD | JPY | 532 271 | 480 846 | 0.31 |
| 1 709 | SEMPRA ENERGY | USD | 255 149 | 238 884 | 0.16 |
| 22 800 | SG HOLDINGS CO LTD | JPY | 510 631 | 449 807 | 0.29 |
| 1 109 | SHERWIN-WILLIAMS CO | USD | 610 657 | 573 076 | 0.37 |
| 19 900 | SHOWA DENKO KK | JPY | 506 316 | 430 230 | 0.28 |
| 1 975 | SIGNATURE BANK/NEW YORK NY | USD | 251 137 | 247 073 | 0.16 |
| 709 | SIMON PROPERTY GROUP INC | USD | 105 542 | 87 264 | 0.06 |
| 103 110 | SINGAPORE EXCHANGE LTD | SGD | 637 880 | 627 218 | 0.41 |

# Swiss Life Funds (LUX) Equity Global

## Anlagenübersicht (Fortsetzung)

| Nominalwert/ Menge | Bezeichnung | Kurs Währung | Kosten USD | Marktwert USD | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| **Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumenten, die an einer amtlichen Börse zugelassen sind oder auf einem anderen geregelten Markt gehandelt werden (Fortsetzung)** | | | | | |
| | **Anteile (Fortsetzung)** | | | | |
| 350 000 | SINO LAND CO LTD | HKD | 511 997 | 476 067 | 0.31 |
| 109 962 | SIRIUS XM HOLDINGS INC | USD | 753 653 | 697 159 | 0.46 |
| 4 648 | SKYWORKS SOLUTIONS INC | USD | 457 177 | 465 637 | 0.30 |
| 2 734 | SODEXO SA | EUR | 303 986 | 260 494 | 0.17 |
| 9 200 | SOHGO SECURITY SERVICES CO LTD | JPY | 508 123 | 430 723 | 0.28 |
| 13 136 | SONIC HEALTHCARE LTD | AUD | 252 713 | 243 917 | 0.16 |
| 250 | SONOVA HOLDING AG | CHF | 63 225 | 59 352 | 0.04 |
| 10 700 | SONY CORP | JPY | 635 136 | 655 798 | 0.43 |
| 12 100 | SONY FINANCIAL HOLDINGS INC | JPY | 279 446 | 242 078 | 0.16 |
| 4 540 | SOUTHERN CO | USD | 280 537 | 274 034 | 0.18 |
| 5 080 | SOUTHWEST AIRLINES CO | USD | 283 880 | 234 645 | 0.15 |
| 2 440 | S&P GLOBAL INC | USD | 624 750 | 648 820 | 0.42 |
| 100 856 | SPARK NEW ZEALAND LTD | NZD | 304 447 | 283 696 | 0.19 |
| 7 853 | SPIRIT AEROSYSTEMS HOLDINGS INC - A | USD | 574 157 | 414 953 | 0.27 |
| 16 797 | STEEL DYNAMICS INC | USD | 566 991 | 447 304 | 0.29 |
| 18 532 | STMICROELECTRONICS NV | EUR | 434 348 | 496 902 | 0.32 |
| 11 887 | SUN LIFE FINANCIAL INC | CAD | 538 662 | 513 524 | 0.34 |
| 14 100 | SUNDRUG CO LTD | JPY | 479 464 | 441 176 | 0.29 |
| 9 421 | SWEDISH MATCH AB | SEK | 524 270 | 543 781 | 0.35 |
| 2 700 | SWISS RE AG | CHF | 287 255 | 255 619 | 0.17 |
| 1 509 | SWISSCOM AG - REG | CHF | 765 333 | 800 680 | 0.52 |
| 10 807 | SYSCO CORP | USD | 851 592 | 720 287 | 0.47 |
| 4 280 | T ROWE PRICE GROUP INC | USD | 482 547 | 505 083 | 0.33 |
| 4 211 | TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE INC | USD | 525 246 | 452 598 | 0.30 |
| 5 775 | TARGET CORP | USD | 563 823 | 594 825 | 0.39 |
| 181 619 | TAYLOR WIMPEY PLC | GBP | 359 687 | 469 083 | 0.31 |
| 4 097 | TELUS CORP | CAD | 164 768 | 147 845 | 0.10 |
| 7 751 | TERADYNE INC | USD | 484 748 | 455 449 | 0.30 |
| 11 458 | TJX COS INC | USD | 693 209 | 685 188 | 0.45 |
| 5 800 | TOKIO MARINE HOLDINGS INC | JPY | 317 548 | 311 925 | 0.20 |
| 2 800 | TOKYO ELECTRON LTD | JPY | 517 083 | 579 521 | 0.38 |
| 26 962 | TRANSURBAN GROUP | AUD | 283 849 | 258 146 | 0.17 |
| 17 492 | TRIPADVISOR INC | USD | 498 172 | 410 187 | 0.27 |
| 4 000 | TSURUHA HOLDINGS INC | JPY | 445 664 | 464 655 | 0.30 |
| 839 | TYLER TECHNOLOGIES INC | USD | 242 706 | 262 901 | 0.17 |
| 1 925 | ULTA BEAUTY INC | USD | 496 650 | 494 898 | 0.32 |
| 76 | UNITED URBAN INVESTMENT CORP | JPY | 138 906 | 121 611 | 0.08 |
| 4 449 | UNITEDHEALTH GROUP INC | USD | 1 312 497 | 1 134 317 | 0.74 |
| 576 | VAIL RESORTS INC | USD | 136 564 | 122 463 | 0.08 |
| 8 124 | VERIZON COMMUNICATIONS INC | USD | 478 033 | 439 996 | 0.29 |
| 15 872 | VIACOMCBS INC - B | USD | 542 664 | 390 610 | 0.25 |
| 9 883 | VICI PROPERTIES INC | USD | 241 837 | 247 668 | 0.16 |
| 1 446 | VISA INC | USD | 256 121 | 262 825 | 0.17 |
| 1 966 | VULCAN MATERIALS CO | USD | 281 426 | 236 431 | 0.15 |

# Swiss Life Funds (LUX) Equity Global

## Anlagenübersicht (Fortsetzung)

| Nominalwert/ Menge | Bezeichnung | Kurs Währung | Kosten USD | Marktwert USD | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| **Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumenten, die an einer amtlichen Börse zugelassen sind oder auf einem anderen geregelten Markt gehandelt werden (Fortsetzung)** | | | | | |
| | **Anteile (Fortsetzung)** | | | | |
| 1 964 | WABCO HOLDINGS INC | USD | 264 745 | 265 336 | 0.17 |
| 3 124 | WEC ENERGY GROUP INC | USD | 289 959 | 288 439 | 0.19 |
| 30 593 | WESTERN UNION CO | USD | 658 658 | 684 977 | 0.45 |
| 2 098 | WP CAREY INC | USD | 177 386 | 162 406 | 0.11 |
| 7 069 | WR BERKLEY CORP - C | USD | 513 634 | 474 613 | 0.31 |
| 499 | WW GRAINGER INC | USD | 157 200 | 138 492 | 0.09 |
| 55 900 | YAMADA DENKI CO LTD | JPY | 283 422 | 268 967 | 0.18 |
| 690 600 | YANGZIJIANG SHIPBUILDING HOLDINGS LTD | SGD | 481 093 | 467 593 | 0.31 |
| 100 000 | YUE YUEN INDUSTRIAL HOLDINGS LTD | HKD | 278 741 | 240 985 | 0.16 |
| 2 207 | ZEBRA TECHNOLOGIES CORP - A | USD | 548 108 | 465 611 | 0.30 |
| 4 936 | ZOETIS INC | USD | 681 316 | 657 623 | 0.43 |
| | **Gesamtsumme der Aktien** | | **156 011 311** | **148 867 231** | **97.17** |
| **Gesamtsumme übertragbarer Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer amtlichen Börse zugelassen sind oder auf einem anderen geregelten Markt gehandelt werden** | | | **156 011 311** | **148 867 231** | **97.17** |
| **Investmentfonds** | | | | | |
| | **Offene Anlagefonds** | | | | |
| 213 225 | LOMBARD ODIER SHORT-TERM MONEY MARKET - IC | USD | 2 351 305 | 2 377 885 | 1.55 |
| | **Gesamtsumme offene Anlagefonds** | | **2 351 305** | **2 377 885** | **1.55** |
| **Gesamtsumme der Anlagefonds** | | | **2 351 305** | **2 377 885** | **1.55** |
| **Gesamtsumme der Anlagen** | | | **158 362 616** | **151 245 116** | **98.72** |

# Swiss Life Funds (LUX) Equity Global

## Sektorstruktur und geographische Verteilung der Anlagen

| Sektorstruktur | % |
|---|---|
| Technologie Hardware und Geräte | 8.43 |
| Finanzdienstleistungen | 7.56 |
| Software- und Computerdienstleistungen | 7.42 |
| Pharmazeutik und Biotechnologie | 6.62 |
| Allgemeiner Einzelhandel | 6.31 |
| Versicherungen (ohne Lebensversicherung) | 5.41 |
| Kundenbetreuung | 4.60 |
| Lebensmittel- und Arzneimittelhandel | 3.47 |
| Geräte und Dienstleistungen im Gesundheitswesen | 3.38 |
| Festnetz-Telekommunikation | 3.34 |
| Medien | 3.28 |
| Haushaltswaren und Heimwerkerbedarf | 3.12 |
| Bauwirtschaft und Baustoffe | 3.00 |
| Industrietechnik | 2.56 |
| Reise, Freizeit und Catering | 2.30 |
| Lebensversicherung | 2.26 |
| Öl- und Gasproduzenten | 2.24 |
| Persönliche Güter | 2.00 |
| Immobilienbezogene Anlagefonds | 1.87 |
| Banken | 1.61 |
| Investmentfonds | 1.55 |
| Elektrizität | 1.54 |
| Freizeitartikel | 1.47 |
| Industrietransport | 1.40 |
| Elektronische und elektrische Geräte | 1.35 |
| Lebensmittelhersteller | 1.27 |
| Gas-, Wasser- und Mehrfachversorgungsunternehmen | 1.13 |
| Luft- und Raumfahrt und Verteidigung | 1.12 |
| Industriemetalle und Bergbau | 1.11 |
| Immobilienbezogene Dienstleistungen und Investitionen | 1.06 |
| Bergbau | 0.91 |
| Chemikalien | 0.88 |
| Mobilfunk | 0.77 |
| Getränke | 0.71 |
| Allgemeine Industrie | 0.52 |
| Automobilbau und -teile | 0.47 |
| Tabak | 0.35 |
| Forst- und Papierindustrie | 0.30 |
| Alternative Energie | 0.03 |
| | **98.72** |

| Geographische Verteilung | % |
|---|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika | 56.64 |
| Japan | 10.45 |
| Kanada | 5.18 |
| Großbritannien | 4.74 |
| Australien | 3.12 |
| Irland | 2.70 |
| Schweiz | 2.62 |
| Deutschland | 2.06 |
| Frankreich | 1.83 |
| Luxemburg | 1.55 |
| Singapur | 1.14 |
| HongKong (China) | 0.98 |
| Bermuda | 0.83 |
| Finnland | 0.74 |
| Belgien | 0.70 |
| Spanien | 0.70 |
| Schweden | 0.68 |
| Niederlande | 0.61 |
| Italien | 0.50 |
| Jersey Inseln | 0.34 |
| Dänemark | 0.28 |
| Neuseeland | 0.23 |
| Portugal | 0.10 |
| | **98.72** |

# Swiss Life Funds (LUX) Equity Global High Dividend

## Anlagenübersicht

| Nominalwert/ Menge | Bezeichnung | Kurs Währung | Kosten EUR | Marktwert EUR | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| **Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumenten, die an einer amtlichen Börse zugelassen sind oder auf einem anderen geregelten Markt gehandelt werden** | | | | | |
| **Aktien** | | | | | |
| 42 755 | ABBVIE INC | USD | 3 037 468 | 3 336 093 | 1.73 |
| 3 813 | ADECCO GROUP AG - REG | CHF | 213 083 | 184 258 | 0.10 |
| 3 925 | AENA SME SA | EUR | 657 241 | 569 125 | 0.29 |
| 18 051 | AES CORP/VA | USD | 282 391 | 274 927 | 0.14 |
| 42 802 | AGL ENERGY LTD | AUD | 545 029 | 480 854 | 0.25 |
| 37 340 | ALGONQUIN POWER & UTILITIES CORP | CAD | 479 891 | 516 606 | 0.27 |
| 16 303 | ALLIANZ SE - REG | EUR | 3 471 069 | 3 175 824 | 1.64 |
| 39 088 | ALTRIA GROUP INC | USD | 2 062 175 | 1 436 554 | 0.74 |
| 61 980 | AMCOR PLC | USD | 585 946 | 525 881 | 0.27 |
| 11 988 | AMERICAN FINANCIAL GROUP INC/OH | USD | 1 098 383 | 1 008 631 | 0.52 |
| 7 555 | AMGEN INC | USD | 1 270 724 | 1 373 718 | 0.71 |
| 14 455 | AMUNDI SA | EUR | 985 831 | 934 516 | 0.48 |
| 34 659 | ANGLO AMERICAN PLC | GBP | 762 849 | 722 158 | 0.37 |
| 109 324 | ASSICURAZIONI GENERALI SPA | EUR | 1 996 256 | 1 777 608 | 0.92 |
| 17 894 | ASTRAZENECA PLC | GBP | 1 317 181 | 1 413 708 | 0.73 |
| 25 016 | ATCO LTD/CANADA - CLASS 1 | CAD | 869 682 | 849 645 | 0.44 |
| 200 112 | AT&T INC | USD | 5 939 885 | 6 416 263 | 3.33 |
| 63 738 | AURIZON HOLDINGS LTD | AUD | 218 665 | 180 698 | 0.09 |
| 123 838 | BAE SYSTEMS PLC | GBP | 759 191 | 876 133 | 0.45 |
| 14 767 | BARRATT DEVELOPMENTS PLC | GBP | 115 608 | 130 026 | 0.07 |
| 35 750 | BCE INC | CAD | 1 457 659 | 1 429 273 | 0.74 |
| 5 538 | BERKELEY GROUP HOLDINGS | GBP | 300 385 | 306 153 | 0.16 |
| 9 992 | BLACKSTONE GROUP INC - A | USD | 495 026 | 489 753 | 0.25 |
| 19 500 | BOC HONG KONG HOLDINGS LTD | HKD | 60 461 | 60 936 | 0.03 |
| 17 667 | BOUYGUES SA | EUR | 667 283 | 626 825 | 0.32 |
| 44 605 | BRISTOL-MYERS SQUIBB CO | USD | 2 115 450 | 2 398 262 | 1.24 |
| 9 255 | BROADCOM INC | USD | 2 345 316 | 2 296 962 | 1.19 |
| 15 202 | CAMPBELL SOUP CO | USD | 657 969 | 624 438 | 0.32 |
| 638 | CANADIAN NATURAL RESOURCES LTD | CAD | 14 087 | 14 949 | 0.01 |
| 18 030 | CANADIAN UTILITIES LTD | CAD | 491 097 | 485 691 | 0.25 |
| 10 792 | CARDINAL HEALTH INC | USD | 502 378 | 512 066 | 0.26 |
| 21 096 | CENTRICA PLC | GBP | 28 269 | 17 692 | 0.01 |
| 89 | CHEVRON CORP | USD | 9 717 | 7 563 | 0.00 |
| 11 116 | CI FINANCIAL CORP | CAD | 163 423 | 168 040 | 0.09 |
| 23 639 | CIMIC GROUP LTD | AUD | 488 927 | 330 782 | 0.17 |
| 124 579 | CISCO SYSTEMS INC | USD | 4 555 294 | 4 528 598 | 2.35 |
| 114 500 | CK ASSET HOLDINGS LTD | HKD | 714 674 | 651 400 | 0.34 |
| 137 000 | CK INFRASTRUCTURE HOLDINGS LTD | HKD | 847 707 | 849 823 | 0.44 |
| 2 583 | COCA-COLA AMATIL LTD | AUD | 17 771 | 17 420 | 0.01 |
| 35 940 | COCA-COLA CO | USD | 1 401 105 | 1 750 130 | 0.91 |
| 19 854 | CVS HEALTH CORP | USD | 1 233 837 | 1 069 652 | 0.55 |
| 36 200 | DAI-ICHI LIFE HOLDINGS INC | JPY | 494 655 | 451 720 | 0.23 |
| 1 000 | DAIWA HOUSE INDUSTRY CO LTD | JPY | 28 282 | 25 147 | 0.01 |
| 8 068 | DARDEN RESTAURANTS INC | USD | 854 725 | 716 127 | 0.37 |

# Swiss Life Funds (LUX) Equity Global High Dividend

## Anlagenübersicht (Fortsetzung)

| Nominalwert/ Menge | Bezeichnung | Kurs Währung | Kosten EUR | Marktwert EUR | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| **Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumenten, die an einer amtlichen Börse zugelassen sind oder auf einem anderen geregelten Markt gehandelt werden (Fortsetzung)** | | | | | |
| | **Anteile (Fortsetzung)** | | | | |
| 59 100 | DBS GROUP HOLDINGS LTD | SGD | 1 000 631 | 929 425 | 0.48 |
| 49 161 | DEUTSCHE POST AG - REG | EUR | 1 625 757 | 1 333 246 | 0.69 |
| 36 674 | DOW INC | USD | 1 652 164 | 1 349 171 | 0.70 |
| 47 119 | EATON CORP PLC | USD | 3 969 549 | 3 891 515 | 2.01 |
| 34 075 | EATON VANCE CORP | USD | 1 387 432 | 1 279 926 | 0.66 |
| 4 118 | ELECTRICITE DE FRANCE SA | EUR | 38 833 | 51 846 | 0.03 |
| 2 961 | ELISA OYJ | EUR | 142 246 | 153 794 | 0.08 |
| 19 172 | ENAGAS SA | EUR | 435 013 | 448 625 | 0.23 |
| 13 691 | ENBRIDGE INC | CAD | 475 912 | 463 888 | 0.24 |
| 5 307 | ENTERGY CORP | USD | 513 304 | 564 834 | 0.29 |
| 83 529 | EXXON MOBIL CORP | USD | 5 872 513 | 3 911 631 | 2.03 |
| 6 189 | FAURECIA SE | EUR | 295 339 | 253 006 | 0.13 |
| 9 039 | FIFTH THIRD BANCORP | USD | 247 389 | 200 784 | 0.10 |
| 6 097 | FINECOBANK BANCA FINECO SPA | EUR | 67 707 | 57 885 | 0.03 |
| 71 143 | FIRSTENERGY CORP | USD | 3 009 306 | 2 884 062 | 1.49 |
| 7 194 | FORTESCUE METALS GROUP LTD | AUD | 46 737 | 42 564 | 0.02 |
| 46 256 | FORTUM OYJ | EUR | 981 552 | 891 816 | 0.46 |
| 45 013 | GENERAL MILLS INC | USD | 2 027 576 | 2 007 954 | 1.04 |
| 271 400 | GENTING SINGAPORE LTD | SGD | 168 376 | 144 277 | 0.07 |
| 34 516 | GILEAD SCIENCES INC | USD | 2 128 270 | 2 179 462 | 1.13 |
| 212 579 | GLAXOSMITHKLINE PLC | GBP | 3 962 139 | 3 861 746 | 2.00 |
| 17 886 | GREAT-WEST LIFECO INC | CAD | 403 096 | 382 951 | 0.20 |
| 2 620 | H LUNDBECK A/S | DKK | 87 613 | 81 689 | 0.04 |
| 57 059 | HANESBRANDS INC | USD | 774 526 | 687 752 | 0.36 |
| 80 100 | HANG SENG BANK LTD | HKD | 1 467 943 | 1 520 546 | 0.79 |
| 7 855 | HANNOVER RUECK SE - REG | EUR | 1 214 698 | 1 264 655 | 0.65 |
| 77 | HENDERSON LAND DEVELOPMENT CO LTD | HKD | 186 | 322 | 0.00 |
| 8 016 | HENNES & MAURITZ AB - B | SEK | 148 063 | 130 489 | 0.07 |
| 848 | HONG KONG & CHINA GAS CO LTD | HKD | 942 | 1 486 | 0.00 |
| 32 671 | HP INC | USD | 591 500 | 618 353 | 0.32 |
| 35 043 | HUNTINGTON BANCSHARES INC/OH | USD | 430 016 | 391 440 | 0.20 |
| 54 362 | IBERDROLA SA | EUR | 486 431 | 561 016 | 0.29 |
| 37 628 | IMPERIAL BRANDS PLC | GBP | 873 100 | 680 319 | 0.35 |
| 22 596 | INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL SA | EUR | 654 390 | 635 625 | 0.33 |
| 64 | INTER PIPELINE LTD | CAD | 955 | 862 | 0.00 |
| 21 215 | INTERNATIONAL BUSINESS MACHINES CORP | USD | 2 736 079 | 2 513 662 | 1.30 |
| 25 166 | INTERNATIONAL PAPER CO | USD | 998 474 | 846 771 | 0.44 |
| 21 360 | INTERPUBLIC GROUP OF COS INC | USD | 429 769 | 415 358 | 0.21 |
| 83 700 | ITOCHU CORP | JPY | 1 503 692 | 1 738 859 | 0.90 |
| 262 555 | ITV PLC | GBP | 418 917 | 355 844 | 0.18 |
| 60 400 | KDDI CORP | JPY | 1 420 493 | 1 558 883 | 0.81 |
| 15 724 | KELLOGG CO | USD | 938 291 | 865 611 | 0.45 |
| 11 322 | KIMBERLY-CLARK CORP | USD | 1 242 276 | 1 352 208 | 0.70 |
| 722 | KOHL'S CORP | USD | 32 416 | 25 733 | 0.01 |

# Swiss Life Funds (LUX) Equity Global High Dividend

## Anlagenübersicht (Fortsetzung)

| Nominal wert/ Menge | Bezeichnung | Kurs Währung | Kosten EUR | Marktwert EUR | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| **Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumenten, die an einer amtlichen Börse zugelassen sind oder auf einem anderen geregelten Markt gehandelt werden (Fortsetzung)** | | | | | |
| | **Anteile (Fortsetzung)** | | | | |
| 33 215 | KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV | EUR | 691 289 | 703 494 | 0.36 |
| 5 180 | KUEHNE + NAGEL INTERNATIONAL AG - REG | CHF | 770 592 | 684 739 | 0.35 |
| 1 710 | LAS VEGAS SANDS CORP | USD | 100 945 | 90 773 | 0.05 |
| 13 704 | LEGGETT & PLATT INC | USD | 637 266 | 494 789 | 0.26 |
| 24 626 | LYONDELLBASELL INDUSTRIES NV - A | USD | 2 070 412 | 1 602 052 | 0.83 |
| 67 326 | MANULIFE FINANCIAL CORP | CAD | 1 146 644 | 1 030 095 | 0.53 |
| 45 600 | MAPLETREE COMMERCIAL TRUST | SGD | 69 022 | 62 462 | 0.03 |
| 19 917 | MARATHON PETROLEUM CORP | USD | 1 012 913 | 859 815 | 0.44 |
| 52 300 | MARUBENI CORP | JPY | 300 536 | 316 402 | 0.16 |
| 12 113 | MAXIM INTEGRATED PRODUCTS INC | USD | 643 318 | 613 342 | 0.32 |
| 40 456 | MERCK & CO INC | USD | 2 378 086 | 2 819 711 | 1.46 |
| 138 961 | M&G PLC | GBP | 361 753 | 321 245 | 0.17 |
| 9 685 | MICRO FOCUS INTERNATIONAL PLC | GBP | 189 444 | 83 420 | 0.04 |
| 60 166 | MIRVAC GROUP | AUD | 122 990 | 107 357 | 0.06 |
| 47 600 | MITSUI & CO LTD | JPY | 771 479 | 716 505 | 0.37 |
| 37 000 | MS&AD INSURANCE GROUP HOLDINGS INC | JPY | 1 088 941 | 1 087 663 | 0.56 |
| 6 054 | MUENCHENER RUECKVERSICHERUNGS-GESELLSCHAFT AG IN MUENCHEN - REG | EUR | 1 583 121 | 1 396 658 | 0.72 |
| 20 678 | NETAPP INC | USD | 1 099 635 | 879 490 | 0.45 |
| 41 | NIPPON PROLOGIS REIT INC | JPY | 96 767 | 101 285 | 0.05 |
| 49 200 | NIPPON TELEGRAPH & TELEPHONE CORP | JPY | 1 149 367 | 1 050 362 | 0.54 |
| 8 100 | NITTO DENKO CORP | JPY | 350 306 | 370 530 | 0.19 |
| 13 400 | NOMURA REAL ESTATE HOLDINGS INC | JPY | 240 813 | 263 285 | 0.14 |
| 4 701 | NORDSTROM INC | USD | 140 074 | 148 504 | 0.08 |
| 71 500 | NTT DOCOMO INC | JPY | 1 803 826 | 1 766 615 | 0.91 |
| 201 000 | NWS HOLDINGS LTD | HKD | 249 726 | 223 770 | 0.12 |
| 15 631 | OMNICOM GROUP INC | USD | 1 120 185 | 985 858 | 0.51 |
| 13 528 | OMV AG | EUR | 670 989 | 512 035 | 0.26 |
| 14 462 | ORION OYJ - B | EUR | 571 746 | 519 909 | 0.27 |
| 47 900 | ORIX CORP | JPY | 723 274 | 704 243 | 0.36 |
| 38 295 | PACCAR INC | USD | 2 431 131 | 2 332 319 | 1.21 |
| 101 | PARTNERS GROUP HOLDING AG | CHF | 75 885 | 78 938 | 0.04 |
| 9 170 | PEPSICO INC | USD | 895 607 | 1 102 203 | 0.57 |
| 17 067 | PERSIMMON PLC | GBP | 496 048 | 563 442 | 0.29 |
| 15 816 | PEUGEOT SA | EUR | 334 508 | 276 859 | 0.14 |
| 171 505 | PFIZER INC | USD | 5 445 752 | 5 217 985 | 2.71 |
| 49 708 | PHILIP MORRIS INTERNATIONAL INC | USD | 3 965 481 | 3 704 851 | 1.92 |
| 24 306 | PHILLIPS 66 | USD | 2 322 998 | 1 656 468 | 0.86 |
| 29 955 | POWER CORP OF CANADA | CAD | 639 836 | 602 757 | 0.31 |
| 30 251 | PPL CORP | USD | 921 270 | 826 467 | 0.43 |
| 35 545 | PROCTER & GAMBLE CO | USD | 2 978 561 | 3 664 036 | 1.90 |
| 8 091 | PUBLICIS GROUPE SA | EUR | 319 837 | 283 023 | 0.15 |
| 47 436 | QANTAS AIRWAYS LTD | AUD | 213 172 | 153 971 | 0.08 |
| 6 177 | QUALCOMM INC | USD | 461 562 | 440 311 | 0.23 |

# Swiss Life Funds (LUX) Equity Global High Dividend

## Anlagenübersicht (Fortsetzung)

| Nominalwert/ Menge | Bezeichnung | Kurs Währung | Kosten EUR | Marktwert EUR | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| **Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumenten, die an einer amtlichen Börse zugelassen sind oder auf einem anderen geregelten Markt gehandelt werden (Fortsetzung)** | | | | | |
| | **Anteile (Fortsetzung)** | | | | |
| 79 155 | RED ELECTRICA CORP SA | EUR | 1 397 624 | 1 372 943 | 0.71 |
| 10 993 | RIO TINTO LTD | AUD | 645 321 | 563 103 | 0.29 |
| 24 717 | RIO TINTO PLC | GBP | 1 283 795 | 1 037 025 | 0.54 |
| 26 995 | ROCHE HOLDING AG | CHF | 6 065 367 | 7 863 015 | 4.08 |
| 9 600 | SAMPO OYJ - A | EUR | 354 816 | 354 048 | 0.18 |
| 18 934 | SANOFI | EUR | 1 665 245 | 1 589 131 | 0.82 |
| 10 399 | SCHRODERS PLC | GBP | 396 429 | 345 122 | 0.18 |
| 20 814 | SEAGATE TECHNOLOGY PLC | USD | 975 649 | 908 581 | 0.47 |
| 32 000 | SEKISUI HOUSE LTD | JPY | 630 443 | 571 755 | 0.30 |
| 3 000 | SHOWA DENKO KK | JPY | 73 843 | 59 046 | 0.03 |
| 6 149 | SIEMENS AG - REG | EUR | 720 663 | 573 087 | 0.30 |
| 7 632 | SIMON PROPERTY GROUP INC | USD | 1 001 031 | 855 156 | 0.44 |
| 141 200 | SINGAPORE EXCHANGE LTD | SGD | 754 100 | 781 937 | 0.40 |
| 586 000 | SINO LAND CO LTD | HKD | 778 038 | 725 633 | 0.38 |
| 7 013 | SKANSKA AB - B | SEK | 118 986 | 137 566 | 0.07 |
| 8 586 | SKF AB - B | SEK | 127 560 | 135 447 | 0.07 |
| 2 600 | SOFTBANK CORP | JPY | 31 394 | 30 996 | 0.02 |
| 46 611 | SOUTHERN CO | USD | 2 369 059 | 2 561 282 | 1.32 |
| 56 519 | SPARK NEW ZEALAND LTD | NZD | 134 976 | 144 732 | 0.07 |
| 24 767 | SSE PLC | GBP | 388 912 | 440 360 | 0.23 |
| 16 217 | STEEL DYNAMICS INC | USD | 480 537 | 393 153 | 0.20 |
| 3 600 | SUBARU CORP | JPY | 83 786 | 79 590 | 0.04 |
| 23 004 | SUN LIFE FINANCIAL INC | CAD | 926 503 | 904 715 | 0.47 |
| 74 500 | SWIRE PACIFIC LTD - A | HKD | 741 062 | 610 952 | 0.32 |
| 8 000 | SWIRE PROPERTIES LTD | HKD | 23 003 | 21 541 | 0.01 |
| 6 822 | SWISS PRIME SITE AG - REG | CHF | 670 750 | 744 277 | 0.39 |
| 2 659 | SWISSCOM AG - REG | CHF | 1 260 736 | 1 284 423 | 0.66 |
| 211 635 | TAYLOR WIMPEY PLC | GBP | 439 496 | 497 617 | 0.26 |
| 13 169 | TC ENERGY CORP | CAD | 585 960 | 624 824 | 0.32 |
| 15 272 | TD AMERITRADE HOLDING CORP | USD | 712 523 | 587 133 | 0.30 |
| 31 200 | TOKIO MARINE HOLDINGS INC | JPY | 1 494 812 | 1 527 554 | 0.79 |
| 35 668 | TOTAL SA | EUR | 1 765 635 | 1 368 938 | 0.71 |
| 10 900 | TOYOTA MOTOR CORP | JPY | 690 005 | 655 650 | 0.34 |
| 11 712 | TRYG A/S | DKK | 326 579 | 293 390 | 0.15 |
| 53 770 | UNILEVER NV | EUR | 2 876 057 | 2 560 259 | 1.32 |
| 55 617 | UNILEVER PLC | GBP | 3 057 582 | 2 696 935 | 1.40 |
| 8 325 | UNIPER SE | EUR | 235 838 | 222 611 | 0.12 |
| 21 992 | UNITED PARCEL SERVICE INC - B | USD | 2 322 338 | 1 811 695 | 0.94 |
| 17 381 | UNUM GROUP | USD | 473 350 | 368 839 | 0.19 |
| 32 672 | UPM-KYMMENE OYJ | EUR | 958 837 | 905 995 | 0.47 |
| 344 | VAIL RESORTS INC | USD | 73 945 | 66 583 | 0.03 |
| 2 053 | VALEO SA | EUR | 66 332 | 46 767 | 0.02 |
| 17 501 | VALERO ENERGY CORP | USD | 1 346 802 | 1 055 525 | 0.55 |
| 19 359 | VEOLIA ENVIRONNEMENT SA | EUR | 431 125 | 501 979 | 0.26 |

# Swiss Life Funds (LUX) Equity Global High Dividend

## Anlagenübersicht (Fortsetzung)

| Nominalwert/ Menge | Bezeichnung | Kurs Währung | Kosten EUR | Marktwert EUR | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| **Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumenten, die an einer amtlichen Börse zugelassen sind oder auf einem anderen geregelten Markt gehandelt werden (Fortsetzung)** | | | | | |
| | **Anteile (Fortsetzung)** | | | | |
| 130 106 | VERIZON COMMUNICATIONS INC | USD | 5 872 035 | 6 414 985 | 3.33 |
| 3 781 | VICI PROPERTIES INC | USD | 84 212 | 86 260 | 0.04 |
| 34 137 | WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC | USD | 1 691 588 | 1 422 103 | 0.74 |
| 30 241 | WESFARMERS LTD | AUD | 727 927 | 721 545 | 0.37 |
| 33 817 | WESTERN UNION CO | USD | 811 144 | 689 301 | 0.36 |
| 8 519 | WESTROCK CO | USD | 294 444 | 257 870 | 0.13 |
| 57 000 | WHARF REAL ESTATE INVESTMENT CO LTD | HKD | 285 012 | 235 384 | 0.12 |
| 2 165 | WHIRLPOOL CORP | USD | 273 931 | 252 007 | 0.13 |
| 14 000 | YAMAHA MOTOR CO LTD | JPY | 261 064 | 204 179 | 0.11 |
| 194 000 | YANGZIJIANG SHIPBUILDING HOLDINGS LTD | SGD | 180 253 | 119 581 | 0.06 |
| 6 109 | ZURICH INSURANCE GROUP AG | CHF | 1 652 411 | 2 131 040 | 1.10 |
| 17 256 | 3M CO | USD | 2 704 213 | 2 344 472 | 1.21 |
| | **Gesamtsumme der Aktien** | | **193 967 841** | **186 724 194** | **96.59** |
| | **Gesamtsumme übertragbarer Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer amtlichen Börse zugelassen sind oder auf einem anderen geregelten Markt gehandelt werden** | | **193 967 841** | **186 724 194** | **96.59** |
| | **Gesamtsumme der Anlagen** | | **193 967 841** | **186 724 194** | **96.59** |

# Swiss Life Funds (LUX) Equity Global High Dividend

## Sektorstruktur und geographische Verteilung der Anlagen

| Sektorstruktur | % |
|---|---|
| Pharmazeutik und Biotechnologie | 17.15 |
| Festnetz-Telekommunikation | 9.55 |
| Versicherungen (ohne Lebensversicherung) | 7.25 |
| Technologie Hardware und Geräte | 5.32 |
| Öl- und Gasproduzenten | 4.86 |
| Elektrizität | 4.18 |
| Persönliche Güter | 3.77 |
| Finanzdienstleistungen | 3.59 |
| Kundenbetreuung | 3.54 |
| Haushaltswaren und Heimwerkerbedarf | 3.37 |
| Gas-, Wasser- und Mehrfachversorgungsunternehmen | 3.36 |
| Tabak | 3.01 |
| Industrietransport | 2.37 |
| Allgemeine Industrie | 2.33 |
| Banken | 2.04 |
| Lebensversicherung | 1.94 |
| Lebensmittelhersteller | 1.81 |
| Lebensmittel- und Arzneimittelhandel | 1.65 |
| Getränke | 1.48 |
| Industrietechnik | 1.34 |
| Software- und Computerdienstleistungen | 1.34 |
| Immobilienbezogene Dienstleistungen und Investitionen | 1.33 |
| Medien | 1.06 |
| Chemikalien | 1.05 |
| Mobilfunk | 0.93 |
| Forst- und Papierindustrie | 0.91 |
| Allgemeiner Einzelhandel | 0.86 |
| Bergbau | 0.83 |
| Automobilbau und -teile | 0.78 |
| Bauwirtschaft und Baustoffe | 0.68 |
| Immobilienbezogene Anlagefonds | 0.67 |
| Reise, Freizeit und Catering | 0.61 |
| Ölbranche: Maschinen, Dienstleistungen und Vertrieb | 0.56 |
| Luft- und Raumfahrt und Verteidigung | 0.45 |
| Anlageinstrumente, die keine Aktien sind | 0.27 |
| Industriemetalle und Bergbau | 0.23 |
| Alternative Energie | 0.12 |
| | **96.59** |

| Geographische Verteilung | % |
|---|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika | 49.33 |
| Großbritannien | 7.42 |
| Japan | 6.87 |
| Schweiz | 6.71 |
| Deutschland | 4.12 |
| Kanada | 3.87 |
| Frankreich | 3.07 |
| Niederlande | 2.52 |
| Irland | 2.48 |
| Spanien | 1.86 |
| HongKong (China) | 1.52 |
| Finnland | 1.46 |
| Australien | 1.34 |
| Singapur | 1.05 |
| Italien | 0.95 |
| Bermuda | 0.56 |
| Kaimaninseln | 0.46 |
| Jersey Inseln | 0.27 |
| Österreich | 0.26 |
| Schweden | 0.21 |
| Dänemark | 0.19 |
| Neuseeland | 0.07 |
| | **96.59** |

# Swiss Life Funds (LUX) Equity Global Long/Short

## Anlagenübersicht

| Nominalwert/ Menge | Bezeichnung | Kurs Währung | Kosten EUR | Marktwert EUR | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| **Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumenten, die an einer amtlichen Börse zugelassen sind oder auf einem anderen geregelten Markt gehandelt werden** | | | | | |
| **Aktien** | | | | | |
| 4 369 | AALBERTS NV | EUR | 180 178 | 147 454 | 0.09 |
| 2 140 | ABBVIE INC | USD | 170 735 | 166 980 | 0.10 |
| 3 258 | ACCENTURE PLC - A | USD | 545 744 | 535 630 | 0.33 |
| 15 009 | ACS ACTIVIDADES DE CONSTRUCCION Y SERVICIOS SA | EUR | 531 442 | 402 992 | 0.25 |
| 6 852 | ADECCO GROUP AG - REG | CHF | 369 666 | 331 113 | 0.21 |
| 3 010 | ADIDAS AG - REG - REG | EUR | 705 439 | 754 155 | 0.47 |
| 16 923 | ADMIRAL GROUP PLC | GBP | 411 413 | 415 622 | 0.26 |
| 1 827 | AENA SME SA | EUR | 292 959 | 264 915 | 0.16 |
| 11 458 | AES CORP/VA | USD | 209 467 | 174 512 | 0.11 |
| 4 508 | AFLAC INC | USD | 210 177 | 175 855 | 0.11 |
| 11 303 | AGEAS | EUR | 569 736 | 473 370 | 0.29 |
| 130 099 | AIB GROUP PLC | EUR | 399 742 | 272 948 | 0.17 |
| 805 | AIR LIQUIDE SA | EUR | 75 698 | 98 935 | 0.06 |
| 586 | AIRBUS SE | EUR | 71 153 | 63 347 | 0.04 |
| 2 031 | ALLEGION PLC | USD | 226 888 | 212 613 | 0.13 |
| 6 027 | ALLIANZ SE - REG | EUR | 1 136 888 | 1 174 059 | 0.73 |
| 4 186 | ALLSTATE CORP | USD | 384 232 | 401 089 | 0.25 |
| 488 | ALPHABET CLASS - A | USD | 421 029 | 594 978 | 0.37 |
| 498 | ALPHABET INC | USD | 563 473 | 607 207 | 0.38 |
| 2 029 | ALSTOM SA | EUR | 75 538 | 90 270 | 0.06 |
| 29 574 | ALSTRIA OFFICE REIT-AG | EUR | 487 983 | 507 194 | 0.31 |
| 692 | ALTEN SA | EUR | 68 086 | 69 408 | 0.04 |
| 18 113 | ALTICE EUROPE NV - A | EUR | 106 070 | 87 721 | 0.05 |
| 643 | AMAZON.COM INC | USD | 801 994 | 1 102 690 | 0.68 |
| 17 628 | AMCOR PLC | USD | 155 362 | 149 568 | 0.09 |
| 1 734 | AMERICAN ELECTRIC POWER CO INC | USD | 121 782 | 140 905 | 0.09 |
| 1 880 | AMERICAN EXPRESS CO | USD | 197 933 | 188 145 | 0.12 |
| 1 316 | AMERICAN TOWER CORP | USD | 256 581 | 271 718 | 0.17 |
| 2 599 | AMERIPRISE FINANCIAL INC | USD | 354 049 | 334 324 | 0.21 |
| 3 373 | AMERISOURCEBERGEN CORP | USD | 251 759 | 258 921 | 0.16 |
| 2 965 | AMGEN INC | USD | 555 336 | 539 123 | 0.33 |
| 4 300 | AMPLIFON SPA | EUR | 110 940 | 110 768 | 0.07 |
| 6 105 | AMUNDI SA | EUR | 401 058 | 394 688 | 0.24 |
| 17 370 | ANGLO AMERICAN PLC | GBP | 329 511 | 361 923 | 0.22 |
| 974 | ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV | EUR | 84 426 | 49 411 | 0.03 |
| 733 | AON PLC | USD | 150 498 | 138 799 | 0.09 |
| 11 086 | APPLE INC | USD | 1 901 750 | 2 758 858 | 1.72 |
| 8 337 | APPLIED MATERIALS INC | USD | 366 910 | 441 118 | 0.27 |
| 5 287 | ARKEMA SA | EUR | 478 051 | 449 712 | 0.28 |
| 3 231 | ARTHUR J GALLAGHER & CO | USD | 250 493 | 286 759 | 0.18 |
| 68 003 | ASHMORE GROUP PLC | GBP | 380 300 | 365 498 | 0.23 |
| 4 159 | ASM INTERNATIONAL NV | EUR | 322 249 | 436 487 | 0.27 |
| 1 436 | ASML HOLDING NV | EUR | 187 768 | 356 272 | 0.22 |
| 3 580 | ASSA ABLOY AB | SEK | 77 452 | 72 242 | 0.04 |

# Swiss Life Funds (LUX) Equity Global Long/Short

## Anlagenübersicht (Fortsetzung)

| Nominal wert/ Menge | Bezeichnung | Kurs Währung | Kosten EUR | Marktwert EUR | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| **Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumenten, die an einer amtlichen Börse zugelassen sind oder auf einem anderen geregelten Markt gehandelt werden (Fortsetzung)** | | | | | |
| | **Anteile (Fortsetzung)** | | | | |
| 40 856 | ASSICURAZIONI GENERALI SPA | EUR | 675 806 | 664 319 | 0.41 |
| 1 745 | ASSURANT INC | USD | 183 720 | 191 570 | 0.12 |
| 7 403 | ASTRAZENECA PLC | GBP | 452 840 | 584 871 | 0.36 |
| 9 993 | ATLAS COPCO AB | SEK | 282 264 | 318 194 | 0.20 |
| 6 834 | AT&T INC | USD | 198 323 | 219 121 | 0.14 |
| 2 197 | AVALONBAY COMMUNITIES INC | USD | 418 684 | 401 198 | 0.25 |
| 34 013 | AVAST PLC | GBP | 178 513 | 155 757 | 0.10 |
| 1 971 | AVERY DENNISON CORP | USD | 231 173 | 205 435 | 0.13 |
| 35 092 | AVIVA PLC | GBP | 168 860 | 143 151 | 0.09 |
| 6 302 | AXA SA | EUR | 137 260 | 132 058 | 0.08 |
| 212 063 | A2A SPA | EUR | 355 572 | 333 893 | 0.21 |
| 86 975 | BAE SYSTEMS PLC | GBP | 583 252 | 615 333 | 0.38 |
| 81 483 | BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA SA | EUR | 407 226 | 353 188 | 0.22 |
| 16 952 | BANCO SANTANDER SA | EUR | 78 429 | 56 399 | 0.03 |
| 54 818 | BANKINTER SA | EUR | 337 398 | 292 728 | 0.18 |
| 37 996 | BARRATT DEVELOPMENTS PLC | GBP | 317 390 | 334 561 | 0.21 |
| 116 | BARRY CALLEBAUT AG - REG | CHF | 231 881 | 216 344 | 0.13 |
| 1 233 | BASF SE - REG | EUR | 93 933 | 65 448 | 0.04 |
| 866 | BEIERSDORF AG | EUR | 85 246 | 82 183 | 0.05 |
| 7 923 | BELLWAY PLC | GBP | 327 560 | 343 012 | 0.21 |
| 7 453 | BERKELEY GROUP HOLDINGS | GBP | 374 162 | 412 019 | 0.26 |
| 2 765 | BERKSHIRE HATHAWAY INC - B | USD | 533 262 | 519 396 | 0.32 |
| 5 253 | BEST BUY CO INC | USD | 340 966 | 361 773 | 0.22 |
| 1 686 | BIOGEN INC | USD | 367 086 | 473 345 | 0.29 |
| 319 | BLACKROCK INC | USD | 154 678 | 134 462 | 0.08 |
| 1 687 | BNP PARIBAS SA | EUR | 86 321 | 73 865 | 0.05 |
| 4 558 | BOLSAS Y MERCADOS ESPANOLES SHMSF SA | EUR | 121 332 | 157 160 | 0.10 |
| 115 | BOOKING HOLDINGS INC | USD | 207 603 | 177 524 | 0.11 |
| 6 847 | BORGWARNER INC | USD | 236 960 | 196 973 | 0.12 |
| 6 266 | BOUYGUES SA | EUR | 238 857 | 222 318 | 0.14 |
| 112 655 | BP PLC | GBP | 654 557 | 518 964 | 0.32 |
| 6 403 | BRENNTAG AG | EUR | 308 872 | 258 745 | 0.16 |
| 13 732 | BRISTOL-MYERS SQUIBB CO | USD | 592 574 | 738 324 | 0.46 |
| 3 938 | BRISTOL-MYERS SQUIBB CO - RIGHTS - 30/12/2020 | USD | - | 12 010 | 0.01 |
| 3 805 | BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC | GBP | 115 494 | 135 506 | 0.08 |
| 743 | BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS INC | USD | 75 933 | 70 590 | 0.04 |
| 49 114 | BT GROUP PLC | GBP | 119 287 | 80 883 | 0.05 |
| 9 736 | BUNZL PLC | GBP | 228 380 | 211 714 | 0.13 |
| 12 856 | BUREAU VERITAS SA | EUR | 297 658 | 283 475 | 0.18 |
| 2 041 | CADENCE DESIGN SYSTEMS INC | USD | 109 922 | 122 893 | 0.08 |
| 2 375 | CAMPBELL SOUP CO | USD | 100 004 | 97 556 | 0.06 |
| 2 157 | CARL ZEISS MEDITEC AG | EUR | 230 635 | 204 376 | 0.13 |
| 1 214 | CARLSBERG A/S - B | DKK | 151 881 | 144 193 | 0.09 |
| 13 117 | CASTELLUM AB | SEK | 237 949 | 272 205 | 0.17 |

# Swiss Life Funds (LUX) Equity Global Long/Short

## Anlagenübersicht (Fortsetzung)

| Nominalwert/ Menge | Bezeichnung | Kurs Währung | Kosten EUR | Marktwert EUR | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| **Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumenten, die an einer amtlichen Börse zugelassen sind oder auf einem anderen geregelten Markt gehandelt werden (Fortsetzung)** | | | | | |
| | **Anteile (Fortsetzung)** | | | | |
| 1 000 | CBOE GLOBAL MARKETS INC | USD | 94 065 | 103 783 | 0.06 |
| 7 342 | CBRE GROUP INC | USD | 343 472 | 375 238 | 0.23 |
| 2 083 | CELANESE CORP - A | USD | 230 325 | 177 760 | 0.11 |
| 4 432 | CEMBRA MONEY BANK AG | CHF | 398 534 | 451 432 | 0.28 |
| 111 111 | CENTRICA PLC | GBP | 92 368 | 93 184 | 0.06 |
| 1 110 | CH ROBINSON WORLDWIDE INC | USD | 78 028 | 69 624 | 0.04 |
| 2 313 | CHARLES SCHWAB CORP | USD | 98 860 | 85 807 | 0.05 |
| 306 | CHARTER COMMUNICATIONS INC | USD | 102 721 | 137 385 | 0.09 |
| 4 405 | CHEVRON CORP | USD | 479 504 | 374 312 | 0.23 |
| 187 | CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC | USD | 73 483 | 131 694 | 0.08 |
| 397 | CHRISTIAN DIOR SE | EUR | 161 936 | 151 257 | 0.09 |
| 1 497 | CINTAS CORP | USD | 332 233 | 363 521 | 0.23 |
| 2 049 | CISCO SYSTEMS INC | USD | 81 923 | 74 484 | 0.05 |
| 2 750 | CITRIX SYSTEMS INC | USD | 270 962 | 258 840 | 0.16 |
| 799 | CLOROX CO | USD | 106 615 | 115 960 | 0.07 |
| 2 196 | CMS ENERGY CORP | USD | 134 026 | 120 791 | 0.07 |
| 16 694 | CNP ASSURANCES | EUR | 293 202 | 236 220 | 0.15 |
| 2 946 | COCA-COLA CO | USD | 134 951 | 143 458 | 0.09 |
| 945 | COFINIMMO SA | EUR | 106 899 | 136 269 | 0.08 |
| 1 663 | COLOPLAST A/S | DKK | 150 854 | 201 351 | 0.12 |
| 8 775 | COLRUYT SA | EUR | 416 528 | 366 971 | 0.23 |
| 2 881 | COMCAST CORP | USD | 107 246 | 106 039 | 0.07 |
| 19 197 | COMPASS GROUP PLC | GBP | 383 007 | 381 842 | 0.24 |
| 6 595 | CONOCOPHILLIPS | USD | 344 532 | 290 710 | 0.18 |
| 1 705 | CONSOLIDATED EDISON INC | USD | 131 920 | 122 343 | 0.08 |
| 189 885 | CONVATEC GROUP PLC | GBP | 379 370 | 452 659 | 0.28 |
| 4 842 | COPART INC | USD | 354 912 | 372 390 | 0.23 |
| 7 606 | COVESTRO AG | EUR | 344 653 | 262 331 | 0.16 |
| 7 545 | CTS EVENTIM AG & CO KGAA | EUR | 405 818 | 360 953 | 0.22 |
| 1 571 | CUMMINS INC | USD | 212 176 | 216 375 | 0.13 |
| 2 953 | DANONE SA | EUR | 214 375 | 188 165 | 0.12 |
| 955 | DARDEN RESTAURANTS INC | USD | 101 717 | 84 767 | 0.05 |
| 2 855 | DAVITA INC | USD | 198 310 | 201 743 | 0.13 |
| 4 008 | DELTA AIR LINES INC | USD | 190 793 | 168 318 | 0.10 |
| 1 591 | DENTSPLY SIRONA INC | USD | 67 197 | 71 319 | 0.04 |
| 677 | DEUTSCHE BOERSE AG | EUR | 88 648 | 96 168 | 0.06 |
| 13 361 | DEUTSCHE POST AG - REG | EUR | 443 187 | 362 350 | 0.22 |
| 14 444 | DEUTSCHE TELEKOM AG - REG | EUR | 213 105 | 213 136 | 0.13 |
| 10 932 | DEVON ENERGY CORP | USD | 237 447 | 161 624 | 0.10 |
| 9 489 | DIAGEO PLC | GBP | 270 802 | 305 155 | 0.19 |
| 10 523 | DIALOG SEMICONDUCTOR PLC | EUR | 443 500 | 322 109 | 0.20 |
| 1 629 | DIASORIN SPA | EUR | 166 497 | 166 973 | 0.10 |
| 30 972 | DIRECT LINE INSURANCE GROUP PLC | GBP | 111 239 | 110 569 | 0.07 |
| 3 311 | DISCOVER FINANCIAL SERVICES | USD | 238 187 | 197 674 | 0.12 |

# Swiss Life Funds (LUX) Equity Global Long/Short

## Anlagenübersicht (Fortsetzung)

| Nominal wert/ Menge | Bezeichnung | Kurs Währung | Kosten EUR | Marktwert EUR | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| **Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumenten, die an einer amtlichen Börse zugelassen sind oder auf einem anderen geregelten Markt gehandelt werden (Fortsetzung)** | | | | | |
| | **Anteile (Fortsetzung)** | | | | |
| 3 064 | DISCOVERY COMMUNICATIONS INC - C | USD | 82 475 | 70 014 | 0.04 |
| 1 151 | DOMINION ENERGY INC | USD | 85 689 | 81 920 | 0.05 |
| 3 642 | DOVER CORP | USD | 357 034 | 340 643 | 0.21 |
| 5 566 | DOW INC | USD | 253 098 | 204 763 | 0.13 |
| 6 858 | DR HORTON INC | USD | 305 110 | 332 583 | 0.21 |
| 1 176 | DSV PANALPINA A/S | DKK | 96 363 | 107 293 | 0.07 |
| 1 926 | DTE ENERGY CO | USD | 221 043 | 195 800 | 0.12 |
| 6 225 | DUKE REALTY CORP | USD | 197 181 | 184 010 | 0.11 |
| 3 030 | EATON CORP PLC | USD | 259 458 | 250 245 | 0.16 |
| 4 042 | EBAY INC | USD | 138 111 | 127 466 | 0.08 |
| 797 | EDWARDS LIFESCIENCES CORP | USD | 158 595 | 148 625 | 0.09 |
| 4 353 | EIFFAGE SA | EUR | 421 634 | 419 716 | 0.26 |
| 3 474 | ELECTRONIC ARTS INC | USD | 305 655 | 320 597 | 0.20 |
| 1 497 | ELI LILLY & CO | USD | 194 528 | 171 894 | 0.11 |
| 10 027 | ELISA OYJ | EUR | 469 449 | 520 802 | 0.32 |
| 3 564 | EMERSON ELECTRIC CO | USD | 242 885 | 208 010 | 0.13 |
| 18 968 | ENAGAS SA | EUR | 423 341 | 443 851 | 0.28 |
| 7 867 | ENDESA SA | EUR | 172 059 | 182 750 | 0.11 |
| 61 451 | ENEL SPA | EUR | 314 346 | 465 553 | 0.29 |
| 7 562 | ENI SPA | EUR | 114 170 | 84 377 | 0.05 |
| 1 024 | ENTERGY CORP | USD | 84 541 | 108 986 | 0.07 |
| 2 149 | EOG RESOURCES INC | USD | 143 325 | 123 761 | 0.08 |
| 5 819 | EQUINOR ASA | NOK | 116 880 | 79 000 | 0.05 |
| 3 242 | EQUITY RESIDENTIAL | USD | 243 565 | 221 653 | 0.14 |
| 743 | ESSEX PROPERTY TRUST INC | USD | 207 321 | 191 667 | 0.12 |
| 5 187 | ESSITY AB | SEK | 141 687 | 140 079 | 0.09 |
| 1 011 | ESTEE LAUDER COS INC - A | USD | 171 212 | 168 983 | 0.10 |
| 3 122 | E*TRADE FINANCIAL CORP | USD | 122 945 | 130 115 | 0.08 |
| 6 213 | EURONEXT NV | EUR | 423 046 | 467 528 | 0.29 |
| 4 576 | EUTELSAT COMMUNICATIONS SA | EUR | 83 747 | 56 010 | 0.03 |
| 7 393 | EVOLUTION GAMING GROUP AB | SEK | 215 151 | 243 667 | 0.15 |
| 1 627 | EXOR NV | EUR | 110 657 | 104 258 | 0.06 |
| 1 606 | EXPEDIA GROUP INC | USD | 195 827 | 144 188 | 0.09 |
| 2 217 | EXPEDITORS INTERNATIONAL OF WASHINGTON INC | USD | 142 261 | 142 129 | 0.09 |
| 4 136 | EXPERIAN PLC | GBP | 92 635 | 124 616 | 0.08 |
| 4 506 | EXTRA SPACE STORAGE INC | USD | 461 961 | 411 691 | 0.26 |
| 1 859 | EXXON MOBIL CORP | USD | 121 199 | 87 056 | 0.05 |
| 4 921 | FABEGE AB | SEK | 61 942 | 72 524 | 0.04 |
| 2 402 | FACEBOOK INC | USD | 377 597 | 420 878 | 0.26 |
| 10 155 | FASTIGHETS AB BALDER - B | SEK | 371 724 | 430 819 | 0.27 |
| 3 208 | FAURECIA SE | EUR | 145 879 | 131 143 | 0.08 |
| 5 686 | FERGUSON PLC | GBP | 452 036 | 445 650 | 0.28 |
| 743 | FERRARI NV | EUR | 107 724 | 105 172 | 0.07 |
| 35 763 | FINECOBANK BANCA FINECO SPA | EUR | 387 298 | 339 534 | 0.21 |

# Swiss Life Funds (LUX) Equity Global Long/Short

## Anlagenübersicht (Fortsetzung)

| Nominalwert/ Menge | Bezeichnung | Kurs Währung | Kosten EUR | Marktwert EUR | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| **Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumenten, die an einer amtlichen Börse zugelassen sind oder auf einem anderen geregelten Markt gehandelt werden (Fortsetzung)** | | | | | |
| | **Anteile (Fortsetzung)** | | | | |
| 8 682 | FIRSTENERGY CORP | USD | 354 693 | 351 959 | 0.22 |
| 18 964 | FORTUM OYJ | EUR | 400 760 | 365 626 | 0.23 |
| 1 922 | FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC | USD | 124 042 | 108 046 | 0.07 |
| 4 992 | FOX CORP | USD | 144 362 | 139 701 | 0.09 |
| 23 676 | FREENET AG | EUR | 497 704 | 418 828 | 0.26 |
| 8 335 | GALENICA AG | CHF | 442 626 | 509 154 | 0.32 |
| 2 256 | GARMIN LTD | USD | 168 097 | 181 536 | 0.11 |
| 950 | GEBERIT AG - REG | CHF | 398 786 | 427 980 | 0.27 |
| 7 567 | GENERAL MILLS INC | USD | 341 375 | 337 551 | 0.21 |
| 119 | GEORG FISCHER AG - REG | CHF | 103 429 | 91 887 | 0.06 |
| 48 | GIVAUDAN SA - REG | CHF | 102 537 | 135 705 | 0.08 |
| 14 113 | GJENSIDIGE FORSIKRING ASA | NOK | 247 442 | 256 372 | 0.16 |
| 38 311 | GLANBIA PLC | EUR | 432 135 | 404 181 | 0.25 |
| 75 834 | GLAXOSMITHKLINE PLC | GBP | 1 373 227 | 1 377 613 | 0.85 |
| 3 884 | GLOBE LIFE INC | USD | 338 502 | 327 636 | 0.20 |
| 11 571 | GRAND CITY PROPERTIES SA | EUR | 255 730 | 245 305 | 0.15 |
| 9 484 | GREGGS PLC | GBP | 193 366 | 230 497 | 0.14 |
| 7 042 | H LUNDBECK A/S | DKK | 247 099 | 219 563 | 0.14 |
| 6 371 | HALLIBURTON CO | USD | 113 081 | 98 368 | 0.06 |
| 7 671 | HALMA PLC | GBP | 196 776 | 172 072 | 0.11 |
| 23 055 | HANESBRANDS INC | USD | 326 744 | 277 890 | 0.17 |
| 3 551 | HANNOVER RUECK SE - REG | EUR | 531 255 | 571 711 | 0.35 |
| 9 226 | HARTFORD FINANCIAL SERVICES GROUP INC | USD | 456 442 | 419 535 | 0.26 |
| 69 456 | HAYS PLC | GBP | 136 973 | 111 701 | 0.07 |
| 14 201 | HEALTHPEAK PROPERTIES INC | USD | 438 919 | 409 049 | 0.25 |
| 8 444 | HELLA GMBH & CO KGAA | EUR | 381 911 | 315 299 | 0.20 |
| 4 267 | HELVETIA HOLDING AG | CHF | 465 362 | 513 284 | 0.32 |
| 28 335 | HENNES & MAURITZ AB - B | SEK | 514 815 | 461 255 | 0.29 |
| 3 413 | HENRY SCHEIN INC | USD | 208 228 | 189 347 | 0.12 |
| 133 523 | HERA SPA | EUR | 474 306 | 517 802 | 0.32 |
| 119 | HERMES INTERNATIONAL | EUR | 66 732 | 74 970 | 0.05 |
| 3 682 | HERSHEY CO | USD | 468 976 | 482 654 | 0.30 |
| 12 389 | HEXPOL AB | SEK | 107 692 | 83 411 | 0.05 |
| 10 515 | HIKMA PHARMACEUTICALS PLC | GBP | 230 142 | 218 627 | 0.14 |
| 3 546 | HOCHTIEF AG | EUR | 390 491 | 315 417 | 0.20 |
| 2 756 | HOLLYFRONTIER CORP | USD | 136 465 | 84 503 | 0.05 |
| 1 745 | HOME DEPOT INC | USD | 360 247 | 346 061 | 0.21 |
| 1 270 | HONEYWELL INTERNATIONAL INC | USD | 192 855 | 187 497 | 0.12 |
| 8 248 | HOST HOTELS & RESORTS INC | USD | 125 829 | 108 727 | 0.07 |
| 56 470 | HOWDEN JOINERY GROUP PLC | GBP | 364 226 | 417 640 | 0.26 |
| 10 283 | H&R BLOCK INC | USD | 220 150 | 193 500 | 0.12 |
| 98 669 | HSBC HOLDINGS PLC | GBP | 680 728 | 601 113 | 0.37 |
| 8 132 | HUGO BOSS AG | EUR | 388 659 | 321 702 | 0.20 |
| 773 | HUMANA INC | USD | 248 526 | 224 965 | 0.14 |

# Swiss Life Funds (LUX) Equity Global Long/Short

## Anlagenübersicht (Fortsetzung)

| Nominalwert/ Menge | Bezeichnung | Kurs Währung | Kosten EUR | Marktwert EUR | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| **Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumenten, die an einer amtlichen Börse zugelassen sind oder auf einem anderen geregelten Markt gehandelt werden (Fortsetzung)** | | | | | |
| | **Anteile (Fortsetzung)** | | | | |
| 865 | HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIES INC | USD | 207 672 | 161 849 | 0.10 |
| 26 790 | IBERDROLA SA | EUR | 195 519 | 276 473 | 0.17 |
| 3 596 | ICA GRUPPEN AB | SEK | 112 456 | 121 493 | 0.08 |
| 63 970 | IG GROUP HOLDINGS PLC | GBP | 525 156 | 501 078 | 0.31 |
| 1 538 | ILLINOIS TOOL WORKS INC | USD | 248 561 | 234 918 | 0.15 |
| 26 870 | IMI PLC | GBP | 329 890 | 314 335 | 0.19 |
| 8 811 | IMPERIAL BRANDS PLC | GBP | 235 401 | 159 304 | 0.10 |
| 39 077 | INCHCAPE PLC | GBP | 319 615 | 262 195 | 0.16 |
| 22 221 | INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL SA | EUR | 653 322 | 625 077 | 0.39 |
| 2 541 | INGENICO GROUP SA | EUR | 218 233 | 325 121 | 0.20 |
| 5 444 | INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI SA | EUR | 54 097 | 62 715 | 0.04 |
| 4 087 | INTEL CORP | USD | 216 171 | 206 573 | 0.13 |
| 1 861 | INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC | USD | 136 302 | 151 157 | 0.09 |
| 829 | INTERNATIONAL BUSINESS MACHINES CORP | USD | 101 082 | 98 224 | 0.06 |
| 6 905 | INTERPUBLIC GROUP OF COS INC | USD | 143 061 | 134 272 | 0.08 |
| 5 093 | INVESTOR AB - B | SEK | 240 750 | 228 262 | 0.14 |
| 2 296 | IPSEN SA | EUR | 212 224 | 134 546 | 0.08 |
| 36 335 | ITALGAS SPA | EUR | 195 792 | 201 005 | 0.12 |
| 280 335 | ITV PLC | GBP | 411 946 | 379 941 | 0.24 |
| 40 539 | IWG PLC | GBP | 192 602 | 165 795 | 0.10 |
| 42 663 | JD SPORTS FASHION PLC | GBP | 350 041 | 365 633 | 0.23 |
| 25 861 | JERONIMO MARTINS SGPS SA | EUR | 359 658 | 411 319 | 0.26 |
| 1 269 | JM SMUCKER CO | USD | 134 897 | 118 981 | 0.07 |
| 5 332 | JOHNSON & JOHNSON | USD | 680 447 | 652 781 | 0.40 |
| 2 639 | JPMORGAN CHASE & CO | USD | 293 988 | 278 952 | 0.17 |
| 4 485 | JUNIPER NETWORKS INC | USD | 101 981 | 86 642 | 0.05 |
| 51 754 | JUPITER FUND MANAGEMENT PLC | GBP | 207 350 | 180 548 | 0.11 |
| 650 | KERRY GROUP PLC | EUR | 53 592 | 74 750 | 0.05 |
| 2 098 | KESKO OYJ - B | EUR | 107 486 | 128 691 | 0.08 |
| 6 240 | KINDER MORGAN | USD | 112 757 | 108 900 | 0.07 |
| 3 202 | KION GROUP AG | EUR | 196 552 | 154 336 | 0.10 |
| 2 407 | KLA CORP | USD | 337 322 | 336 820 | 0.21 |
| 16 904 | KOJAMO OYJ | EUR | 286 675 | 286 692 | 0.18 |
| 8 714 | KONE OYJ - B | EUR | 448 841 | 444 414 | 0.28 |
| 29 245 | KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV | EUR | 633 292 | 619 409 | 0.38 |
| 3 086 | KONINKLIJKE DSM NV | EUR | 322 760 | 314 001 | 0.19 |
| 33 041 | KONINKLIJKE KPN NV | EUR | 94 443 | 72 723 | 0.05 |
| 10 953 | KONINKLIJKE PHILIPS NV | EUR | 414 020 | 424 100 | 0.26 |
| 11 845 | KROGER CO | USD | 294 517 | 303 336 | 0.19 |
| 3 031 | KUEHNE + NAGEL INTERNATIONAL AG - REG | CHF | 433 863 | 400 665 | 0.25 |
| 1 595 | LAM RESEARCH CORP | USD | 290 422 | 426 074 | 0.26 |
| 3 531 | LAMB WESTON HOLDINGS INC | USD | 272 155 | 279 310 | 0.17 |
| 32 163 | LEGAL & GENERAL GROUP PLC | GBP | 106 410 | 97 243 | 0.06 |
| 3 235 | LEGRAND SA | EUR | 210 420 | 223 280 | 0.14 |

# Swiss Life Funds (LUX) Equity Global Long/Short

## Anlagenübersicht (Fortsetzung)

| Nominal wert/ Menge | Bezeichnung | Kurs Währung | Kosten EUR | Marktwert EUR | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| **Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumenten, die an einer amtlichen Börse zugelassen sind oder auf einem anderen geregelten Markt gehandelt werden (Fortsetzung)** | | | | | |
| | **Anteile (Fortsetzung)** | | | | |
| 4 597 | LEIDOS HOLDINGS INC | USD | 355 492 | 429 589 | 0.27 |
| 8 596 | LENNAR CORP | USD | 431 607 | 472 195 | 0.29 |
| 4 337 | LINDE PLC | EUR | 770 284 | 744 879 | 0.46 |
| 2 647 | LKQ CORP | USD | 82 369 | 71 281 | 0.04 |
| 11 220 | LOGITECH INTERNATIONAL SA - REG | CHF | 418 368 | 391 183 | 0.24 |
| 3 619 | LONDON STOCK EXCHANGE GROUP PLC | GBP | 274 996 | 318 827 | 0.20 |
| 2 803 | L'OREAL SA | EUR | 657 273 | 675 523 | 0.42 |
| 2 995 | LUNDBERGFORETAGEN AB - B | SEK | 101 189 | 111 649 | 0.07 |
| 2 468 | LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE | EUR | 680 875 | 915 257 | 0.57 |
| 1 736 | LYONDELLBASELL INDUSTRIES NV - A | USD | 128 519 | 112 936 | 0.07 |
| 1 039 | L3HARRIS TECHNOLOGIES INC | USD | 168 529 | 187 029 | 0.12 |
| 236 588 | MAN GROUP PLC | GBP | 423 132 | 403 323 | 0.25 |
| 11 476 | MARATHON OIL CORP | USD | 122 365 | 86 505 | 0.05 |
| 2 864 | MARATHON PETROLEUM CORP | USD | 138 523 | 123 639 | 0.08 |
| 1 025 | MARKETAXESS HOLDINGS INC | USD | 324 765 | 302 643 | 0.19 |
| 39 163 | MARKS & SPENCER GROUP PLC | GBP | 83 637 | 72 137 | 0.04 |
| 3 026 | MARSH & MCLENNAN COS INC | USD | 291 250 | 288 041 | 0.18 |
| 547 | MARTIN MARIETTA MATERIALS INC | USD | 130 099 | 113 304 | 0.07 |
| 8 625 | MASCO CORP | USD | 345 251 | 324 444 | 0.20 |
| 944 | MCKESSON CORP | USD | 116 440 | 120 195 | 0.07 |
| 5 865 | MEDTRONIC PLC | USD | 548 306 | 537 512 | 0.33 |
| 3 207 | MERCK & CO INC | USD | 241 260 | 223 522 | 0.14 |
| 3 774 | MERCK KGAA | EUR | 410 625 | 411 555 | 0.26 |
| 27 755 | METRO AG | EUR | 379 484 | 291 011 | 0.18 |
| 145 428 | M&G PLC | GBP | 387 464 | 336 195 | 0.21 |
| 13 367 | MICRO FOCUS INTERNATIONAL PLC | GBP | 173 599 | 115 134 | 0.07 |
| 19 995 | MICROSOFT CORP | USD | 1 883 653 | 2 949 054 | 1.84 |
| 2 058 | MID-AMERICA APARTMENT COMMUNITIES INC | USD | 230 136 | 242 175 | 0.15 |
| 18 066 | MONEYSUPERMARKET.COM GROUP PLC | GBP | 71 079 | 65 230 | 0.04 |
| 585 | MOODY'S CORP | USD | 121 468 | 127 832 | 0.08 |
| 1 474 | MOTOROLA SOLUTIONS INC | USD | 188 116 | 222 324 | 0.14 |
| 414 | MTU AERO ENGINES AG | EUR | 83 441 | 91 370 | 0.06 |
| 3 457 | MUENCHENER RUECKVERSICHERUNGS-GESELLSCHAFT AG IN MUENCHEN - REG | EUR | 712 101 | 797 529 | 0.49 |
| 1 160 | NASDAQ INC | USD | 124 706 | 108 296 | 0.07 |
| 11 388 | NATIONAL GRID PLC | GBP | 110 677 | 130 149 | 0.08 |
| 2 737 | NESTE OYJ | EUR | 90 294 | 97 601 | 0.06 |
| 25 408 | NESTLE SA | CHF | 1 823 038 | 2 362 172 | 1.47 |
| 6 808 | NETAPP INC | USD | 279 128 | 289 562 | 0.18 |
| 6 167 | NEXT PLC | GBP | 425 983 | 436 161 | 0.27 |
| 6 537 | NIKE INC - B | USD | 526 570 | 531 910 | 0.33 |
| 5 569 | NORDSTROM INC | USD | 202 804 | 175 925 | 0.11 |
| 16 307 | NOVO NORDISK A/S | DKK | 676 241 | 863 689 | 0.54 |
| 139 | NVR INC | USD | 448 771 | 464 052 | 0.29 |

# Swiss Life Funds (LUX) Equity Global Long/Short

## Anlagenübersicht (Fortsetzung)

| Nominal wert/ Menge | Bezeichnung | Kurs Währung | Kosten EUR | Marktwert EUR | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| **Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumenten, die an einer amtlichen Börse zugelassen sind oder auf einem anderen geregelten Markt gehandelt werden (Fortsetzung)** | | | | | |
| | **Anteile (Fortsetzung)** | | | | |
| 4 074 | OCCIDENTAL PETROLEUM CORP | USD | 179 018 | 121 428 | 0.08 |
| 244 927 | OLD MUTUAL LTD | GBP | 275 374 | 219 023 | 0.14 |
| 4 606 | OMNICOM GROUP INC | USD | 320 025 | 290 504 | 0.18 |
| 6 316 | OMV AG | EUR | 309 462 | 239 061 | 0.15 |
| 425 | O'REILLY AUTOMOTIVE INC | USD | 150 485 | 142 661 | 0.09 |
| 13 668 | ORION OYJ - B | EUR | 460 368 | 491 365 | 0.30 |
| 942 | ORSTED A/S | DKK | 69 046 | 87 658 | 0.05 |
| 5 358 | PACCAR INC | USD | 342 945 | 326 324 | 0.20 |
| 3 013 | PADDY POWER BETFAIR PLC | EUR | 321 823 | 289 188 | 0.18 |
| 5 793 | PANDORA A/S | DKK | 268 482 | 235 427 | 0.15 |
| 478 | PARKER-HANNIFIN CORP | USD | 88 590 | 80 404 | 0.05 |
| 556 | PARTNERS GROUP HOLDING AG | CHF | 423 527 | 434 551 | 0.27 |
| 33 829 | PEARSON PLC | GBP | 291 696 | 219 351 | 0.14 |
| 1 640 | PEPSICO INC | USD | 196 011 | 197 122 | 0.12 |
| 13 932 | PERSIMMON PLC | GBP | 381 698 | 459 945 | 0.29 |
| 15 502 | PEUGEOT SA | EUR | 310 614 | 271 363 | 0.17 |
| 2 912 | PFIZER INC | USD | 99 272 | 88 597 | 0.05 |
| 3 302 | PHILIP MORRIS INTERNATIONAL INC | USD | 246 980 | 246 106 | 0.15 |
| 2 631 | PHILLIPS 66 | USD | 254 394 | 179 304 | 0.11 |
| 785 | PPG INDUSTRIES INC | USD | 90 242 | 74 645 | 0.05 |
| 2 391 | PRINCIPAL FINANCIAL GROUP INC | USD | 117 682 | 96 624 | 0.06 |
| 1 563 | PROCTER & GAMBLE CO | USD | 127 176 | 161 117 | 0.10 |
| 2 794 | PROGRESSIVE CORP | USD | 175 993 | 186 089 | 0.12 |
| 1 304 | PROLOGIS INC | USD | 103 545 | 100 051 | 0.06 |
| 20 193 | PROSIEBENSAT.1 MEDIA SE | EUR | 269 315 | 221 517 | 0.14 |
| 7 963 | PROXIMUS SADP | EUR | 206 810 | 178 053 | 0.11 |
| 1 465 | PSP SWISS PROPERTY AG - REG | CHF | 130 220 | 196 482 | 0.12 |
| 3 727 | PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GROUP INC | USD | 204 706 | 174 093 | 0.11 |
| 6 661 | PUBLICIS GROUPE SA | EUR | 309 252 | 233 002 | 0.14 |
| 9 875 | PULTEGROUP INC | USD | 294 134 | 361 396 | 0.22 |
| 938 | PUMA SE | EUR | 63 718 | 64 910 | 0.04 |
| 2 071 | QORVO INC | USD | 205 062 | 189 632 | 0.12 |
| 3 193 | QUEST DIAGNOSTICS INC | USD | 295 212 | 308 298 | 0.19 |
| 991 | RALPH LAUREN CORP - A | USD | 111 036 | 95 189 | 0.06 |
| 8 038 | RANDSTAD NV | EUR | 399 133 | 375 455 | 0.23 |
| 2 248 | RAYTHEON CO | USD | 431 927 | 385 892 | 0.24 |
| 1 444 | RECKITT BENCKISER GROUP PLC | GBP | 103 966 | 96 065 | 0.06 |
| 9 015 | RED ELECTRICA CORP SA | EUR | 167 287 | 156 365 | 0.10 |
| 1 317 | REGENERON PHARMACEUTICALS INC | USD | 367 209 | 533 023 | 0.33 |
| 8 583 | RELX PLC | EUR | 147 539 | 185 994 | 0.12 |
| 16 044 | RELX PLC | GBP | 359 432 | 348 418 | 0.22 |
| 625 | RESMED INC | USD | 87 034 | 90 446 | 0.06 |
| 1 380 | RHEINMETALL AG | EUR | 150 160 | 113 602 | 0.07 |
| 50 598 | RIGHTMOVE PLC | GBP | 337 478 | 364 209 | 0.23 |

# Swiss Life Funds (LUX) Equity Global Long/Short

## Anlagenübersicht (Fortsetzung)

| Nominalwert/ Menge | Bezeichnung | Kurs Währung | Kosten EUR | Marktwert EUR | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| **Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumenten, die an einer amtlichen Börse zugelassen sind oder auf einem anderen geregelten Markt gehandelt werden (Fortsetzung)** | | | | | |
| | **Anteile (Fortsetzung)** | | | | |
| 11 989 | RIO TINTO PLC | GBP | 512 454 | 503 010 | 0.31 |
| 6 408 | ROBERT HALF INTERNATIONAL INC | USD | 315 618 | 294 076 | 0.18 |
| 9 056 | ROCHE HOLDING AG | CHF | 1 963 680 | 2 637 801 | 1.65 |
| 1 198 | ROCKWELL AUTOMATION INC | USD | 219 358 | 200 130 | 0.12 |
| 2 577 | ROSS STORES INC | USD | 269 118 | 255 201 | 0.16 |
| 4 384 | ROYAL UNIBREW A/S | DKK | 346 663 | 340 843 | 0.21 |
| 1 481 | RUBIS SCA | EUR | 78 978 | 72 273 | 0.04 |
| 2 194 | RWE AG | EUR | 47 225 | 68 365 | 0.04 |
| 1 566 | SAFRAN SA | EUR | 183 925 | 194 341 | 0.12 |
| 3 904 | SANDVIK AB | SEK | 54 673 | 58 068 | 0.04 |
| 3 969 | SANOFI | EUR | 291 393 | 333 118 | 0.21 |
| 5 044 | SAP SE | EUR | 436 146 | 562 709 | 0.35 |
| 1 446 | SARTORIUS STEDIM BIOTECH | EUR | 227 140 | 248 278 | 0.15 |
| 8 858 | SCHNEIDER ELECTRIC SE | EUR | 668 336 | 801 649 | 0.50 |
| 10 528 | SCHRODERS PLC | GBP | 376 266 | 349 403 | 0.22 |
| 2 199 | SCOUT24 AG | EUR | 113 134 | 130 181 | 0.08 |
| 6 773 | SEAGATE TECHNOLOGY PLC | USD | 280 621 | 295 658 | 0.18 |
| 3 648 | SEALED AIR CORP | USD | 120 460 | 100 661 | 0.06 |
| 2 891 | SEB SA | EUR | 385 618 | 344 607 | 0.21 |
| 28 521 | SEGRO PLC | GBP | 262 574 | 272 358 | 0.17 |
| 4 019 | SEMPRA ENERGY | USD | 504 110 | 511 426 | 0.32 |
| 528 | SHERWIN-WILLIAMS CO | USD | 252 861 | 248 390 | 0.15 |
| 1 932 | SIEMENS AG - REG | EUR | 205 297 | 180 062 | 0.11 |
| 15 885 | SIGNIFY NV | EUR | 405 371 | 425 718 | 0.26 |
| 1 132 | SIKA AG | CHF | 172 293 | 182 483 | 0.11 |
| 2 940 | SIMON PROPERTY GROUP INC | USD | 416 563 | 329 423 | 0.20 |
| 23 338 | SKANSKA AB - B | SEK | 425 892 | 457 795 | 0.28 |
| 7 696 | SKF AB - B | SEK | 129 899 | 121 407 | 0.08 |
| 2 018 | SKYWORKS SOLUTIONS INC | USD | 214 092 | 184 044 | 0.11 |
| 8 523 | SMITH & NEPHEW PLC | GBP | 166 371 | 172 353 | 0.11 |
| 3 540 | SMURFIT KAPPA GROUP PLC | EUR | 120 714 | 106 979 | 0.07 |
| 820 | SNAP-ON INC | USD | 120 803 | 108 057 | 0.07 |
| 1 170 | SODEXO SA | EUR | 111 593 | 101 486 | 0.06 |
| 2 110 | SONOVA HOLDING AG | CHF | 427 490 | 456 034 | 0.28 |
| 3 100 | SOPRA GROUPE | EUR | 381 874 | 451 670 | 0.28 |
| 10 453 | SOUTHERN CO | USD | 538 903 | 574 394 | 0.36 |
| 2 077 | SOUTHWEST AIRLINES CO | USD | 93 467 | 87 338 | 0.05 |
| 1 889 | S&P GLOBAL INC | USD | 399 342 | 457 284 | 0.28 |
| 7 243 | SPIE SA | EUR | 136 138 | 124 580 | 0.08 |
| 15 979 | SSE PLC | GBP | 261 206 | 284 108 | 0.18 |
| 16 683 | STANDARD CHARTERED PLC | GBP | 132 483 | 109 144 | 0.07 |
| 19 553 | STMICROELECTRONICS NV | EUR | 401 903 | 477 289 | 0.30 |
| 2 139 | SUNRISE COMMUNICATIONS GROUP AG | CHF | 148 489 | 156 917 | 0.10 |
| 6 882 | SWEDISH MATCH AB | SEK | 344 644 | 361 627 | 0.22 |

# Swiss Life Funds (LUX) Equity Global Long/Short

## Anlagenübersicht (Fortsetzung)

| Nominalwert/ Menge | Bezeichnung | Kurs Währung | Kosten EUR | Marktwert EUR | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| **Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumenten, die an einer amtlichen Börse zugelassen sind oder auf einem anderen geregelten Markt gehandelt werden (Fortsetzung)** | | | | | |
| | **Anteile (Fortsetzung)** | | | | |
| 164 | SWISS LIFE HOLDING AG - REG | CHF | 41 242 | 67 651 | 0.04 |
| 3 732 | SWISS PRIME SITE AG - REG | CHF | 282 367 | 407 159 | 0.25 |
| 1 200 | SWISS RE AG | CHF | 98 769 | 103 426 | 0.06 |
| 1 298 | SWISSCOM AG - REG | CHF | 575 353 | 626 995 | 0.39 |
| 7 376 | SYNCHRONY FINANCIAL | USD | 239 354 | 195 404 | 0.12 |
| 7 246 | SYSCO CORP | USD | 515 067 | 439 661 | 0.27 |
| 3 519 | T ROWE PRICE GROUP INC | USD | 367 010 | 378 057 | 0.23 |
| 14 330 | TAG IMMOBILIEN AG | EUR | 303 225 | 314 400 | 0.20 |
| 1 730 | TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE INC | USD | 181 754 | 169 275 | 0.10 |
| 4 357 | TARGET CORP | USD | 388 091 | 408 549 | 0.25 |
| 45 855 | TATE & LYLE PLC | GBP | 392 591 | 376 246 | 0.23 |
| 196 696 | TAYLOR WIMPEY PLC | GBP | 377 669 | 462 491 | 0.29 |
| 4 977 | TELENET GROUP HOLDING NV | EUR | 207 740 | 171 806 | 0.11 |
| 7 192 | TELENOR ASA | NOK | 127 594 | 103 930 | 0.06 |
| 601 | TELEPERFORMANCE | EUR | 131 379 | 132 100 | 0.08 |
| 39 078 | TESCO PLC | GBP | 103 317 | 103 835 | 0.06 |
| 1 675 | TEXAS INSTRUMENTS INC | USD | 182 438 | 174 049 | 0.11 |
| 13 664 | TGS NOPEC GEOPHYSICAL CO ASA | NOK | 334 493 | 280 523 | 0.17 |
| 4 890 | TJX COS INC | USD | 270 759 | 266 213 | 0.17 |
| 7 258 | TOPDANMARK A/S | DKK | 323 996 | 284 961 | 0.18 |
| 17 568 | TOTAL SA | EUR | 835 838 | 674 260 | 0.42 |
| 9 922 | TRYG A/S | DKK | 225 139 | 248 550 | 0.15 |
| 9 554 | UBS GROUP AG | CHF | 106 134 | 95 248 | 0.06 |
| 4 350 | UCB SA | EUR | 319 093 | 363 486 | 0.23 |
| 872 | ULTA BEAUTY INC | USD | 204 498 | 204 090 | 0.13 |
| 13 132 | UNILEVER NV | EUR | 635 785 | 625 280 | 0.39 |
| 20 954 | UNILEVER PLC | GBP | 1 016 873 | 1 016 083 | 0.63 |
| 6 928 | UNITE GROUP PLC | GBP | 71 335 | 91 278 | 0.06 |
| 1 921 | UNITED PARCEL SERVICE INC - B | USD | 209 219 | 158 251 | 0.10 |
| 6 093 | UNITED UTILITIES GROUP PLC | GBP | 53 072 | 66 899 | 0.04 |
| 1 967 | UNITEDHEALTH GROUP INC | USD | 507 270 | 456 558 | 0.28 |
| 9 241 | UPM-KYMMENE OYJ | EUR | 263 827 | 256 253 | 0.16 |
| 2 889 | VALERO ENERGY CORP | USD | 245 571 | 174 242 | 0.11 |
| 16 047 | VALMET OYJ | EUR | 311 333 | 342 764 | 0.21 |
| 2 019 | VAT GROUP AG | CHF | 294 129 | 246 572 | 0.15 |
| 424 | VERISIGN INC | USD | 61 636 | 73 243 | 0.05 |
| 3 746 | VERIZON COMMUNICATIONS INC | USD | 174 065 | 184 700 | 0.11 |
| 509 | VERTEX PHARMACEUTICALS INC | USD | 102 239 | 103 811 | 0.06 |
| 10 982 | VIACOMCBS INC - B | USD | 407 678 | 246 044 | 0.15 |
| 8 974 | VINCI SA | EUR | 809 635 | 816 454 | 0.51 |
| 1 062 | VISA INC | USD | 159 203 | 175 729 | 0.11 |
| 41 862 | VODAFONE GROUP PLC | GBP | 86 198 | 65 406 | 0.04 |
| 3 744 | VOLVO AB - B | SEK | 50 168 | 52 313 | 0.03 |
| 708 | VULCAN MATERIALS CO | USD | 95 178 | 77 513 | 0.05 |

# Swiss Life Funds (LUX) Equity Global Long/Short

## Anlagenübersicht (Fortsetzung)

| Nominalwert/ Menge | Bezeichnung | Kurs Währung | Kosten EUR | Marktwert EUR | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| **Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumenten, die an einer amtlichen Börse zugelassen sind oder auf einem anderen geregelten Markt gehandelt werden (Fortsetzung)** | | | | | |
| | **Anteile (Fortsetzung)** | | | | |
| 3 200 | WAREHOUSES DE PAUW CVA | EUR | 67 804 | 77 440 | 0.05 |
| 5 434 | WARTSILA OYJ ABP | EUR | 54 449 | 51 101 | 0.03 |
| 1 136 | WASTE MANAGEMENT INC | USD | 92 259 | 114 598 | 0.07 |
| 4 632 | WEC ENERGY GROUP INC | USD | 354 742 | 389 342 | 0.24 |
| 19 233 | WESTERN UNION CO | USD | 350 772 | 392 031 | 0.24 |
| 1 900 | WHIRLPOOL CORP | USD | 262 131 | 221 161 | 0.14 |
| 12 896 | WIENERBERGER AG | EUR | 329 644 | 297 640 | 0.18 |
| 1 149 | WIRECARD AG | EUR | 128 516 | 132 078 | 0.08 |
| 30 236 | WM MORRISON SUPERMARKETS PLC | GBP | 68 067 | 60 212 | 0.04 |
| 2 589 | WOLTERS KLUWER NV | EUR | 137 273 | 171 702 | 0.11 |
| 413 | WW GRAINGER INC | USD | 97 230 | 104 351 | 0.06 |
| 3 704 | XEROX HOLDINGS CORP | USD | 101 297 | 108 579 | 0.07 |
| 1 022 | YUM! BRANDS INC | USD | 102 962 | 83 038 | 0.05 |
| 359 | ZEBRA TECHNOLOGIES CORP - A | USD | 82 639 | 68 950 | 0.04 |
| 1 344 | ZOETIS INC | USD | 139 239 | 163 013 | 0.10 |
| 2 845 | ZURICH INSURANCE GROUP AG | CHF | 821 457 | 992 438 | 0.62 |
| | **Gesamtsumme der Aktien** | | **129 264 303** | **131 824 231** | **81.76** |
| | **Gesamtsumme übertragbarer Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer amtlichen Börse zugelassen sind oder auf einem anderen geregelten Markt gehandelt werden** | | **129 264 303** | **131 824 231** | **81.76** |
| | **Gesamtsumme der Anlagen** | | **129 264 303** | **131 824 231** | **81.76** |

# Swiss Life Funds (LUX) Equity Global Long/Short

## Sektorstruktur und geographische Verteilung der Anlagen

| Sektorstruktur | % |
|---|---|
| Pharmazeutik und Biotechnologie | 7.46 |
| Technologie Hardware und Geräte | 5.19 |
| Finanzdienstleistungen | 5.03 |
| Versicherungen (ohne Lebensversicherung) | 5.02 |
| Software- und Computerdienstleistungen | 4.50 |
| Allgemeiner Einzelhandel | 3.90 |
| Persönliche Güter | 3.80 |
| Bauwirtschaft und Baustoffe | 3.07 |
| Geräte und Dienstleistungen im Gesundheitswesen | 2.89 |
| Lebensmittelhersteller | 2.76 |
| Immobilienbezogene Anlagefonds | 2.76 |
| Haushaltswaren und Heimwerkerbedarf | 2.75 |
| Lebensmittel- und Arzneimittelhandel | 2.44 |
| Industrietechnik | 2.43 |
| Medien | 2.38 |
| Kundenbetreuung | 2.37 |
| Elektrizität | 2.22 |
| Öl- und Gasproduzenten | 2.17 |
| Gas-, Wasser- und Mehrfachversorgungsunternehmen | 1.93 |
| Banken | 1.81 |
| Chemikalien | 1.72 |
| Lebensversicherung | 1.52 |
| Immobilienbezogene Dienstleistungen und Investitionen | 1.42 |
| Festnetz-Telekommunikation | 1.32 |
| Elektronische und elektrische Geräte | 1.31 |
| Luft- und Raumfahrt und Verteidigung | 1.13 |
| Reise, Freizeit und Catering | 1.08 |
| Industrietransport | 0.93 |
| Automobilbau und -teile | 0.75 |
| Allgemeine Industrie | 0.75 |
| Getränke | 0.73 |
| Tabak | 0.56 |
| Mobilfunk | 0.50 |
| Bergbau | 0.31 |
| Freizeitartikel | 0.30 |
| Ölbranche: Maschinen, Dienstleistungen und Vertrieb | 0.30 |
| Forst- und Papierindustrie | 0.16 |
| Anlageinstrumente, die keine Aktien sind | 0.09 |
| | **81.76** |

| Geographische Verteilung | % |
|---|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika | 31.29 |
| Großbritannien | 11.66 |
| Schweiz | 7.82 |
| Frankreich | 6.29 |
| Deutschland | 6.09 |
| Niederlande | 3.34 |
| Irland | 2.31 |
| Schweden | 2.24 |
| Spanien | 2.03 |
| Finnland | 1.85 |
| Italien | 1.79 |
| Dänemark | 1.70 |
| Belgien | 1.13 |
| Jersey Inseln | 0.80 |
| Norwegen | 0.45 |
| Österreich | 0.33 |
| Portugal | 0.26 |
| Luxemburg | 0.15 |
| Südafrika | 0.14 |
| Guernsey | 0.09 |
| | **81.76** |

# Swiss Life Funds (LUX) Equity Global Minimum Volatility

## Anlagenübersicht

| Nominalwert/ Menge | Bezeichnung | Kurs Währung | Kosten USD | Marktwert USD | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| **Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumenten, die an einer amtlichen Börse zugelassen sind oder auf einem anderen geregelten Markt gehandelt werden** | | | | | |
| **Aktien** | | | | | |
| 8 200 | ABC-MART INC | JPY | 466 778 | 468 289 | 0.27 |
| 4 711 | AENA SME SA | EUR | 889 110 | 750 346 | 0.43 |
| 105 460 | AGNC INVESTMENT CORP | USD | 1 816 163 | 1 797 038 | 1.02 |
| 30 827 | AGNICO EAGLE MINES LTD | CAD | 1 249 148 | 1 462 642 | 0.83 |
| 700 | AJINOMOTO CO INC | JPY | 14 142 | 11 759 | 0.01 |
| 2 310 | ALLEGHANY CORP | USD | 1 670 166 | 1 552 898 | 0.88 |
| 27 722 | ALLIANT ENERGY CORP | USD | 1 434 209 | 1 444 871 | 0.82 |
| 15 757 | ALLSTATE CORP | USD | 1 622 522 | 1 658 424 | 0.94 |
| 11 310 | ALSTOM SA | EUR | 489 865 | 552 720 | 0.31 |
| 10 012 | ALTRIA GROUP INC | USD | 440 928 | 404 184 | 0.23 |
| 24 474 | AMEREN CORP | USD | 1 535 132 | 1 933 446 | 1.10 |
| 16 783 | AMERICAN ELECTRIC POWER CO INC | USD | 1 361 168 | 1 498 051 | 0.85 |
| 16 483 | AMERICAN FINANCIAL GROUP INC/OH | USD | 1 665 720 | 1 523 359 | 0.87 |
| 11 858 | AMERICAN WATER WORKS CO INC | USD | 1 535 611 | 1 466 360 | 0.84 |
| 194 619 | ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC | USD | 1 949 814 | 1 724 324 | 0.98 |
| 44 351 | ARCH CAPITAL GROUP LTD | USD | 1 778 488 | 1 793 111 | 1.02 |
| 172 263 | AROUNDTOWN SA | EUR | 1 409 654 | 1 481 232 | 0.84 |
| 18 770 | ARTHUR J GALLAGHER & CO | USD | 1 528 990 | 1 829 887 | 1.04 |
| 9 377 | ASSURANT INC | USD | 1 169 007 | 1 130 772 | 0.64 |
| 115 389 | AUCKLAND INTERNATIONAL AIRPORT LTD | NZD | 708 471 | 563 265 | 0.32 |
| 11 712 | AUSTRALIA & NEW ZEALAND BANKING GROUP LTD | AUD | 194 379 | 187 497 | 0.11 |
| 9 584 | AUTOMATIC DATA PROCESSING INC | USD | 1 594 897 | 1 483 028 | 0.84 |
| 62 475 | BANKINTER SA | EUR | 353 125 | 366 461 | 0.21 |
| 13 331 | BEIERSDORF AG | EUR | 1 529 380 | 1 389 662 | 0.79 |
| 25 857 | BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDING CORP | USD | 1 806 887 | 1 843 604 | 1.05 |
| 21 243 | BOSTON SCIENTIFIC CORP | USD | 885 196 | 794 276 | 0.45 |
| 35 200 | BRIDGESTONE CORP | JPY | 1 351 010 | 1 176 759 | 0.67 |
| 45 047 | BROWN & BROWN INC | USD | 1 723 048 | 1 937 471 | 1.10 |
| 20 196 | CAMPBELL SOUP CO | USD | 854 886 | 911 244 | 0.52 |
| 50 900 | CANON INC | JPY | 1 362 964 | 1 289 900 | 0.73 |
| 7 430 | CBOE GLOBAL MARKETS INC | USD | 881 735 | 847 020 | 0.48 |
| 19 282 | CHURCH & DWIGHT CO INC | USD | 1 352 346 | 1 340 485 | 0.76 |
| 17 269 | CINCINNATI FINANCIAL CORP | USD | 1 935 423 | 1 610 162 | 0.92 |
| 11 976 | CLOROX CO | USD | 1 897 023 | 1 909 214 | 1.09 |
| 8 639 | CME GROUP INC | USD | 1 508 098 | 1 717 606 | 0.98 |
| 29 712 | CMS ENERGY CORP | USD | 1 849 606 | 1 795 199 | 1.02 |
| 24 017 | COLRUYT SA | EUR | 1 379 948 | 1 103 273 | 0.63 |
| 61 471 | COMPASS GROUP PLC | GBP | 1 345 449 | 1 343 076 | 0.77 |
| 12 211 | CONAGRA BRANDS INC | USD | 349 601 | 325 912 | 0.19 |
| 17 373 | CONSOLIDATED EDISON INC | USD | 1 361 030 | 1 369 340 | 0.78 |
| 2 951 | COSTCO WHOLESALE CORP | USD | 871 430 | 829 644 | 0.47 |
| 11 834 | COVIVIO | EUR | 1 249 989 | 1 247 910 | 0.71 |
| 7 110 | DANONE SA | EUR | 637 421 | 497 652 | 0.28 |
| 15 395 | DARDEN RESTAURANTS INC | USD | 1 849 854 | 1 501 013 | 0.86 |

# Swiss Life Funds (LUX) Equity Global Minimum Volatility

## Anlagenübersicht (Fortsetzung)

| Nominalwert/ Menge | Bezeichnung | Kurs Währung | Kosten USD | Marktwert USD | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| **Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumenten, die an einer amtlichen Börse zugelassen sind oder auf einem anderen geregelten Markt gehandelt werden (Fortsetzung)** | | | | | |
| | **Anteile (Fortsetzung)** | | | | |
| 110 377 | DEUTSCHE TELEKOM AG - REG | EUR | 1 891 474 | 1 789 071 | 1.02 |
| 13 662 | DEUTSCHE WOHNEN SE | EUR | 481 060 | 547 156 | 0.31 |
| 34 546 | DIAGEO PLC | GBP | 1 402 099 | 1 220 333 | 0.70 |
| 186 297 | DIRECT LINE INSURANCE GROUP PLC | GBP | 719 366 | 730 552 | 0.42 |
| 4 979 | DOLLAR GENERAL CORP | USD | 701 690 | 748 344 | 0.43 |
| 20 484 | DR HORTON INC | USD | 1 051 141 | 1 091 183 | 0.62 |
| 14 614 | DTE ENERGY CO | USD | 1 619 596 | 1 631 945 | 0.93 |
| 2 314 | EDISON INTERNATIONAL | USD | 165 520 | 155 478 | 0.09 |
| 29 629 | ELISA OYJ | EUR | 1 322 243 | 1 690 438 | 0.96 |
| 39 142 | ENDESA SA | EUR | 1 025 850 | 998 786 | 0.57 |
| 11 870 | ENTERGY CORP | USD | 1 402 797 | 1 387 722 | 0.79 |
| 1 808 | ESSILORLUXOTTICA SA | EUR | 269 682 | 244 476 | 0.14 |
| 29 134 | EVERGY INC | USD | 1 691 546 | 1 903 907 | 1.08 |
| 13 366 | EVERSOURCE ENERGY | USD | 1 088 928 | 1 155 624 | 0.66 |
| 17 924 | FIDELITY NATIONAL FINANCIAL INC - A | USD | 847 626 | 694 734 | 0.40 |
| 9 657 | FIDELITY NATIONAL INFORMATION SERVICES INC | USD | 832 843 | 1 349 276 | 0.77 |
| 24 822 | FIRSTENERGY CORP | USD | 1 163 234 | 1 105 324 | 0.63 |
| 17 153 | FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC | USD | 840 840 | 1 059 198 | 0.60 |
| 18 501 | FRANCO-NEVADA CORP | CAD | 1 196 647 | 1 986 071 | 1.13 |
| 23 503 | GENERAL MILLS INC | USD | 1 276 213 | 1 151 647 | 0.66 |
| 75 644 | GLAXOSMITHKLINE PLC | GBP | 1 623 936 | 1 509 448 | 0.86 |
| 12 219 | HERSHEY CO | USD | 1 338 184 | 1 759 414 | 1.00 |
| 507 000 | HKT TRUST & HKT LTD | HKD | 715 494 | 758 578 | 0.43 |
| 440 | HONG KONG & CHINA GAS CO LTD | HKD | 722 | 847 | 0.00 |
| 40 034 | HORMEL FOODS CORP | USD | 1 570 499 | 1 665 414 | 0.95 |
| 191 800 | JAPAN POST BANK CO LTD | JPY | 1 911 881 | 1 714 135 | 0.98 |
| 193 | JAPAN PRIME REALTY INVESTMENT CORP | JPY | 886 897 | 849 905 | 0.48 |
| 185 | JAPAN REAL ESTATE INVESTMENT CORP | JPY | 1 247 485 | 1 262 318 | 0.72 |
| 516 | JAPAN RETAIL FUND INVESTMENT CORP | JPY | 1 040 808 | 981 148 | 0.56 |
| 13 000 | JM SMUCKER CO | USD | 1 486 788 | 1 338 870 | 0.76 |
| 27 746 | JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL PLC | USD | 1 184 754 | 1 014 671 | 0.58 |
| 19 900 | KDDI CORP | JPY | 487 700 | 564 170 | 0.32 |
| 6 000 | KEIO CORP | JPY | 370 377 | 288 694 | 0.16 |
| 27 577 | KELLOGG CO | USD | 1 796 388 | 1 667 581 | 0.95 |
| 9 631 | KERRY GROUP PLC | EUR | 927 080 | 1 216 605 | 0.69 |
| 11 671 | KIMBERLY-CLARK CORP | USD | 1 597 139 | 1 531 118 | 0.87 |
| 69 947 | KIMCO REALTY CORP | USD | 1 309 212 | 1 213 580 | 0.69 |
| 16 048 | KINDER MORGAN | USD | 324 170 | 307 640 | 0.18 |
| 392 184 | KINROSS GOLD CORP | CAD | 1 247 357 | 1 972 101 | 1.12 |
| 20 796 | KIRKLAND LAKE GOLD LTD | CAD | 990 454 | 670 661 | 0.38 |
| 254 262 | KONINKLIJKE KPN NV | EUR | 759 900 | 614 726 | 0.35 |
| 16 119 | KROGER CO | USD | 387 017 | 453 427 | 0.26 |
| 7 400 | LAWSON INC | JPY | 367 604 | 393 102 | 0.22 |
| 15 626 | LEIDOS HOLDINGS INC | USD | 1 361 995 | 1 604 009 | 0.91 |

# Swiss Life Funds (LUX) Equity Global Minimum Volatility

## Anlagenübersicht (Fortsetzung)

| Nominal wert/ Menge | Bezeichnung | Kurs Währung | Kosten USD | Marktwert USD | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| **Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumenten, die an einer amtlichen Börse zugelassen sind oder auf einem anderen geregelten Markt gehandelt werden (Fortsetzung)** | | | | | |
| | **Anteile (Fortsetzung)** | | | | |
| 29 625 | LENNAR CORP | USD | 1 619 740 | 1 787 573 | 1.02 |
| 1 397 | MARKEL CORP | USD | 1 486 984 | 1 650 695 | 0.94 |
| 15 044 | MARSH & MCLENNAN COS INC | USD | 1 336 905 | 1 573 001 | 0.90 |
| 2 521 | MARTIN MARIETTA MATERIALS INC | USD | 661 650 | 573 603 | 0.33 |
| 6 701 | MCCORMICK & CO INC/MD | USD | 1 057 861 | 979 619 | 0.56 |
| 5 170 | MCDONALD'S CORP | USD | 1 006 702 | 1 003 859 | 0.57 |
| 38 700 | MCDONALD'S HOLDINGS CO JAPAN LTD | JPY | 1 736 824 | 1 625 281 | 0.93 |
| 11 344 | MOTOROLA SOLUTIONS INC | USD | 1 761 277 | 1 879 474 | 1.07 |
| 14 000 | NEC CORP | JPY | 581 509 | 524 359 | 0.30 |
| 8 916 | NESTLE SA | CHF | 764 500 | 910 525 | 0.52 |
| 95 490 | NEWCREST MINING LTD | AUD | 1 693 523 | 1 619 201 | 0.92 |
| 45 649 | NEWMONT CORP | USD | 1 540 189 | 2 037 316 | 1.17 |
| 5 824 | NEXTERA ENERGY INC | USD | 1 373 183 | 1 472 074 | 0.84 |
| 194 | NIPPON BUILDING FUND INC | JPY | 1 427 265 | 1 455 022 | 0.83 |
| 246 | NIPPON PROLOGIS REIT INC | JPY | 643 628 | 667 540 | 0.38 |
| 36 600 | NIPPON TELEGRAPH & TELEPHONE CORP | JPY | 830 745 | 858 292 | 0.49 |
| 67 600 | NTT DOCOMO INC | JPY | 1 651 301 | 1 834 691 | 1.05 |
| 210 | NVR INC | USD | 805 984 | 770 108 | 0.44 |
| 33 953 | OGE ENERGY CORP | USD | 1 473 333 | 1 293 609 | 0.74 |
| 122 873 | ORANGE SA | EUR | 1 851 936 | 1 645 282 | 0.94 |
| 63 779 | ORKLA ASA | NOK | 630 443 | 533 436 | 0.30 |
| 21 601 | PAYCHEX INC - AK9420 | USD | 1 618 921 | 1 673 645 | 0.95 |
| 9 785 | PEPSICO INC | USD | 1 341 524 | 1 291 914 | 0.74 |
| 3 590 | PERNOD RICARD SA | EUR | 615 301 | 577 319 | 0.33 |
| 21 423 | PINNACLE WEST CAPITAL CORP | USD | 1 911 318 | 1 917 144 | 1.09 |
| 60 376 | PROXIMUS SADP | EUR | 1 661 820 | 1 482 916 | 0.84 |
| 8 638 | PUBLIC STORAGE | USD | 1 852 298 | 1 806 379 | 1.03 |
| 33 182 | PULTEGROUP INC | USD | 1 203 502 | 1 333 916 | 0.76 |
| 84 015 | RED ELECTRICA CORP SA | EUR | 1 679 868 | 1 600 705 | 0.91 |
| 9 122 | RENAISSANCERE HOLDINGS LTD | USD | 1 483 671 | 1 554 389 | 0.89 |
| 32 257 | RIO TINTO PLC | GBP | 1 655 420 | 1 486 612 | 0.85 |
| 18 759 | SABRE CORP | USD | 416 075 | 255 404 | 0.15 |
| 39 200 | SANKYO CO LTD | JPY | 1 416 388 | 1 288 314 | 0.73 |
| 8 484 | SEALED AIR CORP | USD | 328 755 | 257 150 | 0.15 |
| 4 999 | SIGNATURE BANK/NEW YORK NY | USD | 649 620 | 625 375 | 0.36 |
| 7 823 | SIMON PROPERTY GROUP INC | USD | 1 169 617 | 962 855 | 0.55 |
| 757 700 | SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS LTD | SGD | 1 705 528 | 1 628 652 | 0.93 |
| 60 618 | SMITH & NEPHEW PLC | GBP | 1 191 759 | 1 346 506 | 0.77 |
| 4 068 | SODEXO SA | EUR | 468 012 | 387 597 | 0.22 |
| 416 838 | SPARK NEW ZEALAND LTD | NZD | 1 194 279 | 1 172 515 | 0.67 |
| 7 985 | STARBUCKS CORP | USD | 691 421 | 626 264 | 0.36 |
| 6 917 | STRYKER CORP | USD | 1 369 428 | 1 318 311 | 0.75 |
| 12 307 | SWISS PRIME SITE AG - REG | CHF | 1 240 166 | 1 474 875 | 0.84 |
| 3 476 | SWISSCOM AG - REG | CHF | 1 584 798 | 1 844 377 | 1.05 |

# Swiss Life Funds (LUX) Equity Global Minimum Volatility

## Anlagenübersicht (Fortsetzung)

| Nominalwert/ Menge | Bezeichnung | Kurs Währung | Kosten USD | Marktwert USD | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| **Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumenten, die an einer amtlichen Börse zugelassen sind oder auf einem anderen geregelten Markt gehandelt werden (Fortsetzung)** | | | | | |
| | **Anteile (Fortsetzung)** | | | | |
| 20 646 | SYSCO CORP | USD | 1 525 904 | 1 376 056 | 0.78 |
| 195 629 | TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDING AG | EUR | 495 795 | 507 352 | 0.29 |
| 44 162 | TELENOR ASA | NOK | 780 935 | 701 006 | 0.40 |
| 11 000 | TOHO CO LTD/TOKYO | JPY | 446 780 | 339 081 | 0.19 |
| 41 691 | TRYG A/S | DKK | 1 247 649 | 1 147 193 | 0.65 |
| 2 500 | TYLER TECHNOLOGIES INC | USD | 698 550 | 783 375 | 0.45 |
| 3 505 | UNITED TECHNOLOGIES CORP | USD | 405 518 | 457 718 | 0.26 |
| 10 925 | VENTAS INC | USD | 615 624 | 587 437 | 0.33 |
| 29 814 | VERIZON COMMUNICATIONS INC | USD | 1 603 244 | 1 614 726 | 0.92 |
| 14 139 | VIACOMCBS INC - B | USD | 583 799 | 347 961 | 0.20 |
| 14 519 | VIVENDI SA | EUR | 399 962 | 367 132 | 0.21 |
| 27 043 | VONOVIA SE | EUR | 1 344 740 | 1 443 088 | 0.82 |
| 5 577 | VULCAN MATERIALS CO | USD | 794 165 | 670 690 | 0.38 |
| 12 803 | WELLTOWER INC | USD | 1 039 220 | 957 920 | 0.55 |
| 17 785 | WESFARMERS LTD | AUD | 463 045 | 466 124 | 0.27 |
| 66 407 | WHEATON PRECIOUS METALS CORP | CAD | 1 501 559 | 1 888 302 | 1.08 |
| 17 390 | WOOLWORTHS GROUP LTD | AUD | 430 910 | 435 029 | 0.25 |
| 26 108 | WR BERKLEY CORP - C | USD | 1 854 015 | 1 752 891 | 1.00 |
| 129 800 | YAMADA DENKI CO LTD | JPY | 613 416 | 624 542 | 0.36 |
| 14 950 | YUM! BRANDS INC | USD | 1 486 628 | 1 334 288 | 0.76 |
| | **Gesamtsumme der Aktien** | | **173 500 476** | **174 267 418** | **99.29** |
| | **Gesamtsumme übertragbarer Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer amtlichen Börse zugelassen sind oder auf einem anderen geregelten Markt gehandelt werden** | | **173 500 476** | **174 267 418** | **99.29** |
| | **Gesamtsumme der Anlagen** | | **173 500 476** | **174 267 418** | **99.29** |

# Swiss Life Funds (LUX) Equity Global Minimum Volatility

## Sektorstruktur und geographische Verteilung der Anlagen

| Sektorstruktur | % |
|---|---|
| Versicherungen (ohne Lebensversicherung) | 10.62 |
| Elektrizität | 8.78 |
| Bergbau | 7.48 |
| Immobilienbezogene Anlagefonds | 7.26 |
| Festnetz-Telekommunikation | 6.98 |
| Lebensmittelhersteller | 6.39 |
| Reise, Freizeit und Catering | 5.50 |
| Immobilienbezogene Dienstleistungen und Investitionen | 4.40 |
| Mobilfunk | 3.68 |
| Haushaltswaren und Heimwerkerbedarf | 3.49 |
| Lebensmittel- und Arzneimittelhandel | 3.15 |
| Gas-, Wasser- und Mehrfachversorgungsunternehmen | 3.14 |
| Software- und Computerdienstleistungen | 3.08 |
| Persönliche Güter | 2.69 |
| Geräte und Dienstleistungen im Gesundheitswesen | 2.11 |
| Technologie Hardware und Geräte | 2.10 |
| Kundenbetreuung | 1.90 |
| Finanzdienstleistungen | 1.86 |
| Allgemeine Industrie | 1.82 |
| Getränke | 1.76 |
| Bauwirtschaft und Baustoffe | 1.75 |
| Banken | 1.65 |
| Lebensversicherung | 1.58 |
| Allgemeiner Einzelhandel | 1.52 |
| Pharmazeutik und Biotechnologie | 0.86 |
| Industrietransport | 0.75 |
| Alternative Energie | 0.74 |
| Automobilbau und -teile | 0.67 |
| Medien | 0.60 |
| Industrietechnik | 0.31 |
| Luft- und Raumfahrt und Verteidigung | 0.26 |
| Tabak | 0.23 |
| Ölbranche: Maschinen, Dienstleistungen und Vertrieb | 0.18 |
| | **99.29** |

| Geographische Verteilung | % |
|---|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika | 57.06 |
| Japan | 10.38 |
| Kanada | 4.55 |
| Großbritannien | 4.35 |
| Deutschland | 3.23 |
| Frankreich | 3.15 |
| Schweiz | 2.41 |
| Spanien | 2.12 |
| Bermuda | 1.91 |
| Australien | 1.54 |
| Belgien | 1.47 |
| Irland | 1.27 |
| Neuseeland | 0.99 |
| Finnland | 0.96 |
| Singapur | 0.93 |
| Luxemburg | 0.84 |
| Norwegen | 0.70 |
| Dänemark | 0.65 |
| HongKong (China) | 0.43 |
| Niederlande | 0.35 |
| | **99.29** |

# Swiss Life Funds (LUX) Equity Global Protect

## Anlagenübersicht

| Nominalwert/ Menge | Bezeichnung | Kurs Währung | Kosten EUR | Marktwert EUR | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| **Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumenten, die an einer amtlichen Börse zugelassen sind oder auf einem anderen geregelten Markt gehandelt werden** | | | | | |
| **Aktien** | | | | | |
| 19 979 | ABB LTD | CHF | 416 493 | 391 030 | 0.13 |
| 13 224 | ABBOTT LABORATORIES | USD | 628 705 | 927 347 | 0.32 |
| 10 652 | ABBVIE INC | USD | 748 749 | 831 156 | 0.28 |
| 447 | ABIOMED INC | USD | 154 517 | 61 146 | 0.02 |
| 4 735 | ACCENTURE PLC - A | USD | 565 861 | 778 455 | 0.27 |
| 6 769 | ACTIVISION BLIZZARD INC | USD | 387 297 | 358 216 | 0.12 |
| 2 048 | ADECCO GROUP AG - REG | CHF | 134 506 | 98 967 | 0.03 |
| 3 968 | ADIDAS AG - REG - REG | EUR | 835 386 | 994 182 | 0.34 |
| 3 696 | ADOBE INC | USD | 561 063 | 1 161 239 | 0.40 |
| 7 897 | ADVANCED MICRO DEVICES INC | USD | 111 510 | 326 966 | 0.11 |
| 10 300 | ADVANTEST CORP | JPY | 179 173 | 427 267 | 0.15 |
| 6 500 | AEON CO LTD | JPY | 114 587 | 110 515 | 0.04 |
| 7 295 | AFLAC INC | USD | 266 774 | 284 574 | 0.10 |
| 3 037 | AGILENT TECHNOLOGIES INC | USD | 169 901 | 213 084 | 0.07 |
| 9 947 | AIR LIQUIDE SA | EUR | 897 507 | 1 222 486 | 0.42 |
| 2 088 | AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC | USD | 270 660 | 417 448 | 0.14 |
| 12 094 | AIRBUS SE | EUR | 1 021 328 | 1 307 361 | 0.45 |
| 6 700 | AJINOMOTO CO INC | JPY | 102 264 | 102 464 | 0.03 |
| 3 925 | ALCON INC | CHF | 119 627 | 217 652 | 0.07 |
| 1 544 | ALCON INC | USD | 83 976 | 86 164 | 0.03 |
| 1 935 | ALEXION PHARMACEUTICALS INC | USD | 231 185 | 165 641 | 0.06 |
| 606 | ALIGN TECHNOLOGY INC | USD | 134 763 | 120 461 | 0.04 |
| 2 733 | ALLERGAN PLC | USD | 467 697 | 474 397 | 0.16 |
| 8 981 | ALLIANZ SE - REG | EUR | 1 684 534 | 1 749 499 | 0.60 |
| 3 347 | ALLSTATE CORP | USD | 263 431 | 320 699 | 0.11 |
| 4 456 | ALPHABET CLASS - A | USD | 3 895 645 | 5 432 834 | 1.85 |
| 6 500 | ALPS ALPINE CO LTD | JPY | 113 123 | 91 012 | 0.03 |
| 14 185 | ALTRIA GROUP INC | USD | 789 264 | 521 324 | 0.18 |
| 9 474 | AMADEUS IT GROUP SA - A | EUR | 616 378 | 601 599 | 0.21 |
| 3 066 | AMAZON.COM INC | USD | 3 201 662 | 5 257 933 | 1.79 |
| 5 187 | AMERICAN AIRLINES GROUP INC | USD | 201 408 | 89 956 | 0.03 |
| 4 719 | AMERICAN ELECTRIC POWER CO INC | USD | 291 651 | 383 466 | 0.13 |
| 5 287 | AMERICAN EXPRESS CO | USD | 410 487 | 529 109 | 0.18 |
| 6 954 | AMERICAN INTERNATIONAL GROUP INC | USD | 343 161 | 266 904 | 0.09 |
| 3 459 | AMERICAN TOWER CORP | USD | 419 516 | 714 189 | 0.24 |
| 4 648 | AMGEN INC | USD | 719 286 | 845 141 | 0.29 |
| 3 145 | AMPHENOL CORP - A | USD | 230 644 | 262 491 | 0.09 |
| 3 494 | ANALOG DEVICES INC | USD | 255 461 | 346 871 | 0.12 |
| 7 200 | ANGLO AMERICAN PLC | GBP | 118 282 | 150 020 | 0.05 |
| 18 478 | ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV | EUR | 1 688 003 | 937 389 | 0.32 |
| 1 953 | ANTHEM INC | USD | 330 147 | 457 096 | 0.16 |
| 1 992 | AON PLC | USD | 244 533 | 377 201 | 0.13 |
| 33 945 | APPLE INC | USD | 4 901 996 | 8 447 543 | 2.87 |
| 7 844 | APPLIED MATERIALS INC | USD | 303 856 | 415 033 | 0.14 |

# Swiss Life Funds (LUX) Equity Global Protect

## Anlagenübersicht (Fortsetzung)

| Nominal wert/ Menge | Bezeichnung | Kurs Währung | Kosten EUR | Marktwert EUR | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| **Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumenten, die an einer amtlichen Börse zugelassen sind oder auf einem anderen geregelten Markt gehandelt werden (Fortsetzung)** | | | | | |
| | **Anteile (Fortsetzung)** | | | | |
| 3 101 | APTIV PLC | USD | 220 732 | 220 510 | 0.08 |
| 7 032 | ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO | USD | 265 873 | 241 026 | 0.08 |
| 5 700 | ASAHI GROUP HOLDINGS LTD | JPY | 203 169 | 199 647 | 0.07 |
| 8 300 | ASAHI KASEI CORP | JPY | 77 625 | 63 095 | 0.02 |
| 3 197 | ASHTEAD GROUP PLC | GBP | 63 658 | 88 815 | 0.03 |
| 9 089 | ASML HOLDING NV | EUR | 1 299 058 | 2 254 981 | 0.77 |
| 2 669 | ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC | GBP | 88 453 | 69 988 | 0.02 |
| 25 900 | ASTELLAS PHARMA INC | JPY | 323 215 | 371 392 | 0.13 |
| 10 034 | ASTRAZENECA PLC | GBP | 545 435 | 792 732 | 0.27 |
| 54 096 | AT&T INC | USD | 1 631 886 | 1 734 500 | 0.59 |
| 7 021 | AUTO TRADER GROUP PLC | GBP | 46 073 | 42 422 | 0.01 |
| 1 916 | AUTODESK INC | USD | 203 830 | 332 947 | 0.11 |
| 3 565 | AUTOMATIC DATA PROCESSING INC | USD | 352 233 | 502 206 | 0.17 |
| 216 | AUTOZONE INC | USD | 101 492 | 203 034 | 0.07 |
| 3 573 | AVALONBAY COMMUNITIES INC | USD | 590 837 | 652 472 | 0.22 |
| 28 483 | AVIVA PLC | GBP | 167 361 | 116 191 | 0.04 |
| 45 260 | AXA SA | EUR | 1 093 798 | 948 423 | 0.32 |
| 23 349 | BAE SYSTEMS PLC | GBP | 157 167 | 165 190 | 0.06 |
| 3 647 | BALL CORP | USD | 162 751 | 233 937 | 0.08 |
| 137 990 | BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA SA | EUR | 963 220 | 598 118 | 0.20 |
| 351 887 | BANCO SANTANDER SA | EUR | 1 837 666 | 1 170 728 | 0.40 |
| 68 199 | BANK OF AMERICA CORP | USD | 1 488 957 | 1 769 467 | 0.60 |
| 7 401 | BANK OF NEW YORK MELLON CORP | USD | 324 532 | 268 833 | 0.09 |
| 129 338 | BARCLAYS PLC | GBP | 273 687 | 223 708 | 0.08 |
| 7 687 | BARRATT DEVELOPMENTS PLC | GBP | 49 218 | 67 685 | 0.02 |
| 20 056 | BASF SE - REG | EUR | 1 693 360 | 1 064 572 | 0.36 |
| 4 303 | BAXTER INTERNATIONAL INC | USD | 237 266 | 326 980 | 0.11 |
| 20 384 | BAYER AG | EUR | 2 016 922 | 1 329 241 | 0.45 |
| 6 991 | BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG | EUR | 577 571 | 411 980 | 0.14 |
| 2 122 | BECTON DICKINSON AND CO | USD | 383 285 | 459 424 | 0.16 |
| 14 277 | BERKSHIRE HATHAWAY INC - B | USD | 2 297 032 | 2 681 884 | 0.92 |
| 2 593 | BEST BUY CO INC | USD | 123 990 | 178 579 | 0.06 |
| 16 157 | BHP GROUP PLC | GBP | 267 119 | 266 493 | 0.09 |
| 1 649 | BIOGEN INC | USD | 450 587 | 462 957 | 0.16 |
| 1 067 | BLACKROCK INC | USD | 409 209 | 449 753 | 0.15 |
| 24 309 | BNP PARIBAS SA | EUR | 1 510 327 | 1 064 370 | 0.36 |
| 3 942 | BOEING CO | USD | 902 013 | 987 285 | 0.34 |
| 342 | BOOKING HOLDINGS INC | USD | 540 342 | 527 940 | 0.18 |
| 1 914 | BOSTON PROPERTIES INC | USD | 196 996 | 224 672 | 0.08 |
| 10 929 | BOSTON SCIENTIFIC CORP | USD | 271 917 | 372 011 | 0.13 |
| 155 761 | BP PLC | GBP | 830 215 | 717 538 | 0.24 |
| 5 700 | BRIDGESTONE CORP | JPY | 192 392 | 173 476 | 0.06 |
| 12 259 | BRISTOL-MYERS SQUIBB CO | USD | 633 846 | 659 126 | 0.22 |
| 18 046 | BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC | GBP | 934 918 | 642 664 | 0.22 |

# Swiss Life Funds (LUX) Equity Global Protect

## Anlagenübersicht (Fortsetzung)

| Nominalwert/ Menge | Bezeichnung | Kurs Währung | Kosten EUR | Marktwert EUR | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| **Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumenten, die an einer amtlichen Börse zugelassen sind oder auf einem anderen geregelten Markt gehandelt werden (Fortsetzung)** | | | | | |
| | **Anteile (Fortsetzung)** | | | | |
| 19 052 | BRITISH LAND CO PLC | GBP | 128 280 | 110 995 | 0.04 |
| 2 951 | BROADCOM INC | USD | 621 151 | 732 397 | 0.25 |
| 61 685 | BT GROUP PLC | GBP | 186 566 | 101 585 | 0.03 |
| 2 597 | BUNZL PLC | GBP | 65 742 | 56 473 | 0.02 |
| 3 110 | BURBERRY GROUP PLC | GBP | 65 048 | 59 636 | 0.02 |
| 9 200 | CANON INC | JPY | 226 289 | 212 249 | 0.07 |
| 4 772 | CAPITAL ONE FINANCIAL CORP | USD | 341 616 | 383 428 | 0.13 |
| 3 378 | CARDINAL HEALTH INC | USD | 199 138 | 160 282 | 0.05 |
| 2 077 | CARMAX INC | USD | 142 974 | 165 090 | 0.06 |
| 4 059 | CARNIVAL CORP | USD | 220 160 | 123 642 | 0.04 |
| 1 238 | CARNIVAL PLC | GBP | 66 618 | 35 055 | 0.01 |
| 7 400 | CASIO COMPUTER CO LTD | JPY | 82 821 | 115 980 | 0.04 |
| 4 496 | CATERPILLAR INC | USD | 509 207 | 508 519 | 0.17 |
| 5 004 | CENTENE CORP | USD | 217 120 | 241 533 | 0.08 |
| 900 | CENTRAL JAPAN RAILWAY CO | JPY | 169 449 | 135 056 | 0.05 |
| 66 231 | CENTRICA PLC | GBP | 140 121 | 55 545 | 0.02 |
| 3 860 | CERNER CORP | USD | 215 707 | 243 418 | 0.08 |
| 10 189 | CHARLES SCHWAB CORP | USD | 373 518 | 377 989 | 0.13 |
| 1 334 | CHARTER COMMUNICATIONS INC | USD | 420 446 | 598 925 | 0.20 |
| 13 767 | CHEVRON CORP | USD | 1 343 243 | 1 169 841 | 0.40 |
| 180 | CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC | USD | 71 741 | 126 764 | 0.04 |
| 3 550 | CHUBB LTD | USD | 438 146 | 468 712 | 0.16 |
| 4 900 | CHUGAI PHARMACEUTICAL CO LTD | JPY | 257 053 | 484 482 | 0.17 |
| 5 691 | CIE FINANCIERE RICHEMONT SA - REG | CHF | 431 392 | 350 051 | 0.12 |
| 2 855 | CIGNA CORP | USD | 336 437 | 475 482 | 0.16 |
| 1 201 | CINTAS CORP | USD | 235 733 | 291 643 | 0.10 |
| 33 647 | CISCO SYSTEMS INC | USD | 1 018 992 | 1 223 110 | 0.42 |
| 18 422 | CITIGROUP INC | USD | 1 101 886 | 1 064 282 | 0.36 |
| 6 929 | CITIZENS FINANCIAL GROUP INC | USD | 213 362 | 199 900 | 0.07 |
| 1 533 | CLOROX CO | USD | 168 067 | 222 487 | 0.08 |
| 2 734 | CME GROUP INC | USD | 322 586 | 494 855 | 0.17 |
| 28 504 | COCA-COLA CO | USD | 1 101 921 | 1 388 028 | 0.47 |
| 1 512 | COCA-COLA HBC AG | EUR | 43 843 | 42 941 | 0.01 |
| 5 783 | COGNIZANT TECHNOLOGY SOLUTIONS CORP - A | USD | 357 580 | 320 778 | 0.11 |
| 7 066 | COLGATE-PALMOLIVE CO | USD | 422 216 | 434 658 | 0.15 |
| 33 480 | COMCAST CORP | USD | 1 103 135 | 1 232 279 | 0.42 |
| 2 874 | COMERICA INC | USD | 191 250 | 137 728 | 0.05 |
| 11 957 | COMPASS GROUP PLC | GBP | 213 654 | 237 833 | 0.08 |
| 6 200 | COMSYS HOLDINGS CORP | JPY | 140 377 | 139 401 | 0.05 |
| 4 824 | CONAGRA BRANDS INC | USD | 123 052 | 117 213 | 0.04 |
| 1 706 | CONCHO RESOURCES INC | USD | 189 402 | 105 642 | 0.04 |
| 9 708 | CONOCOPHILLIPS | USD | 434 759 | 427 932 | 0.15 |
| 3 557 | CONSOLIDATED EDISON INC | USD | 234 733 | 255 235 | 0.09 |
| 1 478 | CONSTELLATION BRANDS INC - A | USD | 258 271 | 231 943 | 0.08 |

# Swiss Life Funds (LUX) Equity Global Protect

## Anlagenübersicht (Fortsetzung)

| Nominalwert/ Menge | Bezeichnung | Kurs Währung | Kosten EUR | Marktwert EUR | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| **Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumenten, die an einer amtlichen Börse zugelassen sind oder auf einem anderen geregelten Markt gehandelt werden (Fortsetzung)** | | | | | |
| | **Anteile (Fortsetzung)** | | | | |
| 7 260 | CORNING INC | USD | 178 070 | 157 698 | 0.05 |
| 5 779 | CORTEVA INC | USD | 199 397 | 143 101 | 0.05 |
| 3 546 | COSTCO WHOLESALE CORP | USD | 540 999 | 907 572 | 0.31 |
| 8 500 | CREDIT SAISON CO LTD | JPY | 96 500 | 112 487 | 0.04 |
| 25 991 | CREDIT SUISSE GROUP AG - REG | CHF | 340 694 | 264 249 | 0.09 |
| 24 423 | CRH PLC | EUR | 652 182 | 744 169 | 0.25 |
| 1 411 | CRODA INTERNATIONAL PLC | GBP | 72 417 | 74 722 | 0.03 |
| 3 438 | CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORP | USD | 310 025 | 448 478 | 0.15 |
| 6 653 | CSX CORP | USD | 279 762 | 426 696 | 0.15 |
| 1 565 | CUMMINS INC | USD | 218 720 | 215 548 | 0.07 |
| 10 156 | CVS HEALTH CORP | USD | 560 597 | 547 164 | 0.19 |
| 5 100 | DAIICHI SANKYO CO LTD | JPY | 152 566 | 283 658 | 0.10 |
| 5 200 | DAIKIN INDUSTRIES LTD | JPY | 495 585 | 646 246 | 0.22 |
| 19 622 | DAIMLER AG | EUR | 1 228 807 | 736 610 | 0.25 |
| 5 800 | DAIWA HOUSE INDUSTRY CO LTD | JPY | 166 274 | 145 851 | 0.05 |
| 4 786 | DANAHER CORP | USD | 363 357 | 629 942 | 0.21 |
| 13 637 | DANONE SA | EUR | 914 206 | 868 950 | 0.30 |
| 1 054 | DCC PLC | GBP | 83 398 | 67 803 | 0.02 |
| 2 828 | DEERE & CO | USD | 337 200 | 402 864 | 0.14 |
| 5 231 | DELTA AIR LINES INC | USD | 234 310 | 219 679 | 0.07 |
| 5 900 | DENSO CORP | JPY | 239 445 | 210 137 | 0.07 |
| 5 300 | DENTSU INC | JPY | 223 027 | 125 785 | 0.04 |
| 20 584 | DEUTSCHE POST AG - REG | EUR | 712 326 | 558 238 | 0.19 |
| 68 156 | DEUTSCHE TELEKOM AG - REG | EUR | 1 010 639 | 1 005 710 | 0.34 |
| 5 909 | DEVON ENERGY CORP | USD | 182 695 | 87 361 | 0.03 |
| 18 179 | DIAGEO PLC | GBP | 522 477 | 584 616 | 0.20 |
| 1 789 | DIAMONDBACK ENERGY INC | USD | 162 188 | 100 977 | 0.03 |
| 2 453 | DIGITAL REALTY TRUST INC | USD | 238 166 | 268 223 | 0.09 |
| 3 309 | DISCOVER FINANCIAL SERVICES | USD | 178 982 | 197 555 | 0.07 |
| 5 442 | DISCOVERY COMMUNICATIONS INC - C | USD | 134 827 | 124 352 | 0.04 |
| 2 494 | DOLLAR GENERAL CORP | USD | 187 037 | 341 252 | 0.12 |
| 2 033 | DOLLAR TREE INC | USD | 139 037 | 153 671 | 0.05 |
| 6 680 | DOMINION ENERGY INC | USD | 427 564 | 475 436 | 0.16 |
| 6 852 | DOW INC | USD | 380 172 | 252 073 | 0.09 |
| 4 214 | DR HORTON INC | USD | 139 701 | 204 360 | 0.07 |
| 5 905 | DUKE ENERGY CORP | USD | 417 826 | 492 957 | 0.17 |
| 5 779 | DUPONT DE NEMOURS INC | USD | 477 532 | 225 699 | 0.08 |
| 3 479 | DXC TECHNOLOGY CO | USD | 225 064 | 76 361 | 0.03 |
| 4 257 | EATON CORP PLC | USD | 273 068 | 351 582 | 0.12 |
| 7 715 | EBAY INC | USD | 232 582 | 243 295 | 0.08 |
| 2 267 | ECOLAB INC | USD | 265 201 | 372 416 | 0.13 |
| 2 757 | EDISON INTERNATIONAL | USD | 138 970 | 168 640 | 0.06 |
| 1 592 | EDWARDS LIFESCIENCES CORP | USD | 168 902 | 296 878 | 0.10 |
| 4 900 | EISAI CO LTD | JPY | 345 681 | 330 060 | 0.11 |

# Swiss Life Funds (LUX) Equity Global Protect

## Anlagenübersicht (Fortsetzung)

| Nominalwert/ Menge | Bezeichnung | Kurs Währung | Kosten EUR | Marktwert EUR | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| **Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumenten, die an einer amtlichen Börse zugelassen sind oder auf einem anderen geregelten Markt gehandelt werden (Fortsetzung)** | | | | | |
| | **Anteile (Fortsetzung)** | | | | |
| 2 576 | ELECTRONIC ARTS INC | USD | 252 414 | 237 725 | 0.08 |
| 6 559 | ELI LILLY & CO | USD | 471 787 | 753 140 | 0.26 |
| 6 202 | EMERSON ELECTRIC CO | USD | 330 987 | 361 974 | 0.12 |
| 165 856 | ENEL SPA | EUR | 845 676 | 1 256 525 | 0.43 |
| 38 302 | ENGIE SA | EUR | 534 943 | 575 679 | 0.20 |
| 53 061 | ENI SPA | EUR | 758 381 | 592 055 | 0.20 |
| 5 000 | EOG RESOURCES INC | USD | 427 883 | 287 951 | 0.10 |
| 695 | EQUINIX INC | USD | 267 516 | 362 416 | 0.12 |
| 8 795 | EQUITY RESIDENTIAL | USD | 541 267 | 601 306 | 0.21 |
| 6 309 | ESSILORLUXOTTICA SA | EUR | 701 048 | 776 638 | 0.26 |
| 1 669 | ESTEE LAUDER COS INC - A | USD | 185 949 | 278 964 | 0.10 |
| 8 920 | EXELON CORP | USD | 296 658 | 350 076 | 0.12 |
| 1 514 | EXPEDIA GROUP INC | USD | 182 404 | 135 929 | 0.05 |
| 6 707 | EXPERIAN PLC | GBP | 118 039 | 202 080 | 0.07 |
| 30 574 | EXXON MOBIL CORP | USD | 2 109 857 | 1 431 769 | 0.49 |
| 17 749 | FACEBOOK INC | USD | 2 558 631 | 3 109 972 | 1.06 |
| 19 000 | FAMILYMART UNY HOLDINGS CO LTD | JPY | 494 929 | 382 616 | 0.13 |
| 5 100 | FANUC CORP | JPY | 741 699 | 773 495 | 0.26 |
| 5 200 | FAST RETAILING CO LTD | JPY | 2 184 394 | 2 345 355 | 0.80 |
| 5 450 | FASTENAL CO | USD | 135 515 | 169 784 | 0.06 |
| 2 207 | FEDEX CORP | USD | 411 355 | 283 638 | 0.10 |
| 1 632 | FERGUSON PLC | GBP | 94 857 | 127 911 | 0.04 |
| 3 063 | FIDELITY NATIONAL INFORMATION SERVICES INC | USD | 248 206 | 389 606 | 0.13 |
| 9 182 | FIFTH THIRD BANCORP | USD | 211 409 | 203 961 | 0.07 |
| 2 401 | FIRST REPUBLIC BANK/CA | USD | 214 724 | 219 827 | 0.08 |
| 6 200 | FIRSTENERGY CORP | USD | 217 182 | 251 341 | 0.09 |
| 3 750 | FISERV INC | USD | 203 993 | 373 344 | 0.13 |
| 893 | FLEETCOR TECHNOLOGIES INC | USD | 210 769 | 216 078 | 0.07 |
| 32 615 | FORD MOTOR CO | USD | 301 178 | 206 655 | 0.07 |
| 3 521 | FORTIVE CORP | USD | 219 379 | 221 687 | 0.08 |
| 5 379 | FOX CORP | USD | 179 812 | 149 111 | 0.05 |
| 8 705 | FRESENIUS SE & CO KGAA | EUR | 591 350 | 369 223 | 0.13 |
| 5 500 | FUJIFILM HOLDINGS CORP | JPY | 201 484 | 244 956 | 0.08 |
| 443 | GEBERIT AG - REG | CHF | 170 152 | 199 574 | 0.07 |
| 2 507 | GENERAL DYNAMICS CORP | USD | 372 471 | 364 462 | 0.12 |
| 66 693 | GENERAL ELECTRIC CO | USD | 1 109 902 | 660 585 | 0.23 |
| 5 097 | GENERAL MILLS INC | USD | 227 682 | 227 369 | 0.08 |
| 11 171 | GENERAL MOTORS CO | USD | 369 745 | 310 178 | 0.11 |
| 9 491 | GILEAD SCIENCES INC | USD | 643 120 | 599 295 | 0.20 |
| 94 | GIVAUDAN SA - REG | CHF | 171 636 | 265 755 | 0.09 |
| 38 566 | GLAXOSMITHKLINE PLC | GBP | 632 703 | 700 597 | 0.24 |
| 87 816 | GLENCORE PLC | GBP | 321 343 | 197 352 | 0.07 |
| 2 745 | GOLDMAN SACHS GROUP INC | USD | 526 069 | 501 719 | 0.17 |
| 11 106 | HALLIBURTON CO | USD | 384 610 | 171 476 | 0.06 |

# Swiss Life Funds (LUX) Equity Global Protect

## Anlagenübersicht (Fortsetzung)

| Nominal wert/ Menge | Bezeichnung | Kurs Währung | Kosten EUR | Marktwert EUR | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| **Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumenten, die an einer amtlichen Börse zugelassen sind oder auf einem anderen geregelten Markt gehandelt werden (Fortsetzung)** | | | | | |
| | **Anteile (Fortsetzung)** | | | | |
| 2 881 | HALMA PLC | GBP | 57 803 | 64 625 | 0.02 |
| 1 992 | HARGREAVES LANSDOWN PLC | GBP | 50 010 | 35 592 | 0.01 |
| 1 711 | HASBRO INC | USD | 147 675 | 120 328 | 0.04 |
| 2 028 | HCA HEALTHCARE INC | USD | 132 335 | 234 491 | 0.08 |
| 14 689 | HEWLETT PACKARD ENTERPRISE CO | USD | 182 896 | 171 034 | 0.06 |
| 3 236 | HILTON WORLDWIDE HOLDINGS INC | USD | 225 155 | 286 348 | 0.10 |
| 6 600 | HITACHI CONSTRUCTION MACHINERY CO LTD | JPY | 138 245 | 148 339 | 0.05 |
| 800 | HITACHI LTD | JPY | 21 821 | 24 557 | 0.01 |
| 8 550 | HOME DEPOT INC | USD | 1 237 962 | 1 695 600 | 0.58 |
| 12 600 | HONDA MOTOR CO LTD | JPY | 327 658 | 297 708 | 0.10 |
| 5 695 | HONEYWELL INTERNATIONAL INC | USD | 659 153 | 840 783 | 0.29 |
| 13 271 | HP INC | USD | 227 118 | 251 176 | 0.09 |
| 155 213 | HSBC HOLDINGS PLC | GBP | 1 254 659 | 945 591 | 0.32 |
| 1 160 | HUMANA INC | USD | 261 644 | 337 593 | 0.12 |
| 18 518 | HUNTINGTON BANCSHARES INC/OH | USD | 219 005 | 206 851 | 0.07 |
| 128 018 | IBERDROLA SA | EUR | 905 087 | 1 321 146 | 0.45 |
| 2 900 | IDEMITSU KOSAN CO LTD | JPY | 76 462 | 65 057 | 0.02 |
| 972 | IDEXX LABORATORIES INC | USD | 142 404 | 225 212 | 0.08 |
| 6 085 | IHS MARKIT LTD | USD | 278 548 | 394 643 | 0.13 |
| 2 938 | ILLINOIS TOOL WORKS INC | USD | 357 527 | 448 757 | 0.15 |
| 1 180 | ILLUMINA INC | USD | 233 533 | 285 394 | 0.10 |
| 7 178 | IMPERIAL BRANDS PLC | GBP | 249 705 | 129 779 | 0.04 |
| 22 909 | INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL SA | EUR | 692 112 | 644 430 | 0.22 |
| 9 566 | INFORMA PLC | GBP | 83 364 | 75 910 | 0.03 |
| 83 669 | ING GROEP NV | EUR | 1 191 125 | 720 306 | 0.25 |
| 2 470 | INGERSOLL-RAND PLC | USD | 178 859 | 290 162 | 0.10 |
| 33 256 | INTEL CORP | USD | 1 120 308 | 1 680 890 | 0.57 |
| 4 684 | INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC | USD | 272 030 | 380 451 | 0.13 |
| 1 384 | INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC | GBP | 75 299 | 69 236 | 0.02 |
| 6 774 | INTERNATIONAL BUSINESS MACHINES CORP | USD | 845 117 | 802 618 | 0.27 |
| 10 604 | INTERNATIONAL CONSOLIDATED AIRLINES GROUP SA | EUR | 66 890 | 58 364 | 0.02 |
| 4 825 | INTERNATIONAL PAPER CO | USD | 215 720 | 162 349 | 0.06 |
| 1 243 | INTERTEK GROUP PLC | GBP | 72 674 | 76 174 | 0.03 |
| 353 838 | INTESA SANPAOLO SPA | EUR | 923 355 | 777 913 | 0.27 |
| 2 188 | INTUIT INC | USD | 302 165 | 529 546 | 0.18 |
| 934 | INTUITIVE SURGICAL INC | USD | 313 575 | 454 020 | 0.15 |
| 1 479 | IQVIA HOLDINGS INC | USD | 165 632 | 187 815 | 0.06 |
| 8 300 | ITOCHU CORP | JPY | 131 927 | 172 432 | 0.06 |
| 6 100 | JAPAN TOBACCO INC | JPY | 135 536 | 110 381 | 0.04 |
| 6 800 | JGC CORP | JPY | 90 331 | 76 044 | 0.03 |
| 19 432 | JOHNSON & JOHNSON | USD | 2 192 413 | 2 379 002 | 0.81 |
| 8 965 | JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL PLC | USD | 296 599 | 298 466 | 0.10 |
| 1 465 | JOHNSON MATTHEY PLC | GBP | 51 099 | 42 777 | 0.01 |
| 24 750 | JPMORGAN CHASE & CO | USD | 2 058 347 | 2 616 160 | 0.89 |

# Swiss Life Funds (LUX) Equity Global Protect

## Anlagenübersicht (Fortsetzung)

| Nominalwert/ Menge | Bezeichnung | Kurs Währung | Kosten EUR | Marktwert EUR | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| **Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumenten, die an einer amtlichen Börse zugelassen sind oder auf einem anderen geregelten Markt gehandelt werden (Fortsetzung)** | | | | | |
| | **Anteile (Fortsetzung)** | | | | |
| 8 800 | JTEKT CORP | JPY | 96 861 | 78 208 | 0.03 |
| 5 000 | KAO CORP | JPY | 300 357 | 332 027 | 0.11 |
| 29 900 | KDDI CORP | JPY | 651 838 | 771 699 | 0.26 |
| 4 700 | KEISEI ELECTRIC RAILWAY CO LTD | JPY | 131 411 | 137 052 | 0.05 |
| 3 415 | KELLOGG CO | USD | 174 131 | 187 997 | 0.06 |
| 1 625 | KERING SA | EUR | 670 638 | 821 925 | 0.28 |
| 13 750 | KEYCORP | USD | 204 742 | 204 663 | 0.07 |
| 5 000 | KIKKOMAN CORP | JPY | 234 943 | 211 420 | 0.07 |
| 2 968 | KIMBERLY-CLARK CORP | USD | 299 958 | 354 474 | 0.12 |
| 16 175 | KINDER MORGAN | USD | 243 064 | 282 284 | 0.10 |
| 24 752 | KINGFISHER PLC | GBP | 83 266 | 54 501 | 0.02 |
| 5 600 | KIRIN HOLDINGS CO LTD | JPY | 113 365 | 98 072 | 0.03 |
| 6 500 | KOMATSU LTD | JPY | 143 090 | 119 731 | 0.04 |
| 5 000 | KONAMI HOLDINGS CORP | JPY | 204 368 | 164 368 | 0.06 |
| 482 | KONDOOR BRANDS INC | USD | 10 816 | 14 805 | 0.01 |
| 25 155 | KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV | EUR | 582 967 | 532 783 | 0.18 |
| 20 168 | KONINKLIJKE PHILIPS NV | EUR | 696 252 | 780 905 | 0.27 |
| 6 742 | KRAFT HEINZ CO | USD | 363 538 | 152 032 | 0.05 |
| 7 944 | KROGER CO | USD | 147 190 | 203 436 | 0.07 |
| 7 700 | KUBOTA CORP | JPY | 106 127 | 98 976 | 0.03 |
| 8 200 | KURARAY CO LTD | JPY | 111 501 | 77 789 | 0.03 |
| 10 300 | KYOCERA CORP | JPY | 493 761 | 590 785 | 0.20 |
| 5 600 | KYOWA HAKKO KIRIN CO LTD | JPY | 94 531 | 121 468 | 0.04 |
| 5 694 | LAFARGEHOLCIM LTD - REG | CHF | 261 870 | 239 435 | 0.08 |
| 1 514 | LAM RESEARCH CORP | USD | 220 636 | 404 436 | 0.14 |
| 13 951 | LAND SECURITIES GROUP PLC | GBP | 147 411 | 135 397 | 0.05 |
| 42 655 | LEGAL & GENERAL GROUP PLC | GBP | 126 068 | 128 964 | 0.04 |
| 3 415 | LENNAR CORP | USD | 175 593 | 187 593 | 0.06 |
| 4 243 | LINDE PLC | EUR | 535 441 | 728 735 | 0.25 |
| 554 789 | LLOYDS BANKING GROUP PLC | GBP | 393 387 | 323 861 | 0.11 |
| 2 240 | LONDON STOCK EXCHANGE GROUP PLC | GBP | 94 495 | 197 340 | 0.07 |
| 861 | LONZA GROUP AG - REG | CHF | 186 118 | 309 660 | 0.11 |
| 5 243 | L'OREAL SA | EUR | 980 728 | 1 263 563 | 0.43 |
| 6 137 | LOWE'S COS INC | USD | 442 973 | 595 403 | 0.20 |
| 5 677 | LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE | EUR | 1 392 067 | 2 105 315 | 0.72 |
| 3 003 | LYONDELLBASELL INDUSTRIES NV - A | USD | 238 685 | 195 361 | 0.07 |
| 1 028 | L3HARRIS TECHNOLOGIES INC | USD | 128 442 | 185 048 | 0.06 |
| 6 049 | MARATHON PETROLEUM CORP | USD | 334 962 | 261 135 | 0.09 |
| 2 548 | MARRIOTT INTERNATIONAL INC/MD - A | USD | 243 167 | 287 634 | 0.10 |
| 4 159 | MARSH & MCLENNAN COS INC | USD | 282 136 | 395 890 | 0.14 |
| 6 600 | MARUI GROUP CO LTD | JPY | 119 164 | 117 312 | 0.04 |
| 6 707 | MASTERCARD INC | USD | 885 481 | 1 772 231 | 0.60 |
| 1 302 | MCCORMICK & CO INC/MD | USD | 159 046 | 173 280 | 0.06 |
| 5 698 | MCDONALD'S CORP | USD | 761 546 | 1 007 220 | 0.34 |

# Swiss Life Funds (LUX) Equity Global Protect

## Anlagenübersicht (Fortsetzung)

| Nominalwert/ Menge | Bezeichnung | Kurs Währung | Kosten EUR | Marktwert EUR | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| **Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumenten, die an einer amtlichen Börse zugelassen sind oder auf einem anderen geregelten Markt gehandelt werden (Fortsetzung)** | | | | | |
| | **Anteile (Fortsetzung)** | | | | |
| 1 668 | MCKESSON CORP | USD | 221 228 | 212 378 | 0.07 |
| 10 043 | MEDTRONIC PLC | USD | 711 191 | 920 414 | 0.31 |
| 30 650 | MELROSE INDUSTRIES PLC | GBP | 65 510 | 74 634 | 0.03 |
| 18 967 | MERCK & CO INC | USD | 1 008 375 | 1 321 966 | 0.45 |
| 7 835 | METLIFE INC | USD | 319 975 | 304 712 | 0.10 |
| 20 117 | M&G PLC | GBP | 57 309 | 46 506 | 0.02 |
| 2 599 | MICRO FOCUS INTERNATIONAL PLC | GBP | 34 046 | 22 386 | 0.01 |
| 2 146 | MICROCHIP TECHNOLOGY INC | USD | 140 238 | 177 217 | 0.06 |
| 9 930 | MICRON TECHNOLOGY INC | USD | 335 627 | 475 143 | 0.16 |
| 56 513 | MICROSOFT CORP | USD | 4 023 935 | 8 335 081 | 2.83 |
| 7 500 | MINEBEA MITSUMI INC | JPY | 98 845 | 120 522 | 0.04 |
| 7 300 | MITSUBISHI CORP | JPY | 182 433 | 165 735 | 0.06 |
| 4 600 | MITSUBISHI LOGISTICS CORP | JPY | 103 632 | 96 710 | 0.03 |
| 25 500 | MITSUBISHI UFJ FINANCIAL GROUP INC | JPY | 118 036 | 114 475 | 0.04 |
| 10 400 | MITSUI & CO LTD | JPY | 148 236 | 156 547 | 0.05 |
| 6 400 | MITSUI FUDOSAN CO LTD | JPY | 136 074 | 133 824 | 0.05 |
| 12 455 | MONDELEZ INTERNATIONAL INC | USD | 435 629 | 598 684 | 0.20 |
| 4 236 | MONDI PLC | GBP | 97 041 | 76 942 | 0.03 |
| 3 867 | MONSTER BEVERAGE CORP | USD | 184 249 | 219 709 | 0.07 |
| 1 522 | MOODY'S CORP | USD | 201 529 | 332 583 | 0.11 |
| 11 471 | MORGAN STANLEY | USD | 450 330 | 470 244 | 0.16 |
| 2 174 | MOTOROLA SOLUTIONS INC | USD | 170 609 | 327 906 | 0.11 |
| 1 742 | M&T BANK CORP | USD | 247 822 | 222 625 | 0.08 |
| 3 264 | MUENCHENER RUECKVERSICHERUNGS-GESELLSCHAFT AG IN MUENCHEN - REG | EUR | 607 420 | 753 005 | 0.26 |
| 26 024 | NATIONAL GRID PLC | GBP | 270 956 | 297 417 | 0.10 |
| 17 932 | NESTLE SA | CHF | 1 266 125 | 1 667 132 | 0.57 |
| 2 868 | NETAPP INC | USD | 148 970 | 121 984 | 0.04 |
| 3 254 | NETFLIX INC | USD | 604 806 | 1 093 198 | 0.37 |
| 7 326 | NEWMONT CORP | USD | 214 557 | 297 655 | 0.10 |
| 1 014 | NEXT PLC | GBP | 57 063 | 71 715 | 0.02 |
| 3 788 | NEXTERA ENERGY INC | USD | 487 428 | 871 642 | 0.30 |
| 10 700 | NGK INSULATORS LTD | JPY | 140 588 | 153 251 | 0.05 |
| 3 200 | NH FOODS LTD | JPY | 117 021 | 109 922 | 0.04 |
| 2 900 | NICHIREI CORP | JPY | 71 050 | 67 382 | 0.02 |
| 9 960 | NIKE INC - B | USD | 509 049 | 810 437 | 0.28 |
| 7 300 | NIKON CORP | JPY | 100 614 | 68 327 | 0.02 |
| 8 400 | NIPPON KAYAKU CO LTD | JPY | 94 148 | 84 649 | 0.03 |
| 5 300 | NISSAN CHEMICAL CORP | JPY | 249 039 | 204 200 | 0.07 |
| 6 200 | NISSHIN SEIFUN GROUP INC | JPY | 111 244 | 95 550 | 0.03 |
| 5 500 | NITTO DENKO CORP | JPY | 257 641 | 251 594 | 0.09 |
| 122 835 | NOKIA OYJ | EUR | 606 151 | 423 167 | 0.14 |
| 2 314 | NORFOLK SOUTHERN CORP | USD | 262 449 | 384 139 | 0.13 |
| 2 481 | NORTHERN TRUST CORP | USD | 196 077 | 198 218 | 0.07 |

# Swiss Life Funds (LUX) Equity Global Protect

## Anlagenübersicht (Fortsetzung)

| Nominalwert/ Menge | Bezeichnung | Kurs Währung | Kosten EUR | Marktwert EUR | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| **Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumenten, die an einer amtlichen Börse zugelassen sind oder auf einem anderen geregelten Markt gehandelt werden (Fortsetzung)** | | | | | |
| | **Anteile (Fortsetzung)** | | | | |
| 18 432 | NOVARTIS AG - REG | CHF | 1 190 851 | 1 408 512 | 0.48 |
| 27 700 | NTT DATA CORP | JPY | 279 043 | 301 818 | 0.10 |
| 4 311 | NUCOR CORP | USD | 212 166 | 162 283 | 0.06 |
| 4 707 | NVIDIA CORP | USD | 781 282 | 1 157 285 | 0.39 |
| 3 496 | OCADO GROUP PLC | GBP | 50 930 | 43 255 | 0.01 |
| 5 840 | OCCIDENTAL PETROLEUM CORP | USD | 330 411 | 174 065 | 0.06 |
| 1 800 | OKUMA CORP | JPY | 78 786 | 69 579 | 0.02 |
| 20 500 | OLYMPUS CORP | JPY | 188 241 | 339 463 | 0.12 |
| 2 237 | OMNICOM GROUP INC | USD | 146 464 | 141 089 | 0.05 |
| 5 500 | OMRON CORP | JPY | 245 202 | 271 091 | 0.09 |
| 3 838 | ONEOK INC | USD | 189 876 | 233 121 | 0.08 |
| 18 757 | ORACLE CORP | USD | 789 736 | 844 573 | 0.29 |
| 43 660 | ORANGE SA | EUR | 613 009 | 532 215 | 0.18 |
| 660 | O'REILLY AUTOMOTIVE INC | USD | 112 099 | 221 544 | 0.08 |
| 5 100 | OTSUKA HOLDINGS CO LTD | JPY | 186 010 | 175 618 | 0.06 |
| 3 966 | PACCAR INC | USD | 228 246 | 241 545 | 0.08 |
| 1 489 | PARKER-HANNIFIN CORP | USD | 209 295 | 250 464 | 0.09 |
| 3 603 | PAYCHEX INC - AK9420 | USD | 270 546 | 254 140 | 0.09 |
| 8 865 | PAYPAL HOLDINGS INC | USD | 532 753 | 871 529 | 0.30 |
| 4 733 | PEARSON PLC | GBP | 36 636 | 30 689 | 0.01 |
| 10 463 | PEPSICO INC | USD | 1 034 372 | 1 257 617 | 0.43 |
| 2 392 | PERSIMMON PLC | GBP | 65 363 | 78 968 | 0.03 |
| 40 630 | PFIZER INC | USD | 1 254 903 | 1 236 155 | 0.42 |
| 11 589 | PHILIP MORRIS INTERNATIONAL INC | USD | 1 053 564 | 863 755 | 0.29 |
| 3 808 | PHILLIPS 66 | USD | 299 514 | 259 517 | 0.09 |
| 1 708 | PIONEER NATURAL RESOURCES CO | USD | 213 680 | 190 913 | 0.07 |
| 4 055 | PNC FINANCIAL SERVICES GROUP INC | USD | 453 414 | 466 614 | 0.16 |
| 2 363 | PPG INDUSTRIES INC | USD | 212 767 | 224 694 | 0.08 |
| 8 215 | PPL CORP | USD | 211 842 | 224 436 | 0.08 |
| 17 550 | PROCTER & GAMBLE CO | USD | 1 320 410 | 1 809 082 | 0.62 |
| 4 617 | PROGRESSIVE CORP | USD | 196 321 | 307 506 | 0.10 |
| 11 398 | PROLOGIS INC | USD | 696 221 | 874 526 | 0.30 |
| 4 113 | PRUDENTIAL FINANCIAL INC | USD | 365 094 | 282 512 | 0.10 |
| 20 117 | PRUDENTIAL PLC | GBP | 344 768 | 296 392 | 0.10 |
| 4 980 | PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GROUP INC | USD | 201 697 | 232 622 | 0.08 |
| 2 939 | PUBLIC STORAGE | USD | 557 166 | 559 519 | 0.19 |
| 9 360 | QUALCOMM INC | USD | 444 451 | 667 202 | 0.23 |
| 6 400 | RAKUTEN INC | JPY | 56 648 | 48 776 | 0.02 |
| 2 244 | RAYTHEON CO | USD | 358 937 | 385 205 | 0.13 |
| 8 252 | REALTY INCOME CORP | USD | 488 549 | 543 823 | 0.19 |
| 4 959 | RECKITT BENCKISER GROUP PLC | GBP | 379 610 | 329 908 | 0.11 |
| 15 400 | RECRUIT HOLDINGS CO LTD | JPY | 352 705 | 488 446 | 0.17 |
| 588 | REGENERON PHARMACEUTICALS INC | USD | 219 122 | 237 978 | 0.08 |
| 15 667 | REGIONS FINANCIAL CORP | USD | 237 325 | 192 833 | 0.07 |

# Swiss Life Funds (LUX) Equity Global Protect

## Anlagenübersicht (Fortsetzung)

| Nominalwert/ Menge | Bezeichnung | Kurs Währung | Kosten EUR | Marktwert EUR | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| **Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumenten, die an einer amtlichen Börse zugelassen sind oder auf einem anderen geregelten Markt gehandelt werden (Fortsetzung)** | | | | | |
| | **Anteile (Fortsetzung)** | | | | |
| 14 743 | RELX PLC | GBP | 268 266 | 320 165 | 0.11 |
| 14 069 | RENTOKIL INITIAL PLC | GBP | 49 974 | 79 184 | 0.03 |
| 6 862 | RIGHTMOVE PLC | GBP | 43 409 | 49 393 | 0.02 |
| 8 409 | RIO TINTO PLC | GBP | 346 638 | 352 807 | 0.12 |
| 6 196 | ROCHE HOLDING AG | CHF | 1 299 358 | 1 804 751 | 0.62 |
| 1 585 | ROCKWELL AUTOMATION INC | USD | 228 781 | 264 780 | 0.09 |
| 12 118 | ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC | GBP | 123 169 | 87 367 | 0.03 |
| 1 120 | ROPER TECHNOLOGIES INC | USD | 227 677 | 358 600 | 0.12 |
| 3 071 | ROSS STORES INC | USD | 174 081 | 304 123 | 0.10 |
| 30 712 | ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP PLC | GBP | 84 294 | 63 803 | 0.02 |
| 1 763 | ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD | USD | 175 479 | 129 057 | 0.04 |
| 34 183 | ROYAL DUTCH SHELL PLC - A | EUR | 862 338 | 663 492 | 0.23 |
| 28 731 | ROYAL DUTCH SHELL PLC - B | GBP | 734 158 | 555 810 | 0.19 |
| 12 019 | RSA INSURANCE GROUP PLC | GBP | 86 829 | 72 510 | 0.02 |
| 7 637 | SAFRAN SA | EUR | 692 690 | 947 752 | 0.32 |
| 8 324 | SAGE GROUP PLC | GBP | 61 590 | 65 996 | 0.02 |
| 5 794 | SALESFORCE.COM INC | USD | 551 085 | 898 810 | 0.31 |
| 23 828 | SANOFI | EUR | 1 896 256 | 1 999 884 | 0.68 |
| 22 988 | SAP SE | EUR | 2 125 984 | 2 564 540 | 0.87 |
| 1 237 | SBA COMMUNICATIONS CORP | USD | 159 708 | 298 526 | 0.10 |
| 13 912 | SCHLUMBERGER LTD | USD | 741 210 | 343 098 | 0.12 |
| 11 643 | SCHNEIDER ELECTRIC SE | EUR | 800 505 | 1 053 692 | 0.36 |
| 1 600 | SCREEN HOLDINGS CO LTD | JPY | 63 917 | 73 866 | 0.03 |
| 5 200 | SECOM CO LTD | JPY | 385 589 | 376 337 | 0.13 |
| 20 230 | SEGRO PLC | GBP | 144 715 | 193 184 | 0.07 |
| 11 900 | SEIKO EPSON CORP | JPY | 157 887 | 153 465 | 0.05 |
| 9 300 | SEKISUI HOUSE LTD | JPY | 123 353 | 166 166 | 0.06 |
| 2 619 | SEMPRA ENERGY | USD | 256 729 | 333 273 | 0.11 |
| 5 400 | SEVEN & I HOLDINGS CO LTD | JPY | 207 162 | 168 448 | 0.06 |
| 1 817 | SEVERN TRENT PLC | GBP | 41 479 | 52 083 | 0.02 |
| 62 | SGS SA - REG | CHF | 125 644 | 139 832 | 0.05 |
| 782 | SHERWIN-WILLIAMS CO | USD | 255 275 | 367 881 | 0.13 |
| 5 200 | SHIN-ETSU CHEMICAL CO LTD | JPY | 359 231 | 533 016 | 0.18 |
| 5 000 | SHIONOGI & CO LTD | JPY | 265 357 | 246 657 | 0.08 |
| 5 200 | SHISEIDO CO LTD | JPY | 252 374 | 281 671 | 0.10 |
| 12 900 | SHIZUOKA BANK LTD | JPY | 92 999 | 74 253 | 0.03 |
| 17 295 | SIEMENS AG - REG | EUR | 1 944 425 | 1 611 894 | 0.55 |
| 1 531 | SIKA AG | CHF | 162 004 | 246 803 | 0.08 |
| 5 383 | SIMON PROPERTY GROUP INC | USD | 791 758 | 603 159 | 0.21 |
| 6 150 | SMITH & NEPHEW PLC | GBP | 90 787 | 124 366 | 0.04 |
| 4 555 | SMITHS GROUP PLC | GBP | 88 784 | 81 200 | 0.03 |
| 2 747 | SMURFIT KAPPA GROUP PLC | EUR | 80 392 | 83 014 | 0.03 |
| 17 557 | SOCIETE GENERALE SA | EUR | 779 149 | 449 284 | 0.15 |
| 35 600 | SOFTBANK GROUP CORP | JPY | 1 205 193 | 1 506 214 | 0.51 |

# Swiss Life Funds (LUX) Equity Global Protect

## Anlagenübersicht (Fortsetzung)

| Nominalwert/ Menge | Bezeichnung | Kurs Währung | Kosten EUR | Marktwert EUR | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| **Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumenten, die an einer amtlichen Börse zugelassen sind oder auf einem anderen geregelten Markt gehandelt werden (Fortsetzung)** | | | | | |
| | **Anteile (Fortsetzung)** | | | | |
| 5 200 | SONY CORP | JPY | 223 798 | 290 141 | 0.10 |
| 8 805 | SOUTHERN CO | USD | 359 150 | 483 836 | 0.17 |
| 5 075 | SOUTHWEST AIRLINES CO | USD | 250 125 | 213 405 | 0.07 |
| 2 130 | S&P GLOBAL INC | USD | 301 117 | 515 625 | 0.18 |
| 559 | SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC | GBP | 54 193 | 54 571 | 0.02 |
| 7 161 | SSE PLC | GBP | 110 128 | 127 323 | 0.04 |
| 6 122 | ST JAMES'S PLACE PLC | GBP | 79 280 | 72 294 | 0.02 |
| 19 422 | STANDARD CHARTERED PLC | GBP | 165 414 | 127 063 | 0.04 |
| 27 592 | STANDARD LIFE ABERDEEN PLC | GBP | 135 635 | 88 685 | 0.03 |
| 1 581 | STANLEY BLACK & DECKER INC | USD | 195 359 | 206 828 | 0.07 |
| 9 181 | STARBUCKS CORP | USD | 433 068 | 655 529 | 0.22 |
| 3 882 | STATE STREET CORP | USD | 288 299 | 240 706 | 0.08 |
| 2 413 | STRYKER CORP | USD | 307 416 | 418 675 | 0.14 |
| 6 300 | SUBARU CORP | JPY | 125 178 | 139 283 | 0.05 |
| 300 | SUMITOMO CHEMICAL CO LTD | JPY | 1 386 | 995 | 0.00 |
| 12 400 | SUMITOMO CORP | JPY | 165 918 | 161 640 | 0.06 |
| 5 400 | SUMITOMO DAINIPPON PHARMA CO LTD | JPY | 104 043 | 71 144 | 0.02 |
| 4 800 | SUMITOMO METAL MINING CO LTD | JPY | 119 493 | 108 794 | 0.04 |
| 6 000 | SUMITOMO REALTY & DEVELOPMENT CO LTD | JPY | 199 718 | 170 757 | 0.06 |
| 5 200 | SUZUKI MOTOR CORP | JPY | 243 587 | 190 341 | 0.06 |
| 593 | SVB FINANCIAL GROUP | USD | 152 757 | 112 376 | 0.04 |
| 367 | SWATCH GROUP AG | CHF | 123 773 | 76 593 | 0.03 |
| 185 | SWISS LIFE HOLDING AG - REG | CHF | 43 931 | 76 314 | 0.03 |
| 3 328 | SWISS RE AG | CHF | 275 894 | 286 836 | 0.10 |
| 302 | SWISSCOM AG - REG | CHF | 129 301 | 145 880 | 0.05 |
| 7 256 | SYNCHRONY FINANCIAL | USD | 186 295 | 192 225 | 0.07 |
| 5 524 | SYSCO CORP | USD | 290 691 | 335 176 | 0.11 |
| 2 691 | T ROWE PRICE GROUP INC | USD | 208 479 | 289 103 | 0.10 |
| 6 100 | TAIYO YUDEN CO LTD | JPY | 77 744 | 155 480 | 0.05 |
| 5 800 | TAKARA HOLDINGS INC | JPY | 65 847 | 40 973 | 0.01 |
| 5 177 | TAKEDA PHARMACEUTICAL CO LTD | JPY | 133 609 | 164 419 | 0.06 |
| 1 351 | TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE INC | USD | 139 647 | 132 191 | 0.05 |
| 4 092 | TARGET CORP | USD | 222 867 | 383 701 | 0.13 |
| 38 459 | TAYLOR WIMPEY PLC | GBP | 78 539 | 90 429 | 0.03 |
| 5 200 | TDK CORP | JPY | 318 396 | 458 626 | 0.16 |
| 3 603 | TE CONNECTIVITY LTD | USD | 254 573 | 271 820 | 0.09 |
| 99 190 | TELEFONICA SA | EUR | 837 120 | 531 658 | 0.18 |
| 23 100 | TERUMO CORP | JPY | 581 652 | 678 079 | 0.23 |
| 72 099 | TESCO PLC | GBP | 153 661 | 191 577 | 0.07 |
| 7 395 | TEXAS INSTRUMENTS INC | USD | 569 606 | 768 415 | 0.26 |
| 3 054 | THERMO FISHER SCIENTIFIC INC | USD | 512 552 | 808 506 | 0.28 |
| 9 925 | TJX COS INC | USD | 332 156 | 540 320 | 0.18 |
| 6 000 | TOKAI CARBON CO LTD | JPY | 70 773 | 48 867 | 0.02 |
| 3 300 | TOKIO MARINE HOLDINGS INC | JPY | 140 831 | 161 568 | 0.06 |

# Swiss Life Funds (LUX) Equity Global Protect

## Anlagenübersicht (Fortsetzung)

| Nominalwert/ Menge | Bezeichnung | Kurs Währung | Kosten EUR | Marktwert EUR | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| **Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumenten, die an einer amtlichen Börse zugelassen sind oder auf einem anderen geregelten Markt gehandelt werden (Fortsetzung)** | | | | | |
| | **Anteile (Fortsetzung)** | | | | |
| 5 100 | TOKYO ELECTRON LTD | JPY | 578 177 | 960 950 | 0.33 |
| 55 538 | TOTAL SA | EUR | 2 613 401 | 2 131 548 | 0.73 |
| 3 100 | TOTO LTD | JPY | 100 519 | 107 141 | 0.04 |
| 6 200 | TOYO SEIKAN GROUP HOLDINGS LTD | JPY | 127 706 | 90 527 | 0.03 |
| 5 700 | TOYOTA MOTOR CORP | JPY | 308 194 | 342 863 | 0.12 |
| 7 200 | TOYOTA TSUSHO CORP | JPY | 198 993 | 198 406 | 0.07 |
| 467 | TRANSDIGM GROUP INC | USD | 194 701 | 237 150 | 0.08 |
| 2 454 | TRAVELERS COS INC | USD | 268 335 | 267 662 | 0.09 |
| 5 100 | TREND MICRO INC/JAPAN | JPY | 259 338 | 231 144 | 0.08 |
| 7 976 | TRUIST FINANCIAL CORP | USD | 318 800 | 335 029 | 0.11 |
| 5 787 | TWITTER INC | USD | 216 016 | 174 909 | 0.06 |
| 2 974 | TYSON FOODS INC - A | USD | 162 025 | 183 646 | 0.06 |
| 42 307 | UBS GROUP AG | CHF | 555 802 | 421 777 | 0.14 |
| 452 | ULTA BEAUTY INC | USD | 91 735 | 105 790 | 0.04 |
| 3 014 | UNIBAIL RODAMCO REITS | EUR | 449 387 | 328 526 | 0.11 |
| 30 832 | UNILEVER NV | EUR | 1 516 527 | 1 468 066 | 0.50 |
| 8 497 | UNILEVER PLC | GBP | 412 681 | 412 030 | 0.14 |
| 5 557 | UNION PACIFIC CORP | USD | 543 395 | 808 470 | 0.28 |
| 2 522 | UNITED AIRLINES HOLDINGS INC | USD | 157 758 | 141 408 | 0.05 |
| 5 410 | UNITED PARCEL SERVICE INC - B | USD | 531 225 | 445 674 | 0.15 |
| 6 537 | UNITED TECHNOLOGIES CORP | USD | 644 652 | 777 156 | 0.27 |
| 5 213 | UNITED UTILITIES GROUP PLC | GBP | 48 286 | 57 237 | 0.02 |
| 7 110 | UNITEDHEALTH GROUP INC | USD | 1 281 094 | 1 650 294 | 0.56 |
| 13 261 | US BANCORP/MN | USD | 587 376 | 560 645 | 0.19 |
| 3 337 | VALERO ENERGY CORP | USD | 224 603 | 201 262 | 0.07 |
| 7 391 | VENTAS INC | USD | 408 187 | 361 795 | 0.12 |
| 1 430 | VERISIGN INC | USD | 204 955 | 247 023 | 0.08 |
| 2 455 | VERISK ANALYTICS INC - A | USD | 216 368 | 346 666 | 0.12 |
| 30 094 | VERIZON COMMUNICATIONS INC | USD | 1 243 491 | 1 483 810 | 0.51 |
| 1 950 | VERTEX PHARMACEUTICALS INC | USD | 272 668 | 397 704 | 0.14 |
| 3 368 | VF CORP | USD | 172 970 | 220 762 | 0.08 |
| 4 126 | VIACOMCBS INC - B | USD | 203 859 | 92 440 | 0.03 |
| 11 593 | VINCI SA | EUR | 935 858 | 1 054 731 | 0.36 |
| 12 835 | VISA INC | USD | 1 248 816 | 2 123 801 | 0.72 |
| 21 436 | VIVENDI SA | EUR | 459 283 | 493 457 | 0.17 |
| 206 375 | VODAFONE GROUP PLC | GBP | 484 358 | 322 444 | 0.11 |
| 1 443 | VULCAN MATERIALS CO | USD | 145 801 | 157 982 | 0.05 |
| 7 184 | WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC | USD | 444 639 | 299 276 | 0.10 |
| 12 934 | WALT DISNEY CO | USD | 1 199 101 | 1 385 302 | 0.47 |
| 3 768 | WASTE MANAGEMENT INC | USD | 254 222 | 380 110 | 0.13 |
| 3 864 | WEC ENERGY GROUP INC | USD | 274 050 | 324 788 | 0.11 |
| 7 497 | WELLTOWER INC | USD | 473 709 | 510 652 | 0.17 |
| 2 814 | WESTERN DIGITAL CORP | USD | 210 000 | 142 333 | 0.05 |
| 2 075 | WESTINGHOUSE AIR BRAKE TECHNOLOGIES CORP | USD | 152 768 | 129 776 | 0.04 |

# Swiss Life Funds (LUX) Equity Global Protect

## Anlagenübersicht (Fortsetzung)

| Nominalwert/ Menge | Bezeichnung | Kurs Währung | Kosten EUR | Marktwert EUR | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| **Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumenten, die an einer amtlichen Börse zugelassen sind oder auf einem anderen geregelten Markt gehandelt werden (Fortsetzung)** | | | | | |
| | **Anteile (Fortsetzung)** | | | | |
| 9 803 | WEYERHAEUSER CO | USD | 269 586 | 231 856 | 0.08 |
| 1 192 | WHITBREAD PLC | GBP | 51 066 | 53 976 | 0.02 |
| 10 479 | WILLIAMS COS INC | USD | 259 158 | 181 733 | 0.06 |
| 1 315 | WILLIS TOWERS WATSON PLC | USD | 182 799 | 226 559 | 0.08 |
| 25 557 | WM MORRISON SUPERMARKETS PLC | GBP | 74 049 | 50 894 | 0.02 |
| 8 333 | WPP PLC | GBP | 125 875 | 72 947 | 0.02 |
| 1 061 | WYNN RESORTS LTD | USD | 140 915 | 104 299 | 0.04 |
| 5 919 | XCEL ENERGY INC | USD | 220 830 | 335 811 | 0.11 |
| 2 135 | XILINX INC | USD | 146 088 | 162 275 | 0.06 |
| 5 300 | YAMAHA CORP | JPY | 196 161 | 237 078 | 0.08 |
| 6 400 | YAMAHA MOTOR CO LTD | JPY | 119 621 | 93 339 | 0.03 |
| 5 900 | YAMATO HOLDINGS CO LTD | JPY | 142 248 | 84 752 | 0.03 |
| 5 800 | YASKAWA ELECTRIC CORP | JPY | 135 987 | 165 701 | 0.06 |
| 6 000 | YOKOGAWA ELECTRIC CORP | JPY | 94 331 | 87 961 | 0.03 |
| 2 792 | YUM! BRANDS INC | USD | 185 000 | 226 852 | 0.08 |
| 2 162 | ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC | USD | 209 103 | 267 974 | 0.09 |
| 4 072 | ZOETIS INC | USD | 240 215 | 493 889 | 0.17 |
| 1 643 | ZURICH INSURANCE GROUP AG | CHF | 414 362 | 573 138 | 0.20 |
| 7 270 | 3I GROUP PLC | GBP | 72 982 | 85 216 | 0.03 |
| 4 383 | 3M CO | USD | 784 487 | 595 493 | 0.20 |
| | **Gesamtsumme der Aktien** | | **230 510 021** | **260 547 351** | **88.90** |
| | **Gesamtsumme übertragbarer Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer amtlichen Börse zugelassen sind oder auf einem anderen geregelten Markt gehandelt werden** | | **230 510 021** | **260 547 351** | **88.89** |
| **Investmentfonds** | | | | | |
| | **Offene Anlagefonds** | | | | |
| 120 | BNP PARIBAS ASSET MANAGEMENT FRANCE - BNP PARIBAS MONEY 3M SICAV - I | EUR | 2 779 849 | 2 774 392 | 0.95 |
| 300 000 | LOMBARD ODIER SHORT-TERM MONEY MARKET - IC | USD | 2 922 659 | 3 045 746 | 1.04 |
| | **Gesamtsumme offene Anlagefonds** | | **5 702 508** | **5 820 138** | **1.99** |
| | **Gesamtsumme der Anlagefonds** | | **5 702 508** | **5 820 138** | **1.99** |
| | **Gesamtsumme der Anlagen** | | **236 212 529** | **266 367 489** | **90.88** |

# Swiss Life Funds (LUX) Equity Global Protect

## Sektorstruktur und geographische Verteilung der Anlagen

| Sektorstruktur | % |
|---|---|
| Software- und Computerdienstleistungen | 9.17 |
| Technologie Hardware und Geräte | 7.89 |
| Pharmazeutik und Biotechnologie | 7.57 |
| Banken | 5.50 |
| Allgemeiner Einzelhandel | 5.35 |
| Geräte und Dienstleistungen im Gesundheitswesen | 4.14 |
| Finanzdienstleistungen | 4.12 |
| Versicherungen (ohne Lebensversicherung) | 3.27 |
| Öl- und Gasproduzenten | 3.22 |
| Persönliche Güter | 3.11 |
| Immobilienbezogene Anlagefonds | 2.74 |
| Festnetz-Telekommunikation | 2.32 |
| Kundenbetreuung | 2.18 |
| Elektrizität | 2.14 |
| Luft- und Raumfahrt und Verteidigung | 2.08 |
| Medien | 2.06 |
| Investmentfonds | 1.99 |
| Chemikalien | 1.95 |
| Lebensmittelhersteller | 1.78 |
| Industrietechnik | 1.78 |
| Getränke | 1.71 |
| Allgemeine Industrie | 1.69 |
| Reise, Freizeit und Catering | 1.66 |
| Elektronische und elektrische Geräte | 1.62 |
| Automobilbau und -teile | 1.16 |
| Haushaltswaren und Heimwerkerbedarf | 1.13 |
| Bauwirtschaft und Baustoffe | 1.11 |
| Industrietransport | 1.09 |
| Lebensmittel- und Arzneimittelhandel | 0.95 |
| Gas-, Wasser- und Mehrfachversorgungsunternehmen | 0.91 |
| Tabak | 0.77 |
| Lebensversicherung | 0.62 |
| Freizeitartikel | 0.59 |
| Mobilfunk | 0.45 |
| Bergbau | 0.38 |
| Ölbranche: Maschinen, Dienstleistungen und Vertrieb | 0.33 |
| Immobilienbezogene Dienstleistungen und Investitionen | 0.10 |
| Industriemetalle und Bergbau | 0.09 |
| Alternative Energie | 0.08 |
| Forst- und Papierindustrie | 0.08 |
| | **90.88** |

| Geographische Verteilung | % |
|---|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika | 53.67 |
| Japan | 8.39 |
| Frankreich | 7.31 |
| Großbritannien | 4.77 |
| Deutschland | 4.49 |
| Schweiz | 3.43 |
| Niederlande | 2.48 |
| Irland | 1.69 |
| Spanien | 1.68 |
| Luxemburg | 1.04 |
| Italien | 0.90 |
| Belgien | 0.32 |
| Jersey Inseln | 0.20 |
| Finnland | 0.14 |
| Bermuda | 0.13 |
| Curacao | 0.12 |
| Guernsey | 0.04 |
| Liberia | 0.04 |
| Panama | 0.04 |
| | **90.88** |

# Swiss Life Funds (LUX) Equity USA

## Anlagenübersicht

| Nominalwert/ Menge | Bezeichnung | Kurs Währung | Kosten USD | Marktwert USD | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| **Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumenten, die an einer amtlichen Börse zugelassen sind oder auf einem anderen geregelten Markt gehandelt werden** | | | | | |
| **Aktien** | | | | | |
| 1 970 | ABBOTT LABORATORIES | USD | 166 189 | 151 749 | 0.05 |
| 33 911 | ABBVIE INC | USD | 2 999 876 | 2 906 512 | 0.90 |
| 14 594 | ACCENTURE PLC - A | USD | 2 808 491 | 2 635 530 | 0.81 |
| 741 | ADOBE INC | USD | 234 636 | 255 734 | 0.08 |
| 88 767 | AES CORP/VA | USD | 1 678 391 | 1 485 072 | 0.46 |
| 8 148 | ALASKA AIR GROUP INC | USD | 542 738 | 411 148 | 0.13 |
| 4 028 | ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUITIES INC | USD | 656 886 | 611 773 | 0.19 |
| 13 967 | ALLEGION PLC | USD | 1 678 554 | 1 606 065 | 0.49 |
| 4 495 | ALLERGAN PLC | USD | 847 038 | 857 062 | 0.26 |
| 11 542 | ALLIANT ENERGY CORP | USD | 613 931 | 601 569 | 0.19 |
| 17 015 | ALLSTATE CORP | USD | 1 847 216 | 1 790 829 | 0.55 |
| 2 764 | ALPHABET CLASS - A | USD | 3 171 850 | 3 701 687 | 1.14 |
| 2 754 | ALPHABET INC | USD | 3 392 351 | 3 688 515 | 1.14 |
| 6 931 | ALTRIA GROUP INC | USD | 342 785 | 279 804 | 0.09 |
| 3 856 | AMAZON.COM INC | USD | 6 745 657 | 7 263 740 | 2.24 |
| 246 711 | AMCOR PLC | USD | 2 407 899 | 2 299 347 | 0.71 |
| 8 572 | AMEREN CORP | USD | 708 304 | 677 188 | 0.21 |
| 10 976 | AMERICAN TOWER CORP | USD | 2 663 546 | 2 489 357 | 0.77 |
| 11 317 | AMERIPRISE FINANCIAL INC | USD | 1 682 553 | 1 599 092 | 0.49 |
| 18 444 | AMERISOURCEBERGEN CORP | USD | 1 728 387 | 1 555 198 | 0.48 |
| 13 793 | AMGEN INC | USD | 2 890 244 | 2 754 876 | 0.85 |
| 9 539 | AON PLC | USD | 2 146 561 | 1 984 112 | 0.61 |
| 57 771 | APPLE INC | USD | 12 677 395 | 15 792 280 | 4.86 |
| 35 803 | APPLIED MATERIALS INC | USD | 1 997 128 | 2 080 870 | 0.64 |
| 17 521 | ARTHUR J GALLAGHER & CO | USD | 1 826 739 | 1 708 122 | 0.53 |
| 15 733 | ASSURANT INC | USD | 2 084 780 | 1 897 242 | 0.58 |
| 44 677 | AT&T INC | USD | 1 582 374 | 1 573 524 | 0.48 |
| 11 748 | AVALONBAY COMMUNITIES INC | USD | 2 576 714 | 2 356 531 | 0.73 |
| 13 370 | AVERY DENNISON CORP | USD | 1 721 655 | 1 530 731 | 0.47 |
| 17 522 | BANK OF AMERICA CORP | USD | 579 086 | 499 377 | 0.15 |
| 22 973 | BAXTER INTERNATIONAL INC | USD | 1 999 340 | 1 917 556 | 0.59 |
| 34 558 | BERKSHIRE HATHAWAY INC - B | USD | 7 405 752 | 7 130 697 | 2.20 |
| 21 411 | BEST BUY CO INC | USD | 1 498 216 | 1 619 742 | 0.50 |
| 17 664 | BRISTOL-MYERS SQUIBB CO | USD | 897 746 | 1 043 236 | 0.32 |
| 13 683 | CAMPBELL SOUP CO | USD | 643 613 | 617 377 | 0.19 |
| 5 525 | CBOE GLOBAL MARKETS INC | USD | 636 714 | 629 850 | 0.19 |
| 29 553 | CBRE GROUP INC | USD | 1 570 154 | 1 659 105 | 0.51 |
| 23 988 | CH ROBINSON WORLDWIDE INC | USD | 1 727 376 | 1 652 773 | 0.51 |
| 1 698 | CHARTER COMMUNICATIONS INC | USD | 712 950 | 837 403 | 0.26 |
| 3 413 | CHEVRON CORP | USD | 402 879 | 318 569 | 0.10 |
| 818 | CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC | USD | 705 664 | 632 788 | 0.19 |
| 8 941 | CHURCH & DWIGHT CO INC | USD | 665 479 | 621 578 | 0.19 |
| 6 649 | CINTAS CORP | USD | 1 875 084 | 1 773 554 | 0.55 |
| 84 130 | CISCO SYSTEMS INC | USD | 3 589 845 | 3 359 311 | 1.03 |

# Swiss Life Funds (LUX) Equity USA

## Anlagenübersicht (Fortsetzung)

| Nominalwert/ Menge | Bezeichnung | Kurs Währung | Kosten USD | Marktwert USD | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| **Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumenten, die an einer amtlichen Börse zugelassen sind oder auf einem anderen geregelten Markt gehandelt werden (Fortsetzung)** | | | | | |
| | **Anteile (Fortsetzung)** | | | | |
| 2 949 | CITIGROUP INC | USD | 216 250 | 187 144 | 0.06 |
| 21 771 | CITRIX SYSTEMS INC | USD | 2 340 248 | 2 250 904 | 0.69 |
| 4 461 | CLOROX CO | USD | 678 595 | 711 173 | 0.22 |
| 4 168 | CME GROUP INC | USD | 894 328 | 828 682 | 0.26 |
| 10 034 | CMS ENERGY CORP | USD | 666 659 | 606 254 | 0.19 |
| 19 124 | COCA-COLA CO | USD | 1 045 568 | 1 022 943 | 0.32 |
| 12 157 | COGNIZANT TECHNOLOGY SOLUTIONS CORP - A | USD | 742 914 | 740 726 | 0.23 |
| 7 710 | COMCAST CORP | USD | 347 567 | 311 715 | 0.10 |
| 40 223 | CONOCOPHILLIPS | USD | 2 361 534 | 1 947 598 | 0.60 |
| 7 907 | CONSOLIDATED EDISON INC | USD | 698 775 | 623 230 | 0.19 |
| 377 | COSTCO WHOLESALE CORP | USD | 111 468 | 105 990 | 0.03 |
| 5 904 | DARDEN RESTAURANTS INC | USD | 694 455 | 575 640 | 0.18 |
| 20 342 | DAVITA INC | USD | 1 470 523 | 1 578 946 | 0.49 |
| 36 620 | DELTA AIR LINES INC | USD | 1 815 986 | 1 689 281 | 0.52 |
| 12 125 | DENTSPLY SIRONA INC | USD | 667 319 | 597 035 | 0.18 |
| 4 011 | DISCOVERY COMMUNICATIONS INC - C | USD | 119 568 | 100 676 | 0.03 |
| 4 612 | DOLLAR GENERAL CORP | USD | 750 234 | 693 184 | 0.21 |
| 15 796 | DOVER CORP | USD | 1 661 455 | 1 622 881 | 0.50 |
| 16 167 | DOW INC | USD | 695 989 | 653 308 | 0.20 |
| 43 176 | DR HORTON INC | USD | 2 428 697 | 2 299 986 | 0.71 |
| 5 439 | DTE ENERGY CO | USD | 707 457 | 607 373 | 0.19 |
| 48 884 | DUKE REALTY CORP | USD | 1 695 804 | 1 587 263 | 0.49 |
| 20 619 | EATON CORP PLC | USD | 1 884 577 | 1 870 556 | 0.58 |
| 22 395 | ELECTRONIC ARTS INC | USD | 2 217 333 | 2 270 181 | 0.70 |
| 27 026 | ELI LILLY & CO | USD | 3 757 270 | 3 408 789 | 1.05 |
| 20 042 | ENTERGY CORP | USD | 2 483 691 | 2 343 110 | 0.72 |
| 30 833 | EQUITY RESIDENTIAL | USD | 2 503 738 | 2 315 558 | 0.71 |
| 2 269 | ESSEX PROPERTY TRUST INC | USD | 714 495 | 642 944 | 0.20 |
| 6 153 | EXTRA SPACE STORAGE INC | USD | 666 643 | 617 515 | 0.19 |
| 78 311 | EXXON MOBIL CORP | USD | 4 304 135 | 4 028 318 | 1.24 |
| 16 499 | FACEBOOK INC | USD | 3 101 348 | 3 175 563 | 0.98 |
| 14 264 | FIRSTENERGY CORP | USD | 681 408 | 635 176 | 0.20 |
| 25 137 | FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC | USD | 1 629 632 | 1 552 210 | 0.48 |
| 70 428 | FOX CORP | USD | 2 309 334 | 2 164 957 | 0.67 |
| 49 486 | GENERAL MILLS INC | USD | 2 591 992 | 2 424 814 | 0.75 |
| 34 226 | GILEAD SCIENCES INC | USD | 2 556 682 | 2 373 915 | 0.73 |
| 16 303 | GLOBE LIFE INC | USD | 1 594 433 | 1 510 636 | 0.47 |
| 121 085 | HANESBRANDS INC | USD | 1 869 823 | 1 603 165 | 0.49 |
| 32 563 | HARTFORD FINANCIAL SERVICES GROUP INC | USD | 1 821 721 | 1 626 522 | 0.50 |
| 18 775 | HEALTHPEAK PROPERTIES INC | USD | 668 118 | 594 041 | 0.18 |
| 15 777 | HERSHEY CO | USD | 2 013 146 | 2 271 730 | 0.70 |
| 13 924 | HOLLYFRONTIER CORP | USD | 500 986 | 468 960 | 0.14 |
| 2 404 | HOME DEPOT INC | USD | 558 997 | 523 687 | 0.16 |
| 594 | HONEYWELL INTERNATIONAL INC | USD | 100 952 | 96 329 | 0.03 |

# Swiss Life Funds (LUX) Equity USA

## Anlagenübersicht (Fortsetzung)

| Nominalwert/ Menge | Bezeichnung | Kurs Währung | Kosten USD | Marktwert USD | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| **Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumenten, die an einer amtlichen Börse zugelassen sind oder auf einem anderen geregelten Markt gehandelt werden (Fortsetzung)** | | | | | |
| | **Anteile (Fortsetzung)** | | | | |
| 82 136 | HP INC | USD | 1 865 309 | 1 707 607 | 0.53 |
| 28 094 | H&R BLOCK INC | USD | 663 169 | 580 703 | 0.18 |
| 6 104 | HUMANA INC | USD | 2 081 201 | 1 951 327 | 0.60 |
| 7 532 | HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIES INC | USD | 1 856 865 | 1 548 052 | 0.48 |
| 11 602 | ILLINOIS TOOL WORKS INC | USD | 1 980 577 | 1 946 584 | 0.60 |
| 75 798 | INTEL CORP | USD | 4 249 994 | 4 208 305 | 1.30 |
| 600 | INTERNATIONAL BUSINESS MACHINES CORP | USD | 85 139 | 78 090 | 0.02 |
| 3 948 | JACK HENRY & ASSOCIATES INC | USD | 633 851 | 599 070 | 0.18 |
| 6 524 | JM SMUCKER CO | USD | 705 324 | 671 907 | 0.21 |
| 48 124 | JOHNSON & JOHNSON | USD | 6 707 407 | 6 471 716 | 1.99 |
| 17 344 | JPMORGAN CHASE & CO | USD | 2 142 966 | 2 013 812 | 0.62 |
| 27 948 | JUNIPER NETWORKS INC | USD | 625 476 | 593 057 | 0.18 |
| 1 817 | KELLOGG CO | USD | 125 627 | 109 874 | 0.03 |
| 20 107 | KIMBERLY-CLARK CORP | USD | 2 779 994 | 2 637 837 | 0.81 |
| 37 307 | KINDER MORGAN | USD | 776 645 | 715 175 | 0.22 |
| 84 733 | KROGER CO | USD | 2 285 602 | 2 383 539 | 0.73 |
| 3 918 | LABORATORY CORP OF AMERICA HOLDINGS | USD | 671 959 | 688 353 | 0.21 |
| 6 590 | LAM RESEARCH CORP | USD | 1 417 170 | 1 933 704 | 0.60 |
| 25 284 | LAMB WESTON HOLDINGS INC | USD | 2 270 729 | 2 196 927 | 0.68 |
| 15 758 | LEIDOS HOLDINGS INC | USD | 1 505 962 | 1 617 559 | 0.50 |
| 37 911 | LENNAR CORP | USD | 2 313 396 | 2 287 550 | 0.70 |
| 259 | LINDE PLC | EUR | 54 092 | 48 863 | 0.02 |
| 23 454 | LYONDELLBASELL INDUSTRIES NV - A | USD | 1 744 743 | 1 676 023 | 0.52 |
| 36 236 | MARATHON PETROLEUM CORP | USD | 1 886 446 | 1 718 311 | 0.53 |
| 2 127 | MARKETAXESS HOLDINGS INC | USD | 761 726 | 689 850 | 0.21 |
| 18 865 | MARSH & MCLENNAN COS INC | USD | 2 113 446 | 1 972 524 | 0.61 |
| 2 602 | MARTIN MARIETTA MATERIALS INC | USD | 715 590 | 592 033 | 0.18 |
| 38 845 | MASCO CORP | USD | 1 733 635 | 1 605 075 | 0.49 |
| 2 068 | MASTERCARD INC | USD | 654 003 | 600 237 | 0.18 |
| 5 466 | MCDONALD'S CORP | USD | 1 074 452 | 1 061 333 | 0.33 |
| 11 515 | MCKESSON CORP | USD | 1 830 655 | 1 610 488 | 0.50 |
| 36 134 | MEDTRONIC PLC | USD | 3 854 441 | 3 637 610 | 1.12 |
| 15 923 | MERCK & CO INC | USD | 1 308 894 | 1 219 065 | 0.38 |
| 102 424 | MICROSOFT CORP | USD | 13 274 171 | 16 593 711 | 5.11 |
| 16 817 | MID-AMERICA APARTMENT COMMUNITIES INC | USD | 2 265 441 | 2 173 765 | 0.67 |
| 7 579 | MOODY'S CORP | USD | 1 703 759 | 1 819 187 | 0.56 |
| 4 174 | MOTOROLA SOLUTIONS INC | USD | 699 319 | 691 548 | 0.21 |
| 15 171 | NASDAQ INC | USD | 1 714 626 | 1 555 786 | 0.48 |
| 34 382 | NETAPP INC | USD | 1 912 610 | 1 606 327 | 0.49 |
| 420 | NETFLIX INC | USD | 128 587 | 154 993 | 0.05 |
| 15 155 | NEWMONT CORP | USD | 605 040 | 676 368 | 0.21 |
| 325 | NEXTERA ENERGY INC | USD | 79 004 | 82 147 | 0.03 |
| 930 | NIKE INC - B | USD | 83 269 | 83 123 | 0.03 |
| 45 248 | NORDSTROM INC | USD | 1 661 755 | 1 570 106 | 0.48 |

# Swiss Life Funds (LUX) Equity USA

## Anlagenübersicht (Fortsetzung)

| Nominal wert/ Menge | Bezeichnung | Kurs Währung | Kosten USD | Marktwert USD | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| **Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumenten, die an einer amtlichen Börse zugelassen sind oder auf einem anderen geregelten Markt gehandelt werden (Fortsetzung)** | | | | | |
| | **Anteile (Fortsetzung)** | | | | |
| 33 217 | NORTONLIFELOCK INC | USD | 641 088 | 632 120 | 0.19 |
| 37 324 | NUCOR CORP | USD | 1 789 313 | 1 543 347 | 0.48 |
| 913 | NVIDIA CORP | USD | 211 730 | 246 574 | 0.08 |
| 614 | NVR INC | USD | 2 282 948 | 2 251 649 | 0.69 |
| 32 725 | OMNICOM GROUP INC | USD | 2 561 221 | 2 267 188 | 0.70 |
| 19 295 | ORACLE CORP | USD | 1 027 125 | 954 331 | 0.29 |
| 1 199 | O'REILLY AUTOMOTIVE INC | USD | 513 175 | 442 095 | 0.14 |
| 5 596 | PAYCHEX INC - AK9420 | USD | 484 390 | 433 578 | 0.13 |
| 874 | PAYPAL HOLDINGS INC | USD | 92 286 | 94 383 | 0.03 |
| 8 869 | PEPSICO INC | USD | 1 244 631 | 1 170 974 | 0.36 |
| 11 423 | PFIZER INC | USD | 436 712 | 381 757 | 0.12 |
| 1 574 | PHILIP MORRIS INTERNATIONAL INC | USD | 128 832 | 128 863 | 0.04 |
| 9 134 | PROCTER & GAMBLE CO | USD | 963 392 | 1 034 243 | 0.32 |
| 24 133 | PROLOGIS INC | USD | 2 202 378 | 2 033 929 | 0.63 |
| 39 086 | PULTEGROUP INC | USD | 1 437 792 | 1 571 257 | 0.48 |
| 17 425 | QORVO INC | USD | 1 779 067 | 1 752 607 | 0.54 |
| 5 931 | QUEST DIAGNOSTICS INC | USD | 644 588 | 629 042 | 0.19 |
| 15 908 | RALPH LAUREN CORP - A | USD | 1 615 935 | 1 678 453 | 0.52 |
| 13 945 | RAYTHEON CO | USD | 2 982 749 | 2 629 469 | 0.81 |
| 9 252 | REALTY INCOME CORP | USD | 688 825 | 669 752 | 0.21 |
| 10 448 | REGENCY CENTERS CORP | USD | 642 030 | 600 133 | 0.18 |
| 30 960 | ROBERT HALF INTERNATIONAL INC | USD | 1 741 769 | 1 560 694 | 0.48 |
| 9 166 | ROCKWELL AUTOMATION INC | USD | 1 889 515 | 1 681 961 | 0.52 |
| 16 788 | ROSS STORES INC | USD | 1 917 698 | 1 826 199 | 0.56 |
| 1 330 | SALESFORCE.COM INC | USD | 222 552 | 226 632 | 0.07 |
| 33 369 | SEAGATE TECHNOLOGY PLC | USD | 1 915 048 | 1 600 044 | 0.49 |
| 49 585 | SEALED AIR CORP | USD | 1 787 054 | 1 502 921 | 0.46 |
| 14 954 | SEMPRA ENERGY | USD | 2 083 650 | 2 090 270 | 0.64 |
| 3 728 | SHERWIN-WILLIAMS CO | USD | 2 167 043 | 1 926 444 | 0.59 |
| 14 756 | SIMON PROPERTY GROUP INC | USD | 2 266 757 | 1 816 168 | 0.56 |
| 16 183 | SKYWORKS SOLUTIONS INC | USD | 1 598 103 | 1 621 213 | 0.50 |
| 4 131 | SNAP-ON INC | USD | 617 378 | 597 962 | 0.18 |
| 45 437 | SOUTHERN CO | USD | 2 606 034 | 2 742 577 | 0.84 |
| 7 733 | S&P GLOBAL INC | USD | 1 909 867 | 2 056 282 | 0.63 |
| 35 727 | SYSCO CORP | USD | 2 827 285 | 2 381 205 | 0.73 |
| 14 644 | T ROWE PRICE GROUP INC | USD | 1 682 429 | 1 728 138 | 0.53 |
| 19 435 | TARGET CORP | USD | 2 009 219 | 2 001 805 | 0.62 |
| 476 | TEXAS INSTRUMENTS INC | USD | 60 512 | 54 331 | 0.02 |
| 301 | THERMO FISHER SCIENTIFIC INC | USD | 94 180 | 87 531 | 0.03 |
| 13 263 | UDR INC | USD | 647 804 | 596 570 | 0.18 |
| 6 517 | ULTA BEAUTY INC | USD | 1 545 181 | 1 675 456 | 0.52 |
| 532 | UNION PACIFIC CORP | USD | 89 376 | 85 019 | 0.03 |
| 551 | UNITED TECHNOLOGIES CORP | USD | 79 195 | 71 955 | 0.02 |
| 16 911 | UNITEDHEALTH GROUP INC | USD | 4 927 679 | 4 311 629 | 1.33 |

# Swiss Life Funds (LUX) Equity USA

## Anlagenübersicht (Fortsetzung)

| Nominalwert/ Menge | Bezeichnung | Kurs Währung | Kosten USD | Marktwert USD | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| **Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumenten, die an einer amtlichen Börse zugelassen sind oder auf einem anderen geregelten Markt gehandelt werden (Fortsetzung)** | | | | | |
| | **Anteile (Fortsetzung)** | | | | |
| 25 434 | VALERO ENERGY CORP | USD | 1 824 126 | 1 685 003 | 0.52 |
| 24 601 | VERIZON COMMUNICATIONS INC | USD | 1 480 852 | 1 332 390 | 0.41 |
| 9 283 | VERTEX PHARMACEUTICALS INC | USD | 2 154 027 | 2 079 670 | 0.64 |
| 22 015 | VIACOMCBS INC - B | USD | 728 256 | 541 789 | 0.17 |
| 6 751 | VISA INC | USD | 1 211 304 | 1 227 062 | 0.38 |
| 28 708 | VORNADO REALTY TRUST | USD | 1 856 195 | 1 538 175 | 0.47 |
| 3 533 | WALT DISNEY CO | USD | 523 206 | 415 657 | 0.13 |
| 6 498 | WASTE MANAGEMENT INC | USD | 695 541 | 720 043 | 0.22 |
| 25 926 | WEC ENERGY GROUP INC | USD | 2 455 087 | 2 393 748 | 0.74 |
| 11 775 | WHIRLPOOL CORP | USD | 1 732 691 | 1 505 552 | 0.46 |
| 1 858 | WW GRAINGER INC | USD | 529 251 | 515 669 | 0.16 |
| 10 568 | XCEL ENERGY INC | USD | 722 323 | 658 598 | 0.20 |
| 45 138 | XEROX HOLDINGS CORP | USD | 1 612 781 | 1 453 444 | 0.45 |
| 7 054 | YUM! BRANDS INC | USD | 773 946 | 629 570 | 0.19 |
| | **Gesamtsumme der Aktien** | | **313 631 800** | **307 183 124** | **94.63** |
| | **Gesamtsumme übertragbarer Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer amtlichen Börse zugelassen sind oder auf einem anderen geregelten Markt gehandelt werden** | | **313 631 800** | **307 183 124** | **94.63** |
| | **Gesamtsumme der Anlagen** | | **313 631 800** | **307 183 124** | **94.63** |

# Swiss Life Funds (LUX) Equity USA

## Sektorstruktur und geographische Verteilung der Anlagen

| Sektorstruktur | % |
|---|---|
| Technologie Hardware und Geräte | 11.48 |
| Software- und Computerdienstleistungen | 10.59 |
| Pharmazeutik und Biotechnologie | 7.24 |
| Immobilienbezogene Anlagefonds | 6.36 |
| Allgemeiner Einzelhandel | 5.80 |
| Versicherungen (ohne Lebensversicherung) | 4.99 |
| Geräte und Dienstleistungen im Gesundheitswesen | 4.79 |
| Finanzdienstleistungen | 4.60 |
| Haushaltswaren und Heimwerkerbedarf | 3.55 |
| Lebensmittel- und Arzneimittelhandel | 3.14 |
| Öl- und Gasproduzenten | 3.13 |
| Elektrizität | 3.00 |
| Kundenbetreuung | 2.82 |
| Bauwirtschaft und Baustoffe | 2.44 |
| Industrietechnik | 2.09 |
| Medien | 2.09 |
| Persönliche Güter | 2.04 |
| Lebensmittelhersteller | 1.85 |
| Gas-, Wasser- und Mehrfachversorgungsunternehmen | 1.79 |
| Reise, Freizeit und Catering | 1.54 |
| Lebensversicherung | 1.05 |
| Festnetz-Telekommunikation | 0.90 |
| Luft- und Raumfahrt und Verteidigung | 0.86 |
| Banken | 0.83 |
| Anlageinstrumente, die keine Aktien sind | 0.71 |
| Freizeitartikel | 0.70 |
| Getränke | 0.68 |
| Industrietransport | 0.54 |
| Chemikalien | 0.53 |
| Immobilienbezogene Dienstleistungen und Investitionen | 0.51 |
| Elektronische und elektrische Geräte | 0.49 |
| Industriemetalle und Bergbau | 0.48 |
| Allgemeine Industrie | 0.46 |
| Ölbranche: Maschinen, Dienstleistungen und Vertrieb | 0.22 |
| Bergbau | 0.21 |
| Tabak | 0.13 |
| | **94.63** |

| Geographische Verteilung | % |
|---|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika | 89.01 |
| Irland | 3.78 |
| Jersey Inseln | 0.71 |
| Großbritannien | 0.61 |
| Niederlande | 0.52 |
| | **94.63** |

# Swiss Life Funds (LUX) Fixed Income Alpha Select[1]

## Anlagenübersicht

| Nominalwert/ Menge | Bezeichnung | Kurs Währung | Kosten EUR | Marktwert EUR | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| **Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumenten, die an einer amtlichen Börse zugelassen sind oder auf einem anderen geregelten Markt gehandelt werden** | | | | | |
| | **Anleihen** | | | | |
| 200 000 | ABBVIE INC - 144A - 4.25% 21/11/2049 | USD | 180 818 | 205 858 | 0.38 |
| 200 000 | ABERTIS INFRAESTRUCTURAS SA 1.125% 26/03/2028 | EUR | 198 194 | 196 538 | 0.36 |
| 300 000 | ABERTIS INFRAESTRUCTURAS SA 2.375% 27/09/2027 | EUR | 335 325 | 323 412 | 0.60 |
| 200 000 | ABU DHABI NATIONAL ENERGY CO PJSC - REGS - 4% 03/10/2049 | USD | 182 790 | 202 513 | 0.37 |
| 400 000 | AGEAS FRN PERPETUAL | EUR | 400 000 | 399 820 | 0.74 |
| 200 000 | AIR FRANCE-KLM 1.875% 16/01/2025 | EUR | 198 822 | 191 012 | 0.35 |
| 100 000 | ALIMENTATION COUCHE-TARD INC 2.95% 25/01/2030 | USD | 90 181 | 93 817 | 0.17 |
| 200 000 | ALIMENTATION COUCHE-TARD INC 3.8% 25/01/2050 | USD | 179 873 | 182 943 | 0.34 |
| 300 000 | ALLIANZ SE FRN 07/07/2045 | EUR | 322 470 | 320 964 | 0.59 |
| 100 000 | ALSTOM SA 0.25% 14/10/2026 | EUR | 99 592 | 100 034 | 0.19 |
| 500 000 | AMERICA MOVIL SAB DE CV FRN 06/09/2073 | GBP | 587 093 | 593 522 | 1.11 |
| 100 000 | AMPLIFON SPA 1.125% 13/02/2027 | EUR | 99 253 | 99 469 | 0.18 |
| 400 000 | ANALOG DEVICES INC 3.5% 05/12/2026 | USD | 378 108 | 395 929 | 0.73 |
| 200 000 | ARES CAPITAL CORP 3.25% 15/07/2025 | USD | 179 299 | 183 661 | 0.34 |
| 200 000 | AT&T INC 1.8% 14/09/2039 | EUR | 198 670 | 199 164 | 0.37 |
| 250 000 | AT&T INC 4.3% 15/02/2030 | USD | 254 219 | 260 529 | 0.48 |
| 300 000 | AXA SA FRN 17/01/2047 | USD | 297 209 | 300 726 | 0.56 |
| 100 000 | BANCA MONTE DEI PASCHI DI SIENA SPA 0.875% 08/10/2026 | EUR | 99 622 | 103 354 | 0.19 |
| 100 000 | BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA SA FRN 16/01/2030 | EUR | 99 391 | 96 767 | 0.18 |
| 300 000 | BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA SA 0.5% 14/01/2027 | EUR | 297 642 | 293 106 | 0.54 |
| 380 000 | BANCO DEL ESTADO DE CHILE 0.575% 07/04/2027 | CHF | 353 812 | 369 550 | 0.68 |
| 200 000 | BANCO DEL ESTADO DE CHILE 2.704% 09/01/2025 | USD | 178 739 | 183 950 | 0.34 |
| 300 000 | BANCO MERCANTIL DEL NORTE SA/GRAND CAYMAN 0.5% 06/12/2024 | CHF | 281 466 | 283 559 | 0.53 |
| 150 000 | BANCO SANTANDER CHILE 2.7% 10/01/2025 | USD | 134 632 | 137 866 | 0.26 |
| 500 000 | BANK OF AMERICA CORP FRN 09/05/2030 | EUR | 541 925 | 529 375 | 0.99 |
| 500 000 | BAT CAPITAL CORP 2.789% 06/09/2024 | USD | 456 100 | 471 273 | 0.87 |
| 300 000 | BERKSHIRE HATHAWAY INC 1.125% 16/03/2027 | EUR | 319 623 | 319 113 | 0.59 |
| 250 000 | BHARTI AIRTEL LTD - REGS - 4.375% 10/06/2025 | USD | 232 363 | 239 041 | 0.44 |
| 300 000 | BIOGEN INC 4.05% 15/09/2025 | USD | 291 551 | 304 351 | 0.56 |
| 300 000 | BLACKSTONE HOLDINGS FINANCE CO LLC 2.5% 10/01/2030 | USD | 270 196 | 283 908 | 0.53 |
| 300 000 | BLACKSTONE PROPERTY PARTNERS EUROPE HOLDINGS SARL 0.5% 12/09/2023 | EUR | 299 892 | 302 372 | 0.56 |
| 200 000 | BMW FINANCE NV 0.375% 14/01/2027 | EUR | 199 504 | 200 024 | 0.37 |
| 300 000 | BOS FUNDING LTD 1.5% 29/11/2023 | CHF | 273 648 | 284 834 | 0.53 |
| 300 000 | BP CAPITAL MARKETS PLC 0.831% 08/11/2027 | EUR | 311 730 | 309 693 | 0.57 |
| 400 000 | BRISTOL-MYERS SQUIBB CO - 144A - 4.25% 26/10/2049 | USD | 443 521 | 465 787 | 0.86 |
| 250 000 | BURLINGTON NORTHERN SANTA FE LLC 3.55% 15/02/2050 | USD | 249 867 | 256 534 | 0.47 |
| 400 000 | CAIXABANK SA 0.625% 01/10/2024 | EUR | 397 256 | 398 700 | 0.74 |
| 500 000 | CANADIAN IMPERIAL BANK OF COMMERCE 2.35% 28/08/2024 | CAD | 340 775 | 343 422 | 0.64 |
| 300 000 | CARNIVAL PLC 1% 28/10/2029 | EUR | 298 560 | 284 964 | 0.53 |
| 300 000 | CBQ FINANCE LTD 0.38% 19/10/2023 | CHF | 275 710 | 284 702 | 0.53 |
| 500 000 | CELANESE US HOLDINGS LLC 3.5% 08/05/2024 | USD | 470 697 | 479 885 | 0.89 |
| 300 000 | CELLNEX TELECOM SA 0.775% 18/02/2027 | CHF | 279 733 | 281 683 | 0.52 |
| 100 000 | CEZ AS 0.875% 02/12/2026 | EUR | 99 126 | 101 888 | 0.19 |

[1] Dieser Teilfonds wurde zum 3. September 2019 aufgelegt.

# Swiss Life Funds (LUX) Fixed Income Alpha Select[1]

## Anlagenübersicht (Fortsetzung)

| Nominalwert/ Menge | Bezeichnung | Kurs Währung | Kosten EUR | Marktwert EUR | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| **Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumenten, die an einer amtlichen Börse zugelassen sind oder auf einem anderen geregelten Markt gehandelt werden (Fortsetzung)** | | | | | |
| | **Anleihen (Fortsetzung)** | | | | |
| 200 000 | CHUBB INA HOLDINGS INC 0.3% 15/12/2024 | EUR | 199 752 | 200 870 | 0.37 |
| 300 000 | CHUBB INA HOLDINGS INC 1.4% 15/06/2031 | EUR | 327 255 | 317 850 | 0.59 |
| 200 000 | CK HUTCHISON CAPITAL SECURITIES 17 LTD - REGS - FRN PERPETUAL | USD | 180 514 | 184 496 | 0.34 |
| 200 000 | CK HUTCHISON GROUP TELECOM FINANCE SA 0.375% 17/10/2023 | EUR | 199 478 | 201 292 | 0.37 |
| 400 000 | COCA-COLA HBC FINANCE BV 1% 14/05/2027 | EUR | 422 380 | 416 588 | 0.77 |
| 100 000 | COLGATE-PALMOLIVE CO 0.875% 12/11/2039 | EUR | 97 389 | 99 882 | 0.18 |
| 150 000 | COMCAST CORP 0.25% 20/05/2027 | EUR | 149 432 | 150 470 | 0.28 |
| 200 000 | COMCAST CORP 3.45% 01/02/2050 | USD | 179 499 | 200 373 | 0.37 |
| 250 000 | CONOCOPHILLIPS CO 4.95% 15/03/2026 | USD | 263 593 | 266 892 | 0.49 |
| 200 000 | CORP NACIONAL DEL COBRE DE CHILE 3% 30/09/2029 | USD | 181 612 | 185 259 | 0.34 |
| 200 000 | COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO LTD 5.125% 14/01/2027 | USD | 179 509 | 181 905 | 0.34 |
| 200 000 | CPI PROPERTY GROUP SA 1.625% 23/04/2027 | EUR | 196 244 | 202 188 | 0.37 |
| 200 000 | CSX CORP 3.35% 15/09/2049 | USD | 181 174 | 190 933 | 0.35 |
| 100 000 | DANSKE BANK A/S 2.25% 14/01/2028 | GBP | 117 394 | 117 423 | 0.22 |
| 200 000 | DEUTSCHE BANK AG 2.625% 16/12/2024 | GBP | 234 110 | 236 035 | 0.44 |
| 300 000 | DEUTSCHE TELEKOM AG 1.75% 25/03/2031 | EUR | 331 775 | 333 009 | 0.62 |
| 200 000 | DH EUROPE FINANCE II SARL 3.4% 15/11/2049 | USD | 179 490 | 199 774 | 0.37 |
| 100 000 | DIGITAL DUTCH FINCO BV 0.125% 15/10/2022 | EUR | 99 910 | 100 413 | 0.19 |
| 300 000 | DNB BANK ASA 0.05% 14/11/2023 | EUR | 299 379 | 300 861 | 0.56 |
| 100 000 | DOW CHEMICAL CO 0.5% 15/03/2027 | EUR | 99 442 | 98 825 | 0.18 |
| 200 000 | DR HORTON INC 2.5% 15/10/2024 | USD | 181 790 | 187 102 | 0.35 |
| 200 000 | DUKE ENERGY CAROLINAS LLC 3.2% 15/08/2049 | USD | 180 158 | 195 780 | 0.36 |
| 300 000 | EASYJET PLC 0.875% 11/06/2025 | EUR | 301 860 | 297 354 | 0.55 |
| 200 000 | ELECTRICITE DE FRANCE SA FRN PERPETUAL | EUR | 198 254 | 205 642 | 0.38 |
| 250 000 | EMPRESAS PUBLICAS DE MEDELLIN ESP - REGS - 4.25% 18/07/2029 | USD | 239 373 | 237 243 | 0.44 |
| 300 000 | ENBW ENERGIE BADEN-WUERTTEMBERG FRN 05/11/2079 | EUR | 298 089 | 297 907 | 0.55 |
| 100 000 | ENEL FINANCE INTERNATIONAL NV 0.375% 17/06/2027 | EUR | 99 257 | 100 105 | 0.19 |
| 400 000 | ENEL FINANCE INTERNATIONAL NV 2.65% 10/09/2024 | USD | 361 766 | 375 147 | 0.69 |
| 500 000 | ENGIE SA FRN PERPETUAL | EUR | 510 275 | 498 200 | 0.92 |
| 200 000 | ENGIE SA 1.25% 24/10/2041 | EUR | 201 132 | 213 868 | 0.40 |
| 400 000 | ENI SPA 1.125% 19/09/2028 | EUR | 427 100 | 428 504 | 0.79 |
| 200 000 | ENTERPRISE PRODUCTS OPERATING LLC 2.8% 31/01/2030 | USD | 178 598 | 185 287 | 0.34 |
| 200 000 | E.ON SE 0.25% 24/10/2026 | EUR | 198 276 | 200 692 | 0.37 |
| 100 000 | E.ON SE 0.625% 07/11/2031 | EUR | 98 673 | 99 017 | 0.18 |
| 200 000 | ERSTE GROUP BANK AG FRN 10/06/2030 | EUR | 198 870 | 196 218 | 0.36 |
| 200 000 | ERSTE GROUP BANK AG FRN PERPETUAL | EUR | 200 000 | 188 494 | 0.35 |
| 150 000 | ESSITY AB 0.5% 03/02/2030 | EUR | 148 809 | 150 572 | 0.28 |
| 500 000 | EUTELSAT SA 2% 02/10/2025 | EUR | 530 550 | 531 750 | 0.99 |
| 300 000 | EXPEDIA GROUP INC - 144A - 3.25% 15/02/2030 | USD | 270 687 | 270 040 | 0.50 |
| 200 000 | EXXON MOBIL CORP 4.114% 01/03/2046 | USD | 221 437 | 215 952 | 0.40 |
| 250 000 | FCA CAPITAL SUISSE SA 0.1% 23/10/2023 | CHF | 229 836 | 236 654 | 0.44 |
| 400 000 | FIDELITY NATIONAL INFORMATION SERVICES INC 0.75% 21/05/2023 | EUR | 409 944 | 408 228 | 0.76 |
| 200 000 | FOMENTO ECONOMICO MEXICANO SAB DE CV 3.5% 16/01/2050 | USD | 176 093 | 190 956 | 0.35 |
| 300 000 | FORD MOTOR CREDIT CO LLC 1.744% 19/07/2024 | EUR | 300 000 | 298 050 | 0.55 |

[1] Dieser Teilfonds wurde zum 3. September 2019 aufgelegt.

# Swiss Life Funds (LUX) Fixed Income Alpha Select[1]

## Anlagenübersicht (Fortsetzung)

| Nominalwert/ Menge | Bezeichnung | Kurs Währung | Kosten EUR | Marktwert EUR | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| **Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumenten, die an einer amtlichen Börse zugelassen sind oder auf einem anderen geregelten Markt gehandelt werden (Fortsetzung)** | | | | | |
| | **Anleihen (Fortsetzung)** | | | | |
| 300 000 | FRESENIUS MEDICAL CARE AG & CO KGAA 1.5% 11/07/2025 | EUR | 321 345 | 321 003 | 0.59 |
| 500 000 | GAZPROM PJSC VIA GAZ CAPITAL SA 2.75% 30/11/2021 | CHF | 480 322 | 491 752 | 0.91 |
| 250 000 | GILEAD SCIENCES INC 4.15% 01/03/2047 | USD | 259 008 | 272 762 | 0.51 |
| 200 000 | GOLDMAN SACHS GROUP INC FRN 21/04/2023 | EUR | 200 000 | 200 044 | 0.37 |
| 200 000 | GOLDMAN SACHS GROUP INC 0.125% 19/08/2024 | EUR | 200 270 | 198 000 | 0.37 |
| 300 000 | GOLDMAN SACHS GROUP INC 0.875% 21/01/2030 | EUR | 296 562 | 299 035 | 0.55 |
| 500 000 | HEIDELBERGCEMENT FINANCE LUXEMBOURG SA 1.125% 01/12/2027 | EUR | 522 748 | 515 720 | 0.96 |
| 200 000 | HOME DEPOT INC 3.125% 15/12/2049 | USD | 176 444 | 192 438 | 0.36 |
| 210 000 | HSBC HOLDINGS PLC FRN 18/05/2024 FRN 18/05/2024 | USD | 191 897 | 192 484 | 0.36 |
| 200 000 | HYUNDAI CAPITAL AMERICA 2.65% 10/02/2025 | USD | 181 447 | 185 039 | 0.34 |
| 100 000 | HYUNDAI CAPITAL AMERICA 2.85% 01/11/2022 | USD | 90 141 | 93 264 | 0.17 |
| 100 000 | ICADE SANTE SAS 0.875% 04/11/2029 | EUR | 99 392 | 101 213 | 0.19 |
| 300 000 | INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI SA 1.45% 28/10/2024 | EUR | 317 817 | 316 359 | 0.59 |
| 250 000 | INTERNATIONAL BUSINESS MACHINES CORP 4.25% 15/05/2049 | USD | 267 720 | 281 260 | 0.52 |
| 200 000 | INVERSIONES CMPC SA 3.85% 13/01/2030 | USD | 179 567 | 186 288 | 0.34 |
| 500 000 | JEFFERIES GROUP LLC 1% 19/07/2024 | EUR | 505 625 | 506 735 | 0.94 |
| 300 000 | JPMORGAN CHASE & CO FRN 04/11/2032 | EUR | 300 000 | 303 657 | 0.56 |
| 200 000 | JPMORGAN CHASE & CO FRN 24/02/2028 | EUR | 200 000 | 197 178 | 0.37 |
| 200 000 | JT INTERNATIONAL FINANCIAL SERVICES BV 1% 26/11/2029 | EUR | 198 886 | 208 648 | 0.39 |
| 400 000 | KAZAKHSTAN TEMIR ZHOLY NATIONAL CO JSC 3.638% 20/06/2022 | CHF | 393 151 | 403 435 | 0.75 |
| 300 000 | KINDER MORGAN INC/DE 4.3% 01/03/2028 | USD | 297 178 | 303 957 | 0.56 |
| 300 000 | KKR GROUP FINANCE CO VI LLC 3.75% 01/07/2029 | USD | 293 186 | 300 748 | 0.56 |
| 400 000 | KOREA NATIONAL OIL CORP 0% 04/10/2024 | CHF | 369 942 | 383 379 | 0.71 |
| 300 000 | LANDESBANK BADEN-WUERTTEMBERG 0.375% 18/02/2027 | EUR | 299 772 | 298 107 | 0.55 |
| 100 000 | LANDESBANK BADEN-WUERTTEMBERG 1.5% 03/02/2025 | GBP | 118 522 | 115 851 | 0.21 |
| 200 000 | LANDSBANKINN HF 0.5% 20/05/2024 | EUR | 199 792 | 199 850 | 0.37 |
| 200 000 | LEASEPLAN CORP NV 2.875% 24/10/2024 | USD | 179 514 | 187 803 | 0.35 |
| 200 000 | LLOYDS BANK CORPORATE MARKETS PLC 0.25% 04/10/2022 | EUR | 199 726 | 201 044 | 0.37 |
| 200 000 | LLOYDS BANKING GROUP PLC FRN 12/11/2025 | EUR | 198 870 | 198 978 | 0.37 |
| 500 000 | LUMINOR BANK AS/ESTONIA 1.375% 21/10/2022 | EUR | 510 925 | 508 110 | 0.94 |
| 100 000 | LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE 0.375% 11/02/2031 | EUR | 99 208 | 98 840 | 0.18 |
| 200 000 | LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE 1.125% 11/02/2027 | GBP | 234 211 | 230 311 | 0.43 |
| 400 000 | MEDTRONIC GLOBAL HOLDINGS SCA 1.125% 07/03/2027 | EUR | 425 156 | 423 084 | 0.78 |
| 200 000 | MERCK KGAA FRN 25/06/2079 | EUR | 216 210 | 213 516 | 0.40 |
| 300 000 | MICRON TECHNOLOGY INC 4.185% 15/02/2027 | USD | 279 626 | 291 613 | 0.54 |
| 250 000 | MICROSOFT CORP 3.7% 08/08/2046 | USD | 270 639 | 275 302 | 0.51 |
| 500 000 | MIZUHO FINANCIAL GROUP INC FRN 16/07/2023 | USD | 456 990 | 457 099 | 0.85 |
| 200 000 | MORGAN STANLEY FRN 26/07/2024 | EUR | 204 360 | 202 410 | 0.37 |
| 150 000 | MPLX LP FRN 09/09/2022 | USD | 135 999 | 136 854 | 0.25 |
| 300 000 | MPLX LP 4.125% 01/03/2027 | USD | 288 469 | 294 013 | 0.54 |
| 100 000 | NEW YORK LIFE GLOBAL FUNDING 0.25% 23/01/2027 | EUR | 99 482 | 100 373 | 0.19 |
| 250 000 | NGG FINANCE PLC FRN 05/12/2079 | EUR | 247 750 | 250 365 | 0.46 |
| 200 000 | NOMURA HOLDINGS INC 3.103% 16/01/2030 | USD | 180 140 | 187 517 | 0.35 |
| 200 000 | NYKREDIT REALKREDIT A/S 0.75% 20/01/2027 | EUR | 199 782 | 201 332 | 0.37 |

[1] Dieser Teilfonds wurde zum 3. September 2019 aufgelegt.

# Swiss Life Funds (LUX) Fixed Income Alpha Select[1]

## Anlagenübersicht (Fortsetzung)

| Nominalwert/ Menge | Bezeichnung | Kurs Währung | Kosten EUR | Marktwert EUR | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| **Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumenten, die an einer amtlichen Börse zugelassen sind oder auf einem anderen geregelten Markt gehandelt werden (Fortsetzung)** | | | | | |
| | **Anleihen (Fortsetzung)** | | | | |
| 500 000 | OCCIDENTAL PETROLEUM CORP FRN 15/08/2022 | USD | 457 720 | 456 684 | 0.85 |
| 500 000 | ONEOK INC 3.4% 01/09/2029 | USD | 454 372 | 469 443 | 0.87 |
| 100 000 | ORSTED A/S FRN 09/12/3019 | EUR | 99 079 | 101 878 | 0.19 |
| 200 000 | PETROLEOS DEL PERU SA - REGS - 5.625% 19/06/2047 | USD | 206 897 | 219 893 | 0.41 |
| 100 000 | PETROLEOS MEXICANOS - REGS - 5.95% 28/01/2031 | USD | 90 106 | 88 352 | 0.16 |
| 400 000 | PHILIP MORRIS INTERNATIONAL INC 0.125% 03/08/2026 | EUR | 389 880 | 391 256 | 0.72 |
| 200 000 | PHILLIPS 66 PARTNERS LP 3.15% 15/12/2029 | USD | 182 041 | 187 096 | 0.35 |
| 200 000 | PLAINS ALL AMERICAN PIPELINE LP / PAA FINANCE CORP 5.15% 01/06/2042 | USD | 189 127 | 189 469 | 0.35 |
| 500 000 | PROSEGUR CASH SA 1.375% 04/02/2026 | EUR | 522 875 | 515 375 | 0.96 |
| 400 000 | QNB FINANCE LTD 2.75% 12/02/2027 | USD | 362 858 | 367 365 | 0.68 |
| 300 000 | RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL AG FRN 12/03/2030 | EUR | 298 207 | 297 771 | 0.55 |
| 100 000 | RCS & RDS SA - REGS - 2.5% 05/02/2025 | EUR | 100 000 | 96 915 | 0.18 |
| 200 000 | ROGERS COMMUNICATIONS INC 3.7% 15/11/2049 | USD | 178 366 | 199 574 | 0.37 |
| 200 000 | ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP PLC FRN 01/11/2029 | USD | 179 929 | 189 420 | 0.35 |
| 300 000 | SANTANDER CONSUMER BANK AG 0.25% 15/10/2024 | EUR | 299 940 | 301 755 | 0.56 |
| 200 000 | SANTANDER UK GROUP HOLDINGS PLC FRN 28/02/2025 | EUR | 200 000 | 198 602 | 0.37 |
| 200 000 | SERVICE PROPERTIES TRUST 4.35% 01/10/2024 | USD | 180 929 | 191 932 | 0.36 |
| 100 000 | SHELL INTERNATIONAL FINANCE BV 3.125% 07/11/2049 | USD | 88 267 | 94 334 | 0.17 |
| 500 000 | SOUTHWEST AIRLINES CO 2.625% 10/02/2030 | USD | 452 045 | 456 247 | 0.84 |
| 300 000 | SOUTHWEST AIRLINES CO 3% 15/11/2026 | USD | 284 069 | 284 810 | 0.53 |
| 200 000 | STANDARD CHARTERED PLC FRN 30/01/2026 | USD | 179 507 | 185 523 | 0.34 |
| 500 000 | SUEZ FRN PERPETUAL | EUR | 497 545 | 493 375 | 0.91 |
| 450 000 | TANNER SERVICIOS FINANCIEROS SA 0.6% 07/11/2022 | CHF | 418 094 | 427 531 | 0.79 |
| 300 000 | TELECOM ITALIA SPA/MILANO 4% 11/04/2024 | EUR | 332 046 | 327 153 | 0.61 |
| 300 000 | TELEFONICA EUROPE BV FRN PERPETUAL | EUR | 300 100 | 304 119 | 0.56 |
| 300 000 | TELENOR ASA 0.25% 25/09/2027 | EUR | 297 634 | 301 338 | 0.56 |
| 200 000 | THALES SA 0.25% 29/01/2027 | EUR | 199 418 | 200 356 | 0.37 |
| 100 000 | THERMO FISHER SCIENTIFIC INC 0.5% 01/03/2028 | EUR | 99 060 | 99 627 | 0.18 |
| 300 000 | THERMO FISHER SCIENTIFIC INC 0.75% 12/09/2024 | EUR | 307 089 | 307 878 | 0.57 |
| 250 000 | TOTAL SA FRN PERPETUAL | EUR | 260 763 | 254 548 | 0.47 |
| 100 000 | TOYOTA MOTOR CREDIT CORP 0.25% 16/07/2026 | EUR | 99 769 | 100 213 | 0.19 |
| 250 000 | TRAFIGURA FUNDING SA 5.25% 19/03/2023 | USD | 217 044 | 222 341 | 0.41 |
| 200 000 | UBS GROUP AG FRN 29/01/2026 | EUR | 198 892 | 197 188 | 0.37 |
| 300 000 | UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD SE 0.875% 29/03/2032 | EUR | 296 130 | 302 751 | 0.56 |
| 300 000 | VATTENFALL AB 0.5% 24/06/2026 | EUR | 306 312 | 308 034 | 0.57 |
| 500 000 | VERIZON COMMUNICATIONS INC FRN 15/05/2025 | USD | 463 397 | 464 045 | 0.86 |
| 300 000 | VIFOR PHARMA AG 0.75% 13/09/2022 | CHF | 280 393 | 286 902 | 0.53 |
| 400 000 | VIVENDI SA 0.625% 11/06/2025 | EUR | 410 092 | 408 708 | 0.76 |
| 300 000 | VONOVIA FINANCE BV 0.5% 14/09/2029 | EUR | 296 895 | 295 398 | 0.55 |
| 150 000 | WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC 3.6% 20/11/2025 | GBP | 180 707 | 184 158 | 0.34 |
| 250 000 | WALMART INC 3.625% 15/12/2047 | USD | 268 062 | 268 019 | 0.50 |
| 200 000 | WINTERSHALL DEA FINANCE BV 0.84% 25/09/2025 | EUR | 200 000 | 201 739 | 0.37 |

[1] Dieser Teilfonds wurde zum 3. September 2019 aufgelegt.

# Swiss Life Funds (LUX) Fixed Income Alpha Select[1]

## Anlagenübersicht (Fortsetzung)

| Nominalwert/ Menge | Bezeichnung | Kurs Währung | Kosten EUR | Marktwert EUR | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| **Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumenten, die an einer amtlichen Börse zugelassen sind oder auf einem anderen geregelten Markt gehandelt werden (Fortsetzung)** | | | | | |
| | **Anleihen (Fortsetzung)** | | | | |
| 200 000 | ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC 1.164% 15/11/2027 | EUR | 200 000 | 205 808 | 0.38 |
| | **Gesamtsumme der Anleihen** | | **44 872 602** | **45 425 405** | **84.11** |
| | **Supranationale Institutionen, Regierungen und örtliche Behörden, Schuldtitel** | | | | |
| 200 000 | AFRICA FINANCE CORP 3.75% 30/10/2029 | USD | 177 776 | 188 442 | 0.35 |
| 200 000 | AFRICAN EXPORT-IMPORT BANK - REGS - 3.994% 21/09/2029 | USD | 181 004 | 190 037 | 0.35 |
| 205 000 | AFRICAN EXPORT-IMPORT BANK 5.25% 11/10/2023 | USD | 199 771 | 202 251 | 0.37 |
| 200 000 | BLACK SEA TRADE & DEVELOPMENT BANK 0.45% 13/06/2023 | CHF | 182 112 | 190 149 | 0.35 |
| 300 000 | COLOMBIA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 3% 30/01/2030 | USD | 267 367 | 275 521 | 0.51 |
| 2 000 000 | EUROPEAN INVESTMENT BANK 2.75% 25/08/2026 | PLN | 485 536 | 491 280 | 0.91 |
| 2 000 000 | EUROPEAN INVESTMENT BANK 3% 24/05/2024 | PLN | 482 468 | 488 680 | 0.90 |
| 200 000 | INDONESIA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 0.9% 14/02/2027 | EUR | 199 276 | 200 512 | 0.37 |
| 7 000 000 | ISRAEL GOVERNMENT BOND - FIXED 0% 28/09/2028 | ILS | 2 050 741 | 2 107 401 | 3.91 |
| 200 000 | KAZAKHSTAN GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND - REGS - 0.6% 30/09/2026 | EUR | 200 000 | 198 844 | 0.37 |
| 200 000 | MEXICO GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 1.125% 17/01/2030 | EUR | 197 830 | 197 174 | 0.37 |
| 100 000 | SLOVENIA GOVERNMENT BOND 0.275% 14/01/2030 | EUR | 99 793 | 102 796 | 0.19 |
| 200 000 | STATE OF ISRAEL 2.5% 15/01/2030 | USD | 179 075 | 189 125 | 0.35 |
| 500 000 | UNITED STATES TREASURY INFLATION INDEXED BONDS FRN 15/01/2030 | USD | 460 818 | 474 733 | 0.88 |
| | **Summe supranationale Institutionen, Regierungen und örtliche Behörden, Schuldtitel** | | **5 363 567** | **5 496 945** | **10.18** |
| | **Gesamtsumme übertragbarer Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer amtlichen Börse zugelassen sind oder auf einem anderen geregelten Markt gehandelt werden** | | **50 236 169** | **50 922 350** | **94.29** |
| | **Gesamtsumme der Anlagen** | | **50 236 169** | **50 922 350** | **94.29** |

[1] Dieser Teilfonds wurde zum 3. September 2019 aufgelegt.

Die beigefügten Anmerkungen sind integraler Bestandteil dieses Geschäftsberichts.

## Swiss Life Funds (LUX) Fixed Income Alpha Select[1]

### Sektorstruktur und geographische Verteilung der Anlagen

| Sektorstruktur | % |
|---|---|
| Finanzdienstleistungen | 17.92 |
| Banken | 15.09 |
| Behörden | 10.18 |
| Öl- und Gasproduzenten | 4.64 |
| Gas-, Wasser- und Mehrfachversorgungsunternehmen | 4.28 |
| Mobilfunk | 4.15 |
| Pharmazeutik und Biotechnologie | 3.49 |
| Industrietransport | 2.89 |
| Festnetz-Telekommunikation | 2.88 |
| Reise, Freizeit und Catering | 2.80 |
| Software- und Computerdienstleistungen | 2.29 |
| Geräte und Dienstleistungen im Gesundheitswesen | 2.28 |
| Immobilienbezogene Dienstleistungen und Investitionen | 1.80 |
| Versicherungen (ohne Lebensversicherung) | 1.74 |
| Technologie Hardware und Geräte | 1.72 |
| Elektrizität | 1.56 |
| Medien | 1.41 |
| Lebensmittel- und Arzneimittelhandel | 1.38 |
| Ölbranche: Maschinen, Dienstleistungen und Vertrieb | 1.36 |
| Immobilienbezogene Anlagefonds | 1.15 |
| Chemikalien | 1.07 |
| Persönliche Güter | 1.07 |
| Kundenbetreuung | 0.95 |
| Alternative Energie | 0.87 |
| Allgemeiner Einzelhandel | 0.85 |
| Lebensversicherung | 0.74 |
| Tabak | 0.72 |
| Automobilbau und -teile | 0.55 |
| Luft- und Raumfahrt und Verteidigung | 0.37 |
| Getränke | 0.35 |
| Haushaltswaren und Heimwerkerbedarf | 0.35 |
| Aktien Anlageinstrumente | 0.34 |
| Forst- und Papierindustrie | 0.34 |
| Industriemetalle und Bergbau | 0.34 |
| Industrietechnik | 0.19 |
| Allgemeine Industrie | 0.18 |
| | **94.29** |

| Geographische Verteilung | % |
|---|---|
| Vereinigte Staaten von Amerika | 31.84 |
| Frankreich | 7.66 |
| Luxemburg | 6.55 |
| Deutschland | 5.07 |
| Niederlande | 4.60 |
| Spanien | 4.48 |
| Großbritannien | 4.27 |
| Israel | 4.25 |
| Chile | 2.76 |
| Kaimaninseln | 2.07 |
| Mexiko | 1.98 |
| Italien | 1.77 |
| Kanada | 1.52 |
| Schweiz | 1.33 |
| Österreich | 1.26 |
| Japan | 1.19 |
| Kasachstan | 1.12 |
| Norwegen | 1.12 |
| Kolumbien | 0.95 |
| Estland | 0.94 |
| Schweden | 0.85 |
| Dänemark | 0.78 |
| Belgien | 0.74 |
| Ägypten | 0.73 |
| Südkorea | 0.71 |
| Bermuda | 0.53 |
| Indien | 0.44 |
| Peru | 0.41 |
| Island | 0.37 |
| Indonesien | 0.37 |
| Vereinigte Arabische Emirate | 0.37 |
| Griechenland | 0.35 |
| Nigeria | 0.35 |
| Tschechische Republik | 0.19 |
| Slowenien | 0.19 |
| Rumänien | 0.18 |
| | **94.29** |

[1] Dieser Teilfonds wurde zum 3. September 2019 aufgelegt.

# Swiss Life Funds (LUX) Multi Asset Risk Premia

## Anlagenübersicht

| Nominalwert/ Menge | Bezeichnung | Kurs Währung | Kosten EUR | Marktwert EUR | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| **Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumenten, die an einer amtlichen Börse zugelassen sind oder auf einem anderen geregelten Markt gehandelt werden** | | | | | |
| | **Anleihen** | | | | |
| 4 000 000 | AXA BANQUE FRN 06/03/2020 | EUR | 4 000 000 | 4 000 002 | 1.64 |
| 5 000 000 | AXA BANQUE FRN 06/11/2020 | EUR | 5 000 000 | 5 000 021 | 2.04 |
| 3 000 000 | ONEY BANK FRN 09/03/2021 | EUR | 3 000 000 | 3 000 031 | 1.23 |
| 5 000 000 | ORANGE BANK SA FRN 06/11/2020 | EUR | 5 000 000 | 4 999 909 | 2.05 |
| | **Gesamtsumme der Anleihen** | | **17 000 000** | **16 999 963** | **6.96** |
| | **Aktien** | | | | |
| 1 960 | AALBERTS NV | EUR | 78 282 | 66 150 | 0.03 |
| 5 553 | ABB LTD | CHF | 121 240 | 108 684 | 0.04 |
| 2 172 | ABBVIE INC | USD | 172 494 | 169 477 | 0.07 |
| 2 340 | ACCENTURE PLC - A | USD | 388 153 | 384 706 | 0.16 |
| 6 174 | ACS ACTIVIDADES DE CONSTRUCCION Y SERVICIOS SA | EUR | 213 777 | 165 772 | 0.07 |
| 6 174 | ACS ACTIVIDADES DE CONSTRUCCION Y SERVICIOS SA - RIGHTS - 03/03/2020 | EUR | - | 2 459 | 0.00 |
| 1 753 | ACTIVISION BLIZZARD INC | USD | 94 931 | 92 769 | 0.04 |
| 3 457 | ADECCO GROUP AG - REG | CHF | 175 836 | 167 054 | 0.07 |
| 1 529 | ADIDAS AG - REG - REG | EUR | 362 494 | 383 091 | 0.16 |
| 15 460 | ADMIRAL GROUP PLC | GBP | 371 232 | 379 691 | 0.16 |
| 420 | ADOBE INC | USD | 140 590 | 131 959 | 0.05 |
| 1 050 | ADVANCE AUTO PARTS INC | USD | 128 525 | 127 115 | 0.05 |
| 2 244 | ADVANCED MICRO DEVICES INC | USD | 97 180 | 92 910 | 0.04 |
| 235 | ADYEN NV | EUR | 160 985 | 187 342 | 0.08 |
| 45 922 | AEGON NV | EUR | 168 120 | 141 026 | 0.06 |
| 2 228 | AENA SME SA | EUR | 372 179 | 323 060 | 0.13 |
| 15 950 | AES CORP/VA | USD | 233 200 | 242 927 | 0.10 |
| 5 903 | AFLAC INC | USD | 271 058 | 230 273 | 0.09 |
| 7 209 | AGEAS | EUR | 345 953 | 301 913 | 0.12 |
| 12 003 | AGGREKO PLC | GBP | 119 754 | 94 522 | 0.04 |
| 1 166 | AIR LIQUIDE SA | EUR | 128 258 | 143 301 | 0.06 |
| 1 524 | AKAMAI TECHNOLOGIES INC | USD | 134 595 | 120 025 | 0.05 |
| 4 188 | ALASKA AIR GROUP INC | USD | 243 608 | 192 386 | 0.08 |
| 545 | ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUITIES INC | USD | 79 305 | 75 356 | 0.03 |
| 746 | ALIGN TECHNOLOGY INC | USD | 152 712 | 148 290 | 0.06 |
| 2 070 | ALLEGION PLC | USD | 198 735 | 216 696 | 0.09 |
| 1 413 | ALLERGAN PLC | USD | 239 463 | 245 270 | 0.10 |
| 2 029 | ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP | USD | 196 847 | 158 633 | 0.06 |
| 3 968 | ALLIANT ENERGY CORP | USD | 194 880 | 188 276 | 0.08 |
| 3 575 | ALLIANZ SE - REG | EUR | 691 638 | 696 410 | 0.29 |
| 904 | ALLREAL HOLDING AG | CHF | 156 356 | 175 146 | 0.07 |
| 3 264 | ALLSTATE CORP | USD | 303 327 | 312 746 | 0.13 |
| 435 | ALPHABET CLASS - A | USD | 503 171 | 530 360 | 0.22 |
| 5 634 | ALSTOM SA | EUR | 220 556 | 250 657 | 0.10 |
| 14 970 | ALSTRIA OFFICE REIT-AG | EUR | 235 351 | 256 736 | 0.11 |
| 1 572 | ALTEN SA | EUR | 154 999 | 157 672 | 0.06 |

# Swiss Life Funds (LUX) Multi Asset Risk Premia

## Anlagenübersicht (Fortsetzung)

| Nominalwert/ Menge | Bezeichnung | Kurs Währung | Kosten EUR | Marktwert EUR | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| **Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumenten, die an einer amtlichen Börse zugelassen sind oder auf einem anderen geregelten Markt gehandelt werden (Fortsetzung)** | | | | | |
| | **Anteile (Fortsetzung)** | | | | |
| 11 754 | ALTICE EUROPE NV - A | EUR | 68 831 | 56 925 | 0.02 |
| 441 | AMAZON.COM INC | USD | 693 760 | 756 278 | 0.31 |
| 17 696 | AMCOR PLC | USD | 158 632 | 150 145 | 0.06 |
| 1 572 | AMERICAN ELECTRIC POWER CO INC | USD | 124 747 | 127 741 | 0.05 |
| 1 965 | AMERICAN EXPRESS CO | USD | 205 979 | 196 652 | 0.08 |
| 1 178 | AMERICAN TOWER CORP | USD | 220 611 | 243 225 | 0.10 |
| 1 001 | AMERICAN WATER WORKS CO INC | USD | 106 470 | 112 689 | 0.05 |
| 2 463 | AMERIPRISE FINANCIAL INC | USD | 340 100 | 316 830 | 0.13 |
| 1 598 | AMERISOURCEBERGEN CORP | USD | 115 856 | 122 667 | 0.05 |
| 1 298 | AMGEN INC | USD | 214 193 | 236 014 | 0.10 |
| 2 776 | AMPLIFON SPA | EUR | 59 906 | 71 510 | 0.03 |
| 4 143 | AMUNDI SA | EUR | 264 283 | 267 845 | 0.11 |
| 2 041 | ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV | EUR | 142 645 | 103 540 | 0.04 |
| 352 | ANSYS INC | USD | 68 620 | 77 610 | 0.03 |
| 614 | ANTHEM INC | USD | 133 163 | 143 705 | 0.06 |
| 3 095 | AO SMITH CORP | USD | 130 713 | 111 436 | 0.05 |
| 1 453 | AON PLC | USD | 254 966 | 275 137 | 0.11 |
| 8 548 | APPLE INC | USD | 1 443 210 | 2 127 252 | 0.87 |
| 1 624 | APPLIED MATERIALS INC | USD | 89 818 | 85 927 | 0.04 |
| 3 190 | ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO | USD | 133 615 | 109 339 | 0.04 |
| 4 100 | ARKEMA SA | EUR | 353 357 | 348 746 | 0.14 |
| 4 123 | ARTHUR J GALLAGHER & CO | USD | 360 769 | 365 926 | 0.15 |
| 24 910 | ASHMORE GROUP PLC | GBP | 143 871 | 133 885 | 0.05 |
| 3 694 | ASM INTERNATIONAL NV | EUR | 291 896 | 387 685 | 0.16 |
| 748 | ASML HOLDING NV | EUR | 165 009 | 185 579 | 0.08 |
| 5 328 | ASR NEDERLAND NV | EUR | 183 825 | 160 479 | 0.07 |
| 35 599 | ASSICURAZIONI GENERALI SPA | EUR | 574 651 | 578 840 | 0.24 |
| 6 211 | ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC | GBP | 158 933 | 162 868 | 0.07 |
| 1 709 | ASSURANT INC | USD | 178 719 | 187 617 | 0.08 |
| 6 156 | ASTRAZENECA PLC | GBP | 541 071 | 486 352 | 0.20 |
| 1 092 | ATLAS COPCO AB | SEK | 32 860 | 34 771 | 0.01 |
| 2 438 | ATOS SE | EUR | 153 909 | 164 077 | 0.07 |
| 11 655 | AT&T INC | USD | 361 464 | 373 698 | 0.15 |
| 25 848 | AUTO TRADER GROUP PLC | GBP | 173 507 | 156 179 | 0.06 |
| 951 | AUTOMATIC DATA PROCESSING INC | USD | 148 020 | 133 969 | 0.05 |
| 1 227 | AVALONBAY COMMUNITIES INC | USD | 231 726 | 224 065 | 0.09 |
| 46 431 | AVAST PLC | GBP | 250 381 | 212 623 | 0.09 |
| 45 761 | AVIVA PLC | GBP | 206 413 | 186 673 | 0.08 |
| 9 785 | AXA SA | EUR | 236 112 | 205 045 | 0.08 |
| 162 556 | A2A SPA | EUR | 262 808 | 255 944 | 0.10 |
| 69 417 | BAE SYSTEMS PLC | GBP | 434 150 | 491 113 | 0.20 |
| 1 767 | BAKKAFROST P/F | NOK | 118 805 | 100 457 | 0.04 |
| 1 184 | BALL CORP | USD | 84 128 | 75 948 | 0.03 |
| 26 092 | BANKINTER SA | EUR | 163 951 | 139 331 | 0.06 |

# Swiss Life Funds (LUX) Multi Asset Risk Premia

## Anlagenübersicht (Fortsetzung)

| Nominalwert/ Menge | Bezeichnung | Kurs Währung | Kosten EUR | Marktwert EUR | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| **Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumenten, die an einer amtlichen Börse zugelassen sind oder auf einem anderen geregelten Markt gehandelt werden (Fortsetzung)** | | | | | |
| | **Anteile (Fortsetzung)** | | | | |
| 8 668 | BARRATT DEVELOPMENTS PLC | GBP | 62 923 | 76 323 | 0.03 |
| 135 | BARRY CALLEBAUT AG - REG | CHF | 269 564 | 251 780 | 0.10 |
| 2 481 | BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG | EUR | 164 565 | 146 205 | 0.06 |
| 393 | BECTON DICKINSON AND CO | USD | 90 307 | 85 086 | 0.03 |
| 3 520 | BEIERSDORF AG | EUR | 380 485 | 334 048 | 0.14 |
| 5 470 | BELLWAY PLC | GBP | 176 782 | 236 814 | 0.10 |
| 1 347 | BERKELEY GROUP HOLDINGS | GBP | 74 149 | 74 465 | 0.03 |
| 1 735 | BERKSHIRE HATHAWAY INC - B | USD | 362 887 | 325 914 | 0.13 |
| 4 791 | BEST BUY CO INC | USD | 313 674 | 329 955 | 0.14 |
| 1 159 | BIOGEN INC | USD | 232 581 | 325 389 | 0.13 |
| 197 | BLACKROCK INC | USD | 99 540 | 83 038 | 0.03 |
| 2 801 | BNP PARIBAS SA | EUR | 138 650 | 122 642 | 0.05 |
| 131 | BOOKING HOLDINGS INC | USD | 205 305 | 202 223 | 0.08 |
| 3 891 | BORGWARNER INC | USD | 131 187 | 111 936 | 0.05 |
| 5 261 | BOUYGUES SA | EUR | 188 669 | 186 660 | 0.08 |
| 57 935 | BP PLC | GBP | 319 623 | 266 887 | 0.11 |
| 7 441 | BRENNTAG AG | EUR | 333 178 | 300 691 | 0.12 |
| 10 102 | BRISTOL-MYERS SQUIBB CO | USD | 441 843 | 543 151 | 0.22 |
| 1 241 | BROWN-FORMAN CORP - B | USD | 78 298 | 69 379 | 0.03 |
| 112 986 | BT GROUP PLC | GBP | 231 045 | 186 070 | 0.08 |
| 15 627 | BUNZL PLC | GBP | 367 244 | 339 816 | 0.14 |
| 7 311 | BURBERRY GROUP PLC | GBP | 144 261 | 140 192 | 0.06 |
| 7 374 | BUREAU VERITAS SA | EUR | 157 951 | 162 597 | 0.07 |
| 2 666 | CADENCE DESIGN SYSTEMS INC | USD | 152 857 | 160 526 | 0.07 |
| 4 732 | CAMPBELL SOUP CO | USD | 193 336 | 194 372 | 0.08 |
| 1 884 | CAPGEMINI SE | EUR | 184 783 | 186 930 | 0.08 |
| 96 251 | CAPITA PLC | GBP | 176 041 | 144 721 | 0.06 |
| 2 470 | CAPRI HOLDINGS LTD | USD | 70 517 | 58 059 | 0.02 |
| 2 151 | CARL ZEISS MEDITEC AG | EUR | 248 180 | 203 807 | 0.08 |
| 2 321 | CASTELLUM AB | SEK | 40 634 | 48 166 | 0.02 |
| 2 722 | CBOE GLOBAL MARKETS INC | USD | 285 528 | 282 496 | 0.12 |
| 3 658 | CBRE GROUP INC | USD | 170 510 | 186 954 | 0.08 |
| 1 270 | CELANESE CORP - A | USD | 126 636 | 108 380 | 0.04 |
| 2 315 | CEMBRA MONEY BANK AG | CHF | 214 633 | 235 800 | 0.10 |
| 1 900 | CERNER CORP | USD | 118 553 | 119 817 | 0.05 |
| 4 472 | CH ROBINSON WORLDWIDE INC | USD | 320 740 | 280 505 | 0.11 |
| 1 019 | CHARLES SCHWAB CORP | USD | 44 737 | 37 803 | 0.02 |
| 552 | CHARTER COMMUNICATIONS INC | USD | 198 985 | 247 831 | 0.10 |
| 1 135 | CHEVRON CORP | USD | 119 010 | 96 446 | 0.04 |
| 283 | CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC | USD | 218 465 | 199 302 | 0.08 |
| 372 | CHRISTIAN DIOR SE | EUR | 164 014 | 141 732 | 0.06 |
| 1 015 | CHUBB LTD | USD | 150 916 | 134 012 | 0.05 |
| 2 071 | CHURCH & DWIGHT CO INC | USD | 129 154 | 131 072 | 0.05 |
| 2 116 | CIE GENERALE DES ETABLISSEMENTS MICHELIN SCA | EUR | 206 395 | 203 644 | 0.08 |

# Swiss Life Funds (LUX) Multi Asset Risk Premia

## Anlagenübersicht (Fortsetzung)

| Nominal wert/ Menge | Bezeichnung | Kurs Währung | Kosten EUR | Marktwert EUR | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| **Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumenten, die an einer amtlichen Börse zugelassen sind oder auf einem anderen geregelten Markt gehandelt werden (Fortsetzung)** | | | | | |
| | **Anteile (Fortsetzung)** | | | | |
| 843 | CIGNA CORP | USD | 114 050 | 140 396 | 0.06 |
| 1 860 | CIMAREX ENERGY CO | USD | 74 061 | 55 963 | 0.02 |
| 998 | CINTAS CORP | USD | 226 122 | 242 347 | 0.10 |
| 12 677 | CISCO SYSTEMS INC | USD | 559 787 | 460 824 | 0.19 |
| 2 761 | CITRIX SYSTEMS INC | USD | 233 055 | 259 875 | 0.11 |
| 2 085 | CLOROX CO | USD | 293 727 | 302 600 | 0.12 |
| 799 | CME GROUP INC | USD | 154 763 | 144 619 | 0.06 |
| 5 077 | CMS ENERGY CORP | USD | 311 349 | 279 259 | 0.11 |
| 10 257 | CNP ASSURANCES | EUR | 197 435 | 145 137 | 0.06 |
| 12 544 | COCA-COLA CO | USD | 645 333 | 610 841 | 0.25 |
| 2 392 | COCA-COLA HBC AG | EUR | 80 076 | 67 933 | 0.03 |
| 1 192 | COFINIMMO SA | EUR | 148 837 | 171 886 | 0.07 |
| 4 710 | COGNIZANT TECHNOLOGY SOLUTIONS CORP - A | USD | 263 884 | 261 259 | 0.11 |
| 3 162 | COLGATE-PALMOLIVE CO | USD | 219 806 | 194 507 | 0.08 |
| 3 298 | COLOPLAST A/S | DKK | 347 851 | 399 311 | 0.16 |
| 12 936 | COLRUYT SA | EUR | 616 572 | 540 984 | 0.22 |
| 9 566 | COMPASS GROUP PLC | GBP | 196 671 | 190 274 | 0.08 |
| 6 981 | CONOCOPHILLIPS | USD | 353 989 | 307 725 | 0.13 |
| 3 244 | CONSOLIDATED EDISON INC | USD | 262 209 | 232 775 | 0.10 |
| 30 803 | CONVATEC GROUP PLC | GBP | 69 536 | 73 430 | 0.03 |
| 4 262 | COPART INC | USD | 320 806 | 327 783 | 0.13 |
| 442 | COSTCO WHOLESALE CORP | USD | 125 065 | 113 127 | 0.05 |
| 4 695 | COVESTRO AG | EUR | 234 683 | 161 931 | 0.07 |
| 1 414 | COVIVIO | EUR | 152 288 | 135 744 | 0.06 |
| 2 985 | CRH PLC | EUR | 101 221 | 90 953 | 0.04 |
| 4 215 | CTS EVENTIM AG & CO KGAA | EUR | 215 122 | 201 646 | 0.08 |
| 2 095 | CUMMINS INC | USD | 296 949 | 288 545 | 0.12 |
| 4 084 | CVS HEALTH CORP | USD | 261 483 | 220 029 | 0.09 |
| 2 600 | DAIMLER AG | EUR | 114 595 | 97 604 | 0.04 |
| 1 279 | DARDEN RESTAURANTS INC | USD | 133 496 | 113 526 | 0.05 |
| 1 015 | DAVITA INC | USD | 68 426 | 71 723 | 0.03 |
| 1 130 | DELIVERY HERO SE | EUR | 74 580 | 76 840 | 0.03 |
| 2 626 | DELTA AIR LINES INC | USD | 129 250 | 110 280 | 0.05 |
| 1 640 | DERWENT LONDON PLC | GBP | 80 479 | 74 758 | 0.03 |
| 2 105 | DEUTSCHE BOERSE AG | EUR | 287 762 | 299 015 | 0.12 |
| 11 437 | DEUTSCHE LUFTHANSA AG - REG | EUR | 167 576 | 133 699 | 0.05 |
| 15 941 | DEUTSCHE TELEKOM AG - REG | EUR | 238 174 | 235 225 | 0.10 |
| 10 289 | DIAGEO PLC | GBP | 386 949 | 330 882 | 0.14 |
| 11 098 | DIALOG SEMICONDUCTOR PLC | EUR | 488 460 | 339 710 | 0.14 |
| 1 474 | DIASORIN SPA | EUR | 137 398 | 151 085 | 0.06 |
| 3 292 | DIPLOMA PLC | GBP | 76 779 | 71 969 | 0.03 |
| 87 606 | DIRECT LINE INSURANCE GROUP PLC | GBP | 312 020 | 312 751 | 0.13 |
| 2 557 | DISCOVER FINANCIAL SERVICES | USD | 176 461 | 152 659 | 0.06 |
| 10 610 | DISCOVERY COMMUNICATIONS INC - A | USD | 272 264 | 248 238 | 0.10 |

# Swiss Life Funds (LUX) Multi Asset Risk Premia

## Anlagenübersicht (Fortsetzung)

| Nominal wert/ Menge | Bezeichnung | Kurs Währung | Kosten EUR | Marktwert EUR | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| **Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumenten, die an einer amtlichen Börse zugelassen sind oder auf einem anderen geregelten Markt gehandelt werden (Fortsetzung)** | | | | | |
| | **Anteile (Fortsetzung)** | | | | |
| 1 668 | DOLLAR GENERAL CORP | USD | 216 221 | 228 231 | 0.09 |
| 6 375 | DR HORTON INC | USD | 294 110 | 309 160 | 0.13 |
| 945 | DSV PANALPINA A/S | DKK | 100 035 | 86 218 | 0.04 |
| 2 214 | DTE ENERGY CO | USD | 253 857 | 225 078 | 0.09 |
| 2 344 | DUKE REALTY CORP | USD | 75 500 | 69 288 | 0.03 |
| 1 824 | EASTMAN CHEMICAL CO | USD | 122 751 | 102 139 | 0.04 |
| 948 | EATON CORP PLC | USD | 71 385 | 78 294 | 0.03 |
| 5 536 | EBAY INC | USD | 179 517 | 174 580 | 0.07 |
| 42 079 | EDP - ENERGIAS DE PORTUGAL SA | EUR | 157 411 | 177 573 | 0.07 |
| 960 | EDWARDS LIFESCIENCES CORP | USD | 180 585 | 179 022 | 0.07 |
| 840 | EIFFAGE SA | EUR | 85 848 | 80 993 | 0.03 |
| 1 982 | ELECTRONIC ARTS INC | USD | 171 198 | 182 908 | 0.07 |
| 4 138 | ELI LILLY & CO | USD | 488 189 | 475 148 | 0.19 |
| 861 | ELIA GROUP SA/NV | EUR | 67 158 | 77 576 | 0.03 |
| 4 140 | ELIS SA | EUR | 76 217 | 65 205 | 0.03 |
| 5 878 | ELISA OYJ | EUR | 255 740 | 305 303 | 0.13 |
| 2 900 | EMERSON ELECTRIC CO | USD | 189 984 | 169 256 | 0.07 |
| 14 515 | ENAGAS SA | EUR | 308 450 | 339 651 | 0.14 |
| 7 444 | ENDESA SA | EUR | 157 604 | 172 924 | 0.07 |
| 19 729 | ENEL SPA | EUR | 92 102 | 149 467 | 0.06 |
| 6 965 | ENGIE SA | EUR | 109 420 | 104 684 | 0.04 |
| 25 071 | ENI SPA | EUR | 333 424 | 279 742 | 0.11 |
| 1 855 | ENTERGY CORP | USD | 205 240 | 197 431 | 0.08 |
| 16 529 | EPIROC AB - A | SEK | 143 829 | 171 583 | 0.07 |
| 33 308 | EQT CORP | USD | 246 337 | 177 994 | 0.07 |
| 182 | EQUINIX INC | USD | 88 622 | 94 906 | 0.04 |
| 6 081 | EQUITY RESIDENTIAL | USD | 462 541 | 415 752 | 0.17 |
| 1 150 | ESSEX PROPERTY TRUST INC | USD | 317 675 | 296 658 | 0.12 |
| 1 050 | ESSILORLUXOTTICA SA | EUR | 143 275 | 129 255 | 0.05 |
| 7 217 | ESSITY AB | SEK | 203 303 | 194 901 | 0.08 |
| 3 097 | EURONEXT NV | EUR | 212 230 | 233 049 | 0.10 |
| 25 093 | EUTELSAT COMMUNICATIONS SA | EUR | 406 878 | 307 138 | 0.13 |
| 1 028 | EVERSOURCE ENERGY | USD | 85 096 | 80 915 | 0.03 |
| 12 900 | EVOLUTION GAMING GROUP AB | SEK | 358 019 | 425 173 | 0.17 |
| 3 460 | EXELON CORP | USD | 152 754 | 135 792 | 0.06 |
| 1 891 | EXPEDITORS INTERNATIONAL OF WASHINGTON INC | USD | 126 328 | 121 229 | 0.05 |
| 7 265 | EXPERIAN PLC | GBP | 202 450 | 218 892 | 0.09 |
| 3 085 | EXTRA SPACE STORAGE INC | USD | 302 128 | 281 861 | 0.12 |
| 10 834 | FABEGE AB | SEK | 149 665 | 159 668 | 0.07 |
| 3 410 | FACEBOOK INC | USD | 600 212 | 597 499 | 0.24 |
| 1 876 | FASTIGHETS AB BALDER - B | SEK | 60 511 | 79 588 | 0.03 |
| 3 829 | FAURECIA SE | EUR | 179 439 | 156 530 | 0.06 |
| 6 197 | FERGUSON PLC | GBP | 457 904 | 485 700 | 0.20 |
| 1 352 | FERRARI NV | EUR | 166 011 | 191 376 | 0.08 |

# Swiss Life Funds (LUX) Multi Asset Risk Premia

## Anlagenübersicht (Fortsetzung)

| Nominalwert/ Menge | Bezeichnung | Kurs Währung | Kosten EUR | Marktwert EUR | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| **Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumenten, die an einer amtlichen Börse zugelassen sind oder auf einem anderen geregelten Markt gehandelt werden (Fortsetzung)** | | | | | |
| | **Anteile (Fortsetzung)** | | | | |
| 3 461 | FERROVIAL SA | EUR | 72 612 | 89 571 | 0.04 |
| 16 082 | FINECOBANK BANCA FINECO SPA | EUR | 179 992 | 152 683 | 0.06 |
| 11 493 | FIRSTENERGY CORP | USD | 477 940 | 465 914 | 0.19 |
| 2 280 | FISERV INC | USD | 239 246 | 226 993 | 0.09 |
| 2 639 | FLIR SYSTEMS INC | USD | 129 720 | 102 033 | 0.04 |
| 773 | FLUGHAFEN ZURICH AG | CHF | 122 857 | 105 854 | 0.04 |
| 925 | FMC CORP | USD | 83 147 | 78 399 | 0.03 |
| 731 | FORTINET INC | USD | 73 412 | 67 919 | 0.03 |
| 25 152 | FORTUM OYJ | EUR | 543 749 | 484 931 | 0.20 |
| 1 172 | FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC | USD | 65 095 | 65 885 | 0.03 |
| 3 619 | FOX CORP | USD | 106 852 | 101 277 | 0.04 |
| 25 835 | FREENET AG | EUR | 532 146 | 457 021 | 0.19 |
| 2 832 | FRESENIUS MEDICAL CARE AG & CO KGAA | EUR | 187 631 | 196 314 | 0.08 |
| 4 469 | FRESENIUS SE & CO KGAA | EUR | 197 292 | 189 553 | 0.08 |
| 1 090 | F5 NETWORKS INC | USD | 132 234 | 119 027 | 0.05 |
| 6 736 | GALENICA AG | CHF | 329 392 | 411 477 | 0.17 |
| 1 489 | GARMIN LTD | USD | 116 950 | 119 817 | 0.05 |
| 1 011 | GEBERIT AG - REG | CHF | 420 133 | 455 461 | 0.19 |
| 510 | GECINA SA | EUR | 80 141 | 81 957 | 0.03 |
| 9 759 | GENERAL ELECTRIC CO | USD | 115 126 | 96 662 | 0.04 |
| 5 779 | GENERAL MILLS INC | USD | 271 102 | 257 791 | 0.11 |
| 168 | GENMAB A/S | DKK | 36 804 | 34 216 | 0.01 |
| 194 | GEORG FISCHER AG - REG | CHF | 177 561 | 149 799 | 0.06 |
| 16 335 | GETLINK SE - REG | EUR | 261 353 | 238 164 | 0.10 |
| 2 774 | GILEAD SCIENCES INC | USD | 165 361 | 175 160 | 0.07 |
| 103 | GIVAUDAN SA - REG | CHF | 268 703 | 291 200 | 0.12 |
| 16 659 | GLANBIA PLC | EUR | 199 920 | 175 752 | 0.07 |
| 38 897 | GLAXOSMITHKLINE PLC | GBP | 686 984 | 706 610 | 0.29 |
| 866 | GLOBE LIFE INC | USD | 72 030 | 73 052 | 0.03 |
| 2 665 | GN STORE NORD A/S | DKK | 109 057 | 133 732 | 0.05 |
| 14 747 | GRAND CITY PROPERTIES SA | EUR | 300 290 | 312 636 | 0.13 |
| 6 961 | GREAT PORTLAND ESTATES PLC | GBP | 76 715 | 68 206 | 0.03 |
| 9 197 | GREGGS PLC | GBP | 238 737 | 223 521 | 0.09 |
| 8 458 | GRIFOLS SA | EUR | 263 967 | 245 282 | 0.10 |
| 7 544 | GVC HOLDINGS PLC | GBP | 70 193 | 69 268 | 0.03 |
| 8 809 | H LUNDBECK A/S | DKK | 302 549 | 274 657 | 0.11 |
| 3 912 | HALLIBURTON CO | USD | 79 327 | 60 401 | 0.02 |
| 7 223 | HALMA PLC | GBP | 158 355 | 162 023 | 0.07 |
| 21 435 | HANESBRANDS INC | USD | 310 207 | 258 364 | 0.11 |
| 3 580 | HANNOVER RUECK SE - REG | EUR | 493 233 | 576 380 | 0.24 |
| 8 292 | HARTFORD FINANCIAL SERVICES GROUP INC | USD | 417 902 | 377 064 | 0.15 |
| 87 892 | HAYS PLC | GBP | 149 434 | 141 351 | 0.06 |
| 13 381 | HEALTHPEAK PROPERTIES INC | USD | 386 197 | 385 429 | 0.16 |
| 3 913 | HELLA GMBH & CO KGAA | EUR | 182 821 | 146 111 | 0.06 |

# Swiss Life Funds (LUX) Multi Asset Risk Premia

## Anlagenübersicht (Fortsetzung)

| Nominal wert/ Menge | Bezeichnung | Kurs Währung | Kosten EUR | Marktwert EUR | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| **Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumenten, die an einer amtlichen Börse zugelassen sind oder auf einem anderen geregelten Markt gehandelt werden (Fortsetzung)** | | | | | |
| | **Anteile (Fortsetzung)** | | | | |
| 3 424 | HELLOFRESH SE | EUR | 67 042 | 75 157 | 0.03 |
| 2 941 | HELVETIA HOLDING AG | CHF | 335 703 | 353 777 | 0.14 |
| 2 241 | HENKEL AG & CO KGAA - PFD | EUR | 212 684 | 187 527 | 0.08 |
| 16 068 | HENNES & MAURITZ AB - B | SEK | 297 565 | 261 565 | 0.11 |
| 4 055 | HENRY SCHEIN INC | USD | 228 323 | 224 964 | 0.09 |
| 123 870 | HERA SPA | EUR | 391 800 | 480 368 | 0.20 |
| 326 | HERMES INTERNATIONAL | EUR | 191 579 | 205 380 | 0.08 |
| 3 237 | HERSHEY CO | USD | 397 898 | 424 321 | 0.17 |
| 23 376 | HIKMA PHARMACEUTICALS PLC | GBP | 473 581 | 486 032 | 0.20 |
| 1 564 | HOCHTIEF AG | EUR | 192 228 | 139 118 | 0.06 |
| 3 067 | HOLLYFRONTIER CORP | USD | 113 759 | 94 038 | 0.04 |
| 7 168 | HOLMEN AB | SEK | 193 939 | 181 462 | 0.07 |
| 785 | HOME DEPOT INC | USD | 170 794 | 155 678 | 0.06 |
| 19 724 | HOMESERVE PLC | GBP | 287 473 | 271 335 | 0.11 |
| 1 669 | HONEYWELL INTERNATIONAL INC | USD | 268 119 | 246 403 | 0.10 |
| 3 255 | HORMEL FOODS CORP | USD | 123 409 | 123 272 | 0.05 |
| 19 266 | HOST HOTELS & RESORTS INC | USD | 310 093 | 253 968 | 0.10 |
| 30 256 | HOWDEN JOINERY GROUP PLC | GBP | 180 051 | 223 767 | 0.09 |
| 6 926 | HP INC | USD | 119 683 | 131 086 | 0.05 |
| 11 697 | H&R BLOCK INC | USD | 283 861 | 220 107 | 0.09 |
| 66 704 | HSBC HOLDINGS PLC | GBP | 485 444 | 406 375 | 0.17 |
| 6 317 | HUGO BOSS AG | EUR | 311 118 | 249 901 | 0.10 |
| 1 916 | HUHTAMAKI OYJ | EUR | 77 004 | 71 467 | 0.03 |
| 705 | HUMANA INC | USD | 226 976 | 205 175 | 0.08 |
| 554 | HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIES INC | USD | 124 571 | 103 658 | 0.04 |
| 36 890 | HUSQVARNA AB - B | SEK | 270 592 | 222 458 | 0.09 |
| 24 694 | IBERDROLA SA | EUR | 182 703 | 254 842 | 0.10 |
| 8 705 | ICA GRUPPEN AB | SEK | 334 644 | 294 102 | 0.12 |
| 785 | ICADE | EUR | 76 127 | 70 846 | 0.03 |
| 732 | IDEXX LABORATORIES INC | USD | 172 041 | 169 604 | 0.07 |
| 75 247 | IG GROUP HOLDINGS PLC | GBP | 474 934 | 589 411 | 0.24 |
| 1 271 | IHS MARKIT LTD | USD | 70 726 | 82 431 | 0.03 |
| 571 | ILIAD SA | EUR | 67 207 | 72 117 | 0.03 |
| 1 775 | ILLINOIS TOOL WORKS INC | USD | 240 903 | 271 118 | 0.11 |
| 12 529 | IMI PLC | GBP | 133 085 | 146 569 | 0.06 |
| 7 259 | IMMOFINANZ AG | EUR | 186 556 | 169 135 | 0.07 |
| 19 533 | IMPERIAL BRANDS PLC | GBP | 419 078 | 353 159 | 0.14 |
| 22 738 | INCHCAPE PLC | GBP | 160 006 | 152 565 | 0.06 |
| 18 448 | INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL SA | EUR | 528 261 | 518 942 | 0.21 |
| 639 | INGENICO GROUP SA | EUR | 56 321 | 81 760 | 0.03 |
| 4 393 | INTEL CORP | USD | 196 273 | 222 040 | 0.09 |
| 369 | INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC | USD | 28 293 | 29 971 | 0.01 |
| 4 170 | INTERMEDIATE CAPITAL GROUP PLC | GBP | 64 368 | 77 198 | 0.03 |
| 2 552 | INTERNATIONAL BUSINESS MACHINES CORP | USD | 298 585 | 302 374 | 0.12 |

# Swiss Life Funds (LUX) Multi Asset Risk Premia

## Anlagenübersicht (Fortsetzung)

| Nominal wert/ Menge | Bezeichnung | Kurs Währung | Kosten EUR | Marktwert EUR | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| **Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumenten, die an einer amtlichen Börse zugelassen sind oder auf einem anderen geregelten Markt gehandelt werden (Fortsetzung)** | | | | | |
| | **Anteile (Fortsetzung)** | | | | |
| 3 098 | INTERNATIONAL PAPER CO | USD | 121 587 | 104 240 | 0.04 |
| 11 953 | INTERPUBLIC GROUP OF COS INC | USD | 228 292 | 232 433 | 0.10 |
| 136 | INTERTEK GROUP PLC | GBP | 9 118 | 8 334 | 0.00 |
| 858 | INTUIT INC | USD | 209 593 | 207 656 | 0.09 |
| 2 633 | INVESTOR AB - B | SEK | 125 197 | 118 008 | 0.05 |
| 4 850 | IPSEN SA | EUR | 449 493 | 284 210 | 0.12 |
| 27 396 | ITALGAS SPA | EUR | 137 859 | 151 555 | 0.06 |
| 221 942 | ITV PLC | GBP | 274 040 | 300 801 | 0.12 |
| 32 368 | IWG PLC | GBP | 140 602 | 132 378 | 0.05 |
| 72 055 | J SAINSBURY PLC | GBP | 179 665 | 164 018 | 0.07 |
| 885 | JACOBS ENGINEERING GROUP INC | USD | 77 411 | 74 397 | 0.03 |
| 8 148 | JD SPORTS FASHION PLC | GBP | 67 576 | 69 831 | 0.03 |
| 19 424 | JERONIMO MARTINS SGPS SA | EUR | 291 122 | 308 939 | 0.13 |
| 2 666 | JM SMUCKER CO | USD | 258 972 | 249 963 | 0.10 |
| 5 565 | JOHNSON & JOHNSON | USD | 656 860 | 681 307 | 0.28 |
| 3 585 | JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL PLC | USD | 128 007 | 119 353 | 0.05 |
| 2 307 | JPMORGAN CHASE & CO | USD | 269 568 | 243 858 | 0.10 |
| 11 994 | JUNIPER NETWORKS INC | USD | 254 194 | 231 702 | 0.09 |
| 74 085 | JUPITER FUND MANAGEMENT PLC | GBP | 323 721 | 258 451 | 0.11 |
| 564 | KANSAS CITY SOUTHERN | USD | 76 070 | 77 367 | 0.03 |
| 3 383 | KELLOGG CO | USD | 200 957 | 186 235 | 0.08 |
| 461 | KERING SA | EUR | 214 975 | 233 174 | 0.10 |
| 2 462 | KERRY GROUP PLC | EUR | 286 373 | 283 130 | 0.12 |
| 3 827 | KESKO OYJ - B | EUR | 203 853 | 234 748 | 0.10 |
| 2 653 | KIMBERLY-CLARK CORP | USD | 333 016 | 316 853 | 0.13 |
| 6 806 | KIMCO REALTY CORP | USD | 125 020 | 107 501 | 0.04 |
| 7 336 | KINDER MORGAN | USD | 133 340 | 128 027 | 0.05 |
| 68 675 | KINGFISHER PLC | GBP | 166 674 | 151 214 | 0.06 |
| 2 888 | KOHL'S CORP | USD | 123 972 | 102 932 | 0.04 |
| 4 502 | KOJAMO OYJ | EUR | 67 080 | 76 354 | 0.03 |
| 5 682 | KONE OYJ - B | EUR | 274 861 | 289 782 | 0.12 |
| 19 605 | KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV | EUR | 397 390 | 415 234 | 0.17 |
| 1 830 | KONINKLIJKE DSM NV | EUR | 197 743 | 186 203 | 0.08 |
| 73 188 | KONINKLIJKE KPN NV | EUR | 204 469 | 161 087 | 0.07 |
| 5 088 | KONINKLIJKE VOPAK NV | EUR | 246 019 | 219 547 | 0.09 |
| 5 164 | KROGER CO | USD | 110 230 | 132 244 | 0.05 |
| 1 277 | KUEHNE + NAGEL INTERNATIONAL AG - REG | CHF | 173 776 | 168 805 | 0.07 |
| 837 | LABORATORY CORP OF AMERICA HOLDINGS | USD | 128 599 | 133 873 | 0.05 |
| 4 872 | LAFARGEHOLCIM LTD - REG | CHF | 228 932 | 204 869 | 0.08 |
| 9 492 | LAGARDERE SCA | EUR | 181 487 | 148 645 | 0.06 |
| 305 | LAM RESEARCH CORP | USD | 49 376 | 81 475 | 0.03 |
| 4 395 | LAMB WESTON HOLDINGS INC | USD | 314 290 | 347 655 | 0.14 |
| 1 672 | LEG IMMOBILIEN AG | EUR | 174 865 | 180 743 | 0.07 |
| 1 280 | LEGRAND SA | EUR | 82 376 | 88 346 | 0.04 |

# Swiss Life Funds (LUX) Multi Asset Risk Premia

## Anlagenübersicht (Fortsetzung)

| Nominal wert/ Menge | Bezeichnung | Kurs Währung | Kosten EUR | Marktwert EUR | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| **Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumenten, die an einer amtlichen Börse zugelassen sind oder auf einem anderen geregelten Markt gehandelt werden (Fortsetzung)** | | | | | |
| | **Anteile (Fortsetzung)** | | | | |
| 3 557 | LEIDOS HOLDINGS INC | USD | 282 217 | 332 401 | 0.14 |
| 5 576 | LENNAR CORP | USD | 308 463 | 306 301 | 0.13 |
| 4 797 | LINDE PLC | EUR | 864 284 | 823 885 | 0.34 |
| 8 833 | LOGITECH INTERNATIONAL SA - REG | CHF | 293 372 | 307 961 | 0.13 |
| 1 246 | LONDON STOCK EXCHANGE GROUP PLC | GBP | 100 862 | 109 770 | 0.04 |
| 4 844 | LOOMIS AB - B | SEK | 174 225 | 151 376 | 0.06 |
| 1 221 | L'OREAL SA | EUR | 288 468 | 294 261 | 0.12 |
| 1 966 | LUNDBERGFORETAGEN AB - B | SEK | 63 127 | 73 290 | 0.03 |
| 1 583 | LYONDELLBASELL INDUSTRIES NV - A | USD | 113 826 | 102 983 | 0.04 |
| 7 875 | MACY'S INC | USD | 119 111 | 94 848 | 0.04 |
| 184 052 | MAN GROUP PLC | GBP | 319 544 | 313 763 | 0.13 |
| 72 196 | MAPFRE SA | EUR | 179 862 | 146 197 | 0.06 |
| 2 654 | MARATHON PETROLEUM CORP | USD | 161 636 | 114 573 | 0.05 |
| 985 | MARKETAXESS HOLDINGS INC | USD | 303 394 | 290 833 | 0.12 |
| 2 890 | MARSH & MCLENNAN COS INC | USD | 264 484 | 275 095 | 0.11 |
| 531 | MARTIN MARIETTA MATERIALS INC | USD | 126 142 | 109 990 | 0.05 |
| 5 560 | MASCO CORP | USD | 227 630 | 209 149 | 0.09 |
| 1 393 | MASTERCARD INC | USD | 316 969 | 368 081 | 0.15 |
| 3 007 | MAXIM INTEGRATED PRODUCTS INC | USD | 148 077 | 152 259 | 0.06 |
| 952 | MCDONALD'S CORP | USD | 165 877 | 168 282 | 0.07 |
| 1 034 | MCKESSON CORP | USD | 132 278 | 131 654 | 0.05 |
| 2 898 | MEDTRONIC PLC | USD | 261 186 | 265 594 | 0.11 |
| 11 326 | MEGGITT PLC | GBP | 88 986 | 71 384 | 0.03 |
| 7 205 | MERCK & CO INC | USD | 546 035 | 502 176 | 0.21 |
| 3 309 | MERCK KGAA | EUR | 309 439 | 360 846 | 0.15 |
| 3 159 | METLIFE INC | USD | 137 806 | 122 857 | 0.05 |
| 27 741 | METRO AG | EUR | 407 646 | 290 864 | 0.12 |
| 257 | METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL INC | USD | 171 100 | 164 174 | 0.07 |
| 67 096 | M&G PLC | GBP | 170 800 | 155 110 | 0.06 |
| 15 815 | MICROSOFT CORP | USD | 1 823 520 | 2 332 548 | 0.97 |
| 1 678 | MID-AMERICA APARTMENT COMMUNITIES INC | USD | 196 747 | 197 458 | 0.08 |
| 998 | MOHAWK INDUSTRIES INC | USD | 122 468 | 110 071 | 0.05 |
| 2 518 | MOLSON COORS BREWING CO - B | USD | 126 766 | 113 722 | 0.05 |
| 4 485 | MONCLER SPA | EUR | 154 703 | 157 962 | 0.06 |
| 85 240 | MONEYSUPERMARKET.COM GROUP PLC | GBP | 332 757 | 307 774 | 0.13 |
| 1 200 | MOODY'S CORP | USD | 204 636 | 262 220 | 0.11 |
| 902 | MOTOROLA SOLUTIONS INC | USD | 132 534 | 136 049 | 0.06 |
| 1 067 | MTU AERO ENGINES AG | EUR | 250 011 | 235 487 | 0.10 |
| 2 250 | MUENCHENER RUECKVERSICHERUNGS-GESELLSCHAFT AG IN MUENCHEN - REG | EUR | 442 055 | 519 075 | 0.21 |
| 2 381 | NASDAQ INC | USD | 251 277 | 222 287 | 0.09 |
| 29 349 | NATIONAL GRID PLC | GBP | 355 389 | 335 417 | 0.14 |
| 41 121 | NATIXIS SA | EUR | 167 815 | 150 791 | 0.06 |
| 7 523 | NATURGY ENERGY GROUP SA | EUR | 167 537 | 158 209 | 0.06 |

# Swiss Life Funds (LUX) Multi Asset Risk Premia

## Anlagenübersicht (Fortsetzung)

| Nominalwert/ Menge | Bezeichnung | Kurs Währung | Kosten EUR | Marktwert EUR | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| **Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumenten, die an einer amtlichen Börse zugelassen sind oder auf einem anderen geregelten Markt gehandelt werden (Fortsetzung)** | | | | | |
| | **Anteile (Fortsetzung)** | | | | |
| 5 423 | NESTE OYJ | EUR | 147 654 | 193 384 | 0.08 |
| 19 744 | NESTLE SA | CHF | 1 801 631 | 1 835 593 | 0.75 |
| 5 698 | NETAPP INC | USD | 278 757 | 242 351 | 0.10 |
| 4 069 | NEWELL BRANDS INC | USD | 74 949 | 57 158 | 0.02 |
| 5 871 | NEWMONT CORP | USD | 215 084 | 238 539 | 0.10 |
| 3 334 | NEXT PLC | GBP | 222 807 | 235 797 | 0.10 |
| 507 | NEXTERA ENERGY INC | USD | 98 264 | 116 664 | 0.05 |
| 4 902 | NIBE INDUSTRIER AB - B | SEK | 78 920 | 71 531 | 0.03 |
| 4 265 | NIKE INC - B | USD | 335 398 | 347 040 | 0.14 |
| 6 276 | NMC HEALTH PLC | GBP | 66 534 | 68 485 | 0.03 |
| 5 727 | NN GROUP NV | EUR | 170 092 | 176 621 | 0.07 |
| 8 178 | NORTONLIFELOCK INC | USD | 171 118 | 141 679 | 0.06 |
| 5 468 | NOVO NORDISK A/S | DKK | 321 610 | 289 609 | 0.12 |
| 2 844 | NUCOR CORP | USD | 127 711 | 107 059 | 0.04 |
| 123 | NVR INC | USD | 402 667 | 410 636 | 0.17 |
| 414 | OLD DOMINION FREIGHT LINE INC | USD | 70 148 | 73 042 | 0.03 |
| 158 952 | OLD MUTUAL LTD | GBP | 188 913 | 142 141 | 0.06 |
| 6 158 | OMNICOM GROUP INC | USD | 427 405 | 388 389 | 0.16 |
| 4 279 | OMV AG | EUR | 195 320 | 161 960 | 0.07 |
| 8 652 | ORACLE CORP | USD | 415 378 | 389 574 | 0.16 |
| 16 168 | ORANGE SA | EUR | 206 304 | 197 088 | 0.08 |
| 858 | O'REILLY AUTOMOTIVE INC | USD | 294 833 | 288 007 | 0.12 |
| 14 898 | ORION OYJ - B | EUR | 511 099 | 535 583 | 0.22 |
| 28 871 | ORKLA ASA | NOK | 242 702 | 219 829 | 0.09 |
| 5 456 | OSRAM LICHT AG | EUR | 254 904 | 254 522 | 0.10 |
| 755 | PADDY POWER BETFAIR PLC | EUR | 77 447 | 72 465 | 0.03 |
| 5 355 | PANDORA A/S | DKK | 218 109 | 217 627 | 0.09 |
| 232 | PARTNERS GROUP HOLDING AG | CHF | 155 586 | 181 323 | 0.07 |
| 1 771 | PAYCHEX INC - AK9420 | USD | 133 727 | 124 919 | 0.05 |
| 270 | PAYCOM SOFTWARE INC | USD | 71 502 | 69 476 | 0.03 |
| 51 109 | PEARSON PLC | GBP | 409 033 | 331 396 | 0.14 |
| 6 767 | PENNON GROUP PLC | GBP | 61 472 | 84 828 | 0.03 |
| 4 063 | PEPSICO INC | USD | 481 779 | 488 359 | 0.20 |
| 7 608 | PERSIMMON PLC | GBP | 193 512 | 251 167 | 0.10 |
| 19 258 | PEUGEOT SA | EUR | 415 584 | 337 111 | 0.14 |
| 6 085 | PHILIP MORRIS INTERNATIONAL INC | USD | 437 129 | 453 529 | 0.19 |
| 4 007 | PHILLIPS 66 | USD | 317 897 | 273 079 | 0.11 |
| 1 413 | PINNACLE WEST CAPITAL CORP | USD | 122 568 | 115 116 | 0.05 |
| 714 | PNC FINANCIAL SERVICES GROUP INC | USD | 96 463 | 82 161 | 0.03 |
| 17 676 | POLYMETAL INTERNATIONAL PLC | GBP | 224 368 | 245 423 | 0.10 |
| 5 580 | PPL CORP | USD | 155 181 | 152 447 | 0.06 |
| 2 614 | PRINCIPAL FINANCIAL GROUP INC | USD | 126 592 | 105 636 | 0.04 |
| 1 670 | PROCTER & GAMBLE CO | USD | 180 842 | 172 146 | 0.07 |
| 2 690 | PROGRESSIVE CORP | USD | 197 014 | 179 162 | 0.07 |

# Swiss Life Funds (LUX) Multi Asset Risk Premia

## Anlagenübersicht (Fortsetzung)

| Nominalwert/ Menge | Bezeichnung | Kurs Währung | Kosten EUR | Marktwert EUR | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| **Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumenten, die an einer amtlichen Börse zugelassen sind oder auf einem anderen geregelten Markt gehandelt werden (Fortsetzung)** | | | | | |
| | **Anteile (Fortsetzung)** | | | | |
| 1 151 | PROLOGIS INC | USD | 94 221 | 88 312 | 0.04 |
| 27 233 | PROSIEBENSAT.1 MEDIA SE | EUR | 451 603 | 298 746 | 0.12 |
| 6 851 | PROXIMUS SADP | EUR | 177 214 | 153 188 | 0.06 |
| 1 665 | PRUDENTIAL FINANCIAL INC | USD | 144 987 | 114 365 | 0.05 |
| 8 701 | PRUDENTIAL PLC | GBP | 148 817 | 128 195 | 0.05 |
| 2 588 | PSP SWISS PROPERTY AG - REG | CHF | 293 021 | 347 095 | 0.14 |
| 2 525 | PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GROUP INC | USD | 130 563 | 117 946 | 0.05 |
| 5 270 | PUBLICIS GROUPE SA | EUR | 235 384 | 184 345 | 0.08 |
| 8 146 | PULTEGROUP INC | USD | 248 993 | 298 119 | 0.12 |
| 929 | PVH CORP | USD | 75 217 | 62 678 | 0.03 |
| 324 | QORVO INC | USD | 29 858 | 29 667 | 0.01 |
| 3 339 | QUEST DIAGNOSTICS INC | USD | 322 947 | 322 395 | 0.13 |
| 1 128 | RALPH LAUREN CORP - A | USD | 109 779 | 108 348 | 0.04 |
| 3 431 | RANDSTAD NV | EUR | 163 792 | 160 262 | 0.07 |
| 2 990 | RAYTHEON CO | USD | 574 494 | 513 264 | 0.21 |
| 2 009 | REALTY INCOME CORP | USD | 135 806 | 132 397 | 0.05 |
| 3 265 | RECKITT BENCKISER GROUP PLC | GBP | 249 985 | 217 211 | 0.09 |
| 4 418 | RECORDATI SPA | EUR | 167 663 | 170 888 | 0.07 |
| 20 338 | RED ELECTRICA CORP SA | EUR | 390 608 | 352 763 | 0.14 |
| 410 | REGENERON PHARMACEUTICALS INC | USD | 114 317 | 165 937 | 0.07 |
| 21 317 | RELX PLC | GBP | 444 840 | 462 928 | 0.19 |
| 593 | RESMED INC | USD | 79 971 | 85 815 | 0.04 |
| 1 791 | RHEINMETALL AG | EUR | 176 736 | 147 435 | 0.06 |
| 32 248 | RIGHTMOVE PLC | GBP | 210 563 | 232 124 | 0.10 |
| 11 995 | RIO TINTO PLC | GBP | 596 518 | 503 261 | 0.21 |
| 5 229 | ROBERT HALF INTERNATIONAL INC | USD | 255 925 | 239 969 | 0.10 |
| 7 231 | ROCHE HOLDING AG | CHF | 1 736 614 | 2 106 222 | 0.86 |
| 972 | ROCKWELL AUTOMATION INC | USD | 135 616 | 162 376 | 0.07 |
| 839 | ROSS STORES INC | USD | 86 500 | 83 087 | 0.03 |
| 45 303 | ROTORK PLC | GBP | 151 402 | 148 350 | 0.06 |
| 85 014 | ROYAL MAIL PLC | GBP | 195 340 | 160 597 | 0.07 |
| 3 811 | ROYAL UNIBREW A/S | DKK | 269 628 | 296 294 | 0.12 |
| 28 914 | RSA INSURANCE GROUP PLC | GBP | 173 022 | 174 436 | 0.07 |
| 6 397 | RUBIS SCA | EUR | 334 302 | 312 174 | 0.13 |
| 480 | SAP SE | EUR | 57 799 | 53 549 | 0.02 |
| 402 | SARTORIUS AG | EUR | 82 302 | 75 375 | 0.03 |
| 1 440 | SARTORIUS STEDIM BIOTECH | EUR | 196 056 | 247 248 | 0.10 |
| 363 | SBA COMMUNICATIONS CORP | USD | 84 819 | 87 603 | 0.04 |
| 4 453 | SCHNEIDER ELECTRIC SE | EUR | 409 797 | 402 997 | 0.17 |
| 4 431 | SCHRODERS PLC | GBP | 140 750 | 147 056 | 0.06 |
| 9 493 | SCOR SE | EUR | 346 604 | 308 523 | 0.13 |
| 6 325 | SCOUT24 AG | EUR | 310 580 | 374 440 | 0.15 |
| 8 708 | SEAGATE TECHNOLOGY PLC | USD | 415 691 | 380 125 | 0.16 |
| 1 374 | SEB SA | EUR | 185 537 | 163 781 | 0.07 |

# Swiss Life Funds (LUX) Prudent (EUR)

## Anlagenübersicht

| Nominalwert/ Menge | Bezeichnung | Kurs Währung | Kosten EUR | Marktwert EUR | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| **Investmentfonds** | | | | | |
| | **Offene Anlagefonds** | | | | |
| 5 145 | SWISS LIFE FUNDS (F) SHORT TERM EURO | EUR | 105 186 165 | 104 290 025 | 7.00 |
| 51 030 | AMUNDI INDEX SOLUTIONS - INDEX JP MORGAN GLOBAL GBI GOVIES - IEC | EUR | 69 861 103 | 74 334 380 | 4.99 |
| 580 760 | BLACKROCK GLOBAL INDEX FUNDS - ISHARES GLOBAL GOVERNMENT BOND INDEX FUND LU - D2 | EUR | 66 147 500 | 74 958 693 | 5.03 |
| 570 300 | ISHARES EDGE MSCI EUROPE MINIMUM VOLATILITY UCITS ETF | EUR | 24 070 419 | 25 994 274 | 1.75 |
| 4 572 000 | ISHARES EDGE S&P 500 MINIMUM VOLATILITY UCITS ETF | EUR | 24 454 801 | 28 575 000 | 1.92 |
| 2 014 300 | ISHARES MSCI EMERGING MARKETS MINIMUM VOLATILITY UCITS ETF | USD | 51 002 451 | 49 942 611 | 3.35 |
| 561 100 | PARETO SICAV - PARETO NORDIC CORPORATE BOND - I | EUR | 57 584 340 | 59 750 248 | 4.01 |
| 1 860 | SWISS LIFE FUND (F) EQUITY EURO ZONE MINIMUM VOLATILITY - I | EUR | 25 048 148 | 32 065 191 | 2.15 |
| 9 165 | SWISS LIFE FUND (F) MONEY MARKET EURO - I | EUR | 229 356 380 | 228 462 553 | 15.35 |
| 2 620 | SWISS LIFE FUNDS F BOND FLOATING RATES | EUR | 26 558 570 | 26 425 032 | 1.77 |
| 1 290 | SWISS LIFE FUNDS F CASH EURO | EUR | 28 020 045 | 27 814 013 | 1.87 |
| 2 695 | SWISS LIFE FUNDS (F) EQUITY EUROPE MINIMUM VOLATILITY - I | EUR | 28 268 680 | 32 907 944 | 2.21 |
| 1 410 | SWISS LIFE FUNDS LUX - BOND EMERGING MARKETS CORPORATES - S | EUR | 14 079 413 | 15 126 240 | 1.02 |
| 2 805 | SWISS LIFE FUNDS LUX - BOND GLOBAL CORPORATES FUND - S | EUR | 28 075 756 | 30 458 878 | 2.05 |
| 6 890 | SWISS LIFE FUNDS LUX - BOND GLOBAL HIGH YIELD - S | EUR | 86 384 389 | 98 029 887 | 6.58 |
| 2 250 | SWISS LIFE FUNDS LUX - EQUITY EURO ZONE - S | EUR | 27 277 641 | 28 455 953 | 1.91 |
| 1 225 | SWISS LIFE FUNDS LUX - EQUITY GLOBAL | EUR | 13 964 118 | 17 586 994 | 1.18 |
| 3 150 | SWISS LIFE FUNDS LUX - EQUITY GLOBAL HIGH DIVIDEND - S | EUR | 43 453 581 | 52 004 988 | 3.49 |
| 2 120 | SWISS LIFE FUNDS LUX - EQUITY GLOBAL MINIMUM VOLATILITY - C | EUR | 22 488 868 | 29 078 598 | 1.95 |
| 3 150 | SWISS LIFE FUNDS LUX - EQUITY USA - S | USD | 46 548 732 | 68 434 306 | 4.59 |
| 3 015 | SWISS LIFE FUNDS LUX - FIXED INCOME ALPHA SELECT - S - SHARES - CAPITALISATION | EUR | 30 164 758 | 30 534 925 | 2.05 |
| 7 355 | SWISS LIFE FUNDS LUX - MULTI ASSET RISK PREMIA - S | EUR | 73 455 920 | 67 513 899 | 4.53 |
| 4 565 | SWISS LIFE FUNDS LUX EQUITY GLOBAL LONG/SHORT - SC | EUR | 45 279 627 | 44 551 341 | 2.99 |
| 6 115 | SWISS LIFE FUNDS LUX EQUITY GLOBAL NXS PROTECT - SC | EUR | 67 013 727 | 72 366 194 | 4.86 |
| 4 595 | SWISS LIFE FUNDS LUX-INCOME EQUITY EURO ZONE - S - SHARES - CAPITALISATION | EUR | 45 939 079 | 45 104 612 | 3.03 |
| | **Gesamtsumme offene Anlagefonds** | | **1 279 684 211** | **1 364 766 779** | **91.63** |
| **Gesamtsumme der Anlagefonds** | | | **1 279 684 211** | **1 364 766 779** | **91.63** |
| **Gesamtsumme der Anlagen** | | | **1 279 684 211** | **1 364 766 779** | **91.63** |

## Swiss Life Funds (LUX) Prudent (EUR)

### Sektorstruktur und geographische Verteilung der Anlagen

| Sektorstruktur | % |
|---|---|
| Investmentfonds | 91.63 |
| | **91.63** |

| Geographische Verteilung | % |
|---|---|
| Luxemburg | 54.26 |
| Frankreich | 30.35 |
| Irland | 7.02 |
| | **91.63** |

# Swiss Life Funds (LUX) Harmony (EUR)

## Anlagenübersicht

| Nominalwert/ Menge | Bezeichnung | Kurs Währung | Kosten EUR | Marktwert EUR | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| **Investmentfonds** | | | | | |
| | **Offene Anlagefonds** | | | | |
| 1 335 | SWISS LIFE FUNDS (F) SHORT TERM EURO | EUR | 27 273 604 | 27 060 676 | 6.14 |
| 8 175 | AMUNDI INDEX SOLUTIONS - INDEX JP MORGAN GLOBAL GBI GOVIES - IEC | EUR | 11 206 998 | 11 908 359 | 2.70 |
| 93 070 | BLACKROCK GLOBAL INDEX FUNDS - ISHARES GLOBAL GOVERNMENT BOND INDEX FUND LU - D2 | EUR | 10 685 892 | 12 012 545 | 2.73 |
| 317 500 | ISHARES EDGE MSCI EUROPE MINIMUM VOLATILITY UCITS ETF | EUR | 13 873 602 | 14 471 650 | 3.28 |
| 2 745 000 | ISHARES EDGE S&P 500 MINIMUM VOLATILITY UCITS ETF | EUR | 15 006 363 | 17 156 250 | 3.89 |
| 966 200 | ISHARES MSCI EMERGING MARKETS MINIMUM VOLATILITY UCITS ETF | USD | 24 629 467 | 23 955 990 | 5.44 |
| 103 173 | PARETO SICAV - PARETO NORDIC CORPORATE BOND - I | EUR | 10 586 862 | 10 986 655 | 2.49 |
| 1 010 | SWISS LIFE FUND (F) EQUITY EURO ZONE MINIMUM VOLATILITY - I | EUR | 13 854 262 | 17 411 744 | 3.95 |
| 3 055 | SWISS LIFE FUND (F) MONEY MARKET EURO - I | EUR | 76 301 002 | 76 154 184 | 17.28 |
| 350 | SWISS LIFE FUNDS BOND CASH EQUIVALENT TARGET - I | EUR | 3 734 966 | 3 730 797 | 0.85 |
| 490 | SWISS LIFE FUNDS F BOND FLOATING RATES | EUR | 4 959 491 | 4 942 086 | 1.12 |
| 386 | SWISS LIFE FUNDS F CASH EURO | EUR | 8 393 658 | 8 322 643 | 1.89 |
| 1 285 | SWISS LIFE FUNDS (F) EQUITY EUROPE MINIMUM VOLATILITY - I | EUR | 13 452 139 | 15 690 801 | 3.56 |
| 250 | SWISS LIFE FUNDS LUX - BOND EMERGING MARKETS CORPORATES - S | EUR | 2 496 933 | 2 681 958 | 0.61 |
| 615 | SWISS LIFE FUNDS LUX - BOND GLOBAL CORPORATES FUND - S | EUR | 6 136 796 | 6 678 150 | 1.52 |
| 1 225 | SWISS LIFE FUNDS LUX - BOND GLOBAL HIGH YIELD - S | EUR | 15 477 122 | 17 429 116 | 3.95 |
| 975 | SWISS LIFE FUNDS LUX - EQUITY EURO ZONE - S | EUR | 11 968 281 | 12 330 913 | 2.80 |
| 360 | SWISS LIFE FUNDS LUX - EQUITY GLOBAL | EUR | 4 158 661 | 5 168 423 | 1.17 |
| 925 | SWISS LIFE FUNDS LUX - EQUITY GLOBAL HIGH DIVIDEND - S | EUR | 12 808 174 | 15 271 306 | 3.46 |
| 1 095 | SWISS LIFE FUNDS LUX - EQUITY GLOBAL MINIMUM VOLATILITY - C | EUR | 12 187 317 | 15 019 370 | 3.41 |
| 945 | SWISS LIFE FUNDS LUX - EQUITY USA - S | USD | 14 027 182 | 20 530 292 | 4.66 |
| 680 | SWISS LIFE FUNDS LUX - FIXED INCOME ALPHA SELECT - S - SHARES - CAPITALISATION | EUR | 6 804 919 | 6 886 816 | 1.56 |
| 1 420 | SWISS LIFE FUNDS LUX - MULTI ASSET RISK PREMIA - S | EUR | 14 087 102 | 13 034 634 | 2.96 |
| 895 | SWISS LIFE FUNDS LUX EQUITY GLOBAL LONG/SHORT - SC | EUR | 8 860 085 | 8 734 600 | 1.98 |
| 2 750 | SWISS LIFE FUNDS LUX EQUITY GLOBAL NXS PROTECT - SC | EUR | 30 253 390 | 32 544 077 | 7.38 |
| 1 375 | SWISS LIFE FUNDS LUX-INCOME EQUITY EURO ZONE - S - SHARES - CAPITALISATION | EUR | 13 746 360 | 13 497 028 | 3.06 |
| | **Gesamtsumme offene Anlagefonds** | | **386 970 628** | **413 611 063** | **93.84** |
| **Gesamtsumme der Anlagefonds** | | | **386 970 628** | **413 611 063** | **93.84** |
| **Gesamtsumme der Anlagen** | | | **386 970 628** | **413 611 063** | **93.84** |

## Swiss Life Funds (LUX) Harmony (EUR)

### Sektorstruktur und geographische Verteilung der Anlagen

| Sektorstruktur | % |
|---|---|
| Investmentfonds | 93.84 |
| | **93.84** |

| Geographische Verteilung | % |
|---|---|
| Luxemburg | 46.45 |
| Frankreich | 34.78 |
| Irland | 12.61 |
| | **93.84** |

# Swiss Life Funds (LUX) Income Equity Euro Zone[1]

## Anlagenübersicht

| Nominalwert/ Menge | Bezeichnung | Kurs Währung | Kosten EUR | Marktwert EUR | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| **Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumenten, die an einer amtlichen Börse zugelassen sind oder auf einem anderen geregelten Markt gehandelt werden** | | | | | |
| **Aktien** | | | | | |
| 42 123 | ABN AMRO BANK NV | EUR | 687 869 | 524 010 | 0.51 |
| 4 236 | ADIDAS AG - REG - REG | EUR | 1 234 582 | 1 061 330 | 1.03 |
| 10 993 | AIR LIQUIDE SA | EUR | 1 395 012 | 1 351 040 | 1.32 |
| 15 414 | AIRBUS SE | EUR | 2 032 798 | 1 666 253 | 1.62 |
| 16 695 | ALLIANZ SE - REG | EUR | 3 685 421 | 3 252 186 | 3.17 |
| 1 767 | AMADEUS IT GROUP SA - A | EUR | 127 577 | 112 205 | 0.11 |
| 24 654 | ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV | EUR | 1 825 875 | 1 250 697 | 1.22 |
| 12 858 | ASML HOLDING NV | EUR | 3 402 227 | 3 190 070 | 3.11 |
| 94 501 | AXA SA | EUR | 2 400 798 | 1 980 268 | 1.93 |
| 310 877 | BANCO SANTANDER SA | EUR | 1 188 327 | 1 034 288 | 1.01 |
| 41 081 | BASF SE - REG | EUR | 2 791 043 | 2 180 579 | 2.12 |
| 9 235 | BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG | EUR | 684 775 | 544 219 | 0.53 |
| 32 291 | BNP PARIBAS SA | EUR | 1 729 506 | 1 413 861 | 1.38 |
| 7 412 | CRH PLC | EUR | 265 201 | 225 844 | 0.22 |
| 46 572 | DAIMLER AG | EUR | 2 327 203 | 1 748 313 | 1.70 |
| 9 979 | DANONE SA | EUR | 747 028 | 635 862 | 0.62 |
| 1 778 | DEUTSCHE BOERSE AG | EUR | 251 587 | 252 565 | 0.25 |
| 18 014 | DEUTSCHE POST AG - REG | EUR | 621 213 | 488 540 | 0.48 |
| 68 212 | DEUTSCHE TELEKOM AG - REG | EUR | 1 009 674 | 1 006 536 | 0.98 |
| 36 029 | EDP - ENERGIAS DE PORTUGAL SA | EUR | 137 811 | 152 042 | 0.15 |
| 3 840 | ENAGAS SA | EUR | 88 589 | 89 856 | 0.09 |
| 59 053 | ENDESA SA | EUR | 1 468 648 | 1 371 801 | 1.34 |
| 228 438 | ENEL SPA | EUR | 1 646 124 | 1 730 646 | 1.68 |
| 60 702 | ENGIE SA | EUR | 895 355 | 912 351 | 0.89 |
| 58 237 | ENI SPA | EUR | 813 804 | 649 808 | 0.63 |
| 7 161 | ESSILORLUXOTTICA SA | EUR | 984 638 | 881 519 | 0.86 |
| 28 550 | EUTELSAT COMMUNICATIONS SA | EUR | 415 688 | 349 452 | 0.34 |
| 15 492 | FREENET AG | EUR | 318 051 | 274 053 | 0.27 |
| 3 923 | FRESENIUS SE & CO KGAA | EUR | 196 189 | 166 394 | 0.16 |
| 1 365 | HUGO BOSS AG | EUR | 58 763 | 53 999 | 0.05 |
| 144 695 | IBERDROLA SA | EUR | 1 341 033 | 1 493 252 | 1.45 |
| 1 832 | ICADE | EUR | 175 597 | 165 338 | 0.16 |
| 29 947 | INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL SA | EUR | 941 234 | 842 409 | 0.82 |
| 127 569 | ING GROEP NV | EUR | 1 393 564 | 1 098 242 | 1.07 |
| 1 183 308 | INTESA SANPAOLO SPA | EUR | 2 845 856 | 2 601 503 | 2.53 |
| 189 | KBC GROUP NV | EUR | 12 818 | 11 344 | 0.01 |
| 1 990 | KERING SA | EUR | 1 154 399 | 1 006 542 | 0.98 |
| 26 464 | KLEPIERRE SA | EUR | 884 692 | 715 057 | 0.70 |
| 24 143 | KONINKLIJKE PHILIPS NV | EUR | 1 059 153 | 934 817 | 0.91 |
| 15 562 | LINDE PLC | EUR | 2 980 123 | 2 672 774 | 2.60 |
| 5 439 | L'OREAL SA | EUR | 1 439 703 | 1 310 799 | 1.28 |
| 8 037 | LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE | EUR | 3 299 189 | 2 980 521 | 2.90 |
| 1 992 | MUENCHENER RUECKVERSICHERUNGS-GESELLSCHAFT AG IN MUENCHEN - REG | EUR | 530 071 | 459 554 | 0.45 |

[1] Dieser Teilfonds wurde zum 19. Dezember 2019 aufgelegt.

# Swiss Life Funds (LUX) Income Equity Euro Zone[1]

## Anlagenübersicht (Fortsetzung)

| Nominalwert/ Menge | Bezeichnung | Kurs Währung | Kosten EUR | Marktwert EUR | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| **Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumenten, die an einer amtlichen Börse zugelassen sind oder auf einem anderen geregelten Markt gehandelt werden (Fortsetzung)** | | | | | |
| | **Anteile (Fortsetzung)** | | | | |
| 182 378 | NATIXIS SA | EUR | 730 789 | 668 780 | 0.65 |
| 5 161 | NATURGY ENERGY GROUP SA | EUR | 117 826 | 108 536 | 0.11 |
| 80 220 | NOKIA OYJ | EUR | 262 841 | 276 358 | 0.27 |
| 1 863 | NOKIAN RENKAAT OYJ | EUR | 47 693 | 43 930 | 0.04 |
| 10 404 | ORANGE SA | EUR | 138 425 | 126 825 | 0.12 |
| 379 | ORION OYJ - B | EUR | 16 043 | 13 625 | 0.01 |
| 18 824 | PROSIEBENSAT.1 MEDIA SE | EUR | 259 771 | 206 499 | 0.20 |
| 2 370 | RENAULT SA | EUR | 104 150 | 62 793 | 0.06 |
| 8 315 | RTL GROUP SA | EUR | 366 525 | 313 974 | 0.31 |
| 7 535 | SAFRAN SA | EUR | 1 056 784 | 935 094 | 0.91 |
| 30 447 | SAMPO OYJ - A | EUR | 1 194 131 | 1 122 885 | 1.09 |
| 41 278 | SANOFI | EUR | 3 750 519 | 3 464 463 | 3.36 |
| 33 141 | SAP SE | EUR | 4 008 072 | 3 697 211 | 3.59 |
| 17 910 | SCHNEIDER ELECTRIC SE | EUR | 1 654 526 | 1 620 855 | 1.58 |
| 6 109 | SES SA | EUR | 78 195 | 63 411 | 0.06 |
| 27 625 | SIEMENS AG - REG | EUR | 3 263 618 | 2 574 650 | 2.51 |
| 24 033 | SOCIETE GENERALE SA | EUR | 754 636 | 615 004 | 0.60 |
| 555 821 | TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDING AG | EUR | 1 445 135 | 1 312 293 | 1.28 |
| 122 897 | TELEFONICA SA | EUR | 802 886 | 658 728 | 0.64 |
| 95 486 | TOTAL SA | EUR | 4 685 497 | 3 664 754 | 3.56 |
| 6 001 | UNIBAIL RODAMCO REITS | EUR | 837 140 | 654 109 | 0.64 |
| 53 598 | UNILEVER NV | EUR | 2 769 945 | 2 552 069 | 2.48 |
| 11 650 | VINCI SA | EUR | 1 157 777 | 1 059 917 | 1.03 |
| | **Gesamtsumme der Aktien** | | **82 991 732** | **72 659 502** | **70.73** |
| **Gesamtsumme übertragbarer Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer amtlichen Börse zugelassen sind oder auf einem anderen geregelten Markt gehandelt werden** | | | **82 991 732** | **72 659 502** | **70.73** |
| **Investmentfonds** | | | | | |
| | **Offene Anlagefonds** | | | | |
| 400 | SWISS LIFE FUND (F) MONEY MARKET EURO - I | EUR | 9 975 816 | 9 971 088 | 9.71 |
| | **Gesamtsumme offene Anlagefonds** | | **9 975 816** | **9 971 088** | **9.71** |
| **Gesamtsumme der Anlagefonds** | | | **9 975 816** | **9 971 088** | **9.71** |
| **Gesamtsumme der Anlagen** | | | **92 967 548** | **82 630 590** | **80.44** |

[1] Dieser Teilfonds wurde zum 19. Dezember 2019 aufgelegt.

Die beigefügten Anmerkungen sind integraler Bestandteil dieses Geschäftsberichts.

## Swiss Life Funds (LUX) Income Equity Euro Zone[1]

### Sektorstruktur und geographische Verteilung der Anlagen

| Sektorstruktur | % |
|---|---|
| Investmentfonds | 9.71 |
| Banken | 7.75 |
| Persönliche Güter | 7.74 |
| Versicherungen (ohne Lebensversicherung) | 6.63 |
| Chemikalien | 6.04 |
| Öl- und Gasproduzenten | 4.20 |
| Software- und Computerdienstleistungen | 3.60 |
| Pharmazeutik und Biotechnologie | 3.39 |
| Technologie Hardware und Geräte | 3.37 |
| Elektrizität | 3.29 |
| Luft- und Raumfahrt und Verteidigung | 2.53 |
| Mobilfunk | 2.52 |
| Allgemeine Industrie | 2.51 |
| Gas-, Wasser- und Mehrfachversorgungsunternehmen | 2.42 |
| Automobilbau und -teile | 2.34 |
| Geräte und Dienstleistungen im Gesundheitswesen | 1.93 |
| Allgemeiner Einzelhandel | 1.80 |
| Elektronische und elektrische Geräte | 1.58 |
| Immobilienbezogene Anlagefonds | 1.49 |
| Bauwirtschaft und Baustoffe | 1.25 |
| Getränke | 1.22 |
| Medien | 0.91 |
| Festnetz-Telekommunikation | 0.76 |
| Lebensmittelhersteller | 0.62 |
| Industrietransport | 0.48 |
| Finanzdienstleistungen | 0.25 |
| Kundenbetreuung | 0.11 |
| | **80.44** |

| Geographische Verteilung | % |
|---|---|
| Frankreich | 35.57 |
| Deutschland | 18.77 |
| Niederlande | 9.70 |
| Spanien | 5.56 |
| Italien | 4.85 |
| Irland | 2.82 |
| Finnland | 1.42 |
| Belgien | 1.23 |
| Luxemburg | 0.37 |
| Portugal | 0.15 |
| | **80.44** |

[1] Dieser Teilfonds wurde zum 19. Dezember 2019 aufgelegt.

# Swiss Life Funds (LUX) Portfolio Global Growth (CHF)

## Anlagenübersicht

| Nominalwert/ Menge | Bezeichnung | Kurs Währung | Kosten CHF | Marktwert CHF | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| **Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumenten, die an einer amtlichen Börse zugelassen sind oder auf einem anderen geregelten Markt gehandelt werden** | | | | | |
| | **Anleihen** | | | | |
| 100 000 | ALLERGAN FUNDING SCS 0.5% 01/06/2021 | EUR | 108 600 | 107 082 | 0.22 |
| 100 000 | AMAZON.COM INC 3.875% 22/08/2037 | USD | 97 044 | 116 082 | 0.24 |
| 100 000 | AMERICAN EXPRESS CREDIT CORP 3.3% 03/05/2027 | USD | 98 247 | 105 615 | 0.22 |
| 100 000 | AMGEN INC 0.41% 08/03/2023 | CHF | 100 000 | 102 228 | 0.21 |
| 100 000 | AMGEN INC 2.65% 11/05/2022 | USD | 99 526 | 99 005 | 0.20 |
| 100 000 | APPLE INC 0.75% 25/02/2030 | CHF | 100 142 | 109 722 | 0.23 |
| 100 000 | APPLE INC 1.375% 24/05/2029 | EUR | 108 444 | 118 342 | 0.24 |
| 50 000 | APPLE INC 3.2% 11/05/2027 | USD | 49 541 | 52 758 | 0.11 |
| 100 000 | AT&T INC 1.375% 04/12/2024 | CHF | 99 380 | 107 194 | 0.22 |
| 100 000 | AT&T INC 5.45% 01/03/2047 | USD | 98 105 | 125 110 | 0.26 |
| 100 000 | BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA SA 0.75% 11/09/2022 | EUR | 113 632 | 107 985 | 0.22 |
| 100 000 | BANCO SANTANDER CHILE 0.375% 19/05/2022 | CHF | 100 086 | 101 259 | 0.21 |
| 100 000 | BANK OF AMERICA CORP FRN 01/10/2021 | USD | 96 324 | 97 256 | 0.20 |
| 200 000 | BMW FINANCE NV 0.125% 12/01/2021 | EUR | 213 926 | 213 321 | 0.44 |
| 100 000 | BNP PARIBAS SA 1.75% 05/06/2025 | CHF | 101 076 | 108 141 | 0.22 |
| 100 000 | BRISTOL-MYERS SQUIBB CO 3.25% 27/02/2027 | USD | 100 561 | 105 887 | 0.22 |
| 100 000 | BROADCOM CORP / BROADCOM CAYMAN FINANCE LTD 2.2% 15/01/2021 | USD | 97 313 | 97 156 | 0.20 |
| 100 000 | CANADIAN NATURAL RESOURCES LTD 4.95% 01/06/2047 | USD | 97 083 | 113 360 | 0.23 |
| 200 000 | CBOE GLOBAL MARKETS INC 3.65% 12/01/2027 | USD | 202 826 | 214 285 | 0.44 |
| 200 000 | CHEVRON CORP 2.895% 03/03/2024 | USD | 200 292 | 204 095 | 0.42 |
| 200 000 | COMCAST CORP 3% 01/02/2024 | USD | 201 633 | 204 237 | 0.42 |
| 100 000 | COMMERZBANK FINANCE & COVERED BOND SA 2.5% 29/08/2025 | CHF | 85 500 | 114 519 | 0.24 |
| 100 000 | CREDIT AGRICOLE SA 2.125% 29/09/2025 | CHF | 100 403 | 111 297 | 0.23 |
| 100 000 | CREDIT AGRICOLE SA/LONDON 2.125% 30/10/2024 | CHF | 100 278 | 111 600 | 0.23 |
| 100 000 | CREDIT SUISSE GROUP FUNDING GUERNSEY LTD 1% 14/04/2023 | CHF | 100 116 | 103 591 | 0.21 |
| 100 000 | CVS HEALTH CORP 5.05% 25/03/2048 | USD | 93 372 | 119 023 | 0.24 |
| 100 000 | DH SWITZERLAND FINANCE SA 0.5% 08/12/2023 | CHF | 100 924 | 103 125 | 0.21 |
| 100 000 | DZ BANK AG DEUTSCHE ZENTRAL-GENOSSENSCHAFTSBANK FRANKFURT AM MAIN 3.238% 30/08/2023 | CHF | 100 000 | 109 208 | 0.22 |
| 100 000 | ECOLAB INC 2.375% 10/08/2022 | USD | 97 190 | 98 699 | 0.20 |
| 100 000 | EUROCLEAR INVESTMENTS SA 1.125% 07/12/2026 | EUR | 107 417 | 113 717 | 0.23 |
| 200 000 | GENERAL MILLS INC 3.2% 10/02/2027 | USD | 202 462 | 209 136 | 0.43 |
| 100 000 | GLENCORE FUNDING LLC - 144A - 4% 27/03/2027 | USD | 98 370 | 102 914 | 0.21 |
| 100 000 | HEINEKEN NV - REGS - 3.5% 29/01/2028 | USD | 99 019 | 106 681 | 0.22 |
| 100 000 | HOME DEPOT INC 1.8% 05/06/2020 | USD | 97 614 | 96 844 | 0.20 |
| 100 000 | HOME DEPOT INC 2.8% 14/09/2027 | USD | 95 348 | 103 191 | 0.21 |
| 100 000 | ING GROEP NV FRN 15/02/2029 | EUR | 106 230 | 113 748 | 0.23 |
| 100 000 | INTERNATIONAL BUSINESS MACHINES CORP 1.2% 11/02/2040 | EUR | 106 734 | 106 254 | 0.22 |
| 100 000 | INTERNATIONAL BUSINESS MACHINES CORP 3.3% 27/01/2027 | USD | 99 372 | 105 640 | 0.22 |
| 100 000 | JPMORGAN CHASE & CO FRN 01/03/2025 | USD | 97 159 | 102 134 | 0.21 |
| 100 000 | MACQUARIE BANK LTD/LONDON 0.75% 05/02/2024 | CHF | 100 232 | 103 650 | 0.21 |
| 200 000 | MCDONALD'S CORP 3.5% 01/03/2027 | USD | 201 195 | 211 967 | 0.44 |
| 200 000 | MICROSOFT CORP 2.4% 06/02/2022 | USD | 199 001 | 197 871 | 0.41 |
| 100 000 | MONDELEZ INTERNATIONAL INC 1.125% 30/12/2025 | CHF | 100 982 | 106 736 | 0.22 |

# Swiss Life Funds (LUX) Portfolio Global Growth (CHF)

## Anlagenübersicht (Fortsetzung)

| Nominalwert/ Menge | Bezeichnung | Kurs Währung | Kosten CHF | Marktwert CHF | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| **Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumenten, die an einer amtlichen Börse zugelassen sind oder auf einem anderen geregelten Markt gehandelt werden (Fortsetzung)** | | | | | |
| | **Anleihen (Fortsetzung)** | | | | |
| 100 000 | MOODY'S CORP 2.625% 15/01/2023 | USD | 96 718 | 99 692 | 0.20 |
| 100 000 | NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD 0.25% 19/01/2023 | CHF | 100 295 | 102 222 | 0.21 |
| 100 000 | NATIONAL GRID NORTH AMERICA INC 1% 12/07/2024 | EUR | 108 636 | 110 492 | 0.23 |
| 200 000 | NESTLE HOLDINGS INC 2.375% 18/01/2022 | USD | 202 665 | 197 641 | 0.41 |
| 100 000 | NISSAN MOTOR ACCEPTANCE CORP - REGS - 2.15% 13/07/2020 | USD | 96 614 | 96 971 | 0.20 |
| 100 000 | NORDEA BANK AB 0.25% 27/11/2023 | CHF | 100 119 | 102 840 | 0.21 |
| 100 000 | NOVARTIS CAPITAL CORP 2.4% 17/05/2022 | USD | 100 254 | 99 180 | 0.20 |
| 100 000 | PEPSICO INC 2.25% 02/05/2022 | USD | 99 265 | 98 750 | 0.20 |
| 100 000 | QUALCOMM INC 4.3% 20/05/2047 | USD | 97 434 | 115 858 | 0.24 |
| 200 000 | SANTANDER UK GROUP HOLDINGS PLC 3.571% 10/01/2023 | USD | 205 788 | 199 079 | 0.41 |
| 45 000 | SHERWIN-WILLIAMS CO 2.75% 01/06/2022 | USD | 44 698 | 44 592 | 0.09 |
| 100 000 | SOCIETE GENERALE SA 1% 01/04/2022 | EUR | 107 349 | 108 365 | 0.22 |
| 100 000 | TELEFONICA EMISIONES SAU 2.595% 23/10/2020 | CHF | 100 000 | 101 951 | 0.21 |
| 100 000 | TOTAL CAPITAL INTERNATIONAL SA 1% 29/08/2024 | CHF | 99 834 | 106 838 | 0.22 |
| 100 000 | TRANSURBAN FINANCE CO PTY LTD 1.75% 29/03/2028 | EUR | 113 509 | 116 096 | 0.24 |
| 100 000 | TRANSURBAN QUEENSLAND FINANCE PTY LTD 0.625% 23/06/2023 | CHF | 100 568 | 102 432 | 0.21 |
| 100 000 | UNILEVER NV 0% 31/07/2021 | EUR | 109 413 | 106 725 | 0.22 |
| 100 000 | VERIZON COMMUNICATIONS INC 4.125% 16/03/2027 | USD | 99 935 | 110 400 | 0.23 |
| 100 000 | VODAFONE GROUP PLC 0.375% 22/11/2021 | EUR | 106 621 | 107 379 | 0.22 |
| 100 000 | VOLKSWAGEN INTERNATIONAL FINANCE NV 1.875% 30/03/2027 | EUR | 105 891 | 113 373 | 0.23 |
| 100 000 | WELLS FARGO & CO - MTN - FRN 22/05/2028 | USD | 99 663 | 105 417 | 0.22 |
| 200 000 | WESTPAC BANKING CORP 2.8% 11/01/2022 | USD | 205 683 | 198 218 | 0.41 |
| 100 000 | WESTPAC SECURITIES NZ LTD/LONDON 0.375% 05/02/2024 | CHF | 100 217 | 103 133 | 0.21 |
| 200 000 | ZOETIS INC 3.95% 12/09/2047 | USD | 190 061 | 230 752 | 0.47 |
| | **Gesamtsumme der Anleihen** | | **7 763 929** | **8 140 061** | **16.72** |
| | **Aktien** | | | | |
| 20 000 | ABB LTD | CHF | 255 807 | 416 200 | 0.85 |
| 1 806 | ADECCO GROUP AG - REG | CHF | 84 451 | 92 792 | 0.19 |
| 4 600 | ALCON INC | CHF | 113 533 | 271 216 | 0.56 |
| 510 | BALOISE HOLDING AG - REG | CHF | 45 713 | 78 999 | 0.16 |
| 24 | BARRY CALLEBAUT AG - REG | CHF | 18 021 | 47 592 | 0.10 |
| 10 | CHOCOLADEFABRIKEN LINDT & SPRUENGLI AG - PC | CHF | 24 315 | 75 300 | 0.15 |
| 1 | CHOCOLADEFABRIKEN LINDT & SPRUENGLI AG - REG | CHF | 25 766 | 83 700 | 0.17 |
| 5 656 | CIE FINANCIERE RICHEMONT SA - REG | CHF | 306 648 | 369 902 | 0.76 |
| 21 750 | CREDIT SUISSE GROUP AG - REG | CHF | 728 718 | 235 118 | 0.48 |
| 434 | DUFRY AG - REG | CHF | 48 413 | 30 475 | 0.06 |
| 88 | EMS-CHEMIE HOLDING AG | CHF | 19 374 | 49 588 | 0.10 |
| 402 | GEBERIT AG - REG | CHF | 77 614 | 192 558 | 0.40 |
| 98 | GIVAUDAN SA - REG | CHF | 72 226 | 294 588 | 0.61 |
| 2 401 | JULIUS BAER GROUP LTD | CHF | 76 288 | 96 544 | 0.20 |
| 573 | KUEHNE + NAGEL INTERNATIONAL AG - REG | CHF | 68 742 | 80 535 | 0.17 |
| 4 838 | LAFARGEHOLCIM LTD - REG | CHF | 237 857 | 216 307 | 0.44 |
| 554 | LONZA GROUP AG - REG | CHF | 31 737 | 211 850 | 0.44 |

# Swiss Life Funds (LUX) Portfolio Global Growth (CHF)

## Anlagenübersicht (Fortsetzung)

| Nominalwert/ Menge | Bezeichnung | Kurs Währung | Kosten CHF | Marktwert CHF | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| **Übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumenten, die an einer amtlichen Börse zugelassen sind oder auf einem anderen geregelten Markt gehandelt werden (Fortsetzung)** | | | | | |
| | **Anteile (Fortsetzung)** | | | | |
| 32 750 | NESTLE SA | CHF | 1 400 117 | 3 237 337 | 6.65 |
| 23 000 | NOVARTIS AG - REG | CHF | 1 199 287 | 1 868 750 | 3.84 |
| 327 | PARGESA HOLDING SA - BR | CHF | 27 713 | 23 070 | 0.05 |
| 178 | PARTNERS GROUP HOLDING AG | CHF | 31 344 | 147 918 | 0.30 |
| 7 457 | ROCHE HOLDING AG | CHF | 1 342 927 | 2 309 433 | 4.74 |
| 474 | SCHINDLER HOLDING AG | CHF | 50 858 | 101 673 | 0.21 |
| 218 | SCHINDLER HOLDING AG - REG | CHF | 22 899 | 45 170 | 0.09 |
| 58 | SGS SA - REG | CHF | 94 119 | 139 084 | 0.29 |
| 1 380 | SIKA AG | CHF | 46 122 | 236 532 | 0.49 |
| 574 | SONOVA HOLDING AG | CHF | 66 943 | 131 905 | 0.27 |
| 324 | SWATCH GROUP AG | CHF | 120 019 | 71 896 | 0.15 |
| 516 | SWATCH GROUP AG - REG | CHF | 31 257 | 21 311 | 0.04 |
| 345 | SWISS LIFE HOLDING AG - REG | CHF | 27 114 | 151 317 | 0.31 |
| 665 | SWISS PRIME SITE AG - REG | CHF | 36 174 | 77 140 | 0.16 |
| 3 250 | SWISS RE AG | CHF | 118 141 | 297 830 | 0.61 |
| 279 | SWISSCOM AG - REG | CHF | 112 733 | 143 294 | 0.29 |
| 39 962 | UBS GROUP AG | CHF | 689 531 | 423 597 | 0.87 |
| 410 | VIFOR PHARMA AG | CHF | 60 721 | 65 887 | 0.14 |
| 1 615 | ZURICH INSURANCE GROUP AG | CHF | 260 572 | 599 004 | 1.23 |
| | **Gesamtsumme der Aktien** | | **7 973 814** | **12 935 412** | **26.57** |
| | **Supranationale Institutionen, Regierungen und örtliche Behörden, Schuldtitel** | | | | |
| 100 000 | CARIBBEAN DEVELOPMENT BANK 0.297% 07/07/2028 | CHF | 100 380 | 104 758 | 0.22 |
| 100 000 | CORP ANDINA DE FOMENTO 0.5% 26/02/2026 | CHF | 100 729 | 102 982 | 0.21 |
| 100 000 | CORP ANDINA DE FOMENTO 1.5% 01/12/2028 | CHF | 100 266 | 111 733 | 0.23 |
| 100 000 | REPUBLIC OF POLAND GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 1% 17/09/2021 | CHF | 99 765 | 102 329 | 0.21 |
| | **Summe supranationale Institutionen, Regierungen und örtliche Behörden, Schuldtitel** | | **401 140** | **421 802** | **0.87** |
| | **Gesamtsumme übertragbarer Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einer amtlichen Börse zugelassen sind oder auf einem anderen geregelten Markt gehandelt werden** | | **16 138 883** | **21 497 275** | **44.16** |
| **Investmentfonds** | | | | | |
| | **Offene Anlagefonds** | | | | |
| 17 000 | ISHARES MSCI EMERGING MARKETS MINIMUM VOLATILITY UCITS ETF | USD | 502 310 | 448 158 | 0.92 |
| 20 | SWISS LIFE FUND (F) MONEY MARKET EURO - I | EUR | 549 185 | 530 088 | 1.09 |
| 80 | SWISS LIFE FUNDS LUX - EQUITY EURO ZONE - S | EUR | 875 593 | 1 075 761 | 2.21 |
| 165 | SWISS LIFE FUNDS LUX - EQUITY GLOBAL | EUR | 2 213 415 | 2 518 691 | 5.17 |
| 505 | SWISS LIFE FUNDS LUX - EQUITY GLOBAL MINIMUM VOLATILITY - C | EUR | 5 606 235 | 7 364 858 | 15.13 |
| 380 | SWISS LIFE FUNDS LUX - EQUITY USA - S | USD | 3 597 687 | 8 777 733 | 18.03 |
| 80 | SWISS LIFE FUNDS LUX - MULTI ASSET RISK PREMIA - S | EUR | 962 727 | 780 793 | 1.60 |
| 180 | SWISS LIFE FUNDS LUX EQUITY GLOBAL LONG/SHORT - SC | EUR | 2 072 708 | 1 867 789 | 3.84 |

# Swiss Life Funds (LUX) Portfolio Global Growth (CHF)

## Anlagenübersicht (Fortsetzung)

| Nominalwert/ Menge | Bezeichnung | Kurs Währung | Kosten CHF | Marktwert CHF | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| **Investmentfonds (Fortsetzung)** | | | | | |
| | **Offene Investmentfonds (Fortsetzung)** | | | | |
| 25 | SWISS LIFE FUNDS LUX EQUITY GLOBAL NXS PROTECT - SC | EUR | 334 507 | 314 568 | 0.65 |
| | **Gesamtsumme offene Anlagefonds** | | **16 714 367** | **23 678 439** | **48.64** |
| **Gesamtsumme der Anlagefonds** | | | **16 714 367** | **23 678 439** | **48.64** |
| **Gesamtsumme der Anlagen** | | | **32 853 250** | **45 175 714** | **92.80** |

# Swiss Life Funds (LUX) Portfolio Global Growth (CHF)

## Sektorstruktur und geographische Verteilung der Anlagen

| Sektorstruktur | % |
|---|---|
| Investmentfonds | 48.64 |
| Pharmazeutik und Biotechnologie | 10.68 |
| Lebensmittelhersteller | 7.72 |
| Banken | 5.46 |
| Finanzdienstleistungen | 5.16 |
| Versicherungen (ohne Lebensversicherung) | 2.00 |
| Bauwirtschaft und Baustoffe | 1.42 |
| Industrietechnik | 1.16 |
| Festnetz-Telekommunikation | 1.00 |
| Behörden | 0.87 |
| Software- und Computerdienstleistungen | 0.84 |
| Technologie Hardware und Geräte | 0.81 |
| Chemikalien | 0.71 |
| Allgemeiner Einzelhandel | 0.71 |
| Kundenbetreuung | 0.68 |
| Öl- und Gasproduzenten | 0.65 |
| Industrietransport | 0.61 |
| Reise, Freizeit und Catering | 0.44 |
| Mobilfunk | 0.43 |
| Getränke | 0.42 |
| Medien | 0.42 |
| Persönliche Güter | 0.41 |
| Lebensmittel- und Arzneimittelhandel | 0.38 |
| Lebensversicherung | 0.31 |
| Geräte und Dienstleistungen im Gesundheitswesen | 0.27 |
| Gas-, Wasser- und Mehrfachversorgungsunternehmen | 0.23 |
| Bergbau | 0.21 |
| Immobilienbezogene Dienstleistungen und Investitionen | 0.16 |
| | **92.80** |

| Geographische Verteilung | % |
|---|---|
| Luxemburg | 47.54 |
| Schweiz | 26.58 |
| Vereinigte Staaten von Amerika | 9.71 |
| Frankreich | 1.75 |
| Großbritannien | 1.51 |
| Niederlande | 1.34 |
| Australien | 1.07 |
| Irland | 0.92 |
| Venezuela | 0.44 |
| Spanien | 0.43 |
| Kanada | 0.23 |
| Barbados | 0.22 |
| Deutschland | 0.22 |
| Chile | 0.21 |
| Guernsey | 0.21 |
| Polen | 0.21 |
| Schweden | 0.21 |
| | **92.80** |

# Swiss Life Funds (LUX) Vitality (EUR)

## Anlagenübersicht

| Nominalwert/ Menge | Bezeichnung | Kurs Währung | Kosten EUR | Marktwert EUR | % des Nettovermögens |
|---|---|---|---|---|---|
| **Investmentfonds** | | | | | |
| | **Offene Anlagefonds** | | | | |
| 210 | SWISS LIFE FUNDS (F) SHORT TERM EURO | EUR | 4 293 858 | 4 256 736 | 2.84 |
| 755 | AMUNDI INDEX SOLUTIONS - INDEX JP MORGAN GLOBAL GBI GOVIES - IEC | EUR | 1 036 926 | 1 099 793 | 0.73 |
| 8 530 | BLACKROCK GLOBAL INDEX FUNDS - ISHARES GLOBAL GOVERNMENT BOND INDEX FUND LU - D2 | EUR | 976 197 | 1 100 967 | 0.74 |
| 35 | CM-CIC UNION MONEPLUS - IC | EUR | 3 760 257 | 3 744 922 | 2.50 |
| 231 500 | ISHARES EDGE MSCI EUROPE MINIMUM VOLATILITY UCITS ETF | EUR | 10 185 909 | 10 551 770 | 7.05 |
| 1 401 000 | ISHARES EDGE S&P 500 MINIMUM VOLATILITY UCITS ETF | EUR | 7 909 965 | 8 756 250 | 5.85 |
| 464 700 | ISHARES MSCI EMERGING MARKETS MINIMUM VOLATILITY UCITS ETF | USD | 11 904 611 | 11 521 785 | 7.70 |
| 17 020 | PARETO SICAV - PARETO NORDIC CORPORATE BOND - I | EUR | 1 740 172 | 1 812 421 | 1.21 |
| 365 | SWISS LIFE FUND (F) EQUITY EURO ZONE MINIMUM VOLATILITY - I | EUR | 4 943 209 | 6 292 363 | 4.20 |
| 900 | SWISS LIFE FUND (F) MONEY MARKET EURO - I | EUR | 22 473 181 | 22 434 948 | 15.00 |
| 110 | SWISS LIFE FUNDS BOND CASH EQUIVALENT TARGET - I | EUR | 1 173 970 | 1 172 536 | 0.78 |
| 105 | SWISS LIFE FUNDS F BOND FLOATING RATES | EUR | 1 062 618 | 1 059 018 | 0.71 |
| 100 | SWISS LIFE FUNDS F CASH EURO | EUR | 2 178 058 | 2 156 125 | 1.44 |
| 515 | SWISS LIFE FUNDS (F) EQUITY EUROPE MINIMUM VOLATILITY - I | EUR | 5 416 822 | 6 288 531 | 4.20 |
| 30 | SWISS LIFE FUNDS LUX - BOND EMERGING MARKETS CORPORATES - S | EUR | 303 264 | 321 835 | 0.22 |
| 115 | SWISS LIFE FUNDS LUX - BOND GLOBAL CORPORATES FUND - S | EUR | 1 151 183 | 1 248 760 | 0.83 |
| 210 | SWISS LIFE FUNDS LUX - BOND GLOBAL HIGH YIELD - S | EUR | 2 752 611 | 2 987 849 | 2.00 |
| 450 | SWISS LIFE FUNDS LUX - EQUITY EURO ZONE - S | EUR | 5 626 895 | 5 691 191 | 3.80 |
| 125 | SWISS LIFE FUNDS LUX - EQUITY GLOBAL | EUR | 1 515 421 | 1 794 591 | 1.20 |
| 320 | SWISS LIFE FUNDS LUX - EQUITY GLOBAL HIGH DIVIDEND - S | EUR | 4 594 519 | 5 283 046 | 3.53 |
| 535 | SWISS LIFE FUNDS LUX - EQUITY GLOBAL MINIMUM VOLATILITY - C | EUR | 6 168 632 | 7 338 231 | 4.90 |
| 325 | SWISS LIFE FUNDS LUX - EQUITY USA - S | USD | 5 175 656 | 7 060 682 | 4.72 |
| 125 | SWISS LIFE FUNDS LUX - FIXED INCOME ALPHA SELECT - S - SHARES - CAPITALISATION | EUR | 1 251 514 | 1 265 959 | 0.85 |
| 255 | SWISS LIFE FUNDS LUX - MULTI ASSET RISK PREMIA - S | EUR | 2 520 306 | 2 340 727 | 1.56 |
| 140 | SWISS LIFE FUNDS LUX EQUITY GLOBAL LONG/SHORT - SC | EUR | 1 387 617 | 1 366 306 | 0.91 |
| 1 270 | SWISS LIFE FUNDS LUX EQUITY GLOBAL NXS PROTECT - SC | EUR | 14 227 092 | 15 029 446 | 10.05 |
| 475 | SWISS LIFE FUNDS LUX-INCOME EQUITY EURO ZONE - S - SHARES - CAPITALISATION | EUR | 4 748 440 | 4 662 610 | 3.12 |
| | **Gesamtsumme offene Anlagefonds** | | **130 478 903** | **138 639 398** | **92.64** |
| **Gesamtsumme der Anlagefonds** | | | **130 478 903** | **138 639 398** | **92.64** |
| **Gesamtsumme der Anlagen** | | | **130 478 903** | **138 639 398** | **92.64** |

## Swiss Life Funds (LUX) Vitality (EUR)

### Sektorstruktur und geographische Verteilung der Anlagen

| Sektorstruktur | % |
|---|---|
| Investmentfonds | 92.64 |
| | **92.64** |

| Geographische Verteilung | % |
|---|---|
| Luxemburg | 40.36 |
| Frankreich | 31.68 |
| Irland | 20.60 |
| | **92.64** |

# Anmerkungen zum Geschäftsbericht

## 1 - Allgemeines

Swiss Life Funds (LUX) ist eine offene Anlagegesellschaft, gegründet am 8. April 1999 auf unbestimmte Zeit auf Initiative von Swiss Life Ltd, mit eingetragenem Sitz in Zürich.

Die Gesellschaft ist in Luxemburg registriert als Organismus für gemeinsame Anlagen in Wertpapieren (OGAW bzw. OPCVM *Organisme de Placement Collectif en Valeurs Mobilières*). Die Gesellschaft wird auf der offiziellen Liste der Organismen für gemeinsame Anlagen geführt, gemäß dem geänderten Gesetz vom 17. Dezember 2010 über Organismen für gemeinsame Anlagen (das „Gesetz von 2010“) und dem Gesetz vom 10. August 1915 über Handelsgesellschaften in geänderter Fassung. Maßgeblich ist insbesondere Teil I des Gesetzes von 2010.

Die Gesellschaftssatzung wurde erstmalig am 14. Mai 1999 im Mémorial veröffentlicht, nach Hinterlegung bei der Registerstelle des Amtsgerichts von Luxemburg, wo sie eingesehen werden kann und wo gegen Zahlung der Gebühr der Registerstelle Exemplare erhältlich sind. Die Satzung wurde letztmalig am 6. Juli 2015 durch notarielle Urkunde des Notariats Hellinckx geändert und am 27. Juli 2015 im Mémorial veröffentlicht.

Ziel der Gesellschaft ist es, innerhalb der einzelnen Teilfonds eine angemessene Rendite aus Wertpapieren zu erzielen, in die der Teilfonds investiert. Die Prinzipien der Risikostreuung, der Schutz des Anlagevermögens und die Liquidität des Vermögens der Gesellschaft werden angemessen berücksichtigt. Langfristige Erwägungen anhand grundlegender Wirtschaftsdaten haben Vorrang vor kurzfristiger und mit Risiken verbundener Gewinnoptimierung. Zur effizienten Portfolioverwaltung kann die Gesellschaft Techniken und Instrumente im Zusammenhang mit übertragbaren Wertpapieren nutzen.

Da die Vermögenswerte der einzelnen Teilfonds normalen Kursschwankungen unterliegen, kann nicht garantiert werden, dass der betreffende Teilfonds sein Anlageziel erreicht.

Zusätzlich kann der Teilfonds liquide Mittel in Währungen halten, in denen das Vermögen angelegt oder in denen der Rücknahmepreis ausgezahlt wird.

Im Einklang mit den Anlagebeschränkungen kann der Portfoliomanager der einzelnen Teilfonds jeweils Termin-, Swap- und Optionsgeschäfte tätigen. Verbindlichkeiten aus diesen Geschäften dürfen jedoch nicht höher sein als das Nettovermögen des betreffenden Teilfonds.

Zum 29. Februar 2020 standen den Anlegern 21 Teilfonds zur Verfügung:

- Swiss Life Funds (LUX) Bond Emerging Markets Corporates
- Swiss Life Funds (LUX) Bond Emerging Markets Corporates Short Term
- Swiss Life Funds (LUX) Bond Euro Corporates
- Swiss Life Funds (LUX) Bond Global Corporates
- Swiss Life Funds (LUX) Bond Global Corporates Short Term
- Swiss Life Funds (LUX) Bond Global High Yield
- Swiss Life Funds (LUX) Bond Inflation Protection
- Swiss Life Funds (LUX) Equity Euro Zone
- Swiss Life Funds (LUX) Equity Global
- Swiss Life Funds (LUX) Equity Global High Dividend
- Swiss Life Funds (LUX) Equity Global Long/Short
- Swiss Life Funds (LUX) Equity Global Minimum Volatility
- Swiss Life Funds (LUX) Equity Global Protect
- Swiss Life Funds (LUX) Equity USA
- Swiss Life Funds (LUX) Fixed Income Alpha Select[1]
- Swiss Life Funds (LUX) Multi Asset Risk Premia
- Swiss Life Funds (LUX) Prudent (EUR)
- Swiss Life Funds (LUX) Harmony (EUR)
- Swiss Life Funds (LUX) Income Equity Euro Zone[1]
- Swiss Life Funds (LUX) Portfolio Global Growth (CHF)
- Swiss Life Funds (LUX) Vitality (EUR)

[1] Swiss Life Funds (LUX) Fixed Income Alpha Select wurde zum 3. September 2019 aufgelegt und Swiss Life Funds (LUX) Income Equity Euro Zone wurde zum 19. Dezember 2019 aufgelegt.

## **Anmerkungen zum Geschäftsbericht** (Fortsetzung)

Swiss Life Funds (LUX) kann für jeden Teilfonds die unterschiedlichen Anteilklassen ausgeben.

Zum 29. Februar 2020 hat das Unternehmen die folgenden Anteilklassen in den folgenden Teilfonds ausgegeben:

| Teilfonds | Anteilklassen |
|---|---|
| Swiss Life Funds (LUX) Bond Emerging Markets Corporates | AM-Anteile - in CHF Abgesichert - Thesaurierend |
| | AM-Anteile - in EUR Abgesichert - Thesaurierend |
| | F-Anteile - Thesaurierend |
| | I-Anteile - Thesaurierend |
| | I-Anteile - in CHF Abgesichert - Thesaurierend |
| | I-Anteile - in EUR Abgesichert - Thesaurierend |
| | I-Anteile - in EUR Abgesichert - Thesaurierend |
| | R-Anteile - in CHF Abgesichert - Thesaurierend |
| | R-Anteile - in EUR Abgesichert - Thesaurierend |
| | S-Anteile - in EUR Abgesichert - Thesaurierend |
| Swiss Life Funds (LUX) Bond Emerging Markets Corporates Short Term | AM-Anteile - in CHF Abgesichert - Thesaurierend |
| | F-Anteile - Thesaurierend |
| | I-Anteile - Thesaurierend |
| | I-Anteile - in CHF Abgesichert - Thesaurierend |
| | I-Anteile - in EUR Abgesichert - Thesaurierend |
| Swiss Life Funds (LUX) Bond Euro Corporates | Q-Anteile - Thesaurierend |
| | R-Anteile - Thesaurierend |
| | R-Anteile in CHF Abgesichert - Thesaurierend |
| Swiss Life Funds (LUX) Bond Global Corporates | AM-Anteile - Thesaurierend |
| | I-Anteile - Thesaurierend |
| | I-Anteile - Ausschüttend |
| | I-Anteile in USD Abgesichert - Thesaurierend |
| | R-Anteile - Thesaurierend |
| | R-Anteile in CHF Abgesichert - Thesaurierend |
| | S-Anteile - Thesaurierend |
| Swiss Life Funds (LUX) Bond Global Corporates Short Term | I-Anteile - Thesaurierend |
| | I-Anteile - Ausschüttend |
| | R-Anteile - Ausschüttend |
| Swiss Life Funds (LUX) Bond Global High Yield | AM-Anteile - Thesaurierend |
| | AM-Anteile in CHF Abgesichert - Thesaurierend |
| | F-Anteile - Thesaurierend |
| | I-Anteile - Thesaurierend |
| | I-Anteile - Ausschüttend |
| | I-Anteile in CHF Abgesichert - Thesaurierend |
| | R-Anteile - Thesaurierend |
| | R-Anteile in CHF Abgesichert - Thesaurierend |
| | S-Anteile - Thesaurierend |
| Swiss Life Funds (LUX) Bond Inflation Protection | I-Anteile - Thesaurierend |
| | R-Anteile - Thesaurierend |
| Swiss Life Funds (LUX) Equity Euro Zone | AM-Anteile - Thesaurierend |
| | F-Anteile - Thesaurierend |
| | I-Anteile - Thesaurierend |
| | R-Anteile - Thesaurierend |
| | S-Anteile - Thesaurierend |
| Swiss Life Funds (LUX) Equity Global | AM-Anteile in EUR - Thesaurierend |
| | F-Anteile in CHF - Thesaurierend |
| | I-Anteile - Thesaurierend |
| | I-Anteile EUR - Thesaurierend |
| | S-Anteile EUR - Thesaurierend |
| Swiss Life Funds (LUX) Equity Global High Dividend | AM-Anteile - Thesaurierend |
| | I-Anteile - Thesaurierend |
| | I-Anteile - Ausschüttend |
| | R-Anteile - Thesaurierend |
| | R-Anteile in CHF - Ausschüttend |
| | S-Anteile - Thesaurierend |

## **Anmerkungen zum Geschäftsbericht** (Fortsetzung)

| Teilfonds | Anteilklassen |
|---|---|
| Swiss Life Funds (LUX) Equity Global Long/Short | AM-Anteile - Thesaurierend |
| | I-Anteile - Thesaurierend |
| | S-Anteile - Thesaurierend |
| Swiss Life Funds (LUX) Equity Global Minimum Volatility | AM-Anteile in EUR - Thesaurierend |
| | I-Anteile - Thesaurierend |
| | I-Anteile EUR - Thesaurierend |
| | I-Anteile EUR - Ausschüttend |
| | R-Anteile EUR - Ausschüttend |
| | S-Anteile EUR - Thesaurierend |
| Swiss Life Funds (LUX) Equity Global Protect | I-Anteile - Thesaurierend |
| | S-Anteile - Thesaurierend |
| Swiss Life Funds (LUX) Equity USA | AM-Anteile in EUR - Thesaurierend |
| | F-Anteile - Thesaurierend |
| | I-Anteile - Thesaurierend |
| | I-Anteile EUR - Thesaurierend |
| | R-Anteile - Thesaurierend |
| | S-Anteile - Thesaurierend |
| | SL-Anteile in EUR - Ausschüttend |
| Swiss Life Funds (LUX) Fixed Income Alpha Select [1] | AM-Anteile - Thesaurierend |
| | I-Anteile - Thesaurierend |
| | S-Anteile - Thesaurierend |
| Swiss Life Funds (LUX) Multi Asset Risk Premia | AM-Anteile - Thesaurierend |
| | AM-Anteile in CHF Abgesichert - Thesaurierend |
| | I-Anteile - Thesaurierend |
| | I-Anteile in CHF Abgesichert - Thesaurierend |
| | R-Anteile in CHF Abgesichert - Thesaurierend |
| | S-Anteile - Thesaurierend |
| Swiss Life Funds (LUX) Prudent (EUR) | F-Anteile - Thesaurierend |
| | I-Anteile - Thesaurierend |
| | M-Anteile - Thesaurierend |
| | R-Anteile - Thesaurierend |
| Swiss Life Funds (LUX) Harmony (EUR) | M-Anteile - Thesaurierend |
| | R-Anteile - Thesaurierend |
| Swiss Life Funds (LUX) Fixed Income Equity Euro Zone [1] | AM-Anteile - Ausschüttend |
| | S-Anteile - Thesaurierend |
| | SL-Anteile - Ausschüttend |
| Swiss Life Funds (LUX) Portfolio Global Growth (CHF) | R-Anteile - Thesaurierend |
| Swiss Life Funds (LUX) Vitality (EUR) | M-Anteile - Thesaurierend |
| | R-Anteile - Thesaurierend |

Anteile der Klasse AM („AM-Anteile“), die beschränkt sind auf institutionelle Anleger im Sinne von Artikel 174 des Gesetzes von 2010, die eine Anlageverwaltungsvereinbarung mit Swiss Life Asset Management AG oder einem anderen Unternehmen der Swiss Life Group getroffen haben.

Anteile der Klasse F („F-Anteile“) stehen allen Anlegern offen, werden aber nur über bestimmte Finanzintermediäre, Vertriebspartner oder Ähnliches angeboten, die im Auftrag ihrer Kunden investieren und diesen Beratungsgebühren oder Ähnliches berechnen.

Anteile der Klasse I („I-Anteile“) sind beschränkt auf institutionelle Anleger im Sinne von Artikel 174 des Gesetzes von 2010.

Anteile der Klasse M („M-Anteile“) sind beschränkt auf Swiss Life Asset Management AG, Swiss Life Germany oder ein anderes Unternehmen der Swiss Life Group, die im Auftrag ihrer fondsgebundenen Produktkunden handeln.

Anteile der Klasse Q („Q-Anteile“) sind beschränkt auf institutionelle Anleger im Sinne von Artikel 174 des Gesetzes von 2010.

[1] Swiss Life Funds (LUX) Fixed Income Alpha Select wurde zum 3. September 2019 aufgelegt und Swiss Life Funds (LUX) Income Equity Euro Zone wurde zum 19. Dezember 2019 aufgelegt.

## Anmerkungen zum Geschäftsbericht (Fortsetzung)

Anteile der Klasse R („R-Anteile“) stehen allen Anlegern offen.

Anteile der Klasse S („S-Anteile“) sind beschränkt auf Teilfonds der Gesellschaft.

Anteile der Klasse SL („SL-Anteile“) sind beschränkt auf Swiss Life France, Swiss Life Germany und Swiss Life Switzerland oder ein anderes Unternehmen der Swiss Life Group, die im Auftrag ihres eigenen Versicherungsportfolios handeln.

Anteile der Klasse F („F-Anteile“) sind beschränkt auf Swiss Life France, Swiss Life Germany und Swiss Life Switzerland oder ein anderes Unternehmen der Swiss Life Group, die im Auftrag ihres eigenen Versicherungsportfolios handeln.

Anteile der Klasse SF („SF-Anteile“) sind beschränkt auf Swiss Life France, die im Auftrag ihrer fondsgebundenen Produktkunden handelt.

### 2 - Wichtige Grundsätze der Rechnungslegung

#### 2.1 Präsentation des Geschäftsberichts

Der Geschäftsbericht wurde im Einklang mit den allgemeinen Rechnungslegungsstandards für Anlagefonds in Luxemburg erstellt.

Querbeteiligungen von Teilfonds - Zum 29. Februar 2020 besitzen der Teilfonds Anlagen anderer Teilfonds der SICAV im Wert von 846 794 487 EUR. Dies entspricht 15.89% des gesamten Nettoinventarwerts. Ohne diese Querbeteiligungen läge der gesamte zusammengefasste Nettoinventarwert zum Ende des Zeitraums somit bei EUR 4 483 790 167.

#### 2.2 Berechnung des Nettoinventarwerts

Der Nettoinventarwert der Anteile wird im Einklang mit der Gesellschaftssatzung anhand der Kurse zum Bewertungszeitpunkt vor dem Bewertungstag ermittelt. Der Nettoinventarwert pro Anteil wird in der Referenzwährung des entsprechenden Teilfonds ausgedrückt. Er wird für jeden Teilfonds berechnet, indem die Vermögenswerte dieses Teilfonds abzüglich seiner Verbindlichkeiten (unter Berücksichtigung einer Rückstellung für Abgaben und Kosten) durch die Anzahl der ausgegebenen Anteile dieses Teilfonds dividiert werden.

Wenn in einem Teilfonds weitere Anteilklassen erstellt werden, wird der Nettoinventarwert pro Anteil jeder Anteilklasse eines Teilfonds ermittelt, indem der Anteil des Nettoinventarwerts, der jeder Klasse zuzurechnen ist, anhand der Anzahl der ausgegebenen oder als ausgegeben betrachteten Anteile jeder Klasse am entsprechenden Bewertungstag berechnet wird, unter Berücksichtigung einer Anpassung der Vermögenswerte und/oder Verbindlichkeiten, die jeder Klasse zuzurechnen sind.

#### 2.3 Bewertungsgrundsätze

Die in der Satzung dargelegte Methode zur Festlegung des Wertes von Vermögenswerten und Verbindlichkeiten der Gesellschaft sieht vor, das der Wert einer an einem geregelten Markt, an einer Börse in einem anderen Staat oder an einem anderen geregelten Markt geführten, notierten oder gewöhnlich gehandelten Anlage in der Regel der letzte verfügbare Schlusskurs oder die letzte verfügbare Schlussnotierung an diesem Markt zum Bewertungstag ist (oder wenn an diesem Markt am Bewertungstag nicht gehandelt wird, am letzten Tag vor dem Bewertungstag, an dem an diesem Markt gehandelt wird), in einer Höhe und Menge dieser Anlage, welche die Verwaltungsstelle als angemessene Grundlage betrachtet.

2.3.1 Wenn eine Anlage an einem geregelten Markt, an einer Börse in einem anderen Staat oder an einem anderen geregelten Markt notiert oder gehandelt wird, außerhalb oder jenseits des entsprechenden Marktes jedoch mit einem Auf- bzw. Abschlag gekauft oder gehandelt wird, kann die Verwaltungsstelle die Höhe des Auf- bzw. Abschlags am Bewertungstag berücksichtigen.

2.3.2 Wenn eine Anlage an mehr als einem geregelten Markt, an mehr als einer Börse in einem anderen Staat oder an mehr als einem anderen geregelten Markt geführt, notiert oder gewöhnlich gehandelt wird, wendet die Verwaltungsstelle den Schlusskurs oder die Schlussnotierung des Marktes an, der nach Ansicht der Verwaltungsstelle der hauptsächliche Markt dieser Anlage ist.

2.3.3 Wenn für eine Anlage, die an einem geregelten Markt, an einer Börse in einem anderen Staat oder an einem anderen geregelten Markt notiert oder gewöhnlich gehandelt wird, zu einem bestimmten Zeitpunkt aus irgendeinem Grund kein Schlusskurs verfügbar ist oder wenn dieser nach Ansicht des Verwaltungsrats nicht den Marktwert der Anlage zum Ausdruck bringt, ist ihr Wert der voraussichtlich zu erzielende Veräußerungswert, den eine hierzu befähigte und von der Verwaltungsstelle hierzu ermächtigte Person sorgfältig und in gutem Glauben ermittelt.

## **Anmerkungen zum Geschäftsbericht** (Fortsetzung)

2.3.4 Der Wert von Anlagen, die nicht an einem geregelten Markt, an einer Börse in einem anderen Staat oder an einem anderen geregelten Markt geführt, notiert oder gewöhnlich gehandelt werden, ist der voraussichtlich zu erzielende Veräußerungswert, den eine hierzu befähigte und von der Verwaltungsstelle hierzu ermächtigte Person sorgfältig und in gutem Glauben ermittelt.

2.3.5 Der Wert der Kassenbestände oder Bankguthaben, Wechsel und Sichtpapiere und der Forderungen, Rechnungsabgrenzungsposten, Bardividenden und Zinsen, die wie vorstehend erklärt oder aufgelaufen, aber noch nicht eingegangen sind, werden in voller Höhe berücksichtigt, sofern es nicht unwahrscheinlich ist, dass diese in voller Höhe gezahlt oder empfangen werden. In diesem Fall kann der entsprechende Wert nach einem entsprechenden Abschlag berücksichtigt werden, um den wahren Wert widerzuspiegeln.

2.3.6 Der Wert von übertragbaren Wertpapieren, Geldmarktinstrumenten und Finanzanlagen, die an einem geregelten Markt, an einer Börse in einem anderen Staat oder an einem anderen geregelten Markt notiert oder gehandelt werden (gemäß der Definition in den Verkaufsunterlagen für Anteile der Gesellschaft), basiert auf dem letzten verfügbaren Kurs am entsprechenden Markt, der in der Regel der hauptsächliche Markt dieses Vermögenswertes ist.

2.3.7 Sollten Vermögenswerte nicht an einem geregelten Markt, an einer Börse in einem anderen Staat oder an einem anderen geregelten Markt geführt oder gehandelt werden, oder wenn der gemäß obenstehendem Abschnitt ermittelte Preis der an diesen Märkten notierten oder gehandelten Vermögenswerte nach Auffassung des Verwaltungsrates nicht repräsentativ für den Verkehrswert der entsprechenden Vermögenswerte ist, basiert der Wert dieser Vermögenswerte auf dem angemessen voraussehbaren Verkaufspreis, der umsichtig und in gutem Glauben ermittelt wird.

2.3.8 Zur Bewertung kurzfristiger übertragbarer Schuldtitel in bestimmten Teilfonds der Gesellschaft kann der Verwaltungsrat die Verwendung der Methode der fortgeführten Anschaffungskosten genehmigen. Bei dieser Methode werden Wertpapiere zu ihren Kosten bewertet und danach wird eine konstante Amortisierung bis zur Fälligkeit jeglicher Abschläge und Aufschläge angenommen, unabhängig von den Auswirkungen schwankender Zinssätze auf den Marktwert der Wertpapiere oder anderer Instrumente. Diese Methode sorgt für Gewissheit bei der Bewertung, kann jedoch dazu führen, dass der Wert der fortgeführten Anschaffungskosten zeitweilig höher oder niedriger ist als der Preis, den der Teilfonds erhalten würde, wenn er die Wertpapiere verkaufen würde. Anleger können bei bestimmten kurzfristigen übertragbaren Schuldtiteln eine andere Rendite erhalten als bei einem ähnlichen Teilfonds, der die Wertpapiere seines Portfolios marktnah bewertet.

2.3.9 Der Liquidationswert von nicht an geregelten Märkten, an Börsen in anderen Staaten oder an anderen geregelten Märkten gehandelten Future-, Termin- oder Optionskontrakten muss bedeuten, dass deren Nettoliquidationswert gemäß den vom Verwaltungsrat umsichtig und in gutem Glauben aufgestellten Richtlinien auf einer Basis bestimmt wird, die in einem konsistenten Verhältnis zu allen anderen Arten von Kontrakten steht. Der Liquidationswert von an geregelten Märkten, an Börsen in anderen Staaten oder an anderen geregelten Märkten gehandelten Future-, Termin- oder Optionskontrakten muss auf den letzten verfügbaren Abrechnungspreisen dieser Kontrakte an geregelten Märkten, an Börsen in anderen Staaten oder an anderen geregelten Märkten basieren, an denen diese Future-, Termin- oder Optionskontrakte gehandelt werden; wenn ein Future-, Termin- oder Optionskontrakt nicht an dem Tag liquidiert werden konnte, in Bezug auf den das Nettovermögen bestimmt wurde, gilt als Grundlage für die Bestimmung des Liquidationswerts eines solchen Kontrakts der Wert, den der Verwaltungsrat als fair und angemessen betrachtet.

2.3.10 Einheiten oder Anteile offener OGAW und/oder OGA werden zum letzten festgestellten und verfügbaren Nettoinventarwert bewertet. Sollte dieser Preis nicht repräsentativ für den Verkehrswert der Vermögenswerte sein, so wird der Preis durch den Verwaltungsrat auf fairer und gerechter Grundlage ermittelt. Einheiten oder Anteile geschlossener OGA werden zu ihrem letzten verfügbaren Börsenwert bewertet.

2.3.11 Zinsswaps werden zu ihrem Marktwert bewertet, der mit Bezug auf die anzuwendende Zinskurve festgelegt wird. Index- und Finanzinstrumente im Zusammenhang mit Swaps werden zu ihrem Marktwert bewertet, der anhand des jeweiligen Index- oder Finanzinstruments festgelegt wird. Die Bewertung von Swapvereinbarungen im Zusammenhang mit Index- oder Finanzinstrumenten basiert auf dem in gutem Glauben festgelegten Marktwert dieser Swapgeschäfte. Total Return Swaps werden auf einheitlicher Grundlage bewertet.

2.3.12 Alle anderen Wertpapiere und Vermögenswerte werden zum Verkehrswert bewertet, der in gutem Glauben gemäß den vom Verwaltungsrat festgelegten Verfahren bestimmt wird.

2.3.13 Beträge, die in anderen Währungen als der entsprechenden Referenzwährung lauten, werden zum letzten verfügbaren Wechselkurs in die Referenzwährung umgerechnet.

2.3.14 Wenn es nicht möglich oder unzulässig ist, einen bestimmten Vermögenswert gemäß den oben dargelegten Bewertungsregeln zu bewerten, ist der Verwaltungsrat dazu berechtigt, eine andere allgemein anerkannte Bewertungsmethode zu verwenden, um eine angemessene Bewertung dieses spezifischen Vermögenswertes zu erhalten, sofern die alternative Bewertungsmethode von der Verwaltungsstelle genehmigt wird.

## Anmerkungen zum Geschäftsbericht (Fortsetzung)

2.3.15 Alle Entscheidungen des Verwaltungsrats oder seiner Vertreter zur Berechnung des Nettoinventarwerts eines Teilfonds oder des Nettoinventarwerts pro Anteil sind für die Gesellschaft und deren gegenwärtige, frühere und zukünftige Anteilinhaber endgültig und bindend, sofern keine Täuschungsabsicht, keine Fahrlässigkeit oder kein offensichtlicher Fehler vorliegt.

**2.4 Bewertung von Devisentermingeschäften**
Der nicht realisierte Gewinn (Verlust) aus ausstehenden Devisentermingeschäften wird auf Grundlage der maßgeblichen Devisenterminkurse am Bewertungsdatum bewertet.

**2.5 Realisierter Nettogewinn/ (-verlust) aus dem Verkauf von Wertpapieren**
Realisierte Gewinne oder Verluste aus dem Verkauf von Wertpapieren werden auf Grundlage der Durchschnittspreise der verkauften Wertpapiere berechnet.

**2.6 Umrechnung ausländischer Währungen**
Bankkonten, sonstige Nettovermögenswerte und die Bewertung von Wertpapieranlagen, die in anderen Währungen lauten als die Bilanzierungswährung der unterschiedlichen Teilfonds, werden zu den Devisenmittelkassakursen am Bewertungsdatum umgerechnet. Erträge und Aufwendungen, die in anderen Währungen lauten als die Währung der unterschiedlichen Teilfonds, werden zu den Devisenmittelkassakursen am Zahlungsdatum umgerechnet. Gewinne oder Verluste aus Devisenvorgängen werden in der Aufwands- und Ertragsrechnung berücksichtigt. Preise von Wertpapieren, die in anderen Währungen lauten als die Bilanzierungswährung der unterschiedlichen Teilfonds, werden zum maßgeblichen Devisenmittelkassakurs am Tag des Erwerbs umgerechnet.

**2.7 Bilanzierung von Portfoliotransaktionen der Wertpapiere**
Portfoliotransaktionen der Wertpapiere werden zum Bankwerktag nach dem Transaktionsdatum bilanziert.

**2.8 Forderungen für verkaufte Wertpapiere, Verbindlichkeiten für erworbene Wertpapiere**
Der Posten „Forderungen für verkaufte Wertpapiere“ kann Forderungen aus Fremdwährungsgeschäften enthalten.
Der Posten „Verbindlichkeiten für erworbene Wertpapiere“ kann Verbindlichkeiten aus Fremdwährungsgeschäften enthalten.

**2.9 Erfassung von Erträgen**
Dividenden werden nach Abzug der Quellensteuer zum Datum der erstmaligen Dividendenzahlung der entsprechenden Wertpapiere als Ertrag erfasst. Zinseinkünfte werden auf Tagesbasis verrechnet.

**2.10 Gründungskosten**
Gründungskosten von bis zu EUR 100 000 (einschließlich u. a. Anwalts- und Wirtschaftsprüfungskosten, Übersetzungs- und Druckkosten), die der Verwaltungs- oder Depotstelle in Verbindung mit der Gründung und Unterstützung der Gesellschaft entstehen, sowie darüber hinaus Kosten, die der Verwaltungs- oder Depotstelle in Verbindung mit der Erstausgabe von Anteilen jedes Teilfonds entstehen (amortisiert über ein Jahr von bis zu fünf Jahren).

**2.11 Forderungen und Verbindlichkeiten aus Kassadevisen**
Die interne Verrechnung von Kassakonten in ausländischen Währungen mit einer Laufzeit von weniger als drei Tagen wird in der Nettovermögensaufstellung unter der Rubrik „Forderungen aus Kassadevisen“ und „Verbindlichkeiten aus Kassadevisen“ erfasst.

**2.12 Wertpapierleihgeschäfte**
Der Fonds kann Wertpapierleihgeschäfte tätigen, wenn dies im Einklang steht mit den geltenden Regeln des Rundschreibens 08/356 der CSSF (das „Rundschreiben 08/356“) für Organismen für gemeinsame Anlagen und deren Verwendung bestimmter Techniken und Instrumente in Verbindung mit übertragbaren Wertpapieren und Geldmarktinstrumenten: Der Fonds kann Wertpapiere entweder direkt oder über ein standardisiertes Leihsystem verleihen oder ausleihen, das von einer anerkannten Clearingstelle betrieben wird oder von einem Finanzinstitut, das auf diese Art von Geschäfte spezialisiert ist und vernünftigen aufsichtsrechtlichen Bestimmungen unterliegt, die von der CSSF als gleichwertig mit dem Gemeinschaftsrecht angesehen werden. Bei Leihgeschäften muss der Fonds für die Laufzeit der Vereinbarung jederzeit eine Sicherheit in Höhe von mindestens 90% der globalen Bewertung der beliehenen Wertpapiere erhalten.

## Anmerkungen zum Geschäftsbericht (Fortsetzung)

### 3 - Managementgebühren und Anlageverwaltungsgebühren

Der von der Verwaltungsgesellschaft und/oder Swiss Life Asset Management AG bestimmte Portfoliomanager und/oder Vertreiber der Anteile ist für die gemäß der Vereinbarung zur Erbringung unterstützender Dienstleistungen bereitgestellten Serviceleistungen wie nachstehend festgelegt zum jährlichen Erhalt einer Managementgebühr berechtigt:

| Teilfonds | Anteilklassen | Jährliche Verwaltungsgebühr Maximale | Effektiv |
|---|---|---|---|
| Swiss Life Funds (LUX) Bond Emerging Markets Corporates | AM-Anteile - in CHF Abgesichert - Thesaurierend | 1.50% | 0.15% |
| | AM-Anteile - in EUR Abgesichert -Thesaurierend | 1.50% | 0.15% |
| | F-Anteile - Thesaurierend | 1.50% | 0.85% |
| | I-Anteile - Thesaurierend | 1.50% | 0.70% |
| | I-Anteile - in CHF Abgesichert - Thesaurierend | 1.50% | 0.70% |
| | I-Anteile - in EUR Abgesichert - Thesaurierend | 1.50% | 0.70% |
| | I-Anteile - in EUR Abgesichert - Ausschüttend | 1.50% | 0.70% |
| | R-Anteile - in CHF Abgesichert - Thesaurierend | 1.50% | 1.30% |
| | R-Anteile - in EUR Abgesichert - Thesaurierend | 1.50% | 1.30% |
| | S-Anteile - in EUR Abgesichert - Thesaurierend | 1.50% | 0.00% |
| Swiss Life Funds (LUX) Bond Emerging Markets Corporates Short Term | AM-Anteile - in CHF Abgesichert - Thesaurierend | 1.00% | 0.15% |
| | F-Anteile - Thesaurierend | 1.00% | 0.60% |
| | I-Anteile - Thesaurierend | 1.00% | 0.45% |
| | I-Anteile - in CHF Abgesichert - Thesaurierend | 1.00% | 0.45% |
| | I-Anteile - in EUR Abgesichert - Thesaurierend | 1.00% | 0.45% |
| Swiss Life Funds (LUX) Bond Euro Corporates | Q-Anteile - Thesaurierend | 1.00% | 0.45% |
| | R-Anteile - Thesaurierend | 1.00% | 0.90% |
| | R-Anteile in CHF Abgesichert - Thesaurierend | 1.00% | 0.90% |
| Swiss Life Funds (LUX) Bond Global Corporates | AM-Anteile - Thesaurierend | 1.00% | 0.15% |
| | I-Anteile - Ausschüttend | 1.00% | 0.40% |
| | I-Anteile - Thesaurierend | 1.00% | 0.40% |
| | I-Anteile in USD Abgesichert - Thesaurierend | 1.00% | 0.40% |
| | R-Anteile - Thesaurierend | 1.00% | 0.90% |
| | R-Anteile in CHF Abgesichert - Thesaurierend | 1.00% | 0.90% |
| | S-Anteile - Thesaurierend | 1.00% | 0.00% |
| Swiss Life Funds (LUX) Bond Global Corporates Short Term | I-Anteile - Thesaurierend | 1.00% | 0.25% |
| | I-Anteile - Ausschüttend | 1.00% | 0.25% |
| | R-Anteile - Ausschüttend | 1.00% | 0.45% |
| Swiss Life Funds (LUX) Bond Global High Yield | AM-Anteile - Thesaurierend | 1.50% | 0.15% |
| | AM-Anteile in CHF Abgesichert - Thesaurierend | 1.50% | 0.15% |
| | F-Anteile - Thesaurierend | 1.50% | 0.75% |
| | I-Anteile - Thesaurierend | 1.50% | 0.60% |
| | I-Anteile - Ausschüttend | 1.50% | 0.60% |
| | I-Anteile in CHF Abgesichert - Thesaurierend | 1.50% | 0.60% |
| | R-Anteile - Thesaurierend | 1.50% | 1.20% |
| | R-Anteile in CHF Abgesichert - Thesaurierend | 1.50% | 1.20% |

## Anmerkungen zum Geschäftsbericht (Fortsetzung)

| Teilfonds | Anteilklassen | Jährliche Verwaltungsgebühr Maximale | Effektiv |
|---|---|---|---|
| | S-Anteile - Thesaurierend | 1.50% | 0.00% |
| Swiss Life Funds (LUX) Bond Inflation Protection | I-Anteile - Thesaurierend | 1.00% | 0.45% |
| | R-Anteile - Thesaurierend | 1.00% | 0.90% |
| Swiss Life Funds (LUX) Equity Euro Zone | AM-Anteile - Thesaurierend | 1.50% | 0.15% |
| | F-Anteile - Thesaurierend | 1.50% | 0.85% |
| | I-Anteile - Thesaurierend | 1.50% | 0.60% |
| | R-Anteile - Thesaurierend | 1.50% | 1.50% |
| | S-Anteile - Thesaurierend | 1.50% | 0.00% |
| Swiss Life Funds (LUX) Equity Global | AM-Anteile in EUR - Thesaurierend | 1.50% | 0.15% |
| | F-Anteile in CHF - Thesaurierend | 1.50% | 0.85% |
| | I-Anteile - Thesaurierend | 1.50% | 0.60% |
| | I-Anteile EUR - Thesaurierend | 1.50% | 0.60% |
| | S-Anteile EUR - Thesaurierend | 1.50% | 0.00% |
| Swiss Life Funds (LUX) Equity Global High Dividend | AM-Anteile - Thesaurierend | 1.50% | 0.15% |
| | I-Anteile - Thesaurierend | 1.50% | 0.60% |
| | I-Anteile - Ausschüttend | 1.50% | 0.60% |
| | R-Anteile - Thesaurierend | 1.50% | 1.50% |
| | R-Anteile in CHF - Ausschüttend | 1.50% | 1.50% |
| | S-Anteile - Thesaurierend | 1.50% | 0.00% |
| Swiss Life Funds (LUX) Equity Global Long/Short | AM-Anteile - Thesaurierend | 1.50% | 0.15% |
| | I-Anteile - Thesaurierend | 1.50% | 0.30% |
| | S-Anteile - Thesaurierend | 1.50% | 0.00% |
| Swiss Life Funds (LUX) Equity Global Minimum Volatility | AM-Anteile in EUR - Thesaurierend | 1.50% | 0.15% |
| | I-Anteile - Thesaurierend | 1.50% | 0.60% |
| | I-Anteile EUR - Thesaurierend | 1.50% | 0.60% |
| | I-Anteile EUR - Ausschüttend | 1.50% | 0.60% |
| | R-Anteile EUR - Ausschüttend | 1.50% | 1.50% |
| | S-Anteile - EUR - Thesaurierend | 1.50% | 0.00% |
| Swiss Life Funds (LUX) Equity Global Protect | I-Anteile - Thesaurierend | 1.50% | 0.60% |
| | S-Anteile - Thesaurierend | 1.50% | 0.00% |
| Swiss Life Funds (LUX) Equity USA | AM-Anteile in EUR - Thesaurierend | 1.50% | 0.15% |
| | F-Anteile - Thesaurierend | 1.50% | 0.85% |
| | I-Anteile - Thesaurierend | 1.50% | 0.60% |
| | I-Anteile EUR - Thesaurierend | 1.50% | 0.60% |
| | R-Anteile - Thesaurierend | 1.50% | 1.50% |
| | S-Anteile - Thesaurierend | 1.50% | 0.00% |
| | SL-Anteile in EUR - Ausschüttend | 1.50% | 0.30% |
| Swiss Life Funds (LUX) Fixed Income Alpha Select[1] | I-Anteile - Thesaurierend | 1.50% | 0.70% |
| | AM-Anteile - Thesaurierend | 1.50% | 0.15% |
| | S-Anteile - Thesaurierend | 1.50% | 0.00% |

[1] Dieser Teilfonds wurde zum 3. September 2019 aufgelegt.

## Anmerkungen zum Geschäftsbericht (Fortsetzung)

| Teilfonds | Anteilklassen | Jährliche Verwaltungsgebühr Maximale | Effektiv |
|---|---|---|---|
| Swiss Life Funds (LUX) Multi Asset Risk Premia | AM-Anteile - Thesaurierend | 1.50% | 0.25% |
| | AM-Anteile in CHF Abgesichert - Thesaurierend | 1.50% | 0.25% |
| | I-Anteile - Thesaurierend | 1.50% | 0.60% |
| | I-Anteile in CHF Abgesichert - Thesaurierend | 1.50% | 0.60% |
| | R-Anteile in CHF Abgesichert - Thesaurierend | 1.50% | 1.40% |
| | S-Anteile - Thesaurierend | 1.50% | 0.00% |
| Swiss Life Funds (LUX) Prudent (EUR) | F-Anteile - Thesaurierend | 1.20% | 0.60% |
| | I-Anteile - Thesaurierend | 1.20% | 0.40% |
| | M-Anteile - Thesaurierend | 1.20% | 0.30% |
| | R-Anteile - Thesaurierend | 1.20% | 1.20% |
| Swiss Life Funds (LUX) Harmony (EUR) | M-Anteile - Thesaurierend | 1.45% | 0.35% |
| | R-Anteile - Thesaurierend | 1.45% | 1.45% |
| Swiss Life Funds (LUX) Income Equity Euro Zone[1] | AM-Anteile - Ausschüttend | 1.00% | 0.15% |
| | S-Anteile - Thesaurierend | 1.00% | 0.00% |
| | SL-Anteile - Ausschüttend | 1.00% | 0.40% |
| Swiss Life Funds (LUX) Portfolio Global Growth (CHF) | R-Anteile - Thesaurierend | 1.50% | 1.50% |
| Swiss Life Funds (LUX) Vitality (EUR) | M-Anteile - Thesaurierend | 1.70% | 0.40% |
| | R-Anteile - Thesaurierend | 1.70% | 1.70% |

### 4 - Gebühren der Depot-, Verwaltungs- und Registerstelle

Eine täglich berechnete und monatlich an die Depotstelle zu zahlende rückwirkende Depotgebühr. Die Depotgebühr kann je nach Art der von der Depotstelle verwahrten Vermögenswerte variieren. Darüber hinaus werden der Depotstelle entsprechende Kosten (zu marktüblichen Tarifen) erstattet. Die Depotgebühr einschließlich der Gebühren für Unterdepotstellen ist auf einen Höchstsatz von 0.07% (ohne Transaktionsgebühren) des jährlichen Nettovermögenswerts des Teilfonds festgelegt.

Eine täglich berechnete und monatlich an die Verwaltungsstelle zu zahlende rückwirkende Verwaltungsgebühr mit einem Höchstsatz von 0.56% des jährlichen Nettoinventarwerts des Teilfonds.

Eine täglich berechnete und monatlich an die Registerstelle zu zahlende rückwirkende Registerstellen- und Übertragungsgebühr mit einem Höchstsatz von 0.03% (ohne Transaktionsgebühren) des jährlichen Nettoinventarwerts des Teilfonds.

### 5 - Besteuerung

Gemäß geltendem Recht unterliegt die SICAV in Luxemburg einer Taxe d'Abonnement von jährlich 0.05% ihres Nettoinventarwerts. Diese Steuer ist vierteljährlich am Ende des entsprechenden Kalenderquartals auf Grundlage der gesamten Nettovermögenswerte des Teilfonds zu zahlen. Ein reduzierter Steuersatz von 0.01% gilt für:

(a) Organismen, deren einziges Ziel in der gemeinsamen Anlage in Geldmarktinstrumente und der Platzierung von Einlagen bei Kreditinstituten besteht;

(b) Organismen, deren einziges Ziel in der gemeinsamen Anlage in Einlagen bei Kreditinstituten besteht;

(c) einzelne Abteilungen von OGA mit mehreren Abteilungen und einzelne innerhalb einer OGA oder einer Abteilung einer OGA mit mehreren Abteilungen ausgegebene Wertpapierklassen, sofern die Wertpapiere dieser Abteilungen oder Klassen einem oder mehreren institutionellen Anlegern vorbehalten sind.

- Anteile der Klasse AM, die beschränkt sind auf institutionelle Anleger im Sinne von Artikel 174 des Gesetzes von 2010, die eine Anlageverwaltungsvereinbarung mit Swiss Life Asset Management AG oder einem anderen Unternehmen der

[1] Dieser Teilfonds wurde zum 19. Dezember 2019 aufgelegt.

## Anmerkungen zum Geschäftsbericht (Fortsetzung)

Swiss Life Group getroffen haben. Anteile der Klasse AM unterliegen einer Taxe d'Abonnement von 0.01% der Nettovermögenswerte.

- Anteile der Klasse F stehen allen Anlegern offen, werden aber nur über bestimmte Finanzintermediäre, Vertriebspartner oder Ähnliches angeboten, die im Auftrag ihrer Kunden investieren und diesen Beratungsgebühren oder Ähnliches berechnen. Anteile der Klasse F unterliegen einer Taxe d'Abonnement von 0.05% der Nettovermögenswerte.
- Anteile der Klasse I, die beschränkt sind auf institutionelle Anleger im Sinne von Artikel 174 des Gesetzes von 2010. Anteile der Klasse I unterliegen einer Taxe d'Abonnement von 0.01% der Nettovermögenswerte.
- Anteile der Klasse M sind beschränkt auf Swiss Life Asset Management AG, Swiss Life Germany oder ein anderes Unternehmen der Swiss Life Group, die im Auftrag ihrer fondsgebundenen Produktkunden handeln. Anteile der Klasse AM unterliegen einer Taxe d'Abonnement von 0.01% der Nettovermögenswerte.
- Anteile der Klasse Q, die beschränkt sind auf institutionelle Anleger im Sinne von Artikel 174 des Gesetzes von 2010. Anteile der Klasse Q unterliegen einer Taxe d'Abonnement von 0.01% der Nettovermögenswerte.
- Anteile der Klasse R, die allen Anlegern offenstehen. Anteile der Klasse R unterliegen einer Taxe d'Abonnement von jährlich 0.05% der Nettovermögenswerte.
- Anteile der Klasse S, die beschränkt sind auf Teilfonds der Gesellschaft. Anteile der Klasse S unterliegen einer Taxe d'Abonnement von jährlich 0.01% der Nettovermögenswerte.
- Anteile der Klasse SL, die beschränkt sind auf Swiss Life France, Swiss Life Germany und Swiss Life Switzerland oder ein anderes Unternehmen der Swiss Life Group, die im Auftrag ihres eigenen Versicherungsportfolios handeln. Anteile der Klasse SL unterliegen einer Taxe d'Abonnement von 0.01% der Nettovermögenswerte.
- Anteile der Klasse SF, die beschränkt sind auf Swiss Life France, die im Auftrag ihrer fondsgebundenen Produktkunden handelt. Anteile unterliegen einer Taxe d'Abonnement von 0.01% der Nettovermögenswerte des entsprechenden Teilfonds. Diese ist vierteljährlich am Ende des entsprechenden Quartals zu zahlen.

Erträge der SICAV aus Investitionen im Ausland, die im Ursprungsland möglicherweise einer Quellensteuer unterliegen, erfasst die SICAV nach Abzug der entsprechenden Steuer. Quellensteuern sind nicht rückzahlbar und können nicht erstattet werden.

### 6 - Finanztermingeschäfte

Zum 29. Februar 2020 wiesen die Teilfonds die nachstehend detailliert aufgeführten Positionen aus Termingeschäften auf:

**Swiss Life Funds (LUX) Bond Emerging Markets Corporates Short Term**

| Zugrundeliegend | Währungskontrakte | Fälligkeitsbezeichnung | Markt | Fälligkeitsdatum | Anzahl der gekauften Kontrakte | Anzahl der verkauften Kontrakte | Gesamtbetrag USD | Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) USD |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| Zinssatz | USD | US 2 YR NOTE FUTURE | CHICAGO BOARD OF TRADE | Jul-20 | 50 | - | 10 916 406 | 41 016 |
| Zinssatz | USD | US 5 YR NOTE FUTURE | CHICAGO BOARD OF TRADE | Jul-20 | 50 | - | 6 137 500 | 15 234 |
| | | | | | | | **17 053 906** | **56 250** |

**Swiss Life Funds (LUX) Bond Euro Corporates**

| Zugrundeliegend | Währungskontrakte | Fälligkeitsbezeichnung | Markt | Fälligkeitsdatum | Anzahl der gekauften Kontrakte | Anzahl der verkauften Kontrakte | Gesamtbetrag EUR | Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) EUR |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| Zinssatz | EUR | EURO BUND | EUREX-DEUTSCHLAND | Mar-20 | 15 | - | 2 661 900 | 32 000 |
| Zinssatz | EUR | EURO BUXL | EUREX-DEUTSCHLAND | Mar-20 | 4 | - | 879 120 | 34 780 |
| | | | | | | | **3 541 020** | **66 780** |

# Anmerkungen zum Geschäftsbericht (Fortsetzung)

## Swiss Life Funds (LUX) Bond Global Corporates

| Zugrundeliegend | Währungskontrakte | Fälligkeitsbezeichnung | Markt | Fälligkeitsdatum | Anzahl der gekauften Kontrakte | Anzahl der verkauften Kontrakte | Gesamtbetrag EUR | Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) EUR |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| Zinssatz | CAD | CAN 10YR BOND FUT | MONTREAL STOCK EXCHANGE | Jun-20 | 25 | - | 2 419 803 | 32 893 |
| Zinssatz | EUR | EURO BUND | EUREX-DEUTSCHLAND | Mar-20 | - | 56 | 9 937 760 | (272 160) |
| Zinssatz | GBP | LONG GILT | EURONEXT LIFFE | Jun-20 | 4 | - | 629 804 | 5 303 |
| Zinssatz | USD | US 10 YR NOTE FUTURE | CHICAGO BOARD OF TRADE | Jun-20 | 235 | - | 28 828 121 | 329 939 |
| Zinssatz | USD | US 2 YR NOTE FUTURE | CHICAGO BOARD OF TRADE | Jul-20 | 40 | - | 7 950 407 | 40 113 |
| Zinssatz | USD | US 5 YR NOTE FUTURE | CHICAGO BOARD OF TRADE | Jul-20 | 17 | - | 1 899 722 | 18 620 |
| | | | | | | | **51 665 617** | **154 708** |

## Swiss Life Funds (LUX) Bond Global Corporates Short Term

| Zugrundeliegend | Währungskontrakte | Fälligkeitsbezeichnung | Markt | Fälligkeitsdatum | Anzahl der gekauften Kontrakte | Anzahl der verkauften Kontrakte | Gesamtbetrag EUR | Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) EUR |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| Zinssatz | EUR | EURO BOBL | EUREX-DEUTSCHLAND | Mar-20 | - | 20 | 2 713 200 | (34 750) |
| Zinssatz | EUR | EURO SCHATZ | EUREX-DEUTSCHLAND | Mar-20 | 20 | - | 2 246 300 | 6 100 |
| Zinssatz | USD | US 2 YR NOTE FUTURE | CHICAGO BOARD OF TRADE | Jul-20 | 58 | - | 11 528 090 | 60 640 |
| Zinssatz | USD | US 5 YR NOTE FUTURE | CHICAGO BOARD OF TRADE | Jul-20 | - | 10 | 1 117 484 | (11 664) |
| | | | | | | | **17 605 074** | **20 326** |

## Swiss Life Funds (LUX) Bond Inflation Protection

| Zugrundeliegend | Währungskontrakte | Fälligkeitsbezeichnung | Markt | Fälligkeitsdatum | Anzahl der gekauften Kontrakte | Anzahl der verkauften Kontrakte | Gesamtbetrag EUR | Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) EUR |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| Zinssatz | EUR | EURO BUND | EUREX-DEUTSCHLAND | Mar-20 | - | 9 | 1 597 140 | (47 970) |
| Zinssatz | EUR | EURO-BTP FUTURE | EUREX-DEUTSCHLAND | Mar-20 | - | 20 | 2 915 200 | (64 160) |
| Zinssatz | USD | US ULTRA BOND CBT | CHICAGO BOARD OF TRADE | Jun-20 | - | 57 | 10 767 445 | (320 672) |
| Zinssatz | USD | US 10YR ULTRA T NOTE | CHICAGO BOARD OF TRADE | Jun-20 | - | 53 | 7 248 026 | (132 687) |
| | | | | | | | **22 527 811** | **(565 489)** |

## Swiss Life Funds (LUX) Equity Euro Zone

| Zugrundeliegend | Währungskontrakte | Fälligkeitsbezeichnung | Markt | Fälligkeitsdatum | Anzahl der gekauften Kontrakte | Anzahl der verkauften Kontrakte | Gesamtbetrag | Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| Index | EUR | EURO STOXX 50 | EUREX-DEUTSCHLAND | Mar-20 | 20 | - | 662 800 | (64 800) |
| | | | | | | | **662 800** | **(64 800)** |

## Swiss Life Funds (LUX) Equity Global

| Zugrundeliegend | Währungskontrakte | Fälligkeitsbezeichnung | Markt | Fälligkeitsdatum | Anzahl der gekauften Kontrakte | Anzahl der verkauften Kontrakte | Gesamtbetrag USD | Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) USD |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| Index | EUR | EURO STOXX 50 | EUREX-DEUTSCHLAND | Mar-20 | 17 | - | 618 845 | (81 856) |
| Index | USD | S&P 500 EMINI | CHICAGO MERCANTILE EXCHANGE | Mar-20 | 11 | - | 1 623 050 | (147 013) |
| | | | | | | | **2 241 895** | **(228 869)** |

# Anmerkungen zum Geschäftsbericht (Fortsetzung)

## Swiss Life Funds (LUX) Equity Global High Dividend

| Zugrundeliegend | Währungskontrakte | Fälligkeitsbezeichnung | Markt | Fälligkeitsdatum | Anzahl der gekauften Kontrakte | Anzahl der verkauften Kontrakte | Gesamtbetrag EUR | Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) EUR |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| Index | EUR | EURO STOXX 50 | EUREX-DEUTSCHLAND | Mar-20 | 105 | - | 3 479 700 | (202 140) |
| Index | USD | S&P 500 EMINI | CHICAGO MERCANTILE EXCHANGE | Mar-20 | 32 | - | 4 298 421 | (236 288) |
| | | | | | | | **7 778 121** | **(438 428)** |

## Swiss Life Funds (LUX) Equity Global Long/Short

| Zugrundeliegend | Währungskontrakte | Fälligkeitsbezeichnung | Markt | Fälligkeitsdatum | Anzahl der gekauften Kontrakte | Anzahl der verkauften Kontrakte | Gesamtbetrag EUR | Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) EUR |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| Index | USD | S&P 500 EMINI | CHICAGO MERCANTILE EXCHANGE | Mar-20 | - | 387 | 51 984 023 | 3 537 938 |
| Index | EUR | STOXX EUROP 600 FUT | EUREX-DEUTSCHLAND | Mar-20 | - | 3 890 | 72 587 400 | 6 296 030 |
| | | | | | | | **124 571 423** | **9 833 968** |

## Swiss Life Funds (LUX) Equity Global Protect

| Zugrundeliegend | Währungskontrakte | Fälligkeitsbezeichnung | Markt | Fälligkeitsdatum | Anzahl der gekauften Kontrakte | Anzahl der verkauften Kontrakte | Gesamtbetrag EUR | Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) EUR |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| Währungs | USD | CHF CURRENCY FUT | CHICAGO MERCANTILE EXCHANGE | Mar-20 | - | 10 | 1 179 731 | (16 102) |
| Währungs | USD | EURO FX | CHICAGO MERCANTILE EXCHANGE | Mar-20 | 163 | - | 20 477 019 | (242 990) |
| Währungs | USD | JAPANESE YEN | CHICAGO MERCANTILE EXCHANGE | Mar-20 | - | 30 | 3 168 783 | (7 511) |
| Index | EUR | EURO STOXX 50 | EUREX-DEUTSCHLAND | Mar-20 | 5 | - | 165 700 | (16 550) |
| Index | USD | S&P 500 EMINI | CHICAGO MERCANTILE EXCHANGE | Mar-20 | 93 | - | 12 492 285 | (1 337 020) |
| | | | | | | | **37 483 518** | **(1 620 173)** |

## Swiss Life Funds (LUX) Equity USA

| Zugrundeliegend | Währungskontrakte | Fälligkeitsbezeichnung | Markt | Fälligkeitsdatum | Anzahl der gekauften Kontrakte | Anzahl der verkauften Kontrakte | Gesamtbetrag USD | Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) USD |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| Index | USD | S&P 500 EMINI | CHICAGO MERCANTILE EXCHANGE | Mar-20 | 135 | - | 19 919 250 | (1 519 365) |
| | | | | | | | **19 919 250** | **(1 519 365)** |

# Anmerkungen zum Geschäftsbericht (Fortsetzung)

## Swiss Life Funds (LUX) Fixed Income Alpha Select[1]

| Zugrundeliegend | Währungskontrakte | Fälligkeitsbezeichnung | Markt | Fälligkeitsdatum | Anzahl der gekauften Kontrakte | Anzahl der verkauften Kontrakte | Gesamtbetrag EUR | Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) EUR |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| Zinssatz | CAD | CAN 10YR BOND FUT | MONTREAL STOCK EXCHANGE | Jun-20 | - | 51 | 4 936 399 | (40 814) |
| Zinssatz | EUR | EURO BUND | EUREX-DEUTSCHLAND | Mar-20 | - | 47 | 8 340 620 | (156 100) |
| Zinssatz | EUR | EURO BUND | EUREX-DEUTSCHLAND | Jun-20 | 25 | - | 4 367 250 | 40 970 |
| Zinssatz | JPY | JAPANESE 10Y BOND | OSAKA SECURITIES EXCHANGE | Jun-20 | - | 4 | 5 202 712 | (20 593) |
| Zinssatz | GBP | LONG GILT | EURONEXT LIFFE | Jun-20 | - | 27 | 4 251 177 | (3 768) |
| Zinssatz | USD | US LONG BOND | CHICAGO BOARD OF TRADE | Jun-20 | - | 20 | 3 099 822 | (67 140) |
| Zinssatz | USD | US 10 YR NOTE FUTURE | CHICAGO BOARD OF TRADE | Jun-20 | 5 | - | 613 364 | 5 476 |
| Zinssatz | USD | US 5 YR NOTE FUTURE | CHICAGO BOARD OF TRADE | Jul-20 | - | 10 | 1 117 484 | (11 237) |
| Zinssatz | AUD | 10Y AUSTRALIAN BOND | SYDNEY FUTURES EXCHANGE | Jun-20 | 52 | - | 4 569 000 | 33 230 |
| | | | | | | | **36 497 828** | **(219 976)** |

## Swiss Life Funds (LUX) Multi Asset Risk Premia

| Zugrundeliegend | Währungskontrakte | Fälligkeitsbezeichnung | Markt | Fälligkeitsdatum | Anzahl der gekauften Kontrakte | Anzahl der verkauften Kontrakte | Gesamtbetrag EUR | Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) EUR |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| Zinssatz | CAD | CAN 10YR BOND FUT | MONTREAL STOCK EXCHANGE | Jun-20 | - | 846 | 81 886 144 | (602 442) |
| Zinssatz | EUR | EURO BUND | EUREX-DEUTSCHLAND | Mar-20 | 104 | - | 18 455 840 | 378 560 |
| Zinssatz | JPY | JAPANESE 10Y BOND | OSAKA SECURITIES EXCHANGE | Mar-20 | - | 33 | 42 911 237 | (497 956) |
| Zinssatz | GBP | LONG GILT | EURONEXT LIFFE | Jun-20 | 74 | - | 11 651 375 | 77 446 |
| Zinssatz | USD | US 10 YR NOTE FUTURE | CHICAGO BOARD OF TRADE | Jun-20 | 290 | - | 35 575 129 | 468 202 |
| Zinssatz | AUD | 10Y AUSTRALIAN BOND | SYDNEY FUTURES EXCHANGE | Mar-20 | 605 | - | 53 158 552 | 1 338 377 |
| Index | USD | CBOE VIX INDEX | CHICAGO BOARD OF TRADE | Mar-20 | - | 76 | 1 821 385 | (744 413) |
| Index | USD | S&P 500 EMINI | CHICAGO MERCANTILE EXCHANGE | Mar-20 | - | 338 | 45 402 067 | 3 814 021 |
| Index | EUR | STOXX EUROP 600 FUT | EUREX-DEUTSCHLAND | Mar-20 | - | 3 648 | 68 071 680 | 7 180 613 |
| | | | | | | | **358 933 409** | **11 412 408** |

## Swiss Life Funds (LUX) Prudent (EUR)

| Zugrundeliegend | Währungskontrakte | Fälligkeitsbezeichnung | Markt | Fälligkeitsdatum | Anzahl der gekauften Kontrakte | Anzahl der verkauften Kontrakte | Gesamtbetrag EUR | Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) EUR |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| Zinssatz | EUR | EURO BUND | EUREX-DEUTSCHLAND | Mar-20 | 756 | - | 134 159 760 | 3 803 590 |
| Zinssatz | GBP | LONG GILT | EURONEXT LIFFE | Jun-20 | 555 | - | 87 385 313 | 544 753 |
| Zinssatz | USD | US 10 YR NOTE FUTURE | CHICAGO BOARD OF TRADE | Jun-20 | 1 043 | - | 127 947 790 | 1 683 914 |
| Index | EUR | EURO STOXX 50 | EUREX-DEUTSCHLAND | Mar-20 | 758 | - | 25 120 120 | (2 380 561) |
| Index | GBP | FTSE 100 INDEX | ICE FUTURES EUROPE | Mar-20 | 206 | - | 15 638 944 | (1 000 983) |
| Index | USD | S&P 500 EMINI | CHICAGO MERCANTILE EXCHANGE | Mar-20 | 303 | - | 40 700 669 | (3 687 059) |
| | | | | | | | **430 952 596** | **(1 036 346)** |

[1] Dieser Teilfonds wurde zum 3. September 2019 aufgelegt.

# Anmerkungen zum Geschäftsbericht (Fortsetzung)

## Swiss Life Funds (LUX) Harmony (EUR)

| Zugrundeliegend | Währungskontrakte | Fälligkeitsbezeichnung | Markt | Fälligkeitsdatum | Anzahl der gekauften Kontrakte | Anzahl der verkauften Kontrakte | Gesamtbetrag EUR | Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) EUR |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| Zinssatz | EUR | EURO BUND | EUREX-DEUTSCHLAND | Mar-20 | 135 | - | 23 957 100 | 679 440 |
| Zinssatz | GBP | LONG GILT | EURONEXT LIFFE | Jun-20 | 102 | - | 16 060 003 | 101 111 |
| Zinssatz | USD | US 10 YR NOTE FUTURE | CHICAGO BOARD OF TRADE | Jun-20 | 187 | - | 22 939 824 | 301 910 |
| Index | EUR | EURO STOXX 50 | EUREX-DEUTSCHLAND | Mar-20 | 367 | - | 12 162 380 | (1 363 856) |
| Index | GBP | FTSE 100 INDEX | ICE FUTURES EUROPE | Mar-20 | 228 | - | 17 309 123 | (1 621 138) |
| Index | USD | S&P 500 EMINI | CHICAGO MERCANTILE EXCHANGE | Mar-20 | 258 | - | 34 656 015 | (3 038 825) |
| | | | | | | | **127 084 445** | **(4 941 358)** |

## Swiss Life Funds (LUX) Income Equity Euro Zone[1]

| Zugrundeliegend | Währungskontrakte | Fälligkeitsbezeichnung | Markt | Fälligkeitsdatum | Anzahl der gekauften Kontrakte | Anzahl der verkauften Kontrakte | Gesamtbetrag EUR | Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) EUR |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| Index | EUR | EURO STOXX 50 | EUREX-DEUTSCHLAND | Mar-20 | - | 2 509 | 83 148 260 | 7 861 680 |
| | | | | | | | **83 148 260** | **7 861 680** |

## Swiss Life Funds (LUX) Portfolio Global Growth (CHF)

| Zugrundeliegend | Währungskontrakte | Fälligkeitsbezeichnung | Markt | Fälligkeitsdatum | Anzahl der gekauften Kontrakte | Anzahl der verkauften Kontrakte | Gesamtbetrag CHF | Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) CHF |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| Index | JPY | NIKKEI 225 OSE | TOKYO STOCK EXCHANGE | Mar-20 | 6 | - | 1 135 001 | (118 454) |
| Index | USD | S&P 500 EMINI | CHICAGO MERCANTILE EXCHANGE | Mar-20 | 13 | - | 1 856 683 | (122 625) |
| Index | CHF | SWISS MKT INDEX FUT | EUREX-DEUTSCHLAND | Mar-20 | 9 | - | 874 530 | (55 530) |
| | | | | | | | **3 866 214** | **(296 609)** |

## Swiss Life Funds (LUX) Vitality (EUR)

| Zugrundeliegend | Währungskontrakte | Fälligkeitsbezeichnung | Markt | Fälligkeitsdatum | Anzahl der gekauften Kontrakte | Anzahl der verkauften Kontrakte | Gesamtbetrag EUR | Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) EUR |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| Zinssatz | EUR | EURO BUND | EUREX-DEUTSCHLAND | Mar-20 | 11 | - | 1 952 060 | 50 440 |
| Zinssatz | GBP | LONG GILT | EURONEXT LIFFE | Jun-20 | 2 | - | 314 902 | 965 |
| Zinssatz | USD | US 10 YR NOTE FUTURE | CHICAGO BOARD OF TRADE | Jun-20 | 18 | - | 2 208 111 | 29 061 |
| Index | EUR | EURO STOXX 50 | EUREX-DEUTSCHLAND | Mar-20 | 206 | - | 6 826 840 | (796 845) |
| Index | GBP | FTSE 100 INDEX | ICE FUTURES EUROPE | Mar-20 | 141 | - | 10 704 326 | (1 047 900) |
| Index | USD | S&P 500 EMINI | CHICAGO MERCANTILE EXCHANGE | Mar-20 | 152 | - | 20 417 497 | (1 778 270) |
| | | | | | | | **42 423 736** | **(3 542 549)** |

[1] Dieser Teilfonds wurde zum 19. Dezember 2019 aufgelegt.

# Anmerkungen zum Geschäftsbericht (Fortsetzung)

## 7 - Optionen

Zum 29. Februar 2020 wiesen die Teilfonds die nachstehend detailliert aufgeführten Positionen aus Optionsgeschäften auf:

### Swiss Life Funds (LUX) Equity Global Protect

| Short/ Long | Währungs | Bezeichnung | Put/ Call | Ausübung Preis | Fälligkeits-datum | Menge | Markt wert EUR | Gesamtbetrag EUR |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| SHORT | EUR | DJ EURO STOXX 50 EUR | PUT | 2 850 | Dec-20 | (320) | (432 640) | 9 120 000 |
| SHORT | EUR | DJ EURO STOXX 50 EUR | PUT | 2 750 | Sep-20 | (260) | (233 740) | 7 150 000 |
| SHORT | EUR | DJ EURO STOXX 50 EUR | PUT | 2 650 | Jun-20 | (290) | (156 890) | 7 685 000 |
| SHORT | EUR | DJ EURO STOXX 50 EUR | PUT | 2 550 | Mar-20 | (311) | (39 497) | 7 930 500 |
| LONG | EUR | DJ EURO STOXX 50 EUR | PUT | 3 600 | Mar-20 | 369 | 1 095 561 | - |
| LONG | EUR | DJ EURO STOXX 50 EUR | PUT | 3 650 | Jun-20 | 379 | 1 677 075 | - |
| LONG | EUR | DJ EURO STOXX 50 EUR | PUT | 3 650 | Sep-20 | 365 | 1 731 560 | - |
| LONG | EUR | DJ EURO STOXX 50 EUR | PUT | 3 650 | Dec-20 | 350 | 1 779 050 | - |
| SHORT | GBP | FOOTSIE 100 | PUT | 5 600 | Dec-20 | (48) | (135 915) | 3 125 763 |
| SHORT | GBP | FOOTSIE 100 | PUT | 5 600 | Sep-20 | (50) | (116 577) | 3 256 003 |
| SHORT | GBP | FOOTSIE 100 | PUT | 5 725 | Jun-20 | (20) | (40 119) | 1 331 473 |
| SHORT | GBP | FOOTSIE 100 | PUT | 5 725 | Mar-20 | (41) | (39 334) | 2 729 519 |
| LONG | GBP | FOOTSIE 100 | PUT | 7 350 | Mar-20 | 48 | 459 934 | - |
| LONG | GBP | FOOTSIE 100 | PUT | 7 350 | Dec-20 | 40 | 511 658 | - |
| LONG | GBP | FOOTSIE 100 | PUT | 7 350 | Jun-20 | 48 | 527 193 | - |
| LONG | GBP | FOOTSIE 100 | PUT | 7 200 | Sep-20 | 50 | 532 298 | - |
| SHORT | JPY | NIKKEI 225 | PUT | 18 500 | Dec-20 | (28) | (213 868) | 4 371 885 |
| SHORT | JPY | NIKKEI 225 | PUT | 17 000 | Sep-20 | (30) | (120 269) | 4 304 366 |
| SHORT | JPY | NIKKEI 225 | PUT | 16 500 | Jun-20 | (26) | (80 095) | 3 620 731 |
| SHORT | JPY | NIKKEI 225 | PUT | 17 000 | Mar-20 | (20) | (16 880) | 2 869 577 |
| LONG | JPY | NIKKEI 225 | PUT | 20 750 | Sep-20 | 32 | 383 511 | - |
| LONG | JPY | NIKKEI 225 | PUT | 23 250 | Mar-20 | 35 | 679 415 | - |
| LONG | JPY | NIKKEI 225 | PUT | 22 500 | Dec-20 | 32 | 718 407 | - |
| LONG | JPY | NIKKEI 225 | PUT | 23 250 | Jun-20 | 35 | 815 298 | - |
| SHORT | CHF | SMI (ZURICH) | PUT | 8 000 | Dec-20 | (23) | (45 146) | 1 730 543 |
| SHORT | CHF | SMI (ZURICH) | PUT | 8 000 | Sep-20 | (20) | (32 147) | 1 504 820 |
| SHORT | CHF | SMI (ZURICH) | PUT | 7 800 | Jun-20 | (8) | (7 712) | 586 880 |
| SHORT | CHF | SMI (ZURICH) | PUT | 7 300 | Mar-20 | (20) | (3 235) | 1 373 148 |
| LONG | CHF | SMI (ZURICH) | PUT | 10 400 | Mar-20 | 25 | 168 610 | - |
| LONG | CHF | SMI (ZURICH) | PUT | 10 400 | Jun-20 | 23 | 211 840 | - |
| LONG | CHF | SMI (ZURICH) | PUT | 10 400 | Dec-20 | 20 | 216 976 | - |
| LONG | CHF | SMI (ZURICH) | PUT | 10 400 | Sep-20 | 23 | 232 953 | - |
| SHORT | USD | S&P 500 INDEX | PUT | 2 525 | Dec-20 | (133) | (1 601 884) | 30 572 626 |
| SHORT | USD | S&P 500 INDEX | PUT | 2 400 | Sep-20 | (134) | (949 205) | 29 277 619 |
| SHORT | USD | S&P 500 INDEX | PUT | 2 375 | Jun-20 | (132) | (642 666) | 28 540 216 |
| SHORT | USD | S&P 500 INDEX | PUT | 2 225 | Mar-20 | (134) | (50 016) | 27 142 792 |
| LONG | USD | S&P 500 INDEX | PUT | 2 875 | Jun-20 | 2 | 31 239 | - |
| LONG | USD | S&P 500 INDEX | PUT | 3 200 | Mar-20 | 167 | 3 673 103 | - |
| LONG | USD | S&P 500 INDEX | PUT | 3 200 | Jun-20 | 167 | 4 337 485 | - |
| LONG | USD | S&P 500 INDEX | PUT | 3 200 | Sep-20 | 163 | 4 693 901 | - |
| LONG | USD | S&P 500 INDEX | PUT | 3 200 | Dec-20 | 160 | 5 987 347 | - |
| | | | | | | | **25 506 579** | **178 223 461** |

# Anmerkungen zum Geschäftsbericht (Fortsetzung)

## Swiss Life Funds (LUX) Fixed Income Alpha Select[1]

| Short/ Long | Währungs | Bezeichnung | Put/ Call | Ausübung Preis | Fälligkeits-datum | Menge | Markt wert EUR | Gesamtbetrag EUR |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| LONG | USD | CDX.NA.IG | CALL | 100 | Mar-20 | 50 000 000 | 370 114 | - |
| | | | | | | | **370 114** | **-** |

## Swiss Life Funds (LUX) Income Equity Euro Zone[2]

| Short/ Long | Währungs | Bezeichnung | Put/ Call | Ausübung Preis | Fälligkeits-datum | Menge | Markt wert EUR | Gesamtbetrag EUR |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| SHORT | EUR | DJ EURO STOXX 50 EUR | PUT | 3 425 | Mar-20 | (545) | (967 375) | 18 666 250 |
| SHORT | EUR | DJ EURO STOXX 50 EUR | CALL | 3 625 | Mar-20 | (890) | (66 750) | 32 262 500 |
| | | | | | | | **(1 034 125)** | **50 928 750** |

[1] Dieser Teilfonds wurde zum 3. September 2019 aufgelegt.
[2] Dieser Teilfonds wurde zum 19. Dezember 2019 aufgelegt.

## Anmerkungen zum Geschäftsbericht (Fortsetzung)

### 8 - Devisentermingeschäfte

Zum 29. Februar 2020 wiesen die Teilfonds die nachstehend detailliert aufgeführten Positionen aus offenen Devisentermingeschäften auf:

**Swiss Life Funds (LUX) Bond Emerging Markets Corporates**

| Kauf | | Verkauf | | Fälligkeitsdatum | Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) USD |
|---|---|---|---|---|---|
| EUR | 350 000 | USD | 384 244 | 02-Mar-20 | 214 |
| CHF | 259 700 000 | USD | 269 212 628 | 03-Apr-20 | (311 016) |
| CHF | 45 250 000 | USD | 46 907 476 | 03-Apr-20 | (54 191) |
| CHF | 18 420 000 | USD | 19 087 948 | 03-Apr-20 | (15 296) |
| CHF | 5 399 000 | USD | 5 607 627 | 03-Apr-20 | (17 331) |
| CHF | 4 861 500 | USD | 4 990 121 | 03-Apr-20 | 43 630 |
| CHF | 4 468 000 | USD | 4 643 899 | 03-Apr-20 | (17 590) |
| CHF | 4 444 400 | USD | 4 593 413 | 03-Apr-20 | 8 460 |
| CHF | 2 233 000 | USD | 2 307 844 | 03-Apr-20 | 4 275 |
| CHF | 1 734 000 | USD | 1 781 931 | 03-Apr-20 | 13 507 |
| CHF | 1 706 000 | USD | 1 757 158 | 03-Apr-20 | 9 288 |
| CHF | 1 493 000 | USD | 1 546 586 | 03-Apr-20 | (687) |
| CHF | 1 457 000 | USD | 1 495 505 | 03-Apr-20 | 13 119 |
| CHF | 1 327 000 | USD | 1 355 592 | 03-Apr-20 | 18 426 |
| CHF | 1 039 000 | USD | 1 066 609 | 03-Apr-20 | 9 204 |
| CHF | 545 800 | USD | 560 225 | 03-Apr-20 | 4 913 |
| CHF | 450 800 | USD | 467 534 | 03-Apr-20 | (762) |
| CHF | 421 600 | USD | 432 702 | 03-Apr-20 | 3 836 |
| CHF | 302 300 | USD | 310 283 | 03-Apr-20 | 2 728 |
| CHF | 280 800 | USD | 291 082 | 03-Apr-20 | (333) |
| CHF | 160 000 | USD | 164 223 | 03-Apr-20 | 1 446 |
| CHF | 102 000 | USD | 106 325 | 03-Apr-20 | (711) |
| CHF | 100 000 | USD | 102 994 | 03-Apr-20 | 549 |
| CHF | 28 000 | USD | 28 838 | 03-Apr-20 | 154 |
| CHF | 10 000 | USD | 10 264 | 03-Apr-20 | 90 |
| EUR | 55 600 000 | USD | 62 150 792 | 03-Apr-20 | (960 213) |
| EUR | 17 800 000 | USD | 19 897 196 | 03-Apr-20 | (307 406) |
| EUR | 9 710 000 | USD | 10 854 032 | 03-Apr-20 | (167 692) |
| EUR | 6 410 000 | USD | 7 165 226 | 03-Apr-20 | (110 701) |
| EUR | 6 260 000 | USD | 6 997 553 | 03-Apr-20 | (108 110) |
| EUR | 2 000 000 | USD | 2 212 119 | 03-Apr-20 | (11 019) |
| EUR | 621 200 | USD | 686 437 | 03-Apr-20 | (2 775) |
| EUR | 288 000 | USD | 317 982 | 03-Apr-20 | (1 023) |
| EUR | 192 000 | USD | 210 667 | 03-Apr-20 | 638 |
| EUR | 181 900 | USD | 198 060 | 03-Apr-20 | 2 130 |
| EUR | 120 300 | USD | 130 988 | 03-Apr-20 | 1 408 |
| EUR | 104 200 | USD | 115 608 | 03-Apr-20 | (931) |
| EUR | 70 600 | USD | 76 872 | 03-Apr-20 | 827 |
| EUR | 69 200 | USD | 75 348 | 03-Apr-20 | 810 |
| EUR | 64 800 | USD | 71 759 | 03-Apr-20 | (443) |
| EUR | 64 000 | USD | 70 849 | 03-Apr-20 | (413) |
| EUR | 63 700 | USD | 70 672 | 03-Apr-20 | (567) |
| EUR | 23 000 | USD | 25 494 | 03-Apr-20 | (181) |
| EUR | 19 000 | USD | 21 082 | 03-Apr-20 | (172) |
| EUR | 12 000 | USD | 13 181 | 03-Apr-20 | 25 |
| USD | 2 727 719 | CHF | 2 644 000 | 03-Apr-20 | (9 962) |
| USD | 2 025 496 | CHF | 1 960 000 | 03-Apr-20 | (3 950) |
| USD | 107 805 | CHF | 104 000 | 03-Apr-20 | 120 |
| USD | 2 347 422 | EUR | 2 100 000 | 03-Apr-20 | 36 267 |
| USD | 2 237 711 | EUR | 2 000 000 | 03-Apr-20 | 36 611 |
| USD | 554 742 | EUR | 500 000 | 03-Apr-20 | 4 467 |
| USD | 384 993 | EUR | 350 000 | 03-Apr-20 | (199) |

# Anmerkungen zum Geschäftsbericht (Fortsetzung)

## Swiss Life Funds (LUX) Bond Emerging Markets Corporates (Fortsetzung)

| Kauf | | Verkauf | | Fälligkeitsdatum | Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) USD |
|---|---|---|---|---|---|
| USD | 289 116 | EUR | 263 200 | 03-Apr-20 | (548) |
| USD | 126 114 | EUR | 115 000 | 03-Apr-20 | (449) |
| USD | 2 178 | EUR | 2 000 | 03-Apr-20 | (23) |
| | | | | | **(1 887 552)** |

## Swiss Life Funds (LUX) Bond Emerging Markets Corporates Short Term

| Kauf | | Verkauf | | Fälligkeitsdatum | Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) USD |
|---|---|---|---|---|---|
| CHF | 1 544 930 | USD | 1 591 940 | 02-Mar-20 | 4 137 |
| CHF | 228 900 000 | USD | 237 284 446 | 03-Apr-20 | (274 130) |
| CHF | 2 980 100 | USD | 3 059 381 | 03-Apr-20 | 26 309 |
| CHF | 2 874 000 | USD | 2 987 176 | 03-Apr-20 | (11 345) |
| CHF | 2 555 600 | USD | 2 640 507 | 03-Apr-20 | 5 642 |
| CHF | 1 666 000 | USD | 1 730 377 | 03-Apr-20 | (5 348) |
| CHF | 1 487 000 | USD | 1 536 477 | 03-Apr-20 | 3 210 |
| CHF | 1 134 000 | USD | 1 164 832 | 03-Apr-20 | 9 347 |
| CHF | 1 122 000 | USD | 1 155 598 | 03-Apr-20 | 6 156 |
| CHF | 1 012 000 | USD | 1 048 697 | 03-Apr-20 | (840) |
| CHF | 973 000 | USD | 1 007 975 | 03-Apr-20 | (500) |
| CHF | 944 000 | USD | 968 928 | 03-Apr-20 | 8 520 |
| CHF | 866 000 | USD | 884 641 | 03-Apr-20 | 12 043 |
| CHF | 668 000 | USD | 685 757 | 03-Apr-20 | 5 911 |
| EUR | 6 740 000 | USD | 7 534 107 | 03-Apr-20 | (116 400) |
| EUR | 252 000 | USD | 278 316 | 03-Apr-20 | (977) |
| EUR | 100 000 | USD | 110 872 | 03-Apr-20 | (817) |
| USD | 2 665 306 | CHF | 2 583 529 | 03-Apr-20 | (9 762) |
| USD | 1 595 508 | CHF | 1 544 930 | 03-Apr-20 | (4 161) |
| | | | | | **(343 005)** |

## Swiss Life Funds (LUX) Bond Euro Corporates

| Kauf | | Verkauf | | Fälligkeitsdatum | Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) EUR |
|---|---|---|---|---|---|
| CHF | 10 000 | EUR | 9 383 | 02-Mar-20 | 22 |
| CHF | 13 470 000 | EUR | 12 486 658 | 09-Mar-20 | 182 863 |
| CHF | 100 000 | EUR | 93 453 | 09-Mar-20 | 604 |
| CHF | 50 000 | EUR | 47 114 | 09-Mar-20 | (85) |
| CHF | 40 000 | EUR | 37 461 | 09-Mar-20 | 162 |
| CHF | 25 000 | EUR | 23 435 | 09-Mar-20 | 79 |
| EUR | 46 568 | CHF | 50 000 | 09-Mar-20 | (460) |
| EUR | 22 342 | CHF | 24 000 | 09-Mar-20 | (231) |
| | | | | | **182 954** |

# Anmerkungen zum Geschäftsbericht (Fortsetzung)

## Swiss Life Funds (LUX) Bond Global Corporates

| Kauf | | Verkauf | | Fälligkeitsdatum | Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) EUR |
|---|---|---|---|---|---|
| EUR | 4 264 789 | CAD | 6 250 000 | 09-Mar-20 | 27 641 |
| EUR | 60 447 715 | USD | 66 500 000 | 10-Mar-20 | (65 694) |
| USD | 5 790 000 | EUR | 5 262 857 | 10-Mar-20 | 5 905 |
| USD | 61 600 | EUR | 56 702 | 10-Mar-20 | (647) |
| CHF | 71 800 000 | EUR | 67 098 677 | 11-Mar-20 | 435 948 |
| CHF | 746 200 | EUR | 703 205 | 11-Mar-20 | (1 334) |
| EUR | 11 553 684 | GBP | 9 630 000 | 19-Mar-20 | 361 376 |
| EUR | 593 215 | GBP | 500 000 | 19-Mar-20 | 12 098 |
| EUR | 55 619 194 | USD | 60 300 000 | 20-Mar-20 | 781 292 |
| EUR | 802 091 | JPY | 97 500 000 | 27-Mar-20 | (20 669) |
| CHF | 425 000 | EUR | 397 196 | 03-Apr-20 | 2 657 |
| | | | | | **1 538 573** |

## Swiss Life Funds (LUX) Bond Global Corporates Short Term

| Kauf | | Verkauf | | Fälligkeitsdatum | Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) EUR |
|---|---|---|---|---|---|
| CHF | 1 715 000 | EUR | 1 595 563 | 09-Mar-20 | 17 520 |
| EUR | 4 820 823 | CHF | 5 200 000 | 09-Mar-20 | (70 157) |
| EUR | 4 585 662 | GBP | 3 900 000 | 09-Mar-20 | 51 419 |
| EUR | 471 690 | GBP | 400 000 | 09-Mar-20 | 6 639 |
| EUR | 237 117 | GBP | 200 000 | 09-Mar-20 | 4 592 |
| EUR | 25 268 276 | USD | 28 200 000 | 09-Mar-20 | (394 652) |
| GBP | 1 350 000 | EUR | 1 573 122 | 09-Mar-20 | (3 576) |
| USD | 257 037 | CHF | 250 000 | 09-Mar-20 | (1 231) |
| USD | 16 300 000 | EUR | 14 579 202 | 09-Mar-20 | 254 334 |
| USD | 500 000 | EUR | 452 204 | 09-Mar-20 | 2 812 |
| USD | 441 207 | EUR | 400 000 | 09-Mar-20 | 1 513 |
| EUR | 27 710 619 | USD | 30 200 000 | 17-Apr-20 | 291 713 |
| | | | | | **160 926** |

# Anmerkungen zum Geschäftsbericht (Fortsetzung)

## Swiss Life Funds (LUX) Bond Global High Yield

| Kauf | | Verkauf | | Fälligkeitsdatum | Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) EUR |
|---|---|---|---|---|---|
| CHF | 58 764 000 | EUR | 54 500 987 | 03-Apr-20 | 786 013 |
| CHF | 35 148 000 | EUR | 32 595 813 | 03-Apr-20 | 472 520 |
| CHF | 12 193 000 | EUR | 11 307 834 | 03-Apr-20 | 163 720 |
| CHF | 1 050 000 | EUR | 978 279 | 03-Apr-20 | 9 593 |
| CHF | 522 000 | EUR | 488 899 | 03-Apr-20 | 2 215 |
| CHF | 250 000 | EUR | 232 974 | 03-Apr-20 | 2 234 |
| CHF | 192 000 | EUR | 179 480 | 03-Apr-20 | 1 160 |
| CHF | 95 000 | EUR | 88 772 | 03-Apr-20 | 607 |
| CHF | 64 000 | EUR | 59 705 | 03-Apr-20 | 508 |
| CHF | 18 000 | EUR | 16 791 | 03-Apr-20 | 144 |
| EUR | 1 178 363 | CHF | 1 252 000 | 03-Apr-20 | 443 |
| EUR | 678 916 | CHF | 721 000 | 03-Apr-20 | 577 |
| EUR | 8 973 773 | GBP | 7 634 000 | 03-Apr-20 | 105 793 |
| EUR | 119 092 648 | USD | 133 059 000 | 03-Apr-20 | (1 809 629) |
| EUR | 1 622 470 | USD | 1 800 000 | 03-Apr-20 | (13 076) |
| | | | | | **(277 178)** |

## Swiss Life Funds (LUX) Bond Inflation Protection

| Kauf | | Verkauf | | Fälligkeitsdatum | Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) EUR |
|---|---|---|---|---|---|
| EUR | 2 843 662 | GBP | 2 418 000 | 03-Apr-20 | 34 810 |
| EUR | 17 213 310 | USD | 19 254 000 | 03-Apr-20 | (281 578) |
| EUR | 1 352 993 | USD | 1 500 000 | 03-Apr-20 | (9 962) |
| EUR | 869 747 | USD | 963 000 | 03-Apr-20 | (5 270) |
| EUR | 552 216 | USD | 600 000 | 03-Apr-20 | 7 034 |
| EUR | 315 543 | USD | 350 000 | 03-Apr-20 | (2 480) |
| EUR | 127 129 | USD | 140 000 | 03-Apr-20 | (80) |
| GBP | 900 000 | EUR | 1 066 625 | 03-Apr-20 | (21 147) |
| GBP | 660 000 | EUR | 774 873 | 03-Apr-20 | (8 189) |
| GBP | 600 000 | EUR | 716 963 | 03-Apr-20 | (19 978) |
| GBP | 18 000 | EUR | 21 335 | 03-Apr-20 | (426) |
| USD | 4 000 000 | EUR | 3 667 778 | 03-Apr-20 | (33 231) |
| USD | 580 000 | EUR | 528 776 | 03-Apr-20 | (1 767) |
| USD | 200 000 | EUR | 184 190 | 03-Apr-20 | (2 463) |
| USD | 192 000 | EUR | 173 857 | 03-Apr-20 | 602 |
| USD | 105 000 | EUR | 96 522 | 03-Apr-20 | (1 115) |
| USD | 50 000 | EUR | 45 116 | 03-Apr-20 | 316 |
| | | | | | **(344 924)** |

# Anmerkungen zum Geschäftsbericht (Fortsetzung)

## Swiss Life Funds (LUX) Equity Global Long/Short

| Kauf | | Verkauf | | Fälligkeitsdatum | Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) EUR |
|---|---|---|---|---|---|
| EUR | 60 592 997 | USD | 68 000 000 | 18-Mar-20 | (1 255 014) |
| EUR | 903 509 | USD | 1 000 000 | 18-Mar-20 | (6 020) |
| | | | | | **(1 261 034)** |

## Swiss Life Funds (LUX) Equity Global Protect

| Kauf | | Verkauf | | Fälligkeitsdatum | Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) EUR |
|---|---|---|---|---|---|
| EUR | 18 803 271 | GBP | 16 000 000 | 18-Mar-20 | 206 905 |
| EUR | 133 610 566 | USD | 150 000 000 | 18-Mar-20 | (2 818 870) |
| EUR | 3 665 437 | USD | 4 000 000 | 18-Mar-20 | 27 319 |
| GBP | 1 400 000 | EUR | 1 643 086 | 18-Mar-20 | (15 905) |
| USD | 18 000 000 | EUR | 16 156 675 | 18-Mar-20 | 214 857 |
| EUR | 24 097 696 | JPY | 2 950 000 000 | 16-Apr-20 | (794 790) |
| EUR | 8 953 125 | CHF | 9 500 000 | 14-May-20 | 11 977 |
| EUR | 46 884 183 | USD | 51 000 000 | 14-May-20 | 650 395 |
| | | | | | **(2 518 112)** |

## Swiss Life Funds (LUX) Fixed Income Alpha Select[1]

| Kauf | | Verkauf | | Fälligkeitsdatum | Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) EUR |
|---|---|---|---|---|---|
| EUR | 2 875 374 | ILS | 11 200 000 | 19-Mar-20 | (44 526) |
| ILS | 3 400 000 | EUR | 882 018 | 19-Mar-20 | 4 381 |
| EUR | 3 572 855 | CHF | 3 800 000 | 20-Mar-20 | (1 754) |
| EUR | 759 725 | GBP | 650 000 | 20-Mar-20 | 4 299 |
| EUR | 328 234 | GBP | 280 000 | 20-Mar-20 | 2 819 |
| EUR | 235 407 | GBP | 200 000 | 20-Mar-20 | 2 968 |
| EUR | 176 007 | GBP | 150 000 | 20-Mar-20 | 1 677 |
| EUR | 980 163 | PLN | 4 200 000 | 20-Mar-20 | 11 375 |
| EUR | 9 139 520 | USD | 10 200 000 | 20-Mar-20 | (136 542) |
| EUR | 6 434 004 | USD | 7 200 000 | 20-Mar-20 | (113 805) |
| EUR | 340 373 | CAD | 500 000 | 24-Mar-20 | 1 712 |
| EUR | 1 168 703 | USD | 1 300 000 | 05-May-20 | (10 373) |
| EUR | 901 238 | USD | 1 000 000 | 05-May-20 | (5 743) |
| EUR | 499 911 | USD | 550 000 | 05-May-20 | 1 071 |
| | | | | | **(282 441)** |

[1] Dieser Teilfonds wurde zum 3. September 2019 aufgelegt.

# Anmerkungen zum Geschäftsbericht (Fortsetzung)

## Swiss Life Funds (LUX) Multi Asset Risk Premia

| Kauf | | Verkauf | | Fälligkeitsdatum | Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) EUR |
|---|---|---|---|---|---|
| CHF | 114 194 000 | EUR | 107 001 268 | 04-Mar-20 | 400 780 |
| CHF | 19 207 000 | EUR | 17 997 547 | 04-Mar-20 | 67 072 |
| CHF | 4 443 000 | EUR | 4 163 227 | 04-Mar-20 | 15 515 |
| EUR | 65 065 572 | USD | 72 000 000 | 04-Mar-20 | (477 244) |
| | | | | | **6 123** |

## Swiss Life Funds (LUX) Prudent (EUR)

| Kauf | | Verkauf | | Fälligkeitsdatum | Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) EUR |
|---|---|---|---|---|---|
| EUR | 22 440 438 | GBP | 19 074 000 | 04-Mar-20 | 260 816 |
| EUR | 170 314 286 | USD | 188 503 000 | 04-Mar-20 | (1 283 181) |
| | | | | | **(1 022 365)** |

## Swiss Life Funds (LUX) Harmony (EUR)

| Kauf | | Verkauf | | Fälligkeitsdatum | Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) EUR |
|---|---|---|---|---|---|
| EUR | 9 593 347 | GBP | 8 154 000 | 04-Mar-20 | 111 716 |
| EUR | 58 079 104 | USD | 64 280 500 | 04-Mar-20 | (436 522) |
| | | | | | **(324 806)** |

## Swiss Life Funds (LUX) Portfolio Global Growth (CHF)

| Kauf | | Verkauf | | Fälligkeitsdatum | Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) CHF |
|---|---|---|---|---|---|
| CHF | 5 146 663 | EUR | 4 850 000 | 15-May-20 | (6 436) |
| CHF | 3 224 296 | USD | 3 300 000 | 15-May-20 | 45 909 |
| | | | | | **39 473** |

## Anmerkungen zum Geschäftsbericht (Fortsetzung)

### Swiss Life Funds (LUX) Vitality (EUR)

| Kauf | | Verkauf | | Fälligkeitsdatum | Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) EUR |
|---|---|---|---|---|---|
| EUR | 4 064 837 | GBP | 3 455 000 | 04-Mar-20 | 47 295 |
| EUR | 22 546 411 | USD | 24 952 000 | 04-Mar-20 | (167 817) |
| | | | | | **(120 522)** |

### 9 - Wertpapierleihgeschäfte

Die Gesellschaft kann Wertpapierleihgeschäfte tätigen, wenn dies mit folgenden Regeln im Einklang steht:

- Die Gesellschaft kann Wertpapiere entweder direkt oder über ein standardisiertes Leihsystem verleihen oder ausleihen, das von einer anerkannten Clearingstelle betrieben wird oder von einem Finanzinstitut, das auf diese Art von Geschäfte spezialisiert ist und vernünftigen aufsichtsrechtlichen Bestimmungen unterliegt, die von der Aufsichtsbehörde als gleichwertig mit dem Gemeinschaftsrecht angesehen werden.
- Von der Gesellschaft ausgeliehene Wertpapiere dürfen nicht veräußerst werden, solange sie von der Gesellschaft gehalten werden, es sei denn, sie sind in ausreichendem Maße abgesichert durch Finanzinstrumente, die der Gesellschaft nach Abschluss der Transaktion die Rückgabe der ausgeliehenen Wertpapiere ermöglichen.
- In Verbindung mit der Abwicklung eines Verkaufsgeschäfts darf die Gesellschaft unter folgenden Voraussetzungen Wertpapiere ausleihen: (a) in einem Jahr, in dem die Wertpapiere zur erneuten Registrierung verschickt wurden; (b) wenn die Wertpapiere beliehen und nicht fristgerecht zurückgegeben wurden; (c) um zu vermeiden, dass die Abrechnung wegen fehlender Bereitstellung durch die Depotstelle nicht möglich ist; und (d) als Verfahren, mit dem sie ihre Verpflichtung erfüllt, die Wertpapiere bereitzustellen, die Gegenstand eines Pensionsgeschäfts sind, wenn die Gegenpartei eines solchen Geschäfts ihr Recht auf Rückkauf dieser Wertpapiere ausübt, soweit die Gesellschaft diese Wertpapiere zuvor verkauft hat.

Die beliehenen Wertpapiere hatten zum 29. Februar 2020 folgenden Marktwert:

| Teilfonds | Marktwert der verliehenen Wertpapiere (EUR) |
|---|---|
| Swiss Life Funds (LUX) Bond Emerging Markets Corporates | 5 045 873 |
| Swiss Life Funds (LUX) Bond Emerging Markets Corporates Short Term | 4 424 537 |
| Swiss Life Funds (LUX) Bond Inflation Protection | 1 283 182 |
| Swiss Life Funds (LUX) Equity Euro Zone | 9 684 238 |
| Swiss Life Funds (LUX) Equity Global | 428 709 |
| Swiss Life Funds (LUX) Equity Global High Dividend | 1 337 266 |
| Swiss Life Funds (LUX) Equity Global Long/Short | 1 524 233 |
| Swiss Life Funds (LUX) Equity Global Minimum Volatility | 1 421 018 |
| Swiss Life Funds (LUX) Equity Global Protect | 3 949 392 |
| Swiss Life Funds (LUX) Multi Asset Risk Premia | 1 132 908 |
| Swiss Life Funds (LUX) Prudent (EUR) | 7 877 197 |
| Swiss Life Funds (LUX) Harmony (EUR) | 4 447 396 |
| Swiss Life Funds (LUX) Income Equity Euro Zone[1] | 2 188 962 |
| Swiss Life Funds (LUX) Portfolio Global Growth CHF | 1 890 848 |
| Swiss Life Funds (LUX) Vitality (EUR) | 3 315 301 |

Die Gegenpartei und die Leihstelle für Wertpapierbeleihungen ist Société Générale (FR).

[1] Dieser Teilfonds wurde zum 19. Dezember 2019 aufgelegt.

## Anmerkungen zum Geschäftsbericht (Fortsetzung)

Im Folgenden wird der Betrag unbarer Sicherheiten für Aktienleihgeschäfte aufgeführt:

### Swiss Life Funds (LUX) Bond Emerging Markets Corporates

| Art des Instruments | Name des Emittenten | Währung | Erhaltener Sicherheitsbetrag (in der Währung des Teilfonds) |
|---|---|---|---|
| Aktien | CRH PLC | EUR | 1 324 005 |
| Aktien | ORANGE | EUR | 1 231 780 |
| Aktien | BOUYGUES SA | EUR | 873 747 |
| Aktien | VIVENDI SA | EUR | 654 068 |
| Aktien | RENAULT SA | EUR | 445 782 |
| Aktien | DAIMLER AG-REG SHARES | EUR | 275 376 |
| Aktien | SAGE GROUP PLC/THE | EUR | 265 839 |
| Aktien | PEUGEOT SA | EUR | 154 469 |
| Aktien | THALES SA | EUR | 29 698 |
| | | | **5 254 764** |

### Swiss Life Funds (LUX) Bond Emerging Markets Corporates Short Term

| Art des Instruments | Name des Emittenten | Währung | Erhaltener Sicherheitsbetrag (in der Währung des Teilfonds) |
|---|---|---|---|
| Aktien | THALES SA | EUR | 4 016 328 |
| Aktien | BOUYGUES SA | EUR | 341 863 |
| Aktien | PEUGEOT SA | EUR | 184 258 |
| Aktien | DANONE | EUR | 96 792 |
| Aktien | ORANGE | EUR | 14 207 |
| | | | **4 653 448** |

### Swiss Life Funds (LUX) Bond Inflation Protection

| Art des Instruments | Name des Emittenten | Währung | Erhaltener Sicherheitsbetrag (in der Währung des Teilfonds) |
|---|---|---|---|
| Aktien | TOTAL SA | EUR | 1 161 910 |
| Aktien | DANONE | EUR | 96 792 |
| Aktien | BOUYGUES SA | EUR | 70 573 |
| Aktien | ORANGE | EUR | 18 942 |
| | | | **1 348 217** |

### Swiss Life Funds (LUX) Equity Euro Zone

| Art des Instruments | Name des Emittenten | Währung | Erhaltener Sicherheitsbetrag (in der Währung des Teilfonds) |
|---|---|---|---|
| Aktien | DEUT POST | EUR | 5 619 281 |
| Aktien | VEOLIA ENVIRONNEMENT | EUR | 2 884 756 |
| Aktien | CONTINENTAL AG | EUR | 959 708 |
| Aktien | ORANGE | EUR | 821 085 |
| | | | **10 284 830** |

# Anmerkungen zum Geschäftsbericht (Fortsetzung)

## Swiss Life Funds (LUX) Equity Global

| Art des Instruments | Name des Emittenten | Währung | Erhaltener Sicherheitsbetrag (in der Währung des Teilfonds) |
|---|---|---|---|
| Aktien | ORANGE | EUR | 443 717 |
| Aktien | LVMH MOET HENNESSY LOUIS VU | EUR | 28 478 |
| Aktien | BOUYGUES SA | EUR | 10 584 |
| Aktien | TOTAL SA | EUR | 4 365 |
| | | | **487 144** |

## Swiss Life Funds (LUX) Equity Global High Dividend

| Art des Instruments | Name des Emittenten | Währung | Erhaltener Sicherheitsbetrag (in der Währung des Teilfonds) |
|---|---|---|---|
| Aktien | ADIDAS AG | EUR | 1 399 925 |
| Aktien | INTEL CORP | EUR | 147 935 |
| Aktien | DANONE | EUR | 198 729 |
| | | | **1 746 589** |

## Swiss Life Funds (LUX) Equity Global Long/Short

| Art des Instruments | Name des Emittenten | Währung | Erhaltener Sicherheitsbetrag (in der Währung des Teilfonds) |
|---|---|---|---|
| Aktien | PUBLICIS GROUPE | EUR | 1 050 331 |
| Aktien | ORANGE | EUR | 443 717 |
| Aktien | SCHNEIDER ELECTRIC SE | EUR | 198 729 |
| | | | **1 692 777** |

## Swiss Life Funds (Lux) Equity Global Minimum Volatility

| Art des Instruments | Name des Emittenten | Währung | Erhaltener Sicherheitsbetrag (in der Währung des Teilfonds) |
|---|---|---|---|
| Aktien | VEOLIA ENVIRONNEMENT | EUR | 1 203 313 |
| Aktien | PUBLICIS GROUPE | EUR | 291 481 |
| | | | **1 494 794** |

## Swiss Life Funds (LUX) Equity Global Protect

| Art des Instruments | Name des Emittenten | Währung | Erhaltener Sicherheitsbetrag (in der Währung des Teilfonds) |
|---|---|---|---|
| Aktien | DEUT POST | EUR | 2 182 590 |
| Aktien | TOTAL SA | EUR | 1 088 026 |
| Aktien | BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG | EUR | 948 404 |
| Aktien | ORANGE | EUR | 98 607 |
| | | | **4 317 627** |

# Anmerkungen zum Geschäftsbericht (Fortsetzung)

## Swiss Life Funds (LUX) Multi Asset Risk Premia

| Art des Instruments | Name des Emittenten | Währung | Erhaltener Sicherheitsbetrag (in der Währung des Teilfonds) |
|---|---|---|---|
| Aktien | TOTAL SA | EUR | 570 003 |
| Aktien | SANOFI | EUR | 518 789 |
| Aktien | ORANGE | EUR | 147 923 |
| | | | **1 236 715** |

## Swiss Life Funds (LUX) Prudent (EUR)

| Art des Instruments | Name des Emittenten | Währung | Erhaltener Sicherheitsbetrag (in der Währung des Teilfonds) |
|---|---|---|---|
| Aktien | DEUT POST | EUR | 8 183 118 |
| Aktien | ORANGE | EUR | 98 607 |
| | | | **8 281 725** |

## Swiss Life Funds (LUX) Harmony (EUR)

| Art des Instruments | Name des Emittenten | Währung | Erhaltener Sicherheitsbetrag (in der Währung des Teilfonds) |
|---|---|---|---|
| Aktien | POLYMETAL INTERNATIONAL PLC | EUR | 4 646 274 |
| Aktien | ORANGE | EUR | 98 607 |
| | | | **4 744 881** |

## Swiss Life Funds (LUX) Income Equity Euro Zone[1]

| Art des Instruments | Name des Emittenten | Währung | Erhaltener Sicherheitsbetrag (in der Währung des Teilfonds) |
|---|---|---|---|
| Aktien | DEUTSCHE TELEKOM AG-REG | EUR | 2 310 522 |
| Aktien | HEIDELBERGCEMENT AG | EUR | 616 660 |
| Anleihe | HESSEN 0.63% 04/2027* | EUR | 256 037 |
| | | | **3 183 219** |

## Swiss Life Funds (LUX) Portfolio Global Growth (CHF)

| Art des Instruments | Name des Emittenten | Währung | Erhaltener Sicherheitsbetrag (in der Währung des Teilfonds) |
|---|---|---|---|
| Aktien | SANOFI | EUR | 1 986 274 |
| Aktien | VEOLIA ENVIRONNEMENT | EUR | 73 486 |
| Aktien | SCHNEIDER ELECTRIC SE | EUR | 4 781 |
| | | | **2 064 541** |

* Bonitätsstufe AA+

[1] Dieser Teilfonds wurde zum 19. Dezember 2019 aufgelegt.

# Anmerkungen zum Geschäftsbericht (Fortsetzung)

## Swiss Life Funds (LUX) Vitality (EUR)

| Art des Instruments | Name des Emittenten | Währung | Erhaltener Sicherheitsbetrag (in der Währung des Teilfonds) |
|---|---|---|---|
| Aktien | POLYMETAL INTERNATIONAL PLC | EUR | 2 446 709 |
| Aktien | ORANGE | EUR | 1 132 155 |
| | | | **3 578 864** |

Für den zum 29. Februar 2020 abgeschlossenen Zeitraum wurden vom Fonds folgende Erträge aus Wertpapierbeleihungen erzielt:

| Teilfonds | Gesamtbruttobetrag der Erträge aus Wertpapierbeleihungen (in der Währung des Teilfonds) | Direkte und indirekte entstandene Betriebskosten (in der Währung des Teilfonds) | Anteil der direkten und indirekten Betriebskosten | Gesamtnettobetrag der Wertpapierleihgeschäfte (in der Währung des Teilfonds) | Anteil der Erträge aus Wertpapierbeleihungen |
|---|---|---|---|---|---|
| Swiss Life Funds (LUX) Bond Emerging Markets Corporates | 31 909 | 4 786 | 15% | 27 123 | 85% |
| Swiss Life Funds (LUX) Bond Emerging Markets Corporates Short Term | 4 947 | 742 | 15% | 4 205 | 85% |
| Swiss Life Funds (LUX) Bond Euro Corporates | 30 | 5 | 15% | 26 | 85% |
| Swiss Life Funds (LUX) Bond Global Corporates | 586 | 88 | 15% | 498 | 85% |
| Swiss Life Funds (LUX) Bond Inflation Protection | 1 158 | 174 | 15% | 985 | 85% |
| Swiss Life Funds (LUX) Equity Euro Zone | 53 028 | 7 954 | 15% | 45 074 | 85% |
| Swiss Life Funds (LUX) Equity Global | 1 575 | 236 | 15% | 1 339 | 85% |
| Swiss Life Funds (LUX) Equity Global High Dividend | 5 153 | 773 | 15% | 4 380 | 85% |
| Swiss Life Funds (LUX) Equity Global Long/Short | 4 050 | 607 | 15% | 3 442 | 85% |
| Swiss Life Funds (LUX) Equity Global Minimum Volatility | 5 498 | 825 | 15% | 4 673 | 85% |
| Swiss Life Funds (LUX) Equity Global Protect | 11 468 | 1 720 | 15% | 9 748 | 85% |
| Swiss Life Funds (LUX) Equity USA | 350 | 52 | 15% | 297 | 85% |
| Swiss Life Funds (LUX) Multi Asset Risk Premia | 3 825 | 574 | 15% | 3 251 | 85% |
| Swiss Life Funds (LUX) Prudent (EUR) | 2 721 | 408 | 15% | 2 313 | 85% |
| Swiss Life Funds (LUX) Harmony (EUR) | 1101 | 165 | 15% | 936 | 85% |
| Swiss Life Funds (LUX) Portfolio Global Growth (CHF) | 725 | 109 | 15% | 616 | 85% |
| Swiss Life Funds (LUX) Vitality (EUR) | 1 407 | 211 | 15% | 1 196 | 85% |

Der Unterschied zwischen dem Netto- und dem Bruttobetrag wird durch die Gewinnbeteiligung, die hier genau angegeben wird, erklärt:
- 85% für den Teilfonds;
- 15% für Société Générale.

## 10 - Ausstehende Swaps

Zum 29. Februar 2020 wiesen die Teilfonds die nachstehend detailliert aufgeführten Positionen aus Swaps auf:

### Swiss Life Funds (LUX) Bond Global Corporates

| Fälligkeitsdatum | Geschäft | Erhaltener Satz | Währungs | Nominal | Marktwert EUR |
|---|---|---|---|---|---|
| 11/12/2032 | Interest rate swap | LIBOR 3M | USD | 3 000 000 | (394 403) |
| | | | | | **(394 403)** |

# Anmerkungen zum Geschäftsbericht (Fortsetzung)

## Swiss Life Funds (LUX) Fixed Income Alpha Select[1]

| Fälligkeitsdatum | Geschäft | Erhaltener Satz | Währungs | Nominal | Marktwert EUR |
|---|---|---|---|---|---|
| 20/12/2024 | Interest rate swap | LIBOR 3M | EUR | 20 000 000 | (343 286) |
| 20/12/2024 | Interest rate swap | LIBOR 3M | EUR | 10 000 000 | 171 751 |
| | | | | | **(171 535)** |

## Swiss Life Funds (LUX) Multi Asset Risk Premia

| Fälligkeitsdatum | Geschäft | Zugrundeliegend | Währungs | Nominal | Marktwert EUR |
|---|---|---|---|---|---|
| 30/09/2020 | Equity | Basket of securities | USD | 116 100 000 | (20 522)* |
| 30/09/2020 | Equity | Basket of securities | EUR | 207 300 000 | 986 613** |
| 30/09/2020 | Equity | Basket of securities | EUR | 149 700 000 | (513 666***) |
| | | | | | **452 425** |

Die Gegenparteien bei dem Swap sind Barclays (GB)(*), JP Morgan (GB)(***) und Deutsche Bank (DE)(**).

Zu diesem Zweck hatte der Teilfonds zum 29. Februar 2020 folgende Barsicherheiten erhalten oder gewährt:

| Teilfonds | Währungs | Gegenpartei | Art der Sicherheiten | Betrag der erhaltenen Sicherheit | Betrag der erhaltenen Sicherheit |
|---|---|---|---|---|---|
| Swiss Life Funds (LUX) Multi Asset Risk Premia | EUR | CREDIT AGRICOLE | Cash | 350 000 | |
| Swiss Life Funds (LUX) Multi Asset Risk Premia | EUR | DEUTSCHE BANK | Cash | | 4 640 000 |
| Swiss Life Funds (LUX) Multi Asset Risk Premia | EUR | NATIXIS | Cash | | 490 000 |

## 11 - Wechselkurse

Folgende Wechselkurse wurden für die Erstellung dieses Geschäftsberichts verwendet:

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| 1 EUR = | 1.70370 | AUD | 1 EUR = | 1.47450 | CAD |
| 1 EUR = | 1.06325 | CHF | 1 EUR = | 7.47295 | DKK |
| 1 EUR = | 0.85995 | GBP | 1 EUR = | 8.56025 | HKD |
| 1 EUR = | 3.83515 | ILS | 1 EUR = | 118.48435 | JPY |
| 1 EUR = | 10.40425 | NOK | 1 EUR = | 1.77095 | NZD |
| 1 EUR = | 4.33085 | PLN | 1 EUR = | 10.64955 | SEK |
| 1 EUR = | 1.53310 | SGD | 1 EUR = | 1.09845 | USD |

## 12 - Dividenden - Ausschüttung

| Teilfonds | Klasse | Ausschüttungsdatum | Dividende pro Anteil | Gesamtausschüttung in der Währung des Teilfonds |
|---|---|---|---|---|
| Swiss Life Funds (LUX) Bond Emerging Markets Corporates | I-Anteile in EUR Abgesichert - Ausschüttend | 18. Dezember 2019 | 417.78 | 323 851 |
| Swiss Life Funds (LUX) Bond Global Corporates | I-Anteile - Ausschüttend | 18. Dezember 2019 | 308.11 | 219 682 |

[1] Dieser Teilfonds wurde zum 3. September 2019 aufgelegt.

## Anmerkungen zum Geschäftsbericht (Fortsetzung)

| Teilfonds | Klasse | Ausschüttungsdatum | Dividende pro Anteil | Gesamtausschüttung in der Währung des Teilfonds |
|---|---|---|---|---|
| Swiss Life Funds (LUX) Bond Global Corporates Short Term | I-Anteile - Ausschüttend | 18. Dezember 2019 | 250.79 | 2 250 589 |
| Swiss Life Funds (LUX) Bond Global Corporates Short Term | R-Anteile - Ausschüttend | 18. Dezember 2019 | 2.55 | 128 268 |
| Swiss Life Funds (LUX) Bond Global High Yield | I-Anteile - Ausschüttend | 18. Dezember 2019 | 389.83 | 898 558 |
| Swiss Life Funds (LUX) Equity Global High Dividend | I-Anteile - Ausschüttend | 18. Dezember 2019 | 402.44 | 2 186 859 |
| Swiss Life Funds (LUX) Equity Global High Dividend | R-Anteile in CHF - Ausschüttend | 18. Dezember 2019 | 2.81 | 756 644 |
| Swiss Life Funds (LUX) Equity Global Minimum Volatility | I-Anteile EUR - Ausschüttend | 18. Dezember 2019 | 267.45 | 1 006 809 |
| Swiss Life Funds (LUX) Equity Global Minimum Volatility | R-Anteile EUR - Ausschüttend | 18. Dezember 2019 | 2.62 | 292 780 |
| Swiss Life Funds (LUX) Equity USA | SL-Anteile in EUR - Ausschüttend | 18. Dezember 2019 | 176.88 | 1 024 400 |

### 13 - Ereignisse nach dem Bilanzstichtag

Sollte die COVID-19-Krise länger anhalten, könnte sie zu einer globalen Rezession führen und die Aktienmärkte könnten daher 2020 ein starkes Minus verzeichnen.

Die Kreditspreads könnten sich stark ausweiten und auch bei den Kreditportfolios zu negativen Renditen führen, vor allem bei Hochzinsanleihen. Die Marktliquidität könnte erheblich austrocknen, was die Durchführung von Transaktionen erschweren würde. Zum jetzigen Zeitpunkt sind alle Risiken gut unter Kontrolle und werden genau überwacht. Das Portfolio hat keine Zahlungsausfälle, wir konzentrieren uns auf die Liquiditätssteuerung und waren im ersten Quartal bei Aktien defensiv ausgerichtet. Bei den meisten Portfolios schwächte dies den Geschäftsrückgang ab.

Im Moment ist das Coronavirus das alles beherrschende Thema. Auch Swiss Life Asset Managers und Swiss Life Asset Managers Luxembourg haben deshalb seit einigen Wochen angesichts der Situation in Europa Anlass zur Sorge.

Swiss Life Asset Managers und Swiss Life Asset Managers Luxembourg haben interne Vorsichtsmaßnahmen getroffen, um einen einwandfreien Geschäftsbetrieb zu gewährleisten, falls die Regierungen und lokalen Behörden bei steigender Gefahr entsprechende Maßnahmen ergreifen sollten.

Der Schutz der Gesundheit aller Mitarbeiter und die Wahrung der Interessen der Anleger und Kunden haben für Swiss Life Asset Managers und Swiss Life Asset Managers Luxembourg Vorrang. Aus diesem Grund besteht eine der Maßnahmen darin, dass die Mitarbeiter jetzt von zuhause aus arbeiten, um zu gewährleisten, dass sie ihre Arbeit fortsetzen können und um die Aufrechterhaltung der Geschäftskontinuität zu garantieren. Ortsunabhängige Telearbeit ist für Swiss Life Asset Managers und Swiss Life Asset Managers Luxembourg nichts Neues. Für geschäftsentscheidende Tätigkeiten, die eine Anwesenheit vor Ort erfordern, wechseln sich kleinere Teams im Wochenrhythmus ab. Die normalen Verfahren und Kontrollen bleiben weiter bestehen und werden bei Bedarf angepasst, wenn die Situation dies erforderlich machen sollte.

Swiss Life Asset Managers und Swiss Life Asset Managers Luxembourg behalten die neusten Entwicklungen auf den Finanzmärkten weiterhin genau im Auge und analysieren sie eingehend.

# Sonstige Informationen

## 1 - Verordnung über Wertpapierfinanzierungsgeschäfte

### Wertpapierleihgeschäfte

Im Zuge der Verordnung 2015/2365 des Europäischen Parlaments und des Rates vom 25. November 2015 über die Transparenz von Wertpapierfinanzierungsgeschäften unterlagen dieser Verordnung im am 29. Februar 2020 zu Ende gegangenen Zeitraum nur Wertpapierleihgeschäfte:

| | Swiss Life Funds (LUX) Bond Emerging Markts Corporates | Swiss Life Funds (LUX) Bond Emerging Markts Corporates Short Term | Swiss Life Funds (LUX) Bond Inflation Protection | Swiss Life Funds (LUX) Equity Euro Zone |
|---|---|---|---|---|
| **Betrag der Wertpapierleihgeschäfte, in absoluten Beträgen (in der Währung des Teilfonds)** | siehe Anmerkung 9 | siehe Anmerkung 9 | siehe Anmerkung 9 | siehe Anmerkung 9 |
| Anteil der gesamten beleihbaren Vermögenswerte* | 1.12% | 1.57% | 6.45% | 4.61% |
| Anteil des verwalteten Vermögens | 1.04% | 1.52% | 6.23% | 4.62% |
| **Laufzeit der Sicherheiten aufgeschlüsselt nach folgenden Laufzeitbändern** | | | | |
| Weniger als ein Tag | - | - | - | - |
| Ein Tag bis eine Woche | - | - | - | - |
| Eine Woche bis ein Monat | - | - | - | - |
| Ein bis drei Monate | - | - | - | - |
| Drei Monate bis ein Jahr | - | 458 790 | - | - |
| Mehr als ein Jahr | 5 045 873 | 3 965 747 | 1 283 182 | - |
| Offene Laufzeit | - | - | - | 9 684 238 |
| Total | 5 045 873 | 4 424 537 | 1 283 182 | 9 684 238 |
| **Gegenpartei** | | | | |
| *Name der Gegenpartei* | siehe Anmerkung 9 | siehe Anmerkung 9 | siehe Anmerkung 9 | siehe Anmerkung 9 |
| Land des Sitzes der Gegenpartei | siehe Anmerkung 9 | siehe Anmerkung 9 | siehe Anmerkung 9 | siehe Anmerkung 9 |
| Bruttovolumen ausstehender Transaktionen | siehe Anmerkung 9 | siehe Anmerkung 9 | siehe Anmerkung 9 | siehe Anmerkung 9 |
| **Angaben zu den Sicherheiten** | | | | |
| *Art der Sicherheiten:* | | | | |
| Bargeldanlagen | - | - | - | - |
| Wertpapiere | siehe Anmerkung 9 | siehe Anmerkung 9 | siehe Anmerkung 9 | siehe Anmerkung 9 |
| Qualität der Sicherheiten: | | | | |
| Emittent | siehe Anmerkung 9 | siehe Anmerkung 9 | siehe Anmerkung 9 | siehe Anmerkung 9 |
| Rating | siehe Anmerkung 9 | siehe Anmerkung 9 | siehe Anmerkung 9 | - |
| **Laufzeit der Sicherheit aufgeschlüsselt folgenden Laufzeitbändern** | | | | |
| Weniger als ein Tag | - | - | - | - |
| Ein Tag bis eine Woche | - | - | - | - |
| Eine Woche bis ein Monat | - | - | - | - |
| Ein bis drei Monate | - | - | - | - |
| Drei Monate bis ein Jahr | - | - | - | - |
| Mehr als ein Jahr | - | - | - | - |
| Offene Laufzeit | 5 254 764 | 4 653 448 | 1 348 217 | 10 284 829 |
| Total | 5 254 764 | 4 653 448 | 1 348 217 | 10 284 829 |
| **Verwahrung der vom Fonds im Rahmen von Wertpapierbeleihungen erhaltenen Sicherheit** | | | | |
| Name der Depotstelle | siehe Anmerkung 9 | siehe Anmerkung 9 | siehe Anmerkung 9 | siehe Anmerkung 9 |
| Wertpapiere | siehe Anmerkung 9 | siehe Anmerkung 9 | siehe Anmerkung 9 | siehe Anmerkung 9 |
| Bargeldanlagen | - | - | - | - |
| Daten zu Erträgen und Kosten von Wertpapierleihgeschäften | siehe Anmerkung 9 | siehe Anmerkung 9 | siehe Anmerkung 9 | siehe Anmerkung 9 |

* Der Anteil der gesamten beleihbaren Vermögenswerte bildet den Marktwert der beliehenen Wertpapiere / den Marktwert des Portfolios des Teilfonds ab.
Alle Transaktionen sind zweiseitige Transaktionen.
Sicherheiten für Wertpapierleihgeschäfte werden nicht wiederverwendet.

## Sonstige Informationen (Fortsetzung)

| | Swiss Life Funds (LUX) Equity Global | Swiss Life Funds (LUX) Equity Global High Dividend | Swiss Life Funds (LUX) Equity Global Long/Short | Swiss Life Funds (LUX) Equity Global Minimum Volatility |
|---|---|---|---|---|
| **Betrag der Wertpapierleihgeschäfte, in absoluten Beträgen (in der Währung des Teilfonds)** | siehe Anmerkung 9 | siehe Anmerkung 9 | siehe Anmerkung 9 | siehe Anmerkung 9 |
| Anteil der gesamten beleihbaren Vermögenswerte* | 0.28% | 0.72% | 1.16% | 0.82% |
| Anteil des verwalteten Vermögens | 0.28% | 0.69% | 0.95% | 0.81% |
| **Laufzeit der Sicherheiten aufgeschlüsselt nach folgenden Laufzeitbändern** | | | | |
| Weniger als ein Tag | - | - | - | - |
| Ein Tag bis eine Woche | - | - | - | - |
| Eine Woche bis ein Monat | - | - | - | - |
| Ein bis drei Monate | - | - | - | - |
| Drei Monate bis ein Jahr | - | - | - | - |
| Mehr als ein Jahr | - | - | - | - |
| Offene Laufzeit | 428 709 | 1 337 266 | 1 524 233 | 1 421 018 |
| Total | 428 709 | 1 337 266 | 1 524 233 | 1 421 018 |
| **Gegenpartei** | | | | |
| *Name der Gegenpartei* | siehe Anmerkung 9 | siehe Anmerkung 9 | siehe Anmerkung 9 | siehe Anmerkung 9 |
| Land des Sitzes der Gegenpartei | siehe Anmerkung 9 | siehe Anmerkung 9 | siehe Anmerkung 9 | siehe Anmerkung 9 |
| Bruttovolumen ausstehender Transaktionen | - | - | - | - |
| **Angaben zu den Sicherheiten** | | | | |
| *Art der Sicherheiten:* | | | | |
| Bargeldanlagen | - | - | - | - |
| Wertpapiere | siehe Anmerkung 9 | siehe Anmerkung 9 | siehe Anmerkung 9 | siehe Anmerkung 9 |
| Qualität der Sicherheiten: | | | | |
| Emittent | siehe Anmerkung 9 | siehe Anmerkung 9 | siehe Anmerkung 9 | siehe Anmerkung 9 |
| Rating | - | - | - | - |
| **Laufzeit der Sicherheit aufgeschlüsselt folgenden Laufzeitbändern** | | | | |
| Weniger als ein Tag | - | - | - | - |
| Ein Tag bis eine Woche | - | - | - | - |
| Eine Woche bis ein Monat | - | - | - | - |
| Ein bis drei Monate | - | - | - | - |
| Drei Monate bis ein Jahr | - | - | - | - |
| Mehr als ein Jahr | - | - | - | - |
| Offene Laufzeit | 487 144 | 1 548 383 | 1 692 777 | 1 494 794 |
| Total | 487 144 | 1 548 383 | 1 692 777 | 1 494 794 |
| **Verwahrung der vom Fonds im Rahmen von Wertpapierbeleihungen erhaltenen Sicherheit** | | | | |
| Name der Depotstelle | siehe Anmerkung 9 | siehe Anmerkung 9 | siehe Anmerkung 9 | siehe Anmerkung 9 |
| Wertpapiere | siehe Anmerkung 9 | siehe Anmerkung 9 | siehe Anmerkung 9 | siehe Anmerkung 9 |
| Bargeldanlagen | - | - | - | - |
| Daten zu Erträgen und Kosten von Wertpapierleihgeschäften | siehe Anmerkung 9 | siehe Anmerkung 9 | siehe Anmerkung 9 | siehe Anmerkung 9 |

* Der Anteil der gesamten beleihbaren Vermögenswerte bildet den Marktwert der beliehenen Wertpapiere / den Marktwert des Portfolios des Teilfonds ab.
Alle Transaktionen sind zweiseitige Transaktionen.
Sicherheiten für Wertpapierleihgeschäfte werden nicht wiederverwendet.

## Sonstige Informationen (Fortsetzung)

| | Swiss Life Funds (LUX) Equity Global Protect | Swiss Life Funds (LUX) Multi Asset Risk Premia | Swiss Life Funds (LUX) Prudent (EUR) | Swiss Life Funds (LUX) Harmony (EUR) |
|---|---|---|---|---|
| **Betrag der Wertpapierleihgeschäfte, in absoluten Beträgen (in der Währung des Teilfonds)** | siehe Anmerkung 9 | siehe Anmerkung 9 | siehe Anmerkung 9 | siehe Anmerkung 9 |
| Anteil der gesamten beleihbaren Vermögenswerte* | 1.48% | 0.70% | 0.58% | 1.08% |
| Anteil des verwalteten Vermögens | 1.35% | 0.46% | 0.53% | 1.01% |
| **Laufzeit der Sicherheiten aufgeschlüsselt nach folgenden Laufzeitbändern** | | | | |
| Weniger als ein Tag | - | - | - | - |
| Ein Tag bis eine Woche | - | - | - | - |
| Eine Woche bis ein Monat | - | - | - | - |
| Ein bis drei Monate | - | - | - | - |
| Drei Monate bis ein Jahr | - | - | - | - |
| Mehr als ein Jahr | - | - | - | - |
| Offene Laufzeit | 3 949 392 | 1 132 908 | 7 877 197 | 4 447 396 |
| Total | 3 949 392 | 1 132 908 | 7 877 197 | 4 447 396 |
| **Gegenpartei** | | | | |
| *Name der Gegenpartei* | siehe Anmerkung 9 | siehe Anmerkung 9 | siehe Anmerkung 9 | siehe Anmerkung 9 |
| Land des Sitzes der Gegenpartei | siehe Anmerkung 9 | siehe Anmerkung 9 | siehe Anmerkung 9 | siehe Anmerkung 9 |
| Bruttovolumen ausstehender Transaktionen | siehe Anmerkung 9 | siehe Anmerkung 9 | siehe Anmerkung 9 | siehe Anmerkung 9 |
| **Angaben zu den Sicherheiten** | | | | |
| *Art der Sicherheiten:* | | | | |
| Bargeldanlagen | - | - | - | - |
| Wertpapiere | siehe Anmerkung 9 | siehe Anmerkung 9 | siehe Anmerkung 9 | siehe Anmerkung 9 |
| Qualität der Sicherheiten: | | | | |
| Emittent | siehe Anmerkung 9 | siehe Anmerkung 9 | siehe Anmerkung 9 | siehe Anmerkung 9 |
| Rating | - | - | - | - |
| **Laufzeit der Sicherheit aufgeschlüsselt folgenden Laufzeitbändern** | | | | |
| Weniger als ein Tag | - | - | - | - |
| Ein Tag bis eine Woche | - | - | - | - |
| Eine Woche bis ein Monat | - | - | - | - |
| Ein bis drei Monate | - | - | - | - |
| Drei Monate bis ein Jahr | - | - | - | - |
| Mehr als ein Jahr | - | - | - | - |
| Offene Laufzeit | 4 317 626 | 1 236 715 | 8 281 725 | 4 744 881 |
| Total | 4 317 626 | 1236 715 | 8 281 725 | 4 744 881 |
| **Verwahrung der vom Fonds im Rahmen von Wertpapierbeleihungen erhaltenen Sicherheit** | | | | |
| Name der Depotstelle | siehe Anmerkung 9 | siehe Anmerkung 9 | siehe Anmerkung 9 | siehe Anmerkung 9 |
| Wertpapiere | siehe Anmerkung 9 | siehe Anmerkung 9 | siehe Anmerkung 9 | siehe Anmerkung 9 |
| Bargeldanlagen | - | - | - | - |
| Daten zu Erträgen und Kosten von Wertpapierleihgeschäften | siehe Anmerkung 9 | siehe Anmerkung 9 | siehe Anmerkung 9 | siehe Anmerkung 9 |

* Der Anteil der gesamten beleihbaren Vermögenswerte bildet den Marktwert der beliehenen Wertpapiere / den Marktwert des Portfolios des Teilfonds ab.
Alle Transaktionen sind zweiseitige Transaktionen.
Sicherheiten für Wertpapierleihgeschäfte werden nicht wiederverwendet.

## Sonstige Informationen (Fortsetzung)

| | Swiss Life Funds (LUX) Income Equity Euro Zone[1] | Swiss Life Funds (LUX) Portfolio Global Growth (CHF) | Swiss Life Funds (LUX) Vitality (EUR) |
|---|---|---|---|
| **Betrag der Wertpapierleihgeschäfte, in absoluten Beträgen (in der Währung des Teilfonds)** | siehe Anmerkung 9 | siehe Anmerkung 9 | siehe Anmerkung 9 |
| Anteil der gesamten beleihbaren Vermögenswerte* | 2.65% | 4.19% | 2.39% |
| Anteil des verwalteten Vermögens | 2.13% | 3.88% | 2.22% |
| **Laufzeit der Sicherheiten aufgeschlüsselt nach folgenden Laufzeitbändern** | | | |
| Weniger als ein Tag | - | - | - |
| Ein Tag bis eine Woche | - | - | - |
| Eine Woche bis ein Monat | - | - | - |
| Ein bis drei Monate | - | - | - |
| Drei Monate bis ein Jahr | - | - | - |
| Mehr als ein Jahr | - | - | - |
| Offene Laufzeit | 2 188 962 | 1 890 848 | 3 315 301 |
| Total | 2 188 962 | 1 890 848 | 3 315 301 |
| **Gegenpartei** | | | |
| *Name der Gegenpartei* | siehe Anmerkung 9 | siehe Anmerkung 9 | siehe Anmerkung 9 |
| Land des Sitzes der Gegenpartei | siehe Anmerkung 9 | siehe Anmerkung 9 | siehe Anmerkung 9 |
| Bruttovolumen ausstehender Transaktionen | siehe Anmerkung 9 | siehe Anmerkung 9 | siehe Anmerkung 9 |
| **Angaben zu den Sicherheiten** | | | |
| *Art der Sicherheiten:* | | | |
| Bargeldanlagen | - | - | - |
| Wertpapiere | siehe Anmerkung 9 | siehe Anmerkung 9 | siehe Anmerkung 9 |
| Qualität der Sicherheiten: | | | |
| Emittent | siehe Anmerkung 9 | siehe Anmerkung 9 | siehe Anmerkung 9 |
| Rating | - | - | - |
| **Laufzeit der Sicherheit aufgeschlüsselt folgenden Laufzeitbändern** | | | |
| Weniger als ein Tag | - | - | - |
| Ein Tag bis eine Woche | - | - | - |
| Eine Woche bis ein Monat | - | - | - |
| Ein bis drei Monate | - | - | - |
| Drei Monate bis ein Jahr | - | - | - |
| Mehr als ein Jahr | 256 037 | - | - |
| Offene Laufzeit | 2 927 182 | 2 064 541 | 3 578 864 |
| Total | 3 183 219 | 2 064 541 | 3 578 864 |
| **Verwahrung der vom Fonds im Rahmen von Wertpapierbeleihungen erhaltenen Sicherheit** | | | |
| Name der Depotstelle | siehe Anmerkung 9 | siehe Anmerkung 9 | siehe Anmerkung 9 |
| Wertpapiere | siehe Anmerkung 9 | siehe Anmerkung 9 | siehe Anmerkung 9 |
| Bargeldanlagen | - | - | - |
| Daten zu Erträgen und Kosten von Wertpapierleihgeschäften | siehe Anmerkung 9 | siehe Anmerkung 9 | siehe Anmerkung 9 |

* Der Anteil der gesamten beleihbaren Vermögenswerte bildet den Marktwert der beliehenen Wertpapiere / den Marktwert des Portfolios des Teilfonds ab.
Alle Transaktionen sind zweiseitige Transaktionen.
Sicherheiten für Wertpapierleihgeschäfte werden nicht wiederverwendet.

[1] Dieser Teilfonds wurde zum 19. Dezember 2019 aufgelegt.

## Sonstige Informationen (Fortsetzung)

| Teilfonds | Währung | Zehn größte Sicherheitsgeber der gesamten Wertpapierfinanzierungsgeschäfte und Total Return Swaps | Beträge der als Sicherheiten erhaltenen Wertpapiere und Rohstoffe Erhaltene |
|---|---|---|---|
| Swiss Life Funds (LUX) Bond Emerging Markets Corporates | USD | CRH PLC (GB) | 1 324 005 |
| | | ORANGE (FR) | 1 231 780 |
| | | BOUYGUES SA (FR) | 873 747 |
| | | VIVENDI SA (FR) | 654 068 |
| | | RENAULT SA (FR) | 445 782 |
| | | DAIMLER AG-REG SHARES (DE) | 275 376 |
| | | SAGE GROUP PLC (GB) | 265 839 |
| | | PEUGEOT SA (FR) | 154 469 |
| | | THALES SA (FR) | 29 698 |
| Swiss Life Fund (LUX) Bond Emerging Markets Corporates Short Term | USD | THALES SA (FR) | 4 016 328 |
| | | BOUYGUES SA (FR) | 341 863 |
| | | PEUGEOT SA (FR) | 184 258 |
| | | DANONE (FR) | 96 792 |
| | | ORANGE (FR) | 14 207 |
| Swiss Life Funds (LUX) Bond Inflation Protection | EUR | TOTAL SA (FR) | 1 161 910 |
| | | DANONE (FR) | 96 792 |
| | | BOUYGUES SA (FR) | 70 573 |
| | | ORANGE (FR) | 18 942 |
| Swiss Life Funds (LUX) Equity Euro Zone | EUR | DEUTSCH POST (DE) | 8 480 066 |
| | | VEOLIA ENVIRONNEMENT (FR) | 3 103 434 |
| | | CONTINENTAL AG (DE) | 2 090 836 |
| | | ORANGE (FR) | 1 702 044 |
| Swiss Life Funds (LUX) Equity Global | USD | ORANGE (FR) | 443 717 |
| | | LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON (FR) | 28 478 |
| | | BOUYGUES SA (FR) | 10 584 |
| | | TOTAL SA (FR) | 4 365 |
| Swiss Life Funds (LUX) Equity Global High Dividend | EUR | ADIDAS AG (DE) | 1 399 925 |
| | | INTEL CORP (US) | 147 935 |
| | | DANONE (FR) | 198 729 |
| Swiss Life Funds (LUX) Equity Global Long/Short | EUR | PUBLICIS GROUPE (FR) | 1 502 871 |
| | | ORANGE (FR) | 361 936 |
| | | SCHNEIDER ELECTRIC SE (DE) | 231 722 |
| Swiss Life Funds (Lux) Equity Global Minimum Volatility | USD | VEOLIA ENVIRONNEMENT(FR) | 1 203 313 |
| | | PUBLICIS GROUPE (FR) | 291 481 |
| Swiss Life Funds (LUX) Equity Global Protect | EUR | DEUT POST (DE) | 2 182 590 |
| | | TOTAL SA (FR) | 1 088 0264 |
| | | BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG (DE) | 948 4049 |
| | | ORANGE (FR) | 98 607 |
| Swiss Life Funds (LUX) Multi Asset Risk Premia | EUR | TOTAL SA (FR) | 570 003 |
| | | SANOFI (FR) | 518 789 |
| | | ORANGE (FR) | 147 923 |
| Swiss Life Funds (LUX) Prudent (EUR) | EUR | DEUT POST (DE) | 8 183 118 |
| | | ORANGE (FR) | 98 607 |
| Swiss Life Funds (LUX) Harmony (EUR) | EUR | POLYMETAL INTERNATIONAL PLC | 4 646 274 |
| | | ORANGE | 98 607 |
| Swiss Life Funds (LUX) Income Equity Euro Zone[1] | | DEUTSCHE TELEKOM AG-REG | 2 310 522 |
| | | HEIDELBERGCEMENT AG | 616 660 |
| | | HESSEN | 256 037 |
| Swiss Life Funds (LUX) Portfolio Global Growth (CHF) | CHF | SANOFI | 1 986 274 |
| | | VEOLIA ENVIRONNEMENT | 73 486 |
| | | SCHNEIDER ELECTRIC SE | 4 781 |
| Swiss Life Funds (LUX) Vitality (EUR) | EUR | POLYMETAL INTERNATIONAL PLC | 2 446 709 |
| | | ORANGE | 1 132 155 |

[1] Dieser Teilfonds wurde zum 19. Dezember 2019 aufgelegt.

# Sonstige Informationen (Fortsetzung)

## Total Return Swaps

Gemäß der Verordnung 2015/2365 des Europäischen Parlaments und des Rates vom 25. November 2015 über die Transparenz von Wertpapierfinanzierungsgeschäften finden Sie im Folgenden nähere Angaben zu den Total Return Swaps im am 29. Februar 2020 beendeten Zeitraum:

| | **Swiss Life Funds (LUX) Multi Asset Risk Premia** |
|---|---|
| **Total Return Swaps in absoluten Zahlen (in der Währung des Teilfonds)** | 1 520 801 |
| Anteil des verwalteten Vermögens | 0.63% |
| **Laufzeit der Total Return Swaps aufgeschlüsselt nach folgenden Laufzeitbändern** | |
| Weniger als ein Tag | - |
| Ein Tag bis eine Woche | - |
| Eine Woche bis ein Monat | - |
| Ein bis drei Monate | - |
| Drei Monate bis ein Zeitraum | - |
| Länger als ein Zeitraum | 1 520 801 |
| Offene Laufzeit | - |
| Total | 1 520 801 |
| **Gegenpartei** | |
| *Name der Gegenpartei* | siehe Anmerkung 10 |
| Land des Sitzes der Gegenpartei | siehe Anmerkung 10 |
| Bruttovolumen ausstehender Transaktionen | siehe Anmerkung 10 |
| **Angaben zu den Sicherheiten** | |
| *Art der Sicherheiten:* | |
| Bargeldanlagen | siehe Anmerkung 10 |
| Wertpapiere | - |
| Qualität der Sicherheiten: | - |
| Emittent | - |
| Rating | - |
| **Laufzeit der Sicherheit aufgeschlüsselt folgenden Laufzeitbändern** | |
| Weniger als ein Tag | - |
| Ein Tag bis eine Woche | - |
| Eine Woche bis ein Monat | - |
| Ein bis drei Monate | - |
| Drei Monate bis ein Zeitraum | - |
| Länger als ein Zeitraum | - |
| Offene Laufzeit | - |
| Total | - |
| **Verwahrung der vom Fonds im Rahmen von Total Return Swaps erhaltenen Sicherheit** | |
| Name der Depotstelle | Société Générale |
| Wertpapiere | - |
| Bargeldanlagen | siehe Anmerkung 10 |

Alle Transaktionen sind zweiseitige Transaktionen.

Entstandene Erträge und Kosten aus Transaktionen mit Total Return Swaps im Geschäftsjahr bis zum 29. Februar 2020 sind in der Bewertung der Swaps enthalten.