

*Swiss Life Funds (F) Bond ESG
6M*

Information Périodique au 28.06.2024

État du patrimoine

Éléments de l'état du patrimoine	<i>Devise de comptabilité de l'OPC : EUR</i>	Montant à l'arrêté périodique
a) Titres financiers éligibles mentionnés au 1° du I de l'article L.214-20 / 1° du I de l'article L.214-24-55 du code monétaire et financier		1 700 527 504,49
b) Avoirs bancaires		92 243 652,92
c) Autres actifs détenus par l'OPC		197 516 257,22
d) Total des actifs détenus par l'OPC (lignes a+b+c)		1 990 287 414,63
e) Passif		-7 692 753,02
f) Valeur nette d'inventaire (lignes d+e = actif net OPC)		1 982 594 661,61

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

Parts ou actions	Nombre de parts ou actions en circulation	<i>Devise parts ou actions</i>	Valeur nette d'inventaire par part ou action (Valeur liquidative)
PART I / FR0010899179	149 684,406	EUR	11 259,06
PART P / FR0010914358	2 724 019,267	EUR	108,90
PART F / FR001400LFN8	3 562,814	EUR	103,00
PART P2 / FR001400OWY4	2 541,00	EUR	100,29

Portefeuille titres

Éléments du portefeuille titres	Pourcentage	
	Actif net	Total des actifs
a) Les titres financiers éligibles et les instruments du marché monétaire admis à la négociation sur un marché réglementé au sens de l'article L. 422-1 du code monétaire et financier.	85,77	85,44
b) Les titres financiers éligibles et les instruments du marché monétaire admis à la négociation sur un autre marché réglementé, en fonctionnement régulier, reconnu, ouvert au public et dont le siège est situé dans un Etat membre de l'Union européenne ou dans un autre Etat partie à l'accord sur l'Espace économique européen.	-	-
c) Les titres financiers éligibles et les instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs d'un pays tiers ou négociés sur un autre marché d'un pays tiers, réglementé, en fonctionnement régulier, reconnu et ouvert au public, pour autant que cette bourse ou ce marché ne figure pas sur une liste établie par l'Autorité des marchés financiers ou que le choix de cette bourse ou de ce marché soit prévu par la loi ou par le règlement ou les statuts de l'OPC / du fonds d'investissement à vocation générale.	-	-
d) Les titres financiers nouvellement émis mentionnés au 4° du I de l'article R. 214-11 / 4° du I de l'article R.214-32-18 du code monétaire et financier.	-	-
e) Les autres actifs	9,60	9,56

Répartition des actifs par devise

Devises (10 principales devises)	Montant En devise de comptabilité de l'OPC	Pourcentage	
	EUR	Actif net	Total des actifs
Euro	1 691 396 547,85	85,31	84,98
Dollar américain	9 130 956,64	0,46	0,46
-	-	-	-
-	-	-	-
-	-	-	-
-	-	-	-
-	-	-	-
-	-	-	-
-	-	-	-
-	-	-	-
-	-	-	-
Autres devises	-	-	-
Total	1 700 527 504,49	85,77	85,44

Répartition des actifs par pays de résidence de l'émetteur

Pays (10 principaux pays)	Pourcentage	
	Actif net	Total des actifs
France	31,66	31,54
Canada	9,25	9,21
Pays-Bas	9,06	9,03
Allemagne	6,55	6,53
Royaume-Uni	5,52	5,49
États-Unis	4,47	4,45
Danemark	2,76	2,75
Italie	2,71	2,70
Belgique	2,65	2,64
Suède	2,61	2,60
Autres pays	8,53	8,50
Total	85,77	85,44

Répartition des actifs par secteur économique

Secteur économique (10 principaux secteurs)	Pourcentage	
	Actif net	Total des actifs
Banques	54,41	54,20
Expert en finance	8,23	8,20
Détaillants et grossistes Alimentation	2,13	2,12
Composants électriques	1,55	1,54
Participation et promotion immobilières	1,51	1,51
Boissons non alcoolisées	1,21	1,21
Pharmacie	1,17	1,16
Automobiles	1,17	1,16
Service location et de crédit bail: consommateur	1,12	1,12
Services d'investissements	1,11	1,11
Autres secteurs	12,16	12,11
Total	85,77	85,44

Ventilation des autres actifs par nature

Nature d'actifs	Pourcentage	
	Actif net	Total des actifs
Parts d'OPC	9,60	9,56
- OPCVM et équivalents d'autres Etats membres de l'Union européenne	9,60	9,56
- FIA et équivalents d'autres Etats membres de l'Union européenne	-	-
- Autres OPC et fonds d'investissements	-	-
Autres actifs	-	-
Total	9,60	9,56

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

Éléments du portefeuille titres	Mouvements (en montant)	
	Acquisitions	Cessions / Remboursements
<i>Devise de comptabilité de l'OPC : EUR</i>		
a) Les titres financiers éligibles et les instruments du marché monétaire admis à la négociation sur un marché réglementé au sens de l'article L. 422-1° du code monétaire et financier.	6 430 453 312,88	6 346 592 579,42
b) Les titres financiers éligibles et les instruments du marché monétaire admis à la négociation sur un autre marché réglementé, en fonctionnement régulier, reconnu, ouvert au public et dont le siège est situé dans un Etat membre de l'Union européenne ou dans un autre Etat partie à l'accord sur l'Espace économique européen.	-	-
c) Les titres financiers éligibles et les instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs d'un pays tiers ou négociés sur un autre marché d'un pays tiers, réglementé, en fonctionnement régulier, reconnu et ouvert au public, pour autant que cette bourse ou ce marché ne figure pas sur une liste établie par l'Autorité des marchés financiers ou que le choix de cette bourse ou de ce marché soit prévu par la loi ou par le règlement ou les statuts de l'OPC / du fonds d'investissement à vocation générale.	-	-
d) Les titres financiers nouvellement émis mentionnés au 4° du I de l'article R. 214-11 / 4° du I de l'article R.214-32-18 du code monétaire et financier.	-	-
e) Les autres actifs	75 827 618,54	76 564 112,05
Total sur la période	6 506 280 931,42	6 423 156 691,47

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

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

Information sur les commissions de surperformance (en EUR)

Commission de surperformance (frais variables) : montant et % des frais sur la période				
Catégorie de part :	Frais de gestion variables provisionnés	%	Frais de gestion variables acquis (<i>dus aux rachats</i>)	%
PART I / FR0010899179	-	-	-	-
PART P / FR0010914358	-	-	-	-
PART F / FR001400LFN8	-	-	-	-
PART P2 / FR001400OWY4	-	-	-	-

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

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

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

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

Informations générales :

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

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

Données sur la concentration :

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

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

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

Swiss Life Funds (F) Bond ESG 6M

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

Données sur la réutilisation des garanties (collatéral) :

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

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

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

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

Néant.

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

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

Inventaire au 28.06.2024

Code valeur	Libellé valeur	Statut Valeur	Quantité	Valeur boursière	Devise de cotation	% Actif net
Valeurs mobilières						
Obligation						
XS2613658470	ABN AMRO BANK NA 3.75% 20/04/2025	PROPRE	3 900 000,00	3 930 420,00	EUR	0,20
XS2747616105	ABN AMRO BANK NV FRN 15/01/2027	PROPRE	4 000 000,00	4 061 732,00	EUR	0,20
XS2180510732	ABN AMRO BANK NV 1.25% 28/05/2025	PROPRE	6 500 000,00	6 369 341,10	EUR	0,32
FR001400L4Y2	ALD SA FRN 06/10/2025	PROPRE	7 900 000,00	8 022 780,26	EUR	0,40
FR001400G0W1	ALD SA FRN 21/02/2025	PROPRE	3 000 000,00	3 024 090,00	EUR	0,15
FR001400O457	ALD SA 3.875% 22/02/2027	PROPRE	11 000 000,00	11 185 894,89	EUR	0,56
FR0014008FH1	ARVAL SERVICE LEASE 0.875% 17/02/2025	PROPRE	4 000 000,00	3 939 165,46	EUR	0,20
FR001400H8D3	ARVAL SERVICE LEASE 4.25% 11/11/2025	PROPRE	7 000 000,00	7 217 294,92	EUR	0,36
XS2631416950	ASML HOLDING NV 3.5% 06/12/2025	PROPRE	5 000 000,00	5 100 331,69	EUR	0,26
XS2822525205	ASUT NZ BANKING GROUP FRN 21/05/2027	PROPRE	20 000 000,00	20 091 253,33	EUR	1,01
XS2590758400	AT AND T INC 3.55% 18/11/2025	PROPRE	3 500 000,00	3 570 727,16	EUR	0,18
XS2595361978	AT T INC FRN 06/03/2025	PROPRE	2 300 000,00	2 311 898,16	EUR	0,12
XS2577127884	AUSTRALIA NEW ZEALAND BANKING GROUP 3.652% 20/01/2026	PROPRE	5 500 000,00	5 590 717,84	EUR	0,28
XS2620201421	BANCO BILBAO VIZCAYA ARG VAR 10/05/2026	PROPRE	3 500 000,00	3 530 764,04	EUR	0,18
XS2835902839	BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA SA FRN 07/06/2027	PROPRE	4 000 000,00	4 012 212,22	EUR	0,20
XS1717591884	BANCO SANTANDER SA FRN 21/11/2024	PROPRE	13 000 000,00	13 100 013,33	EUR	0,66
XS2115156270	BANCO SANTANDER SA VAR 11/02/2025	PROPRE	12 000 000,00	12 102 340,00	EUR	0,61
XS2575952424	BANCO SANTANDER SA 3.75% 16/01/2026	PROPRE	10 000 000,00	10 190 931,15	EUR	0,51
XS2838482052	BANK NOVA SCOTIA FRN 10/06/2027	PROPRE	24 000 000,00	24 064 296,00	EUR	1,21
XS2387929834	BANK OF AMERICA CORP FRN 22/09/2026	PROPRE	6 000 000,00	6 051 873,33	EUR	0,31
XS2345784057	BANK OF AMERICA CORP FRN 24/08/2025	PROPRE	14 500 000,00	14 597 303,46	EUR	0,74
XS2798993858	BANK OF MONTREAL FRN 12/04/2027	PROPRE	20 000 000,00	20 184 845,00	EUR	1,02
XS2618508340	BANK OF NOVA SCOTIA FRN 02/05/2025	PROPRE	11 300 000,00	11 409 460,90	EUR	0,58
XS2733010628	BANK OF NOVA SCOTIA FRN 12/12/2025	PROPRE	15 000 000,00	15 092 825,00	EUR	0,76
XS2692247468	BANK OF NOVA SCOTIA FRN 22/09/2025	PROPRE	11 000 000,00	11 049 646,67	EUR	0,56
XS2793212197	BANK OF NOVA SCOTIA FRN 26/03/2026	PROPRE	8 000 000,00	8 014 482,67	EUR	0,40

Swiss Life Funds (F) Bond ESG 6M

Code valeur	Libellé valeur	Statut Valeur	Quantité	Valeur boursière	Devise de cotation	% Actif net
XS2842855814	BANK OF NOVA SOCITA FRN 17/06/2026	PROPRE	5 000 000,00	5 009 581,25	EUR	0,25
XS2825483998	BANQ INTERNATIONAL LUXEM FRN 24/05/2027	PROPRE	5 000 000,00	5 029 932,33	EUR	0,25
FR001400OEP0	BANQUE FED CRED MUTUEL FRN 05/03/2027	PROPRE	15 000 000,00	15 102 397,50	EUR	0,76
FR0014009A50	BANQUE FED CRED MUTUEL 1% 23/05/2025	PROPRE	10 000 000,00	9 780 858,90	EUR	0,49
XS1166201035	BANQUE FED CRED MUTUEL 1.25% 14/01/2025	PROPRE	6 000 000,00	5 957 676,07	EUR	0,30
XS2342059784	BARCLAYS PLC VAR 12/05/2026	PROPRE	1 000 000,00	1 012 275,00	EUR	0,05
DE000BLB9V03	BAYERISCHE LANDESBANK FRN 31/01/2026	PROPRE	6 800 000,00	6 857 264,50	EUR	0,35
XS2768933603	BMW FINANCE NV FRN 19/02/2026	PROPRE	4 000 000,00	4 023 035,33	EUR	0,20
XS1589881785	BMW FINANCE NV 0.875% 03/04/2025	PROPRE	2 000 000,00	1 963 415,07	EUR	0,10
FR0013444759	BNP PARIBAS 0.125% 04/09/2026	PROPRE	18 000 000,00	16 764 865,57	EUR	0,85
FR001400OGI0	BPCE SA FRN 06/03/2026	PROPRE	5 000 000,00	5 014 879,44	EUR	0,25
FR001400OHE7	BPCE SA FRN 08/03/2027	PROPRE	12 000 000,00	12 055 530,00	EUR	0,61
FR0013476199	BPCE SA 0.25% 15/01/2026	PROPRE	10 000 000,00	9 497 443,72	EUR	0,48
FR0013323664	BPCE SA 1.375% 23/03/2026	PROPRE	10 000 000,00	9 645 347,95	EUR	0,49
FR001400HAC0	BPCE SA 3.625% 17/04/2026	PROPRE	7 600 000,00	7 662 988,38	EUR	0,39
XS2752874821	CA AUTO BANK SPA IE FRN 26/01/2026	PROPRE	13 500 000,00	13 691 539,88	EUR	0,69
XS2800653581	CA AUTOBANK SPA IE 3.75% 12/04/2027	PROPRE	5 500 000,00	5 528 610,55	EUR	0,28
XS2634071489	CANADIAN IMPERIAL BANK FRN 09/06/2025	PROPRE	5 000 000,00	5 024 151,39	EUR	0,25
XS2793782611	CANADIAN IMPERIAL BANK FRN 27/03/2026	PROPRE	8 000 000,00	8 005 513,33	EUR	0,40
XS2755443459	CANADIAN IMPERIAL BANK FRN 29/01/2027	PROPRE	5 500 000,00	5 580 815,78	EUR	0,28
XS1179916017	CARREFOUR 1.25% 03/06/2025	PROPRE	11 300 000,00	11 054 260,60	EUR	0,56
XS2723549528	CIE DE SAINT GOBAIN SA 3.75% 29/11/2026	PROPRE	19 000 000,00	19 509 601,80	EUR	0,98
XS2167003685	CITIGROUP INC VAR 06/07/2026	PROPRE	10 000 000,00	9 876 633,88	EUR	0,50
DE000CZ45YA3	COMMERZBANK AG FRN 12/03/2027	PROPRE	5 500 000,00	5 534 420,83	EUR	0,28
XS2712747182	COOPERATIEVE RABOBANK UA FRN 03/11/2026	PROPRE	4 000 000,00	4 063 513,33	EUR	0,20
FR00140007B4	CRD MUTUEL ARKEA 0.01% 28/01/2026	PROPRE	7 700 000,00	7 278 445,20	EUR	0,37
FR001400GDG7	CREDIT AGRICOLE SA FRN 07/03/2025	PROPRE	5 500 000,00	5 525 122,78	EUR	0,28
XS2623129256	DAIMLER TRUCK INTL 3.875% 19/06/2026	PROPRE	1 500 000,00	1 511 715,21	EUR	0,08
DE000A3TOX97	DEUT PFANDBRIEFBANK AG 0.25% 17/01/2025	PROPRE	19 100 000,00	18 568 269,57	EUR	0,94
DE000A3826Q8	DEUTSCHE BANK FRN 15/01/2026	PROPRE	4 300 000,00	4 360 033,73	EUR	0,22
DE000A351ZR8	DEUTSCHE BOERSE AG 3.875% 28/09/2026	PROPRE	12 000 000,00	12 462 396,72	EUR	0,63

Swiss Life Funds (F) Bond ESG 6M

Code valeur	Libellé valeur	Statut Valeur	Quantité	Valeur boursière	Devise de cotation	% Actif net
XS2844409271	DIAGEO FINANCE PLC FRN 20/06/2026	PROPRE	6 000 000,00	6 008 622,00	EUR	0,30
XS2742659738	FED CAISSES DESJARDINS FRN 17/01/2026	PROPRE	13 000 000,00	13 177 178,44	EUR	0,66
XS2764789231	FORTIVE CORPORATION 3.70% 13/02/2026	PROPRE	6 889 000,00	6 991 873,47	EUR	0,35
XS2412258522	GN STORE NORD 0.875% 25/11/2024	PROPRE	3 500 000,00	3 436 193,47	EUR	0,17
XS2322254165	GOLDMAN SACHS GROUP INC FRN 19/03/2026	PROPRE	3 000 000,00	3 023 463,58	EUR	0,15
DE000HCB0B02	HAMBURG COMMERCIAL BANK FRN 05/12/2025	PROPRE	8 000 000,00	8 086 612,00	EUR	0,41
USU24652AT35	HARLEY DAVIDSON 3.35% 08/06/2025	PROPRE	10 000 000,00	9 130 956,64	USD	0,46
XS2719096831	HEINEKEN NV 3.625% 15/11/2026	PROPRE	12 500 000,00	12 818 000,68	EUR	0,65
XS2388490802	HSBC HOLDINGS PLC FRN 24/09/2026	PROPRE	4 900 000,00	4 943 435,78	EUR	0,25
XS2767979052	INFINEON TECHNOLOGIES AG 26/02/2027	PROPRE	6 000 000,00	6 061 146,39	EUR	0,31
XS2697966690	ING BANK NV FRN 02/10/2026	PROPRE	7 500 000,00	7 560 750,00	EUR	0,38
XS2804483381	INTESA SANPAOLO SPA FRN 16/04/2027	PROPRE	14 000 000,00	14 139 869,33	EUR	0,71
XS2719281227	INTESA SANPAOLO SPA FRN 16/11/2025	PROPRE	17 000 000,00	17 201 227,11	EUR	0,87
XS2597970800	INTESA SANPAOLO SPA FRN 17/03/2025	PROPRE	4 200 000,00	4 218 320,75	EUR	0,21
XS2625195891	INTESA SANPAOLO SPA 4% 19/05/2026	PROPRE	3 500 000,00	3 536 581,71	EUR	0,18
BE0002950310	KBC GROUP NV VAR 06/06/2026	PROPRE	15 900 000,00	16 040 961,12	EUR	0,81
BE0002728096	KBC GROUP NV VAR 10/09/2026	PROPRE	12 000 000,00	11 499 611,15	EUR	0,58
BE0002846278	KBC GROUP NV VAR 29/03/2026	PROPRE	5 400 000,00	5 326 960,19	EUR	0,27
BE0974423569	KBC GROUP NV VAR 29/06/2025	PROPRE	9 500 000,00	9 502 054,86	EUR	0,48
XS2775174340	KBC IFIMA SA FRN 04/03/2026	PROPRE	12 800 000,00	12 852 558,22	EUR	0,65
FR001400KI02	KERING 3.75% 05/09/2025	PROPRE	6 200 000,00	6 396 603,02	EUR	0,32
XS2780024977	KONINKIJKE AHOLD DLHAIZE FRN 11/03/2026	PROPRE	6 222 000,00	6 248 802,82	EUR	0,32
XS2752465810	LANDBK HESSEN THUERINGEN FRN 23/01/2026	PROPRE	7 000 000,00	7 064 341,67	EUR	0,36
DE000LB39BG3	LANDESBANK BADEN WUERTTEMBERG FRN 09/11/2026	PROPRE	18 000 000,00	18 116 136,00	EUR	0,91
DE000LB38937	LB BADEN WUERTTEMBERG FRN 28/11/2025	PROPRE	8 000 000,00	8 034 684,44	EUR	0,41
XS2477154871	LEASEPLAN CORPORATION NV 2.125% 06/05/2025	PROPRE	8 000 000,00	7 916 147,95	EUR	0,40
FR0128299387	LEGRAND FRANCE SA 3.4% 01/02/2027	PROPRE	10 000 000,00	10 044 555,56	EUR	0,51
XS2518861641	LLOYDS BANK CORP MKTS PLC FRN 12/08/2024	PROPRE	10 000 000,00	10 066 201,67	EUR	0,51
XS2775724862	LLOYDS BANKING GROUP PLC FRN 05/03/2027	PROPRE	9 000 000,00	9 064 273,50	EUR	0,46
XS2679903950	LSEG NETHERLANDS BV 4.125% 29/09/2026	PROPRE	8 000 000,00	8 345 034,10	EUR	0,42
XS2758931880	MITSUBISHI HC CAP UK PLC 3.733% 02/02/2027	PROPRE	2 000 000,00	2 028 842,35	EUR	0,10

Swiss Life Funds (F) Bond ESG 6M

Code valeur	Libellé valeur	Statut Valeur	Quantité	Valeur boursière	Devise de cotation	% Actif net
XS2530031546	MITSUBISHI UFJ FINANCIAL GROUP INC VAR 19/09/2025	PROPRE	7 000 000,00	7 168 807,30	EUR	0,36
XS2329143510	MIZUHO FINANCIAL GROUP 0.184% 13/04/2026	PROPRE	6 754 000,00	6 378 297,18	EUR	0,32
XS2790333616	MORGAN STANLEY FRN 19/03/2027	PROPRE	19 000 000,00	19 078 751,31	EUR	0,96
XS2780858994	NATIONAL BANK OF CANADA FRN 06/03/2026	PROPRE	22 000 000,00	22 089 082,89	EUR	1,11
XS2710354544	NATIONWIDE BLDG SOCIETY 4.50% 01/11/2026	PROPRE	10 000 000,00	10 507 400,00	EUR	0,53
XS2576255751	NATWEST MARKETS FRN 13/01/2026	PROPRE	5 000 000,00	5 104 281,67	EUR	0,26
XS2745115597	NATWEST MARKETS PLC FRN 09/01/2026	PROPRE	20 000 000,00	20 293 300,00	EUR	1,02
XS2419570630	NIBC BANK NV FRN 09/12/2024	PROPRE	10 000 000,00	10 045 858,33	EUR	0,51
XS2630448434	NIBC BANK NV 6.375% 01/12/2025	PROPRE	11 000 000,00	11 755 860,49	EUR	0,59
XS2584643113	NORDEA BANK ABP VAR 10/02/2026	PROPRE	5 500 000,00	5 569 702,88	EUR	0,28
XS2820449945	NOVO NORDISK A/S 3.375% 21/05/2026	PROPRE	23 000 000,00	23 093 921,92	EUR	1,16
DK0030393319	NYKREDIT REALKREDIT AS FRN 27/02/2026	PROPRE	3 200 000,00	3 230 499,20	EUR	0,16
XS2794477518	OP CORPORATE BANK PLC FRN 28/03/2027	PROPRE	2 900 000,00	2 903 416,20	EUR	0,15
XS2577030708	ROYAL BANK OF CANADA FRN 17/01/2025	PROPRE	9 285 000,00	9 386 817,25	EUR	0,47
XS2644417227	SANTAN CONS BANK 4.5% 30/06/2026	PROPRE	3 200 000,00	3 245 397,04	EUR	0,16
XS2733106657	SIEMENS FINANCIERINGSMAT 4.188% 18/12/2025	PROPRE	6 000 000,00	6 026 905,00	EUR	0,30
XS2813108870	SKANDINAVISKA ENSKILDA FRN 03/05/2027	PROPRE	7 000 000,00	7 053 203,15	EUR	0,36
XS2802190459	SNAM SPA FRN 15/04/2026	PROPRE	10 623 000,00	10 742 944,29	EUR	0,54
FR001400F315	SOCIETE GENERALE FRN 13/01/2025	PROPRE	10 700 000,00	10 818 641,60	EUR	0,55
FR001400N9V5	SOCIETE GENERALE FRN 19/01/2026	PROPRE	10 000 000,00	10 118 141,67	EUR	0,51
FR0013311503	SOCIETE GENERALE 1.125% 23/01/2025	PROPRE	3 000 000,00	2 969 156,31	EUR	0,15
FR001400KZP3	SOCIETE GENERALE 4.25% 28/09/2026	PROPRE	12 500 000,00	13 052 392,76	EUR	0,66
XS2629062568	STORA ENSO OYJ 4% 01/06/2026	PROPRE	2 600 000,00	2 617 828,88	EUR	0,13
XS2049582542	SVENSKA HANDELSBANKEN AB 0.05% 03/09/2026	PROPRE	1 000 000,00	928 063,93	EUR	0,05
XS2404629235	SVENSKA HANDELSBANKEN AB 0.125% 03/11/2026	PROPRE	1 000 000,00	926 986,50	EUR	0,05
XS2618499177	SVENSKA HANDELSBANKEN AB 3.75% 05/05/2023	PROPRE	13 500 000,00	13 644 435,21	EUR	0,69
XS2827693446	SWISSCOM FINANCE 3.5% 29/05/2026	PROPRE	7 174 000,00	7 218 695,99	EUR	0,36
FR001400L248	THALES SA 4% 18/10/2025	PROPRE	6 300 000,00	6 497 106,34	EUR	0,33
XS2803392021	TORONTO DOMINION BANK FRN 16/04/2026	PROPRE	20 000 000,00	20 196 973,33	EUR	1,02
XS2577740157	TORONTO DOMINION BANK FRN 20/01/2025	PROPRE	5 000 000,00	5 053 166,25	EUR	0,25
XS2652775789	TORONTO DOMINION BANK FRN 21/07/2025	PROPRE	4 714 000,00	4 769 829,08	EUR	0,24

Swiss Life Funds (F) Bond ESG 6M

Code valeur	Libellé valeur	Statut Valeur	Quantité	Valeur boursière	Devise de cotation	% Actif net
XS2785465860	TOYOTA FINANCE AUSTRALIA 3.434% 18/06/2026	PROPRE	6 000 000,00	6 006 042,90	EUR	0,30
XS2744121869	TOYOTA MOTOR FINANCE BV 3.125% 11/01/2027	PROPRE	3 500 000,00	3 523 104,11	EUR	0,18
XS2737063722	TOYOTO MOTOR FINANCE BV FRN 22/12/2025	PROPRE	5 000 000,00	5 016 988,89	EUR	0,25
XS2800795291	UBS AG LONDON FRN 12/04/2026	PROPRE	20 000 000,00	20 187 390,00	EUR	1,02
XS2744130852	VOLVO TREASURY AB FRN 09/01/2026	PROPRE	3 200 000,00	3 244 805,33	EUR	0,16
XS2824777267	VOLVO TREASURY AB FRN 22/05/2026	PROPRE	6 000 000,00	6 035 760,66	EUR	0,30
XS2760218185	VOLVO TREASURY AB 3.125% 08/09/2026	PROPRE	12 000 000,00	12 053 405,57	EUR	0,61
XS2671621402	VOLVO TREASURY AB 3.875% 29/08/2026	PROPRE	7 500 000,00	7 797 519,67	EUR	0,39
XS1823518730	WUERTH FINANCE INTL BV 1% 26/05/2025	PROPRE	100 000,00	97 748,37	EUR	0,00
Total Obligation				1 106 099 805,59		55,79
O.P.C.V.M.						
FR0013067790	BFT AUREUS ISR FCP	PROPRE	6 500,00	67 539 680,00	EUR	3,41
FR0010216804	BNP PARIBAS INVEST 3M SUSTAINABLE FCP	PROPRE	115,00	70 363 313,50	EUR	3,55
FR0013368065	CM AM MONEPLUS FCP	PROPRE	1,00	112 183,30	EUR	0,01
FR0010089649	SWISS LIFE FUNDS(F) ESG MONEY MARKET EURO SICAV	PROPRE	2 000,00	52 234 800,00	EUR	2,63
Total O.P.C.V.M.				190 249 976,80		9,60
Total Valeurs mobilières				1 296 349 782,39		65,39
Swap de Taux						
SWAP03970144	1721726572#S_2024102	PROPRE	3 500 000,00	75 480,86	EUR	0,00
SWAP03982983	1787663602#S_2024111	PROPRE	4 000 000,00	62 543,43	EUR	0,00
SWAP04025676	1982660512#S_2025022	PROPRE	100 000,00	1 074,87	EUR	0,00
SWAP04029765	2014641002#S_2026011	PROPRE	10 000 000,00	-10 536,62	EUR	-0,00
SWAP04031072	2019525332#S_2026012	PROPRE	5 500 000,00	-5 614,35	EUR	-0,00
SWAP04040441	2087613132#S_2025111	PROPRE	11 000 000,00	-151 592,10	EUR	-0,01
SWAP04048844	2109365912#S_2026050	PROPRE	13 500 000,00	3 594,79	EUR	0,00
SWAP04054285	2118227762#S_2025111	PROPRE	3 500 000,00	-39 053,85	EUR	-0,00
SWAP04055411	2120859762#S_2026051	PROPRE	3 500 000,00	13 858,23	EUR	0,00
SWAP04056065	2147740242#S_2026060	PROPRE	2 600 000,00	-2 843,10	EUR	-0,00
SWAP04056066	2147745742#S_2025120	PROPRE	11 000 000,00	44 171,16	EUR	0,00
SWAP04059183	2162468962#S_2026061	PROPRE	1 500 000,00	-1 759,75	EUR	-0,00
SWAP04059452	2163878042#S_2026011	PROPRE	10 000 000,00	13 534,01	EUR	0,00

Swiss Life Funds (F) Bond ESG 6M

Code valeur	Libellé valeur	Statut Valeur	Quantité	Valeur boursière	Devise de cotation	% Actif net
SWAP04063380	2172600462#S_2026063	PROPRE	3 200 000,00	-13 493,30	EUR	-0,00
SWAP04072336	2180470352#S_2024071	PROPRE	40 000,00	-4,02	EUR	-0,00
SWAP04077481	2185430342#L_2025111	PROPRE	4 000 000,00	55 124,40	EUR	0,00
SWAP04087861	2197968932#S_2024072	PROPRE	5 000 000,00	6 199,21	EUR	0,00
SWAP04092124	2215117362#S_2026072	PROPRE	7 500 000,00	-227 225,05	EUR	-0,01
SWAP04097926	2224083742#S_2024082	PROPRE	5 000 000,00	7 972,07	EUR	0,00
SWAP04102797	2227988462#S_2026090	PROPRE	20 000 000,00	1 813 302,93	EUR	0,09
SWAP04114841	2237846362#S_2025110	PROPRE	5 000 000,00	-10 011,27	EUR	-0,00
SWAP04120769	2239589672#S_2026092	PROPRE	25 000 000,00	-89 855,54	EUR	-0,00
SWAP04121183	2240795202#S_2026082	PROPRE	12 000 000,00	-45 447,14	EUR	-0,00
SWAP04127236	2245771932#S_2026082	PROPRE	8 000 000,00	-31 455,38	EUR	-0,00
SWAP04162124	2267381742#S_2026110	PROPRE	10 000 000,00	-25 041,94	EUR	-0,00
SWAP04173214	2278680282#S_2026101	PROPRE	12 500 000,00	47 109,94	EUR	0,00
SWAP04186644	2302280532#S_2026102	PROPRE	22 000 000,00	342 248,80	EUR	0,02
SWAP04187864	2304641032#S_2024091	PROPRE	5 000 000,00	11 029,29	EUR	0,00
SWAP04194247	2316416952#S_2026012	PROPRE	7 700 000,00	108 510,16	EUR	0,01
SWAP04194245	2316418012#S_2026041	PROPRE	7 600 000,00	94 873,15	EUR	0,00
SWAP04194246	2316469012#S_2026041	PROPRE	6 754 000,00	86 398,51	EUR	0,00
SWAP04194495	2320091162#S_2027011	PROPRE	3 500 000,00	71 163,55	EUR	0,00
SWAP04201440	2329599752#S_2026032	PROPRE	9 500 000,00	114 314,05	EUR	0,01
SWAP04219528	2342697892#S_2027020	PROPRE	2 000 000,00	35 184,35	EUR	0,00
SWAP04221950	2343928082#S_2026090	PROPRE	1 000 000,00	14 516,85	EUR	0,00
SWAP04221949	2343947152#S_2026110	PROPRE	1 000 000,00	15 365,88	EUR	0,00
SWAP04221948	2344013522#S_2027020	PROPRE	10 000 000,00	166 717,21	EUR	0,01
SWAP04224134	2345263582#L_2026102	PROPRE	3 000 000,00	-46 670,29	EUR	-0,00
SWAP04224133	2345333572#S_2026090	PROPRE	12 000 000,00	201 619,25	EUR	0,01
SWAP04224138	2345403102#L_2026090	PROPRE	5 000 000,00	-453 325,67	EUR	-0,02
SWAP04231257	2353429052#S_2026021	PROPRE	6 900 000,00	56 184,02	EUR	0,00
SWAP04233852	2357335122#S_2027022	PROPRE	11 000 000,00	128 528,10	EUR	0,01
SWAP04234892	2359557782#S_2027012	PROPRE	6 000 000,00	50 221,36	EUR	0,00
SWAP04247778	2380283672#S_2026061	PROPRE	6 000 000,00	20 973,75	EUR	0,00

Swiss Life Funds (F) Bond ESG 6M

Code valeur	Libellé valeur	Statut Valeur	Quantité	Valeur boursière	Devise de cotation	% Actif net
SWAP04256847	2406481812#S_2027041	PROPRE	5 500 000,00	31 564,61	EUR	0,00
SWAP04265344	2419100782#S_2024072	PROPRE	60 000 000,00	-1 914,36	EUR	-0,00
SWAP04268706	2430945912#S_2026042	PROPRE	25 000 000,00	-5 507,43	EUR	-0,00
SWAP04286884	2463516382#L_2026092	PROPRE	7 000 000,00	25 159,55	EUR	0,00
SWAP04286882	2463551252#L_2026042	PROPRE	2 000 000,00	0,59	EUR	0,00
Total Swap de Taux				2 557 187,77		0,13
Liquidites						
APPELS DE MARGES						
	APPEL DE MARGE EUR	PROPRE	-2 557 187,67	-2 557 187,67	EUR	-0,13
Total APPELS DE MARGES				-2 557 187,67		-0,13
AUTRES						
	PROV INTCREDCPTDEPCE	PROPRE	87 441,84	87 441,84	EUR	0,00
Total AUTRES				87 441,84		0,00
BANQUE OU ATTENTE						
	À RECEVOIR SUR SWAP	PROPRE	21 676,96	21 676,96	EUR	0,00
	ACH DIFF TITRES EUR	PROPRE	-2 970 968,88	-2 970 968,88	EUR	-0,15
	BANQUE EUR BNP	PROPRE	58 657,45	58 657,45	EUR	0,00
	BANQUE EUR SWISSLIFE	PROPRE	92 027 980,11	92 027 980,11	EUR	4,64
	BANQUE USD SWISSLIFE	PROPRE	168 281,21	157 015,36	USD	0,01
Total BANQUE OU ATTENTE				89 294 361,00		4,50
DEPOSIT DE GARANTIE						
	DEPOSIT OTC VERSE	PROPRE	2 934 896,02	2 934 896,02	EUR	0,15
Total DEPOSIT DE GARANTIE				2 934 896,02		0,15
FRAIS DE GESTION						
	PRCOMGESTFIN	PROPRE	-231 106,50	-231 106,50	EUR	-0,01
	PRCOMGESTFIN	PROPRE	-86 415,24	-86 415,24	EUR	-0,00
	PRCOMGESTFIN	PROPRE	-70,18	-70,18	EUR	-0,00
	PRCOMGESTFIN	PROPRE	-18,49	-18,49	EUR	-0,00
	PRN-1COMGESTFIN	PROPRE	-507 457,92	-507 457,92	EUR	-0,03
	PRN-1COMGESTFIN	PROPRE	-146 822,65	-146 822,65	EUR	-0,01
	PRN-1COMGESTFIN	PROPRE	-1 486,56	-1 486,56	EUR	-0,00
	PRN-1COMGESTFIN	PROPRE	-0,01	-0,01	EUR	-0,00
Total FRAIS DE GESTION				-973 377,55		-0,05
Total Liquidites				88 786 133,64		4,48

Swiss Life Funds (F) Bond ESG 6M

Code valeur	Libellé valeur	Statut Valeur	Quantité	Valeur boursière	Devise de cotation	% Actif net
Creances negociables						
Interets postcomptes.						
FR0127752790	CA CONSUMER FINANCE ESTR+0.6% 03/03/2026	PROPRE	10 000 000,00	10 157 660,50	EUR	0,51
BE6348363043	KBC BANK NV ESTR+0.26% 13/09/2024	PROPRE	6 000 000,00	6 139 802,43	EUR	0,31
XS2651634243	LLOYDS BANK PLC ESTR+0.41% 10/07/2024	PROPRE	5 000 000,00	5 211 398,03	EUR	0,26
XS2796586712	QATAR NATIONAL BANK ESTRCAP+0.40% 30/09/2024	PROPRE	6 000 000,00	6 067 119,65	EUR	0,31
Total Interets postcomptes.				27 575 980,61		1,39
Interets precomptes.						
XS2826695954	AKZO NOBEL NV ZCP 20/09/2024	PROPRE	6 000 000,00	5 947 422,23	EUR	0,30
FR0128459395	ALSTOM SA ZCP 30/09/2024	PROPRE	6 800 000,00	6 728 138,92	EUR	0,34
FR0128613884	ALSTOM ZCP 17/07/2024	PROPRE	15 000 000,00	14 970 642,96	EUR	0,76
FR0128614825	ALSTOM ZCP 26/08/2024	PROPRE	9 000 000,00	8 943 231,59	EUR	0,45
BE6350063556	BRIDGESTONE EUROPE NV ZCP 26/08/2024	PROPRE	4 000 000,00	3 975 365,53	EUR	0,20
XS2824049238	CARLSBERG BREWERIES ZCP 11/09/2024	PROPRE	5 000 000,00	4 960 596,11	EUR	0,25
XS2853495245	COCA COLA EUROPACI ZCP 04/07/2024	PROPRE	10 000 000,00	9 994 929,91	EUR	0,50
XS2820497324	COCA COLA EUROPEAN ZCP 09/07/2024	PROPRE	14 000 000,00	13 985 713,31	EUR	0,71
FR0128636794	COVIVIO HOTELS SCA ZCP 01/07/2024	PROPRE	5 000 000,00	4 998 947,49	EUR	0,25
FR0128507086	COVIVIO HOTELS SCA ZCP 08/07/2024	PROPRE	2 000 000,00	1 998 128,56	EUR	0,10
FR0128638121	COVIVIO HOTELS ZCP 13/09/2024	PROPRE	3 000 000,00	2 975 939,05	EUR	0,15
FR0128666999	COVIVO HOTELS ZCP 01/10/2024	PROPRE	3 000 000,00	2 970 411,49	EUR	0,15
XS2820609142	DXC CAPITAL FUNDING ZCP 10/07/2024	PROPRE	3 000 000,00	2 996 415,93	EUR	0,15
XS2834246931	ENEL FINANCE INTERNATIONAL NV ZCP 29/07/2024	PROPRE	5 000 000,00	4 983 764,42	EUR	0,25
FR0128461185	ENGIE ZCP 02/07/2024	PROPRE	15 000 000,00	14 995 313,06	EUR	0,76
FR0128661495	FRANCE D ZCP 13/09/2024	PROPRE	5 000 000,00	4 955 868,21	EUR	0,25
XS2800557279	HEWLETT PACKARD INT CDN 03/04/2025	PROPRE	2 000 000,00	1 942 920,50	EUR	0,10
XS2794652029	HEWLETT PACKARD INTL BANK ZCP 24/03/2025	PROPRE	3 000 000,00	2 918 334,60	EUR	0,15
XS2843011888	IBERDROLA INTERNATIONAL ZCP 19/07/2024	PROPRE	5 000 000,00	4 989 792,17	EUR	0,25
XS2850508479	IBERDROLA INTERNATIONAL ZCP 23/09/2024	PROPRE	5 000 000,00	4 955 212,68	EUR	0,25
FR0128638626	ITM ENTREPRISES SA ZCP 24/07/2024	PROPRE	10 000 000,00	9 972 134,37	EUR	0,50
FR0128568302	ITM ENTREPRISES ZCP 08/07/2024	PROPRE	5 000 000,00	4 995 065,98	EUR	0,25
FR0128661313	JYSKE BANK ZCP 04/07/2024	PROPRE	20 000 000,00	19 990 019,07	EUR	1,01
FR0128638352	L OCCITANE INTERNATIONAL ZCP 17/09/2024	PROPRE	6 000 000,00	5 946 373,62	EUR	0,30

Swiss Life Funds (F) Bond ESG 6M

Code valeur	Libellé valeur	Statut Valeur	Quantité	Valeur boursière	Devise de cotation	% Actif net
FR0128561372	LAGARDERE SA ZCP 15/07/2024	PROPRE	15 000 000,00	14 972 396,57	EUR	0,76
XS2853498264	LSEG NETHERLANDS BV ZCP 27/08/2024	PROPRE	5 000 000,00	4 968 803,64	EUR	0,25
DE000A36W4Y3	METRO AG ZCP 02/07/2024	PROPRE	10 000 000,00	9 996 709,48	EUR	0,50
DE000A4BF7Y8	METRO AG ZCP 19/08/2024	PROPRE	15 000 000,00	14 916 286,89	EUR	0,75
FR0128657477	NEXITY ZCP 03/09/2024	PROPRE	10 000 000,00	9 916 978,92	EUR	0,50
FR0128609353	NEXITY ZCP 15/07/2024	PROPRE	10 000 000,00	9 981 059,58	EUR	0,50
XS2734745362	NOMURA BANK INTERNA ZCP 13/09/2024	PROPRE	5 000 000,00	4 958 465,84	EUR	0,25
XS2847690158	RELX INVESTMENTS ZCP 03/07/2024	PROPRE	6 000 000,00	5 997 487,88	EUR	0,30
XS2662654339	SANTANDER CONSUMER BANK ZCP 29/07/2024	PROPRE	5 000 000,00	4 983 368,44	EUR	0,25
XS2785683850	SANTANDER CONSUMER ZCP 11/03/2025	PROPRE	5 000 000,00	4 866 958,67	EUR	0,25
XS2676393296	SANTANDER CONSUMER ZCP 28/08/2024	PROPRE	5 000 000,00	4 966 877,61	EUR	0,25
XS2845612527	SGS NEDERLAND HOLDING B V ZCP 17/10/2024	PROPRE	8 000 000,00	7 901 066,02	EUR	0,40
XS2802740899	SGS NEDERLAND HOLDING BV ZCP 10/07/2024	PROPRE	8 000 000,00	7 990 396,32	EUR	0,40
XS2833333458	SGS NEDERLAND HOLDING BV ZCP 29/08/2024	PROPRE	10 500 000,00	10 428 337,53	EUR	0,53
XS2842067030	SNAM SPA ZCP 11/10/2024	PROPRE	4 000 000,00	3 956 410,04	EUR	0,20
FR0128352186	SONEPAR SA ZCP 10/12/2024	PROPRE	10 000 000,00	9 812 079,69	EUR	0,49
FR0128654995	UNIVERSAL MUSCI GROUP NV ZCP 30/08/2024	PROPRE	4 000 000,00	3 973 589,76	EUR	0,20
Total Interets precomptes.				300 677 954,64		15,17
Taux revisable						
FR0127265249	ALLIANZ BANQUE E3R+0.23% 03/02/2025	PROPRE	5 000 000,00	5 029 033,04	EUR	0,25
FR0128037217	ALLIANZ BANQUE E3R+0.51% 26/05/2026	PROPRE	5 000 000,00	5 025 172,08	EUR	0,25
FR0127271148	ALLIANZ BANQUE SA E3R+0.25% 17/02/2025	PROPRE	10 000 000,00	10 048 734,39	EUR	0,51
FR0127152132	ALLIANZ BANQUE SA E3R+0.26% 13/12/2024	PROPRE	10 000 000,00	10 014 683,83	EUR	0,51
FR0127582338	ALLIANZ BANQUE SA E3R+0.38% 02/09/2025	PROPRE	10 000 000,00	10 019 817,22	EUR	0,51
FR0127584086	AXA BANQUE E3R+0.26% 09/09/2024	PROPRE	20 000 000,00	20 042 871,11	EUR	1,01
FR0126895822	BANQUE EDEL E3R+0.35% 27/09/2024	PROPRE	10 000 000,00	10 002 363,89	EUR	0,50
FR0127891424	BANQUE FEDERAL CRED E3R+0.58% 09/03/2026	PROPRE	10 000 000,00	10 034 398,00	EUR	0,51
FR0128200781	BANQUE STELLANTIS FRANCE E3R+0.52 19/03/2025	PROPRE	5 000 000,00	5 009 854,26	EUR	0,25
FR0127585968	BFCM E3R+0.55% 15/09/2025	PROPRE	20 000 000,00	20 007 392,89	EUR	1,01
FR0127738088	CAISSE FED DU CRDT MUT OF VAR E3R+0.82% 28/11/2025	PROPRE	10 000 000,00	10 064 359,70	EUR	0,51
FR0127798793	CAISSE FEDERALE DU CREDIT MUTU E3R+0.60% 9/1/2026	PROPRE	5 000 000,00	5 058 585,04	EUR	0,26

Swiss Life Funds (F) Bond ESG 6M

Code valeur	Libellé valeur	Statut Valeur	Quantité	Valeur boursière	Devise de cotation	% Actif net
FR0127533760	CARREFOUR BANQUE E3R+0.65% 11/10/2024	PROPRE	10 000 000,00	10 107 799,00	EUR	0,51
FR0127688531	CARREFOUR BANQUE E3R+0.65% 20/09/2024	PROPRE	5 000 000,00	5 008 564,33	EUR	0,25
FR0128305861	CARREFOUR BANQUE E3R+0.75% 28/12/2026	PROPRE	10 000 000,00	10 035 898,22	EUR	0,51
FR0127739342	CREDIT MUTUEL ARKEA E3R+0.57% 01/12/2025	PROPRE	25 000 000,00	25 109 836,11	EUR	1,27
FR0127587600	EIFFAGE E3R+1.10% 15/09/2025	PROPRE	10 000 000,00	10 071 401,41	EUR	0,51
FR0127815886	EIFFAGE E3R+1.2% 20/01/2025	PROPRE	6 000 000,00	6 059 843,33	EUR	0,31
FR0128296771	LA CAISSE FRDERALE OCEAN E3R+0.81% 03/11/2026	PROPRE	10 000 000,00	10 102 882,58	EUR	0,51
FR0127147132	NEXITY E3R+1.60% 29/11/2024	PROPRE	10 000 000,00	10 046 500,00	EUR	0,51
FR0127900498	OCEAN CAISSE FEDER DU CREDIT E3R+0.80% 27/03/2026	PROPRE	20 000 000,00	20 052 662,45	EUR	1,01
FR0127217323	ORANGE BANK E3R+0.4% 1701/2025	PROPRE	10 000 000,00	10 062 301,50	EUR	0,51
FR0127151811	ORANGE BANK E3R+0.45% 09/12/2024	PROPRE	10 000 000,00	10 003 221,55	EUR	0,50
FR0127059659	PSA BANQUE FRANCE E3R 0.37% 04/10/2024	PROPRE	5 000 000,00	5 049 921,33	EUR	0,25
FR0127847764	SEB SA E3R+0.90% 03/04/2025	PROPRE	4 000 000,00	4 046 322,67	EUR	0,20
FR0128345149	SOCRAM BANQUE E3R+0.7% 28/11/2025	PROPRE	10 000 000,00	10 059 343,72	EUR	0,51
Total Taux revisable				266 173 763,65		13,43
Total Creances negociables				594 427 698,90		29,98
Coupons						
Obligation						
XS2697966690	ING BANK NV FRN 26	ACHLIG	75,00	86 601,67	EUR	0,00
BE0974423569	KBC VAR 2025	ACHLIG	95,00	273 125,00	EUR	0,01
XS2644417227	SANTAN CONS 4.5% 26	ACHLIG	32,00	144 000,00	EUR	0,01
Total Obligation				503 726,67		0,03
Total Coupons				503 726,67		0,03
Change a terme						
Change a terme						
	OVCT 250508 USD/EUR	RECU	9 050 014,15	9 050 014,15	EUR	0,46
	OVCT 250508 USD/EUR	VERSE	-9 880 000,00	-9 079 140,68	USD	-0,46
	OVCT 250508 USD/EUR	RECU	100 441,46	100 441,46	EUR	0,01
	OVCT 250508 USD/EUR	VERSE	-110 000,00	-101 182,69	USD	-0,01
Total Change a terme				-29 867,76		-0,00
Total Change a terme				-29 867,76		-0,00
Total Swiss Life Funds (F) Bond ESG 6M				1 982 594 661,61		100,00

ANNEXE AU RAPPORT
destinée aux souscripteurs suisses

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

Représentant en Suisse :

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

Agent payeur en Suisse :

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

Clôture annuelle du fonds : 29-déc.

Fortune moyenne du fonds pour la période du 01/07/23 au 28/06/24 : 1 792 107 600,17

Part I **FR0010899179**

Commission de gestion de la direction de l'OPCVM : 0,25 % TTC

Fortune moyenne de la part I pour la période du 01/07/23 au 28/06/24 : 1 661 740 833,30

extrait du compte de résultat

Charges en euro	Rapport semestriel	Rapport annuel	Rapport semestriel
	30/06/2023	29/12/2023	28/06/2024
Commission de la direction de l'OPCVM	1 461 881,05	2 900 252,32	1 537 491,39
Rémunération en fonction de la performance	0,00	0,00	0,00
Commission de la banque dépositaire	0,00	0,00	0,00
Autres charges	0,00	0,00	0,00
Impôts	0,00	0,00	0,00
Total des charges d'exploitation hors bonification	1 461 881,05	2 900 252,32	1 537 491,39
Total des charges d'exploitation avec bonification	1 461 881,05	2 900 252,32	1 537 491,39

TER y compris rémunération en fonction de la performance

$$(((2900252.32-1461881.05)+1537491.39)/1661740833.3)*100$$

TER 0,18 %

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

0,00 %

Swiss Life Funds (F) Bond ESG 6M

Part P

FR0010914358

Commission de gestion de la direction de l'OPCVM : 0,40 % TTC

Fortune moyenne de la part P pour la période du 01/07/23 au 28/06/24 : 130 366 766,87

extrait du compte de résultat

Charges en euro	Rapport semestriel	Rapport annuel	Rapport semestriel
	30/06/2023	29/12/2023	28/06/024
Commission de la direction de l'OPCVM	7 366,29	110 018,62	414 581,52
Rémunération en fonction de la performance	0,00	0,00	0,00
Commission de la banque dépositaire	0,00	0,00	0,00
Autres charges	0,00	0,00	0,00
Impôts	0,00	0,00	0,00
Total des charges d'exploitation hors bonification	7 366,29	110 018,62	414 581,52
Total des charges d'exploitation avec bonification	7 366,29	110 018,62	414 581,52

TER y compris rémunération en fonction de la performance

$$(((110018.62-7366.29)+414581.52)/130366766.87)*100$$

TER 0,40 %

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

0.00 %

Swiss Life Funds (F) Bond ESG 6M

Part F

FR001400LFN8

Commission de gestion de la direction de l'OPCVM : 0,35 % TTC

Fortune moyenne de la part F pour la période du 03/11/23 au 28/06/24 :

2 928 657,93

extrait du compte de résultat

Charges en euro	Rapport semestriel	Rapport annuel	Rapport semestriel
	30/06/2023	29/12/2023	28/06/2024
Commission de la direction de l'OPCVM	0,00	790,69	3 989,95
Rémunération en fonction de la performance	0,00	0,00	0,00
Commission de la banque dépositaire	0,00	0,00	0,00
Autres charges	0,00	0,00	0,00
Impôts	0,00	0,00	0,00
Total des charges d'exploitation hors bonification	0,00	790,69	3 989,95
Total des charges d'exploitation avec bonification	0,00	790,69	3 989,95

TER annualisé du 03/11/23 au 28/06/2024, y compris rémunération en fonction de la performance

$$(((790.69-0)+3989.95)/2928657.93)*1.53*100$$

TER 0,25 %

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

0.00 %

Swiss Life Funds (F) Bond ESG 6M

Part P2

FR001400OWY4

Commission de gestion de la direction de l'OPCVM : 0,40 % TTC

Fortune moyenne de la part P2 pour la période du 30/05/24 au 28/06/24 :

77 798,71

extrait du compte de résultat

Charges en euro	Rapport semestriel	Rapport annuel	Rapport semestriel
	30/06/2023	29/12/2023	28/06/2024
Commission de la direction de l'OPCVM	0,00	0,00	16,48
Rémunération en fonction de la performance	0,00	0,00	0,00
Commission de la banque dépositaire	0,00	0,00	0,00
Autres charges	0,00	0,00	0,00
Impôts	0,00	0,00	0,00
Total des charges d'exploitation hors bonification	0,00	0,00	16,48
Total des charges d'exploitation avec bonification	0,00	0,00	16,48

TER annualisé du 30/05/24 au 28/06/2024, y compris rémunération en fonction de la performance

$$(((0-0)+16.48)/77798.71)*12.17*100$$

TER 0,26 %

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

0.00

 %

Bilan**Actif**

	28.06.2024
Devise	EUR
Immobilisations corporelles nettes	-
Titres financiers	
Actions et valeurs assimilées (A) ⁽¹⁾	-
Négoiciées sur un marché réglementé ou assimilé	-
Non négoiciées sur un marché réglementé ou assimilé	-
Obligations convertibles en actions (B) ⁽¹⁾	-
Négoiciées sur un marché réglementé ou assimilé	-
Non négoiciées sur un marché réglementé ou assimilé	-
Obligations et valeurs assimilées (C) ⁽¹⁾	1 106 099 805,59
Négoiciées sur un marché réglementé ou assimilé	1 086 009 391,70
Non négoiciées sur un marché réglementé ou assimilé	20 090 413,89
Titres de créances (D)	594 427 698,90
Négoiciées sur un marché réglementé ou assimilé	594 427 698,90
Non négoiciées sur un marché réglementé ou assimilé	-
Parts d'OPC et de fonds d'investissements (E)	190 249 976,80
OPCVM	190 249 976,80
FIA et équivalents d'autres Etats membres de l'Union Européenne	-
Autres OPC et fonds d'investissement	-
Dépôts (F)	-
Instruments financiers à terme (G)	3 718 538,93
Opérations temporaires sur titres (H)	-
Créances représentatives de titres financiers reçus en pension	-
Créances représentatives de titres donnés en garantie	-
Créances représentatives de titres financiers prêtés	-
Titres financiers empruntés	-
Titres financiers donnés en pension	-
Autres opérations temporaires	-
Prêts (I)	-
Autres actifs éligibles (J)	-
Sous-total actifs éligibles I = (A + B + C + D + E + F + G + H + I + J)	1 894 496 020,22
Créances et comptes d'ajustement actifs	3 547 741,49
Comptes financiers	92 243 652,92
Sous-total actifs autres que les actifs éligibles II	95 791 394,41
Total Actif I + II	1 990 287 414,63

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

Bilan**Passif**

	28.06.2024
Devise	EUR
Capitaux propres :	
Capital	1 938 038 854,79
Report à nouveau sur revenu net	-
Report à nouveau des plus et moins-values latentes nettes	-
Report à nouveau des plus et moins-values réalisées nettes	0,16
Résultat net de l'exercice	44 555 806,66
Capitaux propres I	1 982 594 661,61
Passifs de financement II ⁽¹⁾	-
Capitaux propres et passifs de financement (I+II) ⁽¹⁾	-
Passifs éligibles :	
Instruments financiers (A)	-
Opérations de cession sur instruments financiers	-
Opérations temporaires sur titres financiers	-
Instruments financiers à terme (B)	3 748 406,59
Emprunts	-
Autres passifs éligibles (C)	-
Sous-total passifs éligibles III = A + B + C	3 748 406,59
Autres passifs :	
Dettes et comptes d'ajustement passifs	3 944 346,43
Concours bancaires	-
Sous-total autres passifs IV	3 944 346,43
Total Passifs: I + II + III + IV	1 990 287 414,63

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

Compte de résultat

	28.06.2024
Devise	EUR
Revenus financiers nets	
Produits sur opérations financières	
Produits sur actions	-
Produits sur obligations	15 616 479,20
Produits sur titres de créance	17 150 810,63
Produits sur des parts d'OPC	-
Produits sur instruments financiers à terme	4 655 013,91
Produits sur opérations temporaires sur titres	-
Produits sur prêts et créances	-
Produits sur autres actifs et passifs éligibles	-
Autres produits financiers	8 759,08
Sous-total Produits sur opérations financières	37 431 062,82
Charges sur opérations financières	
Charges sur opérations financières	-
Charges sur instruments financiers à terme	-2 237 835,00
Charges sur opérations temporaires sur titres	-
Charges sur emprunts	-
Charges sur autres actifs et passifs éligibles	-
Charges sur passifs de financement	-
Autres charges financières	853 180,59
Sous-total charges sur opérations financières	-1 384 654,41
Total Revenus financiers nets (A)	36 046 408,41
Autres produits :	
Frais pris en charge par l'entreprise ⁽¹⁾	-
Rétrocession des frais de gestion au bénéfice de l'OPC	-
Versements en garantie de capital ou de performance	-
Autres produits	-
Autres charges :	
Frais de gestion de la société de gestion	-1 967 614,60
Frais d'audit, d'études des fonds de capital investissement	-
Impôts et taxes	-
Autres charges	-
Sous-total Autres produits et Autres charges (B)	-1 967 614,60
Sous total Revenus nets avant compte de régularisation C = A - B	34 078 793,81
Régularisation des revenus nets de l'exercice (D)	304 166,01

⁽¹⁾ Seulement pour les FCPE.

Compte de résultat (suite)

	28.06.2024
Devise	EUR
Sous-total revenus nets I = C + D	34 382 959,82
Plus ou moins-values réalisées nettes avant compte de régularisations :	
Plus et moins-values réalisées	4 683 859,17
Frais de transactions externes et frais de cession	-5 575,60
Frais de recherche	-
Quote-part des plus-values réalisées restituées aux assureurs	-
Indemnités d'assurance perçues	-
Versements en garantie de capital ou de performance reçus	-
Sous total plus ou moins-values réalisées nettes avant compte de régularisations E	4 678 283,57
Régularisations des plus ou moins-values réalisées nettes F	153 414,64
Plus ou moins-values réalisées nettes II = E + F	4 831 698,21
Plus ou moins-values latentes nettes avant compte de régularisations :	
Variation des plus ou moins-values latentes yc les écarts de change sur les actifs éligibles	5 352 986,93
Écarts de change sur les comptes financiers en devises	1 366,00
Versements en garantie de capital ou de performance à recevoir	-
Quote-part des plus-values latentes à restituer aux assureurs	-
Sous total plus ou moins-values latentes nettes avant compte de régularisation G	5 354 352,93
Régularisations des plus ou moins-values latentes nettes H	-13 204,30
Plus ou moins-values latentes nettes III = G + H	5 341 148,63
Acomptes :	
Acomptes sur revenus nets versés au titre de l'exercice J	-
Acomptes sur plus ou moins-values réalisées nettes versés au titre de l'exercice K	-
Acomptes sur plus ou moins-values latentes nettes versés au titre de l'exercice L ⁽²⁾	-
Total acomptes versés au titre de l'exercice IV = J + K + L	-
Impôt sur le résultat V	-
Résultat net I + II + III -IV -V	44 555 806,66

⁽²⁾ Seulement pour les MMF.

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

FR0010899179	En parts ou actions	En montant
Parts ou actions souscrites durant la période	228 071,574	2 502 585 657,35
Parts ou actions rachetées durant la période	220 013,603	2 416 473 327,68
Solde net des souscriptions/rachats	8 057,971	86 112 329,67

PART P

FR0010914358	En parts ou actions	En montant
Parts ou actions souscrites durant la période	2 908 917,285	311 252 750,14
Parts ou actions rachetées durant la période	281 601,215	30 284 028,11
Solde net des souscriptions/rachats	2 627 316,07	280 968 722,03

PART F

FR001400LFN8	En parts ou actions	En montant
Parts ou actions souscrites durant la période	41 960,214	4 213 587,47
Parts ou actions rachetées durant la période	38 397,400	3 934 965,74
Solde net des souscriptions/rachats	3 562,814	278 621,73

PART P2

FR001400OWY4	En parts ou actions	En montant
Parts ou actions souscrites durant la période	2 541,000	254 553,53
Parts ou actions rachetées durant la période	-	-
Solde net des souscriptions/rachats	2 541,000	254 553,53

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

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

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

fr.swisslife-am.com

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