

# Swiss Life Index Funds (LUX)

Income (EUR)  
Balance (EUR)  
Dynamic (EUR)

Investmentfonds nach Luxemburger Recht  
Handelsregister Luxemburg B 78.728

## Geprüfter Jahresbericht zum 31. August 2015

Auf der Basis dieses Berichts sind keine Zeichnungen möglich. Zeichnungen sind nur gültig, wenn sie auf der Grundlage des aktuellen Verkaufsprospekts, des letzten verfügbaren Jahresberichts des Fonds und des aktuellsten Halbjahresberichts erfolgen, falls dieser nach dem letzten Jahresbericht veröffentlicht wurde.

### Vertriebsbeschränkungen:

Die Anteile dieses Fonds dürfen nicht innerhalb der USA angeboten, verkauft oder vertrieben werden.

Dieses Dokument kann auch in andere Sprachen übersetzt werden. Im Falle von Abweichungen zwischen der englischsprachigen Version und einer anderssprachigen Version hat die englischsprachige Version Vorrang, sofern das Recht eines Landes, in dem die Anteile verkauft werden, keine abweichende Regelung vorschreibt (und nur in diesem Umfang).

# **Swiss Life Index Funds (LUX)**

Investmentfonds nach Luxemburger Recht

## **Inhaltsverzeichnis**

	<b>Seite(n)</b>
Management und Verwaltung	1
Allgemeine Informationen zum Fonds	4
Informationen für die Anteilsinhaber	5
Bericht des Verwaltungsrats der Verwaltungsgesellschaft	6
Prüfungsbericht	8
Nettovermögensaufstellung zum 31. August 2015	10
Ertrags- und Aufwandsrechnung und Veränderungen des Nettovermögens für das Geschäftsjahr zum 31. August 2015	12
Statistische Informationen	16
Performance	17
Anmerkungen zum Abschluss zum 31. August 2015	18
<b>Swiss Life Index Funds (LUX) Income (EUR)</b>	
Wertpapierbestand zum 31. August 2015	26
Wirtschaftliche Klassifizierung der Anlagen	27
Geografische Klassifizierung der Anlagen	27
<b>Swiss Life Index Funds (LUX) Balance (EUR)</b>	
Wertpapierbestand zum 31. August 2015	28
Wirtschaftliche Klassifizierung der Anlagen	29
Geografische Klassifizierung der Anlagen	29
<b>Swiss Life Index Funds (LUX) Dynamic (EUR)</b>	
Wertpapierbestand zum 31. August 2015	30
Wirtschaftliche Klassifizierung der Anlagen	31
Geografische Klassifizierung der Anlagen	31

# Swiss Life Index Funds (LUX)

Investmentfonds nach Luxemburger Recht

## Management und Verwaltung

### Eingetragener Sitz

28-32, place de la Gare, L-1616 Luxemburg

### Verwaltungsgesellschaft

*Bis zum 17. Dezember 2014*

Swiss Life Funds (LUX) Management Company,

Eingetragene Adresse: 28-32, place de la Gare, L-1616 Luxemburg

Hauptsitz: c/o Carne Global Financial Services Luxembourg S.à r.l., European Bank and Business Centre, 6B route de Trèves, L-2633 Senningerberg

*Ab dem 17. Dezember 2014*

Swiss Life Fund Management (LUX) S.A.,

Eingetragene Adresse: 23, route d'Arlon, L-8009 Strassen

### Verwaltungsrat der Verwaltungsgesellschaft

*Bis zum 17. Dezember 2014*

Vorsitzender:

Marcel Finker

Mitglied des Executive Board, Swiss Life Asset Management Ltd,  
Zürich, Schweiz

Stellvertretender Vorsitzender:

Jean-Pierre Grimaud

Chief Executive Officer, Swiss Life Asset Management (France) SA,  
Levallois-Perret, Frankreich

Verwaltungsratsmitglieder:

Hermann Inglin

Chief Operating Officer, Swiss Life Investment Management  
Holding Ltd, Zürich, Schweiz

Dagmar Maroni

Verwaltungsratsmitglied, Swiss Life Asset Management AG,  
Zürich, Schweiz

Andreas Baschong

Verwaltungsratsmitglied, Swiss Life Asset Management AG,  
Zürich, Schweiz

Beat Hubacher

Delegate for Corporate Mandates, Swiss Life Group,  
Zürich, Schweiz

*Ab dem 17. Dezember 2014 bis zum 23. April 2015*

Verwaltungsratsmitglieder:

Jean-Pierre Grimaud

Chief Executive Officer, Swiss Life Asset Management (France) S.A.  
Levallois-Perret, Frankreich (Vorsitzender seit 11. Februar 2015)

Frédéric Bôl

Verwaltungsratsmitglied, Swiss Life Asset Management Ltd.,  
Marseille, Frankreich (Vorsitzender bis 11. Februar 2015)

Beat Reichen

Verwaltungsratsmitglied, Swiss Life Asset Management Ltd.,  
Strassen, Luxemburg

Beat Hubacher

Delegate for Corporate Mandates, Swiss Life Group,  
Zürich, Schweiz

Hermann Inglin

Chief Operating Officer, Swiss Life Investment Management  
Holding Ltd., Zürich, Schweiz

# **Swiss Life Index Funds (LUX)**

Investmentfonds nach Luxemburger Recht

## **Management und Verwaltung (Forts.)**

### **Verwaltungsrat der Verwaltungsgesellschaft (Forts.)**

*Ab dem 23. April 2015*

Vorsitzender:

Hermann Inglin

Chief Operating Officer, Swiss Life Investment Management Holding Ltd., Zürich, Schweiz

Verwaltungsratsmitglieder:

Frédéric Bôl

Verwaltungsratsmitglied, Swiss Life Asset Management Ltd., Marseille, Frankreich (Vorsitzender bis 11. Februar 2015)

Beat Reichen

Verwaltungsratsmitglied, Swiss Life Asset Management Ltd., Strassen, Luxemburg

Beat Hubacher

Delegate for Corporate Mandates, Swiss Life Group, Zürich, Schweiz

### **Geschäftsführer der Verwaltungsgesellschaft**

*Bis zum 17. Dezember 2014*

Tracey McDermott, General Manager, Director, Carne Global Financial Services Luxembourg S.à r.l.

Thomas Nummer, General Manager, Managing Director, Carne Global Financial Services Luxembourg S.à.r.l.

*Ab dem 17. Dezember 2014*

Dagmar Maroni, Swiss Life Asset Management Ltd., Zürich, Schweiz

Fabrice Lombardo, Swiss Life REIM (France), Paris, Frankreich

Vincent Charuel, Swiss Life Fund Management (LUX) S.A., Luxemburg

Kai Nemec, Swiss Life Fund Management (LUX) S.A., Luxemburg

Tracey McDermott, Carne Global Financial Services Luxembourg S.à r.l., Luxemburg

Thomas Nummer, Carne Global Financial Services Luxembourg S.à r.l., Luxemburg

### **Portfoliomanagement**

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

### **Depotbank und Zahlstelle**

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

### **Verwaltungs-, Vertretungs- und Domizilstelle**

Société Générale Bank & Trust (Betriebszentrum), 28-32, place de la Gare, L-1616 Luxemburg, Großherzogtum Luxemburg

### **Registerstelle**

*Bis zum 1. Juli 2015*

European Fund Services S.A., 28-32, place de la Gare, L-1616 Luxemburg, Großherzogtum Luxemburg

*Ab dem 1. Juli 2015*

Société Générale Bank & Trust (Betriebszentrum), 28-32, place de la Gare, L-1616 Luxemburg, Großherzogtum Luxemburg

## **Swiss Life Index Funds (LUX)**

Investmentfonds nach Luxemburger Recht

### **Management und Verwaltung (Forts.)**

#### **Abschlussprüfer**

PricewaterhouseCoopers, Société coopérative, 2, rue Gerhard Mercator, B.P. 1443, L-1014 Luxemburg, Großherzogtum Luxemburg

#### **Rechtsberater**

Arendt & Medernach S.A., Avocats à la Cour, 14, rue Erasme, L-2082 Luxemburg, Großherzogtum Luxemburg

#### **Verkauf in der Bundesrepublik Deutschland**

Zahlstelle

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

Informationsstelle

Swiss Life Invest GmbH- Berliner Straße 85, D-80805 München, Deutschland

#### **Verkauf in der Republik Österreich**

Zahlstelle

Erste Bank der österreichischen Sparkassen AG, Graben 21, A-1010 Wien, Österreich

# **Swiss Life Index Funds (LUX)**

Investmentfonds nach Luxemburger Recht

## **Allgemeine Informationen zum Fonds**

Swiss Life Index Funds (LUX) (der „Fonds“) wurde am 12. Juni 2008 nach Luxemburger Recht auf unbestimmte Zeit als „Fonds Commun de Placement“ (FCP) gegründet. Der Fonds unterliegt ab dem 1. Juli 2011 den Bestimmungen von Teil I des geänderten Luxemburger Gesetzes vom 17. Dezember 2010 über Organismen für gemeinsame Anlagen (das „Gesetz von 2010“) und wird von der Swiss Life Fund Management (LUX) S.A. (die „Verwaltungsgesellschaft“), einer gemäß Kapitel 15 des Gesetzes von 2010 organisierten Aktiengesellschaft, verwaltet.

Das Verwaltungsreglement des Fonds wurde beim Handelsregister Luxemburg eingereicht und am 15. Juli 2008 im „Recueil des Sociétés et Associations“ (das „Mémorial“) veröffentlicht.

Die Verwaltungsgesellschaft ist beim Handelsregister Luxemburg unter der Nummer B 78728 eingetragen.

Der Fonds wurde als Umbrellafonds gegründet und hat zum 31. August 2015 für jeden Teilfonds nur eine Anteilsklasse ausgegeben. Der Verwaltungsrat führt für jeden Teilfonds einen separaten Anlagenpool.

Die Vermögenswerte der Teilfonds werden in die in den Anlagezielen angegebenen Wertpapiere und Instrumente investiert, wobei die im Verkaufsprospekt dargelegten Anlagebeschränkungen berücksichtigt werden. Jeder Teilfonds verfolgt eine unabhängige Anlagepolitik.

Zum 31. August 2015 stehen den Anlegern drei Teilfonds zur Verfügung:

- Swiss Life Index Funds (LUX) Income (EUR)
- Swiss Life Index Funds (LUX) Balance (EUR)
- Swiss Life Index Funds (LUX) Dynamic (EUR)

Die Anteile jedes Teilfonds sind in zwei Klassen unterteilt: Anteile der Klasse R und Anteile der Klasse I.

Die Anteile der Klasse R und die Anteile der Klasse I unterscheiden sich in den Anlegerzielgruppen und dem Zeichnungssteuersatz.

- Anteile der Klasse R, die allen Anlegern offen stehen.
- Anteile der Klasse I, die institutionellen Anlegern im Sinne von Artikel 174 des geänderten Gesetzes von 2010 vorbehalten sind.

In beiden Klassen können Anteile entweder (i) Ausschüttungsanteile sein, die einen Anspruch auf eine jährliche Dividende begründen und die ihren NIW um einen der vorgenommenen Ausschüttung entsprechenden Betrag reduzieren („Ausschüttungsanteile“), oder (ii) Thesaurierungsanteile, die keinen Anspruch auf eine Dividende begründen und deren NIW sich am Dividendenzahltag nicht ändert, so dass sich der auf die Thesaurierungsanteile entfallende Prozentsatz des Gesamtnettoinventarwerts entsprechend erhöht („Thesaurierungsanteile“).

Derzeit werden nur Anteile der Klasse R ausgegeben.

## **Swiss Life Index Funds (LUX)**

Investmentfonds nach Luxemburger Recht

### **Informationen für die Anteilsinhaber**

Das Geschäftsjahr des Fonds beträgt zwölf Monate und endet am 31. August jedes Jahres. Der Jahresbericht, der den geprüften Abschluss des Fonds enthält, sowie der ungeprüfte Halbjahresbericht des Fonds und der Teilfonds stehen Anteilsinhabern für jedes Geschäftsjahr innerhalb von vier Monaten bzw. zwei Monaten ab dem Ende des jeweiligen Berichtszeitraums, auf den sie sich beziehen, zur Verfügung.

Das Geschäftsjahr läuft vom 1. September jedes Jahres bis zum 31. August des darauffolgenden Jahres.

Die Liste der Veränderungen des Portfolios ist am eingetragenen Sitz der Verwaltungsgesellschaft erhältlich.

# Swiss Life Index Funds (LUX)

Investmentfonds nach Luxemburger Recht

## Bericht des Verwaltungsrats der Verwaltungsgesellschaft

### Aktienmarktbericht

Erinnerung: Unsere Fokussierung auf die Performance des Finanzsektors im Vergleich zum gesamten Aktienmarkt liefert uns bedeutsame Informationen über die Gesundheit der Wirtschaft (jedenfalls nach den Erwartungen der Anleger).

Da die Bilanzen der Finanzinstitute meist eine Hebelung enthalten, zeigen sich die wirtschaftlichen Stärken und Schwächen im Finanzsektor verstärkt. Daher ist eine regelmäßige Überwachung dieses Sektors sehr aufschlussreich und liefert nützliche und effektive Informationen hinsichtlich der Entwicklung der Aktienmärkte.

Zeitraum vom 31.08.2014 bis 31.08.2015 (Quelle: MSCI Barra - Bloomberg). Im letzten Bericht stellten wir China und Portugal in Frage. Am Fall Chinas zeigt sich deutlich, wie wichtig es sein kann, den Finanzsektor zu beobachten. Im letzten Geschäftsjahr hatten wir geschrieben, dass aufgrund der mangelnden Leistung in diesem Sektor Strukturreformen in China erforderlich sind. Da diese Reformen nur zögerlich erfolgten und nicht die richtigen Probleme angegangen wurden, ist der Markt in China seit dem 30.04.2015 um 28,20 % zurückgegangen, was einige Fragen im Hinblick auf die allgemeine Entwicklung der weltweiten Aktienmärkte aufwirft. Weiterhin beobachten wir einen dramatischen Niedergang in Brasilien und Russland sowie eine Verschlechterung der Lage in Spanien.

Die Ungleichgewichte in diesen Ländern führten Ende August 2015 zu einem allgemeinen Abwärtstrend. Durch die Analyse der verschiedenen Finanzsektoren und ihrer relativen Performance im Vergleich zu den Aktienmärkten insgesamt werden wir den globalen Aktientrend verfolgen und von neuen Entwicklungen profitieren.

Land	Aktienindex	Finanzsektor
Brasilien	-52,54 %	-54,11 %
Südafrika	4,58 %	15,78 %
Russland	-27,55 %	-34,84 %
China	-9,06 %	1,47 %
Indien	1,15 %	5,32 %
USA	0,54 %	2,61 %
Europa	8,33 %	9,82 %
Großbritannien	-5,54 %	-2,03 %
Japan	21,94 %	24,17 %

Für die Region Europa haben wir für den Berichtszeitraum vom 31.08.2014 bis 31.08.2015 (Quelle: MSCI Barra – Bloomberg):

Land	Aktienindex	Finanzsektor
Frankreich	10,24 %	15,48 %
Spanien	1,41 %	-12,48 %
Italien	9,43 %	18,20 %
Portugal	-16,38 %	-38,98 %
Deutschland	9,66 %	14,57 %

### Anleihenmarktbericht

Die Anleihenmärkte verzeichneten in den Herbst- und Wintermonaten eine dramatische Rally. Infolge des von der Europäischen Zentralbank umgesetzten Programms zur quantitativen Lockerung, der schwachen Wirtschaftsbedingungen und der anhaltenden Deflationsgefahr erreichten die langfristigen europäischen Zinsen im April historische Tiefstände; die Renditen 10-jähriger deutscher Staatsanleihen fielen auf 0,08 %. Der Markttrend kehrte sich jedoch schnell wieder um. Zum Ende des Berichtszeitraums lagen die Renditen bei 0,80 %. Die Renditekurven folgten demselben Trend, angetrieben von der stabilen Entwicklung am langen Ende. Die Normalisierung der europäischen Randländer setzte sich fort, da sich die italienischen und spanischen

## **Swiss Life Index Funds (LUX)**

Investmentfonds nach Luxemburger Recht

### **Bericht des Verwaltungsrats der Verwaltungsgesellschaft (Forts.)**

Refinanzierungsbedingungen leicht verbesserten. Die Renditen der US-Staatsanleihen waren ebenfalls stabil, obwohl statistische Veröffentlichungen weiterhin eine Verbesserung sowohl bei der Wirtschaft als auch bei der Beschäftigung zeigten. Die Kreditmärkte zeigten allgemein eine stabile bis leicht verbesserte Entwicklung, unterstützt durch die entgegenkommende Politik der EZB. Die Bilanzzahlen und Aussichten der Unternehmen waren im Allgemeinen positiv, trotz der Lage in China und Ostasien, die zu der wirtschaftlichen Unsicherheit und Marktvolatilität ihren Teil beitrug.

#### **Swiss Life Index Funds (LUX) Income (EUR)**

Der Swiss Life Index Funds (LUX) Income (EUR) legte im Berichtszeitraum um 1,86 % zu (in EUR).

Fast während des gesamten Berichtszeitraums waren Aktien gegenüber Anleihen übergewichtet. Im Aktienteil waren US-amerikanische Aktien gegen Ende 2014 untergewichtet und in den ersten Monaten des Jahres 2015 übergewichtet. In den darauffolgenden Monaten nahm die Übergewichtung der Aktien in der Eurozone ebenfalls allmählich zu, da das QE-Programm der EZB eine deutliche Auswirkung hatte. Im Herbst und Winter 2014 trug der Einsatz von Minimalvolatilitätsindizes zu einem erheblichen Renditevorteil bei. Dieser Beitrag blieb in den ersten Monaten des Jahres 2015 allgemein neutral. Im Anleihenteil wurden überwiegend Staatsanleihen aus der Eurozone gehalten, während gegen Ende 2014 zunehmend Positionen mit reinen deutschen Staatsanleihen aufgebaut worden waren, um die Kreditrisiken der Länder am Rande der Eurozone zu vermeiden. Die Zinssensitivität wurde bis Mai 2015 überwiegend neutral gehalten und anschließend aufgrund von zunehmender Marktbesorgnis um Veränderungen der Zinssätze deutlich gesenkt.

#### **Swiss Life Index Funds (LUX) Balance (EUR)**

Der Swiss Life Index Funds (LUX) Balance (EUR) legte im Berichtszeitraum um 2,65 % zu (in EUR).

Fast während des gesamten Berichtszeitraums waren Aktien gegenüber Anleihen übergewichtet. Im Aktienteil waren US-amerikanische Aktien gegen Ende 2014 untergewichtet und in den ersten Monaten des Jahres 2015 übergewichtet. In den darauffolgenden Monaten nahm die Übergewichtung der Aktien in der Eurozone ebenfalls allmählich zu, da das QE-Programm der EZB eine deutliche Auswirkung hatte. Im Herbst und Winter 2014 trug der Einsatz von Minimalvolatilitätsindizes zu einem erheblichen Renditevorteil bei. Dieser Beitrag blieb in den ersten Monaten des Jahres 2015 allgemein neutral. Im Anleihenteil wurden überwiegend Staatsanleihen aus der Eurozone gehalten, während gegen Ende 2014 zunehmend Positionen mit reinen deutschen Staatsanleihen aufgebaut worden waren, um die Kreditrisiken der Länder am Rande der Eurozone zu vermeiden. Die Zinssensitivität wurde bis Mai 2015 überwiegend neutral gehalten und anschließend aufgrund von zunehmender Marktbesorgnis um Veränderungen der Zinssätze deutlich gesenkt.

#### **Swiss Life Index Funds (LUX) Dynamic (EUR)**

Der Swiss Life Index Funds (LUX) Dynamic (EUR) legte im Berichtszeitraum um 4,32 % zu (in EUR).

Fast während des gesamten Berichtszeitraums waren Aktien gegenüber Anleihen übergewichtet. Im Aktienteil waren US-amerikanische Aktien gegen Ende 2014 untergewichtet und in den ersten Monaten des Jahres 2015 übergewichtet. In den darauffolgenden Monaten nahm die Übergewichtung der Aktien in der Eurozone ebenfalls allmählich zu, da das QE-Programm der EZB eine deutliche Auswirkung hatte. Im Herbst und Winter 2014 trug der Einsatz von Minimalvolatilitätsindizes zu einem erheblichen Renditevorteil bei. Dieser Beitrag blieb in den ersten Monaten des Jahres 2015 allgemein neutral. Im Anleihenteil wurden überwiegend Staatsanleihen aus der Eurozone gehalten, während gegen Ende 2014 zunehmend Positionen mit reinen deutschen Staatsanleihen aufgebaut worden waren, um die Kreditrisiken der Länder am Rande der Eurozone zu vermeiden. Die Zinssensitivität wurde bis Mai 2015 überwiegend neutral gehalten und anschließend aufgrund von zunehmender Marktbesorgnis um Veränderungen der Zinssätze deutlich gesenkt.

Luxemburg, den 24. November 2015

Der Verwaltungsrat

Hinweis: Die in diesem Bericht aufgeführten Informationen beziehen sich auf die Vergangenheit und sind nicht repräsentativ für die künftige Wertentwicklung.



# pwc

## Prüfungsbericht

An die Anteilsinhaber des  
**Swiss Life Index Funds (LUX)**

Wir haben den beiliegenden Abschluss des Swiss Life Index Funds (LUX) und seiner einzelnen Teifonds geprüft, der sich aus der Vermögensaufstellung und dem Wertpapierbestand zum 31. August 2015 sowie der Ertrags- und Aufwandsrechnung und den Veränderungen des Nettovermögens im abgelaufenen Geschäftsjahr sowie einer Zusammenfassung der wesentlichen Rechnungslegungsmethoden und anderen erläuternden Anmerkungen zum Abschluss zusammensetzt.

### *Verantwortung des Verwaltungsrats der Verwaltungsgesellschaft in Bezug auf den Abschluss*

Der Verwaltungsrat der Verwaltungsgesellschaft ist für die Erstellung und eine den tatsächlichen Verhältnissen entsprechende Darstellung dieses Jahresabschlusses gemäß den in Luxemburg geltenden rechtlichen und aufsichtsrechtlichen Vorschriften in Bezug auf die Aufstellung von Jahresabschlüssen verantwortlich, ebenso wie für jene internen Kontrollen, die der Verwaltungsrat der Verwaltungsgesellschaft für notwendig erachtet, um die Erstellung von Abschlüssen zu ermöglichen, die frei von wesentlichen Fehldarstellungen infolge von Betrug oder Irrtum sind.

### *Verantwortung des „Réviseur d'entreprises agréé“*

Uns obliegt es, auf der Grundlage unserer Prüfung des vorliegenden Abschlusses ein Prüfungsurteil abzugeben. Wir haben diese Prüfung gemäß den internationalen Prüfungsstandards (International Standards on Auditing) in der Form durchgeführt, wie sie von der „Commission de Surveillance du Secteur Financier“ für Luxemburg verabschiedet wurden. Diese Standards verlangen, dass wir ethische Anforderungen einhalten und die Prüfung so planen und durchführen, dass wir angemessene Sicherheit dahingehend erlangen, dass der Abschluss frei von wesentlichen Fehldarstellungen ist.



Eine Abschlussprüfung besteht in der Durchführung von Verfahren zur Erlangung von Prüfungsnachweisen für die im Abschluss enthaltenen Zahlen und Angaben. Die Auswahl der Prüfungsverfahren, einschließlich der Bewertung des Risikos einer wesentlichen Fehldarstellung im Abschluss infolge von Betrug oder Irrtum, liegt im Ermessen des „Réviseur d'entreprises agréé“. Im Rahmen dieser Risikoeinschätzungen berücksichtigt der „Réviseur d'Entreprises agréé“ die für die Erstellung und die den tatsächlichen Verhältnissen entsprechende Darstellung des Abschlusses der Gesellschaft eingerichteten internen Kontrollen, um die unter diesen Umständen angemessenen Prüfungshandlungen festzulegen, nicht jedoch, um ein Urteil über die Wirksamkeit der internen Kontrolle der Gesellschaft abzugeben. Eine Abschlussprüfung umfasst auch die Beurteilung der Angemessenheit der angewandten Rechnungslegungsmethoden, der Plausibilität der vom Verwaltungsrat der Verwaltungsgesellschaft vorgenommenen rechnungslegungsbezogenen Schätzungen sowie die Beurteilung der Gesamtdarstellung des Abschlusses.

Wir sind der Auffassung, dass die von uns erlangten Prüfungsnachweise eine ausreichende und angemessene Grundlage für unser Prüfungsurteil bilden.

#### *Bestätigungsvermerk*

Unserer Auffassung nach vermittelt der Abschluss gemäß den Luxemburger gesetzlichen und aufsichtsrechtlichen Vorschriften über die Erstellung von Abschlüssen ein den Tatsachen entsprechendes Bild der Finanzlage des Swiss Life Index Funds (LLUX) und seiner einzelnen Teilfonds zum 31. August 2015 und ihrer Betriebsergebnisse sowie der Veränderungen ihres Nettovermögens für das zu diesem Datum abgelaufene Geschäftsjahr.

#### *Sonstige Angelegenheiten*

Die im Jahresbericht enthaltenen ergänzenden Angaben wurden von uns im Rahmen unseres Auftrags durchgesehen, waren aber nicht Gegenstand besonderer Prüfungshandlungen nach den oben beschriebenen Grundsätzen. Unser Prüfungsurteil bezieht sich daher nicht auf diese Angaben. Im Rahmen der Gesamtdarstellung des Abschlusses haben uns diese Angaben jedoch keinen Anlass zu Anmerkungen gegeben.

PricewaterhouseCoopers, Société coopérative  
Vertreten durch

Luxemburg, 24. November 2015

Marc Schernberg

# Swiss Life Index Funds (LUX)

Investmentfonds nach Luxemburger Recht

## Nettovermögensaufstellung zum 31. August 2015

(in der Währung des Teilfonds)

Teilfonds	Anm.	Swiss Life Index Funds (LUX)	Swiss Life Index Funds (LUX)	Swiss Life Index Funds (LUX)
		Income (EUR)	Balance (EUR)	Dynamic (EUR)
		EUR	EUR	EUR
<b>Vermögenswerte</b>				
Wertpapierportfolio zu Anschaffungskosten		124.718.100	43.911.280	20.685.668
Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust)		(123.751)	99.157	(345.994)
Wertpapierportfolio zum Marktwert	2.3	124.594.349	44.010.437	20.339.674
Bankguthaben	6	26.776.647	11.323.241	5.256.789
Forderungen aus der Ausgabe von Fondsanteilen		51.994	2.127	1.443
Forderungen aus dem Verkauf von Wertpapieren		1.694.309	829.229	669.330
Forderung aus Devisenkassageschäften	2.12	-	-	107.114
Dividendenforderungen, netto	2.9	32.789	18.573	13.015
Nicht realisierter Wertzuwachs aus Finanztermingeschäften	2.3, 5	<u>13.360</u>	<u>3.270</u>	<u>-</u>
		<b>153.163.448</b>	<b>56.186.877</b>	<b>26.387.365</b>
<b>Verbindlichkeiten</b>				
Verbindlichkeiten aus erworbenen Wertpapieren		586.030	1.090.138	623.965
Verbindlichkeiten aus Devisenkassageschäften	2.12	-	-	107.095
Fällige Managementgebühren	3	336.126	134.783	66.913
Fällige Depotbankgebühren		2.306	857	395
Fällige „Taxe d'abonnement“	4	9.195	3.569	1.773
Fällige Verwaltungsgebühren		15.134	12.297	12.307
Fällige Beratungs-, Prüfungs- und Rechtsanwaltshonorare		4.761	4.761	4.761
Nicht realisierte Wertminderung aus Finanztermingeschäften	2.3, 5	<u>2.057.563</u>	<u>1.120.979</u>	<u>609.940</u>
		<b><u>3.011.115</u></b>	<b><u>2.367.384</u></b>	<b><u>1.427.149</u></b>
<b>Gesamtnettovermögen</b>		<b><u>150.152.333</u></b>	<b><u>53.819.493</u></b>	<b><u>24.960.216</u></b>

Die Erläuterungen im Anhang sind ein wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# Swiss Life Index Funds (LUX)

Investmentfonds nach Luxemburger Recht

## Nettovermögensaufstellung zum 31. August 2015 (Forts.)

(in der Währung des Teilfonds)

Teilfonds	Gesamt	
	Anm.	EUR
<b>Vermögenswerte</b>		
Wertpapierportfolio zu Anschaffungskosten		189.315.048
Nicht realisierter Nettogewinn/(-verlust)		(370.588)
Wertpapierportfolio zum Marktwert	2.3	188.944.460
Bankguthaben	6	43.356.677
Forderungen aus der Ausgabe von Fondsanteilen		55.564
Forderungen aus dem Verkauf von Wertpapieren		3.192.868
Forderung aus Devisenkassageschäften	2.12	107.114
Dividendenforderungen, netto	2.9	64.377
Nicht realisierter Wertzuwachs aus Finanztermingeschäften	5	<u>16.630</u>
		<b>235.737.690</b>
<b>Verbindlichkeiten</b>		
Verbindlichkeiten aus erworbenen Wertpapieren		2.300.133
Verbindlichkeiten aus Devisenkassageschäften	2.12	107.095
Fällige Managementgebühren	3	537.822
Fällige Depotbankgebühren		3.558
Fällige „Taxe d'abonnement“	4	14.537
Fällige Verwaltungsgebühren		39.738
Fällige Beratungs-, Prüfungs- und Rechtsanwaltshonorare		14.283
Nicht realisierte Wertminderung aus Finanztermingeschäften	5	<u>3.788.482</u>
		<b>6.805.648</b>
<b>Gesamtnettovermögen</b>		<b><u>228.932.042</u></b>

Die Erläuterungen im Anhang sind ein wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# Swiss Life Index Funds (LUX)

Investmentfonds nach Luxemburger Recht

## Ertrags- und Aufwandsrechnung und Veränderungen des Nettovermögens für das Geschäftsjahr zum 31. August 2015

(in der Währung des Teilfonds)

Teilfonds		Swiss Life Index Funds (LUX) Income (EUR)	Swiss Life Index Funds (LUX) Balance (EUR)	Swiss Life Index Funds (LUX) Dynamic (EUR)
	Anm.	EUR	EUR	EUR
<b>Nettovermögen zu Beginn des Jahres</b>		<b>68.942.887</b>	<b>46.445.727</b>	<b>21.126.049</b>
<b>Erträge</b>				
Dividenden, netto	2.9	225.051	165.272	138.757
Bankzinsen	2.9	139	89	38
Erträge aus Wertpapierleihgeschäften	2.10, 9	44.462	20.722	12.657
Sonstige Erträge		<u>2.364</u>	<u>2.061</u>	<u>1.823</u>
		<b>272.016</b>	<b>188.144</b>	<b>153.275</b>
<b>Aufwendungen</b>				
Managementgebühren	3	1.425.947	752.619	371.000
Depotbankgebühren		24.251	16.811	15.064
„Taxe d'abonnement“	4	43.364	21.650	10.196
Verwaltungsgebühren		64.096	49.064	45.103
Gebühren der Registerstelle		21.279	9.743	8.447
Beratungs-, Prüfungs- und Rechtsanwaltshonorare		34.763	34.541	34.473
Zinsen und Bankgebühren		3.090	1.624	1.043
Transaktionskosten		16.968	9.712	7.094
Sonstige Aufwendungen		<u>-</u>	<u>9</u>	<u>8</u>
		<b>1.633.758</b>	<b>895.773</b>	<b>492.428</b>
<b>Nettoanlagegewinn/(-verlust)</b>		<b>(1.361.742)</b>	<b>(707.629)</b>	<b>(339.153)</b>

Die Erläuterungen im Anhang sind ein wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# Swiss Life Index Funds (LUX)

Investmentfonds nach Luxemburger Recht

## Ertrags- und Aufwandsrechnung und Veränderungen des Nettovermögens für das Geschäftsjahr zum 31. August 2015 (Forts.)

(in der Währung des Teifonds)

Teifonds		Gesamt
	Anm.	EUR
<b>Nettovermögen zu Beginn des Jahres</b>		<b>136.514.663</b>
<b>Erträge</b>		
Dividenden, netto	2.9	529.080
Bankzinsen	2.9	266
Erträge aus Wertpapierleihgeschäften	2.10, 9	77.841
Sonstige Erträge		<u>6.248</u>
		<b>613.435</b>
<b>Aufwendungen</b>		
Managementgebühren	3	2.549.566
Depotbankgebühren		56.126
„Taxe d'abonnement“	4	75.210
Verwaltungsgebühren		158.263
Gebühren der Registerstelle		39.469
Beratungs-, Prüfungs- und Rechtsanwaltshonorare		103.777
Zinsen und Bankgebühren		5.757
Transaktionskosten		33.774
Sonstige Aufwendungen		<u>17</u>
		<b>3.021.959</b>
<b>Nettoanlagegewinn/(-verlust)</b>		<b>(2.408.524)</b>

Die Erläuterungen im Anhang sind ein wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# Swiss Life Index Funds (LUX)

Investmentfonds nach Luxemburger Recht

## Ertrags- und Aufwandsrechnung und Veränderungen des Nettovermögens für das Geschäftsjahr zum 31. August 2015 (Forts.)

(in der Währung des Teilfonds)

Teilfonds		Swiss Life Index Funds (LUX) Income (EUR)	Swiss Life Index Funds (LUX) Balance (EUR)	Swiss Life Index Funds (LUX) Dynamic (EUR)
	Anm.	EUR	EUR	EUR
<b>Nettoanlagegewinn/(-verlust)</b>		<b>(1.361.742)</b>	<b>(707.629)</b>	<b>(339.153)</b>
<b>Realisierte Nettogewinne/(-verluste) aus</b>				
- verkauften Wertpapieren	2.5	4.441.881	4.834.601	2.715.500
- Devisen		(194.649)	96.346	5.594
- Devisentermingeschäften		3.709	2.752	1.794
- Futures		<u>(242.863)</u>	<u>315.161</u>	<u>192.758</u>
		<b>4.008.078</b>	<b>5.248.860</b>	<b>2.915.646</b>
<b>Realisiertes Nettoergebnis für das Geschäftsjahr</b>		<b>2.646.336</b>	<b>4.541.231</b>	<b>2.576.493</b>
<b>Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/ (-verlustes) aus</b>				
- Wertpapieren		(3.805.213)	(2.461.277)	(1.203.588)
- Futures		<u>(1.973.236)</u>	<u>(1.075.154)</u>	<u>(572.443)</u>
		<b>(5.778.449)</b>	<b>(3.536.431)</b>	<b>(1.776.031)</b>
		<b>(3.132.113)</b>	<b>1.004.800</b>	<b>800.462</b>
<b>BETRIEBSERGEBNIS</b>				
<b>Kapitalbewegungen</b>		90.308.140	9.552.348	3.396.469
Zeichnungen		<u>(5.966.581)</u>	<u>(3.183.382)</u>	<u>(362.764)</u>
Rücknahmen		<b>84.341.559</b>	<b>6.368.966</b>	<b>3.033.705</b>
		<b>150.152.333</b>	<b>53.819.493</b>	<b>24.960.216</b>
<b>Nettovermögen am Ende des Jahres</b>				

Die Erläuterungen im Anhang sind ein wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# Swiss Life Index Funds (LUX)

Investmentfonds nach Luxemburger Recht

## Ertrags- und Aufwandsrechnung und Veränderungen des Nettovermögens für das Geschäftsjahr zum 31. August 2015 (Forts.)

(in der Währung des Teilfonds)

Teilfonds		Gesamt
	Anm.	EUR
<b>Nettoanlagegewinn/(-verlust)</b>		<b>(2.408.524)</b>
<b>Realisierte Nettogewinne/(-verluste) aus</b>		
- verkauften Wertpapieren	2.5	11.991.982
- Devisen		(92.709)
- Devisentermingeschäften		8.255
- Futures		<u>265.056</u>
		<b>12.172.584</b>
<b>Realisiertes Nettoergebnis für das Geschäftsjahr</b>		<b>9.764.060</b>
<b>Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns/ (-verlustes) aus</b>		
- Wertpapieren		(7.470.078)
- Futures		<u>(3.620.833)</u>
		<b>(11.090.911)</b>
<b>BETRIEBSERGEBNIS</b>		<b>(1.326.851)</b>
<b>Kapitalbewegungen</b>		
Zeichnungen		103.256.957
Rücknahmen		<u>(9.512.727)</u>
		<b>93.744.230</b>
<b>Nettovermögen am Ende des Jahres</b>		<b>228.932.042</b>

Die Erläuterungen im Anhang sind ein wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# Swiss Life Index Funds (LUX)

Investmentfonds nach Luxemburger Recht

## Statistische Informationen

### Swiss Life Index Funds (LUX) Income (EUR)

	Geschäftsjahr zum:	31.08.15	31.08.14	31.08.13
Gesamtnettovermögen	EUR	150.152.333	68.942.887	25.183.032
<b>R-Anteile - Thesaurierung</b>				
Anzahl Anteile		1.025.528,356	479.683,355	197.751,470
Nettoinventarwert je Anteil	EUR	146,41	143,73	127,35

### Swiss Life Index Funds (LUX) Balance (EUR)

	Geschäftsjahr zum:	31.08.15	31.08.14	31.08.13
Gesamtnettovermögen	EUR	53.819.493	46.445.727	18.536.312
<b>R-Anteile - Thesaurierung</b>				
Anzahl Anteile		362.460,765	321.086,371	147.493,494
Nettoinventarwert je Anteil	EUR	148,48	144,65	125,68

### Swiss Life Index Funds (LUX) Dynamic (EUR)

	Geschäftsjahr zum:	31.08.15	31.08.14	31.08.13
Gesamtnettovermögen	EUR	24.960.216	21.126.049	7.662.459
<b>R-Anteile - Thesaurierung</b>				
Anzahl Anteile		163.713,664	144.555,342	61.195,792
Nettoinventarwert je Anteil	EUR	152,46	146,15	125,21

## Swiss Life Index Funds (LUX)

Investmentfonds nach Luxemburger Recht

### Performance

#### Swiss Life Index Funds (LUX) Income (EUR)

	Geschäftsjahr zum:	31.08.15	31.08.14	31.08.13
<b>R-Anteile - Thesaurierung<sup>1</sup></b>				
Performance	EUR	1,86 %	12,89 %	5,94 %

#### Swiss Life Index Funds (LUX) Balance (EUR)

	Geschäftsjahr zum:	31.08.15	31.08.14	31.08.13
<b>R-Anteile - Thesaurierung<sup>1</sup></b>				
Performance	EUR	2,65 %	15,13 %	7,58 %

#### Swiss Life Index Funds (LUX) Dynamic (EUR)

	Geschäftsjahr zum:	31.08.15	31.08.14	31.08.13
<b>R-Anteile - Thesaurierung<sup>1</sup></b>				
Performance	EUR	4,32 %	16,78 %	8,90 %

Die bisherige Performance lässt nicht auf die derzeitige oder zukünftige Wertentwicklung schließen.

Die Daten zur Performance enthalten keine Provisionen und Kosten, die bei der Zeichnung und Rücknahme von Anteilen berechnet werden.

Die Daten zur Performance wurden nicht geprüft.

<sup>1</sup>Der Teilfonds hat keinen Vergleichsindex. Daher kann die Performance des Teilfonds nicht mit einem Referenzindex verglichen werden.

# Swiss Life Index Funds (LUX)

Investmentfonds nach Luxemburger Recht

## Anmerkungen zum Abschluss zum 31. August 2015

### Anmerkung 1 - Geschäftstätigkeit

Swiss Life Index Funds (LUX) (der „Fonds“) wurde am 12. Juni 2008 nach Luxemburger Recht auf unbestimmte Zeit als „Fonds Commun de Placement“ (FCP) gegründet.

Das Hauptziel des Fonds ist das aktive Management verschiedener Portfolios zugunsten der Anteilsinhaber gemäß der jeweiligen Anlagestrategie jedes Teilfonds.

Der Fonds kann innerhalb der Grenzen des geänderten Gesetzes von 2010 in eine breite Palette von Wertpapieren investieren.

Der Verwaltungsrat der Verwaltungsgesellschaft bestimmt die Anlageziele und die Anlagepolitik für jeden Teilfonds, wie in den Datenblättern dargelegt, und er ist für die Umsetzung dieser Strategien verantwortlich.

Zum 31. August 2015 sind drei Teilfonds aktiv:

- Swiss Life Index Funds (LUX) Income (EUR)
- Swiss Life Index Funds (LUX) Balance (EUR)
- Swiss Life Index Funds (LUX) Dynamic (EUR)

Zum 31. August 2015 hat der Fonds die folgenden Anteilklassen in den folgenden Teilfonds ausgegeben:

- Swiss Life Index Funds (LUX) Income (EUR): R-Anteile
- Swiss Life Index Funds (LUX) Balance (EUR): R-Anteile
- Swiss Life Index Funds (LUX) Dynamic (EUR): R-Anteile

Das Ziel des Swiss Life Index Funds (LUX) Income (EUR) ist die Erwirtschaftung mittel- bis langfristiger optimaler Anlagerenditen auf der Grundlage einer Euro-Perspektive.

Dieser Teilfonds investiert nach Abzug der liquiden Anlagen mindestens zwei Drittel seines Nettovermögens über Anlagen in OGAW und/oder sonstige OGA (einschließlich unter anderem börsengehandelter Fonds (Exchange Traded Funds, „ETF“)) oder über Derivate in Aktien- und Anleihenindexprodukte, wobei internationale Diversifizierungsmöglichkeiten genutzt werden. Bis zu einem Drittel seines Nettovermögens können in Vermögenswerte investiert werden, die mit den dargelegten Bestimmungen konform sind. Die Anlagen des Teilfonds in anderen OGA dürfen in keinem Fall die im Verkaufsprospekt dargelegten Grenzen überschreiten.

Zusätzlich zu der vorstehenden Regel müssen mindestens 51 % des Nettovermögens des Portfolios des Teilfonds auf konsolidierter Basis direkt oder indirekt in Geldmarktinstrumente, Anleihen, Schuldverschreibungen oder ähnliche fest oder variabel verzinsliche Schuldinstrumente investiert werden.

Das Ziel des Swiss Life Index Funds (LUX) Balance (EUR) ist die Erwirtschaftung mittel- bis langfristiger optimaler Anlagerenditen auf der Grundlage einer Euro-Perspektive.

Dieser Teilfonds investiert nach Abzug der liquiden Anlagen mindestens zwei Drittel seines Nettovermögens über Anlagen in OGAW und/oder sonstige OGA (einschließlich unter anderem börsengehandelter Fonds (Exchange Traded Funds, „ETF“)) oder über Derivate in Aktien- und Anleihenindexprodukte, wobei internationale Diversifizierungsmöglichkeiten genutzt werden. Bis zu einem Drittel seines Nettovermögens können in andere Vermögenswerte investiert werden, die mit den dargelegten Bestimmungen konform sind. Die Anlagen des Teilfonds in anderen OGA dürfen in keinem Fall die im Verkaufsprospekt dargelegten Grenzen überschreiten.

Zusätzlich zu der vorstehenden Regel werden mindestens 30 % des Vermögens des Teilfonds auf konsolidierter Basis direkt oder indirekt in Anteile und andere Aktienwerte investiert. Mindestens 40 % des Vermögens des Teilfonds werden direkt oder indirekt in Geldmarktinstrumente, Anleihen, Schuldverschreibungen und ähnliche fest oder variabel verzinsliche Schuldinstrumente investiert.

Das Ziel des Swiss Life Index Funds (LUX) Dynamic (EUR) ist die Erwirtschaftung mittel- bis langfristiger optimaler Anlagerenditen auf der Grundlage einer Euro-Perspektive.

Dieser Teilfonds investiert nach Abzug der liquiden Anlagen mindestens zwei Drittel seines Nettovermögens über Anlagen in OGAW und/oder sonstige OGA (einschließlich unter anderem börsengehandelter Fonds (Exchange Traded Funds, „ETF“)) oder über Derivate in Aktien- und Anleihenindexprodukte, wobei internationale Diversifizierungsmöglichkeiten genutzt werden. Bis zu einem Drittel seines Nettovermögens können in andere Vermögenswerte investiert werden, die mit den dargelegten Bestimmungen konform sind. Die Anlagen des Teilfonds in anderen OGA dürfen in keinem Fall die im Verkaufsprospekt dargelegten Grenzen überschreiten.

# Swiss Life Index Funds (LUX)

Investmentfonds nach Luxemburger Recht

## Anmerkungen zum Abschluss zum 31. August 2015 (Forts.)

### Anmerkung 1 - Geschäftstätigkeit (Forts.)

Zusätzlich zu der vorstehenden Regel werden mindestens 51 % des Nettovermögens des Portfolios des Teilfonds auf konsolidierter Basis direkt oder indirekt in Anteile und andere Aktienwerte investiert.

### Anmerkung 2 - Wesentliche Rechnungslegungsmethoden

#### 2.1 Darstellung des Abschlusses

Der Abschluss wurde im Einklang mit den allgemein anerkannten Rechnungslegungsgrundsätzen für Investmentfonds in Luxemburg erstellt.

#### 2.2 Berechnung des Nettoinventarwerts

Der Nettoinventarwert (NIW) je Anteil wird zu jedem Bewertungstag im Einklang mit den nachstehend dargelegten Bewertungsregeln auf der Grundlage der Schlusskurse des vorhergehenden Geschäftstags bestimmt, indem das dem jeweiligen Teilfonds zurechenbare Nettovermögen, bei dem es sich um den Wert des diesem Teilfonds zurechenbaren Vermögensanteils abzüglich des diesem Teilfonds zurechenbaren Anteils an den Verbindlichkeiten handelt, durch die Anzahl der zu diesem Zeitpunkt umlaufenden Anteile geteilt wird. Der NIW je Anteil kann im Ermessen der Verwaltungsgesellschaft auf die nächste Einheit der jeweiligen Währung auf- oder abgerundet werden.

#### 2.3 Bewertungsgrundsätze

2.3.1 Wertpapiere, einschließlich Finanzinstrumente („Derivate“), die an einem geregelten Markt oder an einem sonstigen geregelten Markt notiert sind oder gehandelt werden, werden auf der Grundlage des letzten verfügbaren Schlusskurses des vorherigen Geschäftstags bewertet oder können zum Durchschnittskurs (Durchschnitt zwischen dem letzten verfügbaren Geldkurs und dem Briefkurs) der Wertpapiere auf dem entsprechenden Wertpapiermarkt, auf dem die Vermögenswerte des Fonds am Bewertungstag notiert waren oder gehandelt wurden, bewertet werden, es sei denn, dieser Preis ist nicht repräsentativ für den Marktwert der relevanten Vermögenswerte. Wenn das Wertpapier an mehreren geregelten Märkten notiert ist oder gehandelt wird, wird es auf der Grundlage des letzten verfügbaren Kurses auf dem jeweiligen Markt bewertet, der normalerweise der Hauptmarkt für diese Vermögenswerte ist.

2.3.2 Wenn die vom Fonds am Bewertungstag gehaltenen Vermögenswerte nicht an einem geregelten Markt oder einem sonstigen geregelten Markt notiert sind oder gehandelt werden oder wenn sie nicht börsennotiert sind oder falls bei börsennotierten oder an einem sonstigen geregelten Markt gehandelten Wertpapieren der ermittelte Wert nicht den angemessenen Marktwert wiedergibt, hat der Verwaltungsrat der Verwaltungsgesellschaft ihren Wert nach dem Vorsichtsprinzip sowie den Grundsätzen von Treu und Glauben anhand des voraussichtlichen Verkaufspreises zu ermitteln.

2.3.3 Geldmarktinstrumente werden über den Zeitraum vom Kauf bis zur Fälligkeit linear bewertet, und sonstige liquide Mittel werden zu ihrem Nennwert zuzüglich der aufgelaufenen Zinsen bewertet.

2.3.4 Anteile von offenen OGAW und/oder sonstigen OGA werden mit ihrem letzten bestimmten und verfügbaren Nettoinventarwert bewertet, oder wenn dieser Preis nicht dem Marktwert dieser Anlagen entspricht, dann hat der Verwaltungsrat der Verwaltungsgesellschaft den Preis auf faire und gerechte Weise zu ermitteln. Anteile von geschlossenen OGA werden mit ihrem letzten verfügbaren Börsenkurs bewertet.

2.3.5 Devisentermingeschäfte und Optionen werden konsequent mit den letzten verfügbaren Markt- oder Maklerpreisen bewertet. Wenn ein Bewertungstag ebenfalls das Glattstellungsdatum einer Option ist, werden die jeweiligen Optionen mit ihrem jeweiligen endgültigen Glattstellungspreis bewertet.

2.3.6 Der Liquidationswert von nicht an geregelten Märkten, Börsen in anderen Staaten oder sonstigen geregelten Märkten gehandelten Futures, Terminkontrakten oder Optionen ist ihr gemäß den vom Verwaltungsrat umsichtig und nach den Grundsätzen von Treu und Glauben beschlossenen Richtlinien auf einer für jede Art von Kontrakten gleichmäßig angewendeten Grundlage bestimmter Nettoliquidationswert. Der Liquidationswert von an geregelten Märkten, Börsen in anderen Staaten oder sonstigen geregelten Märkten gehandelten Futures, Termingeschäften oder Optionen basiert auf den zuletzt verfügbaren Abwicklungspreisen dieser Kontrakte an den geregelten Märkten, Börsen in anderen Staaten oder sonstigen geregelten Märkten, an denen die jeweiligen Futures, Termingeschäfte oder Optionen von der Gesellschaft gehandelt werden, wobei die Grundlage für die Bestimmung des Liquidationswerts des jeweiligen Kontrakts der vom Verwaltungsrat für angemessen erachtete Wert ist, falls ein Futures-, Termin- oder Optionskontrakt nicht an dem Tag abgewickelt werden kann, zu dem das Nettovermögen ermittelt wird.

# **Swiss Life Index Funds (LUX)**

Investmentfonds nach Luxemburger Recht

## **Anmerkungen zum Abschluss zum 31. August 2015 (Forts.)**

### **Anmerkung 2 - Wesentliche Rechnungslegungsmethoden (Forts.)**

#### **2.3 Bewertungsgrundsätze (Forts.)**

2.3.7 Finanzinstrumente („Derivate“), die nicht an einem geregelten Markt oder an einem sonstigen geregelten Markt notiert sind oder gehandelt werden, werden gemäß allgemein anerkannten Bewertungsregeln bewertet, die vom Abschlussprüfer geprüft werden können.

2.3.8 Alle sonstigen Wertpapiere und Anlagen werden mit ihrem angemessenen Marktwert bewertet, den der Verwaltungsrat der Verwaltungsgesellschaft nach dem Vorsichtsprinzip sowie den Grundsätzen von Treu und Glauben ermittelt.

#### **2.4 Bewertung von Devisentermingeschäften**

Der nicht realisierte Gewinn (Verlust) aus offenen Devisentermingeschäften wird auf der Grundlage der am Bewertungstag vorherrschenden Devisenterminkurse bewertet.

#### **2.5 Realisierter Nettogewinn (-verlust) aus Wertpapierverkäufen**

Die realisierten Gewinne oder Verluste aus dem Verkauf von Wertpapieren werden auf der Grundlage der Durchschnittskosten der verkauften Wertpapiere berechnet.

#### **2.6 Umrechnung von Fremdwährungen**

Bankkonten, sonstige Nettovermögenswerte und die Bewertung der Wertpapieranlagen in anderen Währungen als der Kontowährung der verschiedenen Teilfonds werden zu den mittleren Kassaschlusskursen am Bewertungstag umgerechnet. Auf andere Währungen als die Währung der verschiedenen Teilfonds lautende Erträge und Aufwendungen werden zu den mittleren Kassaschlusskursen am Zahlungstag umgerechnet. Devisengewinne oder -verluste werden in der Ertrags- und Aufwandsrechnung erfasst. Die Kosten von auf andere Währungen als die Kontowährung der verschiedenen Teilfonds lautenden Wertpapieren werden zu dem am Tag des Erwerbs vorherrschenden mittleren Kassaschlusskurs umgerechnet.

#### **2.7 Bilanzierung von Wertpapierportfoliotransaktionen**

Die Wertpapierportfoliotransaktionen werden an dem auf die Transaktionsdaten folgenden Bankgeschäftstag erfasst.

#### **2.8 Forderungen aus Wertpapierverkäufen, Verbindlichkeiten aus Wertpapierkäufen**

Das Konto „Forderungen aus Wertpapierverkäufen“ kann auch Forderungen aus Devisengeschäften enthalten. Das Konto „Verbindlichkeiten aus Wertpapierkäufen“ kann auch Verbindlichkeiten aus Devisengeschäften enthalten.

#### **2.9 Ertragserfassung**

Dividenden abzüglich Quellensteuern werden an dem Tag erfolgswirksam erfasst, an dem die jeweiligen Wertpapiere erstmals als „Ex-Dividende“ geführt werden. Zinserträge werden täglich verbucht.

#### **2.10 Wertpapierleihgeschäfte**

Der Fonds kann Wertpapierleihgeschäfte abschließen, sofern diese mit dem CSSF-Rundschreiben 08/356 über die für Organismen für gemeinsame Anlagen geltenden Regeln, wenn bestimmte Techniken und Instrumente in Bezug auf übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente eingesetzt werden (das „Rundschreiben 08/356“), konform sind:

Der Fonds darf nur direkt oder über von anerkannten Clearingeinrichtungen organisierte standardisierte Systeme oder über von Finanzinstituten organisierte Leihsysteme, die aufsichtsrechtlichen Bestimmungen unterliegen, die nach Ansicht der CSSF mit denen des Gemeinschaftsrechts gleichwertig sind, und die auf diese Art von Geschäften spezialisiert sind, Wertpapiere aus- oder verleihen.

Der Fonds muss bei Leihgeschäften Sicherheiten erhalten, deren Wert über die Laufzeit der Vereinbarung jederzeit mindestens 90 % der Gesamtbewertung der verliehenen Wertpapiere entsprechen muss.

# Swiss Life Index Funds (LUX)

Investmentfonds nach Luxemburger Recht

## Anmerkungen zum Abschluss zum 31. August 2015 (Forts.)

### Anmerkung 2 - Wesentliche Rechnungslegungsmethoden (Forts.)

#### 2.11 Pensionsgeschäfte

Der Fonds kann Pensionsgeschäfte abschließen. Dabei handelt es sich um den Kauf und Verkauf von Wertpapieren mit einer Klausel, die dem Verkäufer das Recht vorbehält oder die Verpflichtung auferlegt, die verkauften Wertpapiere zu einem von den beiden Parteien in ihrem vertraglichen Arrangement bestimmten Preis und Zeitpunkt vom Käufer zurückzukaufen.

Der Fonds kann als Käufer oder Verkäufer an Pensionsgeschäften oder an einer Reihe anhaltender Pensionsgeschäfte beteiligt sein.

#### 2.12 Forderungen und Verbindlichkeiten aus Devisenkassageschäften

Interne Übertragungen zwischen Barkonten in ausländischen Währungen mit einer Laufzeit von weniger als drei Tagen sind in der Nettovermögensaufstellung unter den Überschriften „Forderung aus Devisenkassageschäften“ und „Verbindlichkeiten aus Devisenkassageschäften“ aufgeführt.

### Anmerkung 3 - Managementgebühren und Anlageverwaltungsgebühren

Der Portfoliomanager und/oder die eventuell von der Verwaltungsgesellschaft bestellten Vertriebsstellen haben für die von ihnen erbrachten Leistungen und/oder Swiss Life Asset Management AG hat für die von ihr im Rahmen der Vereinbarung über die Erbringung von Unterstützungsleistungen erbrachten Leistungen Anspruch auf die nachstehend aufgeführte Managementgebühr:

Die Managementgebühr ist vierteljährlich nachschüssig zahlbar und wird auf der Grundlage des an jedem Bewertungstag bestimmten NIW des Teifonds als Prozentsatz des NIW berechnet.

Teifonds	Jährliche Managementgebühr
Income (EUR) R	höchstens 1,75 % effektiv 1,30 %
Balance (EUR) R	höchstens 1,75 % effektiv 1,40 %
Dynamic (EUR) R	höchstens 1,75 % effektiv 1,50 %

### Anmerkung 4 - Besteuerung

Nach geltendem Recht unterliegt der Fonds im Allgemeinen in Luxemburg der „taxe d'abonnement“ von 0,05 %. Der Satz für institutionelle Teifonds oder Klassen beträgt jedoch 0,01 % pro Jahr. Derzeit, und sofern der Verkaufsprospekt für einen bestimmten Teifonds keine abweichenden Angaben enthält, unterliegen alle Teifonds des Fonds der „taxe d'abonnement“ von 0,01 %, die vierteljährlich auf der Grundlage des Nettovermögens des jeweiligen Teifonds berechnet wird und am Ende des jeweiligen Quartals zu zahlen ist. Diese Steuer wird vierteljährlich auf der Grundlage des Nettovermögens des jeweiligen Teifonds berechnet und ist am Ende des jeweiligen Quartals zu zahlen.

**Anteile der Klasse „R“**, die allen Anlegern offen steht. Die Anteile der Klasse „R“ unterliegen einer „taxe d'abonnement“ mit einem jährlichen Satz von 0,05 % des Nettovermögens.

Die vom Fonds mit ausländischen Anlagen erzielten Erträge, die eventuell im Herkunftsland Quellensteuern unterliegen, werden vom Fonds nach Abzug der jeweiligen Steuern vereinnahmt. Quellensteuern sind nicht erstattbar.

# Swiss Life Index Funds (LUX)

Investmentfonds nach Luxemburger Recht

## Anmerkungen zum Abschluss zum 31. August 2015 (Forts.)

### Anmerkung 5 - Futures

Zum 31. August 2015 hatten die Teilfonds die nachstehend aufgeführten Futures:

Einzelheiten zu den Sicherheiten entnehmen Sie bitte der Anmerkung 6.

Alle Futures werden mit dem Broker Newedge durchgeführt.

## Swiss Life Index Funds (LUX) Income (EUR)

Art der Basiswerte	Währungs-kontrakt	Einzelheiten	Markt	Laufzeit	Anzahl der gekauften Kontrakte	Anzahl der verkauften Kontrakte	Verpflichtung EUR	Nicht realisierter Gewinn/ (Verlust) EUR
Zinssatz	EUR	EURO BOBL	EUREX-DEUTSCHLAND	15. Sept	139	-	18.074.170	13.360
Zinssatz	EUR	EURO SCHATZ	EUREX-DEUTSCHLAND	15. Sept	44	-	4.895.220	(400)
Index	EUR	CAC 40	EURONEXT PARIS MONEP	15. Sept	66	-	3.070.320	(136.905)
Index	EUR	DAX INDEX	EUREX-DEUTSCHLAND	15. Sept	16	-	4.098.800	(292.713)
Index	EUR	EURO STOXX 50	EUREX-DEUTSCHLAND	15. Sept	54	-	1.765.260	(103.150)
Index	GBP	FOOTSIE 100	EURONEXT LIFFE	15. Sept	31	-	2.645.350	(187.612)
Index	JPY	NIKKEI 225 OSE	TOKYO STOCK EXCHANGE	15. Sept	65	-	9.018.483	(797.774)
			CHICAGO MERCANTILE EXCHANGE					
Index	USD	S&P 500 EMINI	MONTRÉAL STOCK EXCHANGE	15. Sept	81	-	7.117.771	(396.218)
Index	CAD	S&P/TSE 60 IX FUT		15. Sept	31	-	3.385.599	(142.791)
								<b>54.070.973 (2.044.203)</b>

## Swiss Life Index Funds (LUX) Balance (EUR)

Art der Basiswerte	Währungs-kontrakt	Einzelheiten	Markt	Laufzeit	Anzahl der gekauften Kontrakte	Anzahl der verkauften Kontrakte	Verpflichtung EUR	Nicht realisierter Gewinn/ (Verlust) EUR
Zinssatz	EUR	EURO BOBL	EUREX-DEUTSCHLAND	15. Sept	26	-	3.380.780	3.270
Zinssatz	EUR	EURO SCHATZ	EUREX-DEUTSCHLAND	15. Sept	8	-	890.040	(335)
Index	EUR	CAC 40	EURONEXT PARIS MONEP	15. Sept	38	-	1.767.760	(68.280)
Index	EUR	DAX INDEX	EUREX-DEUTSCHLAND	15. Sept	9	-	2.305.575	(142.563)
Index	EUR	EURO STOXX 50	EUREX-DEUTSCHLAND	15. Sept	28	-	915.320	(57.770)
Index	GBP	FOOTSIE 100	EURONEXT LIFFE	15. Sept	10	-	853.339	(57.409)
Index	JPY	NIKKEI 225 OSE	TOKYO STOCK EXCHANGE	15. Sept	38	-	5.272.344	(429.699)
			CHICAGO MERCANTILE EXCHANGE					
Index	USD	S&P 500 EMINI	MONTRÉAL STOCK EXCHANGE	15. Sept	60	-	5.272.423	(288.108)
Index	CAD	S&P/TSE 60 IX FUT		15. Sept	19	-	2.075.044	(76.815)
								<b>22.732.625 (1.117.709)</b>

## Swiss Life Index Funds (LUX)

Investmentfonds nach Luxemburger Recht

### Anmerkungen zum Abschluss zum 31. August 2015 (Forts.)

#### Anmerkung 5 - Futures (Forts.)

### Swiss Life Index Funds (LUX) Dynamic (EUR)

Art der Basiswerte	Währungs- kontrakt	Einzelheiten	Markt	Laufzeit	Anzahl der gekauften Kontrakte	Anzahl der verkauften Kontrakte	Verpflichtung EUR	Nicht realisierter Gewinn/ (Verlust) EUR
Zinssatz	EUR	EURO BOBL	EUREX-DEUTSCHLAND	15. Sept	5	-	650.150	(1.170)
Zinssatz	EUR	EURO BUND	EUREX-DEUTSCHLAND	15. Sept	2	-	306.180	(4.240)
Index	EUR	CAC 40	EURONEXT PARIS MONEP	15. Sept	25	-	1.163.000	(48.375)
Index	EUR	DAX INDEX	EUREX-DEUTSCHLAND	15. Sept	6	-	1.537.050	(87.413)
Index	EUR	EURO STOXX 50	EUREX-DEUTSCHLAND	15. Sept	18	-	588.420	(35.380)
Index	JPY	NIKKEI 225 OSE	TOKYO STOCK EXCHANGE	15. Sept	25	-	3.468.647	(288.303)
Index	USD	S&P 500 EMINI	CHICAGO MERCANTILE EXCHANGE	15. Sept	19	-	1.669.601	(89.212)
Index	CAD	S&P/TSE 60 IX FUT	MONTREAL STOCK EXCHANGE	15. Sept	12	-	1.310.554	(55.847)
							<b>10.693.602</b>	<b>(609.940)</b>

#### Anmerkung 6 - Marginkonten

Marginkonten sind beim Broker gehaltene nicht verfügbare Barmittel. Marginkonten werden in der Nettovermögensaufstellung unter der Überschrift „Bankguthaben“ geführt.

Zum 31. August 2015 sind die Einschusseinzahlungen für Futures-Derivate wie folgt:

Teilfonds	Währung des Teilfonds	Kontrahent	Art der Sicherheit	Betrag (in der Währung des Teilfonds)
Swiss Life Index Funds (LUX) Income (EUR)	EUR	Newedge	Barmittel	6.983.447
Swiss Life Index Funds (LUX) Balance (EUR)	EUR	Newedge	Barmittel	3.418.327
Swiss Life Index Funds (LUX) Dynamic (EUR)	EUR	Newedge	Barmittel	2.246.436

#### Anmerkung 7 - Management des Gesamtrisikos

In Bezug auf das Risikomanagement hat der Verwaltungsrat der Verwaltungsgesellschaft zur Bestimmung des Gesamtrisikos den Commitment-Ansatz gewählt.

#### Anmerkung 8 - Wechselkurse

Zum 31. August 2015 wurden die folgenden Wechselkurse verwendet:

1 EUR = 1,49085	CAD	1 EUR = 0,72855	GBP
1 EUR = 135,7878	JPY	1 EUR = 1,1205	USD

# Swiss Life Index Funds (LUX)

Investmentfonds nach Luxemburger Recht

## Anmerkungen zum Abschluss zum 31. August 2015 (Forts.)

### Anmerkung 9 - Wertpapierleihe

Der Fonds kann Wertpapierleihgeschäfte abschließen, sofern die folgenden Regeln eingehalten werden:

- Der Fonds darf nur direkt oder über von anerkannten Clearingeinrichtungen oder von auf diese Art von Geschäften spezialisierten Finanzinstituten organisierte standardisierte Leihsysteme, die aufsichtsrechtlichen Bestimmungen unterliegen, die nach Ansicht der Aufsichtsbehörde mit denen des Gemeinschaftsrechts gleichwertig sind, Wertpapiere aus- oder verleihen.
- Der Fonds muss bei Leihgeschäften grundsätzlich Sicherheiten erhalten, deren Wert über die Laufzeit der Vereinbarung durchgehend mindestens 90 % des Werts der verliehenen Wertpapiere entsprechen muss.

Zum 31. August 2015 sind alle Wertpapierleihgeschäfte mit an einer EU-Börse notierten Aktien besichert.

Der Marktwert der verliehenen Wertpapiere war wie folgt:

Teilfonds	Marktwert der verliehenen Wertpapiere (EUR)
Swiss Life Index Funds (LUX) Income (EUR)	7.338.725
Swiss Life Index Funds (LUX) Balance (EUR)	2.523.882
Swiss Life Index Funds (LUX) Dynamic (EUR)	1.029.867

Der Betrag unbarer Sicherheiten für das Aktienleihprogramm ist wie folgt:

Teilfonds	Währung des Teilfonds	Kontrahent	Art der Sicherheit	Betrag der erhaltenen Sicherheit (in der Währung des Teilfonds)
Swiss Life Index Funds (LUX) Income (EUR)	EUR	Société Générale	Wertpapiere	8.183.971
Swiss Life Index Funds (LUX) Balance (EUR)	EUR	Société Générale	Wertpapiere	3.476.048
Swiss Life Index Funds (LUX) Dynamic (EUR)	EUR	Société Générale	Wertpapiere	3.539.652

Für das Geschäftsjahr zum 31. August 2015 sind die vom Fonds generierten Erträge aus der Wertpapierleihe wie folgt:

Teilfonds	Bruttogesamtsumme der Erträge aus Wertpapierleihgeschäften (Teilfonds-Währung)	Direkte und indirekte Kosten und Gebühren, vom Bruttoertrag der Wertpapierleihgeschäfte abgezogen (Teilfonds-Währung)	Nettогesamtsumme der Erträge aus Wertpapierleihgeschäften (Teilfonds-Währung)
Swiss Life Index Funds (LUX) Income (EUR)	52.308	7.846	44.462
Swiss Life Index Funds (LUX) Balance (EUR)	24.379	3.657	20.722
Swiss Life Index Funds (LUX) Dynamic (EUR)	14.891	2.234	12.657

# Swiss Life Index Funds (LUX)

Investmentfonds nach Luxemburger Recht

## Anmerkungen zum Abschluss zum 31. August 2015 (Forts.)

### Anmerkung 9 - Wertpapierleihe (Forts.)

Die Differenz zwischen dem Netto- und dem Bruttobetrag erklärt sich aus der nachfolgend angegebenen Gewinnverteilung:

85 % für den Teifonds;

15 % für Société Générale.

### Anmerkung 10 - Managementgebühren für zugrunde liegende Investmentfonds

Die von zugrunde liegenden Investmentfonds im Berichtszeitraum zum 31. August 2015 berechneten Managementgebühren sind wie folgt:

ISHARES EB.REXX GOVERNMENT GERMANY 5.5-10.5 UCITS ETF DE	0,16 %
BNP PARIBAS ASSET MANAGEMENT - BNP PARIBAS MONEY 3M - I	0,25 %
LYXOR ETF FTSE MIB - EUR	0,35 %
LYXOR ETF EUROMTS GLOBAL	0,17 %
SWISS LIFE ASSET MANAGEMENT SWISS LIFE FUND F MONEY MARKET EURO - I	0,20 %
AMUNDI ETF GOVT BOND EUROMTS BROAD INVESTMENT GRADE UCITS ETF C - C	0,14 %
AMUNDI ETF EUROMTS CASH 3 MONTHS	0,14 %
AMUNDI 3-6 M IC	0,15 %
ISHARES AEX UCITS ETF	0,30 %
ISHARES MSCI EMERGING MARKETS - IE	0,75 %
VANGUARD S&P 500 UCITS ETF	0,07 %
DB X-TRACKERS II - IBOXX SOVEREIGNS EUROZONE TOTAL RETURN INDEX ETF - 1C	0,05 %
DB X-TRACKERS II - IBOXX EUR SOVEREIGNS EUROZONE 1-3 TOTAL RETURN INDEX ETF - 1C	0,05 %
DB X-TRACKERS II - IBOXX SOVEREIGNS EUROZONE 5-7 TOTAL RETURN INDEX ETF - 1C	0,05 %
LOMBARD ODIER SHORT-TERM MONEY MARKET (USD) - IC	0,16 %
DB X-TRACKERS IBEX 35® INDEX ETF 1C	0,10 %
SOURCE MKTS S&P 500 SOURCE ETF USD A	0,05 %
VANGUARD FTSE 100 UCITS ETF - D	0,09 %

# Swiss Life Index Funds (LUX)

Investmentfonds nach Luxemburger Recht

## Swiss Life Index Funds (LUX) Income (EUR)

### Wertpapierbestand zum 31. August 2015

(in EUR)

Nenn- wert/ Menge	Bezeichnung	Notierungs- währung	Anschaffungs- kosten EUR	% des Marktwert Nettovermögens	
				EUR	%
<b>Investmentfonds</b>					
86.000	AMUNDI ETF EUROMTS CASH 3 MONTHS	EUR	10.396.392	10.381.920	6,91
80.200	AMUNDI ETF GOVT BOND EUROMTS BROAD INVESTMENT GRADE UCITS ETF C - C	EUR	17.141.285	17.533.324	11,68
44	AMUNDI 3-6 M IC	EUR	4.500.036	4.501.978	3,00
352	BNP PARIBAS ASSET MANAGEMENT - BNP PARIBAS MONEY 3M - I	EUR	8.181.481	8.193.318	5,46
23.543	DB X-TRACKERS IBEX 35® INDEX ETF 1C	EUR	570.623	517.711	0,34
101.310	DB X-TRACKERS II - IBOXX SOVEREIGNS EUROZONE TOTAL RETURN INDEX ETF - 1C	EUR	21.453.424	22.222.349	14,81
74.100	DB X-TRACKERS II - IBOXX SOVEREIGNS EUROZONE 5-7 TOTAL RETURN INDEX ETF - 1C	EUR	16.682.321	16.665.831	11,10
2.500	DB X-TRACKERS II - IBOXX EUR SOVEREIGNS EUROZONE 1-3 TOTAL RETURN INDEX ETF - 1C	EUR	422.209	423.000	0,28
46.402	ISHARES AEX UCITS ETF	EUR	2.289.175	2.069.993	1,38
19.060	ISHARES EB.REXX GOVERNMENT GERMANY 5.5-10.5 UCITS ETF DE	EUR	2.731.301	2.655.439	1,77
36.251	ISHARES MSCI EMERGING MARKETS - IE	USD	1.293.950	1.028.205	0,68
520.867,64	LOMBARD ODIER SHORT-TERM MONEY MARKET (USD) - IC	USD	4.932.910	4.847.160	3,23
75.492	LYXOR ETF EUROMTS GLOBAL	EUR	12.462.128	12.785.325	8,51
47.100	LYXOR ETF FTSE MIB - EUR	EUR	1.110.800	1.022.051	0,68
170	SWISS LIFE ASSET MANAGEMENT SWISS LIFE FUND F MONEY MARKET EURO - I	EUR	4.235.504	4.264.503	2,84
460.069	VANGUARD S&P 500 UCITS ETF	EUR	16.314.561	15.482.242	10,31
<b>Summe Investmentfonds</b>			<b>124.718.100</b>	<b>124.594.349</b>	<b>82,98</b>
<b>Summe Anlagen</b>			<b>124.718.100</b>	<b>124.594.349</b>	<b>82,98</b>

Die Erläuterungen im Anhang sind ein wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

## **Swiss Life Index Funds (LUX)**

Investmentfonds nach Luxemburger Recht

### **Swiss Life Index Funds (LUX) Income (EUR)**

#### **Wirtschaftliche Klassifizierung der Anlagen**

(in Prozent des Nettovermögens zum 31. August 2015)

%

Investmentfonds

82,98

**82,98**

#### **Geografische Klassifizierung der Anlagen**

(in Prozent des Nettovermögens zum 31. August 2015)

%

Frankreich

39,09

Luxemburg

29,75

Irland

12,37

Deutschland

1,77

**82,98**

# Swiss Life Index Funds (LUX)

Investmentfonds nach Luxemburger Recht

## Swiss Life Index Funds (LUX) Balance (EUR)

### Wertpapierbestand zum 31. August 2015

(in EUR)

Nenn- wert/ Menge	Bezeichnung	Notierungs- währung	Anschaffungs- kosten EUR	% des Marktwert Nettovermögens	
				EUR	%
<b>Investmentfonds</b>					
24.300	AMUNDI ETF EUROMTS CASH 3 MONTHS	EUR	2.936.548	2.933.496	5,45
33.180	AMUNDI ETF GOVT BOND EUROMTS BROAD INVESTMENT GRADE UCITS ETF C - C	EUR	6.900.127	7.253.812	13,48
28	AMUNDI 3-6 M IC	EUR	2.863.800	2.864.895	5,32
74	BNP PARIBAS ASSET MANAGEMENT - BNP PARIBAS MONEY 3M - I	EUR	1.720.282	1.722.459	3,20
14.050	DB X-TRACKERS IBEX 35® INDEX ETF 1C	EUR	340.625	308.960	0,57
26.700	DB X-TRACKERS II - IBOXX SOVEREIGNS EUROZONE TOTAL RETURN INDEX ETF - 1C	EUR	5.338.850	5.856.645	10,88
18.940	DB X-TRACKERS II - IBOXX SOVEREIGNS EUROZONE 5-7 TOTAL RETURN INDEX ETF - 1C	EUR	4.268.639	4.259.795	7,91
3.400	DB X-TRACKERS II - IBOXX EUR SOVEREIGNS EUROZONE 1-3 TOTAL RETURN INDEX ETF - 1C	EUR	574.374	575.280	1,07
27.260	ISHARES AEX UCITS ETF	EUR	1.332.775	1.216.069	2,26
21.477	ISHARES MSCI EMERGING MARKETS - IE	USD	751.070	609.163	1,13
470.000	LOMBARD ODIER SHORT-TERM MONEY MARKET (USD) - IC	USD	4.524.027	4.373.789	8,13
1.725	LYXOR ETF EUROMTS GLOBAL	EUR	271.180	292.146	0,54
27.783	LYXOR ETF FTSE MIB - EUR	EUR	655.647	602.880	1,12
2.800	SOURCE MKTS S&P 500 SOURCE ETF USD A	USD	891.253	839.750	1,56
85	SWISS LIFE ASSET MANAGEMENT SWISS LIFE FUND F MONEY MARKET EURO - I	EUR	2.122.676	2.132.251	3,96
18.200	VANGUARD FTSE 100 UCITS ETF - D	GBP	768.361	706.716	1,31
221.750	VANGUARD S&P 500 UCITS ETF	EUR	7.651.046	7.462.331	13,88
<b>Summe Investmentfonds</b>			<b>43.911.280</b>	<b>44.010.437</b>	<b>81,77</b>
<b>Summe Anlagen</b>			<b>43.911.280</b>	<b>44.010.437</b>	<b>81,77</b>

Die Erläuterungen im Anhang sind ein wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

## **Swiss Life Index Funds (LUX)**

Investmentfonds nach Luxemburger Recht

### **Swiss Life Index Funds (LUX) Balance (EUR)**

#### **Wirtschaftliche Klassifizierung der Anlagen**

(in Prozent des Nettovermögens zum 31. August 2015)

%

Investmentfonds

81,77

**81,77**

#### **Geografische Klassifizierung der Anlagen**

(in Prozent des Nettovermögens zum 31. August 2015)

%

Frankreich

33,07

Luxemburg

28,57

Irland

20,13

**81,77**

# Swiss Life Index Funds (LUX)

Investmentfonds nach Luxemburger Recht

## Swiss Life Index Funds (LUX) Dynamic (EUR)

### Wertpapierbestand zum 31. August 2015

(in EUR)

Nenn- wert/ Menge	Bezeichnung	Notierungs- währung	Anschaffungs- kosten EUR	% des Marktwert Nettovermögens	
				EUR	%
<b>Investmentfonds</b>					
27.300	AMUNDI ETF EUROMTS CASH 3 MONTHS	EUR	3.299.472	3.295.656	13,20
6	AMUNDI 3-6 M IC	EUR	613.635	613.906	2,46
21	BNP PARIBAS ASSET MANAGEMENT - BNP PARIBAS MONEY 3M - I	EUR	486.593	488.806	1,96
8.547	DB X-TRACKERS IBEX 35® INDEX ETF 1C	EUR	206.639	187.949	0,75
8.601	DB X-TRACKERS II - IBOXX SOVEREIGNS EUROZONE TOTAL RETURN INDEX ETF - 1C	EUR	1.897.900	1.886.629	7,56
6.220	DB X-TRACKERS II - IBOXX SOVEREIGNS EUROZONE 5-7 TOTAL RETURN INDEX ETF - 1C	EUR	1.401.466	1.398.940	5,60
1.300	DB X-TRACKERS II - IBOXX EUR SOVEREIGNS EUROZONE 1-3 TOTAL RETURN INDEX ETF - 1C	EUR	219.548	219.960	0,88
18.104	ISHARES AEX UCITS ETF	EUR	885.188	807.619	3,24
13.547	ISHARES MSCI EMERGING MARKETS - IE	USD	484.373	384.240	1,54
210.000	LOMBARD ODIER SHORT-TERM MONEY MARKET (USD) - IC	USD	2.013.247	1.954.246	7,83
2.520	LYXOR ETF EUROMTS GLOBAL	EUR	401.967	426.787	1,71
17.914	LYXOR ETF FTSE MIB - EUR	EUR	422.499	388.727	1,56
8.300	SOURCE MKTS S&P 500 SOURCE ETF USD A	USD	2.658.789	2.489.260	9,97
13	SWISS LIFE ASSET MANAGEMENT SWISS LIFE FUND F MONEY MARKET EURO - I	EUR	323.605	326.109	1,31
25.636	VANGUARD FTSE 100 UCITS ETF - D	GBP	1.083.137	995.460	3,99
132.990	VANGUARD S&P 500 UCITS ETF	EUR	4.287.610	4.475.380	17,93
<b>Summe Investmentfonds</b>			<b>20.685.668</b>	<b>20.339.674</b>	<b>81,49</b>
<b>Summe Anlagen</b>			<b>20.685.668</b>	<b>20.339.674</b>	<b>81,49</b>

Die Erläuterungen im Anhang sind ein wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

## **Swiss Life Index Funds (LUX)**

Investmentfonds nach Luxemburger Recht

### **Swiss Life Index Funds (LUX) Dynamic (EUR)**

#### **Wirtschaftliche Klassifizierung der Anlagen**

(in Prozent des Nettovermögens zum 31. August 2015)

%

Investmentfonds

81,49

**81,49**

#### **Geografische Klassifizierung der Anlagen**

(in Prozent des Nettovermögens zum 31. August 2015)

%

Irland

36,66

Luxemburg

22,63

Frankreich

22,20

**81,49**