Swiss Life Index Funds (LUX)

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

Fonds Commun de Placement (FCP) nach Luxemburger Recht R.C.S. Luxemburg K 954

Halbjahresbericht mit ungeprüftem Geschäftsbericht zum 28. Februar 2023

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

Vertriebsbeschränkungen

Einheiten dieses Fonds dürfen nicht in den USA angeboten, verkauft oder vertrieben werden.

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

Inhaltsverzeichnis

Organisation und Verwaltung	1
Allgemeine Informationen zum Fonds	3
Informationen für die Inhaber von Einheiten	4
Nettovermögensaufstellung	5
Statistische Informationen	7
Wertentwicklung	3
Swiss Life Index Funds (LUX) Income (EUR) Anlagenübersicht	Ş
Sektorstruktur und Geographische Verteilung der Anlagen	10
Swiss Life Index Funds (LUX) Balance (EUR)	44
Anlagenübersicht Sektorstruktur und Geographische Verteilung der Anlagen	11 12
	12
Swiss Life Index Funds (LUX) Dynamic (EUR)	4.0
Anlagenübersicht	13
Sektorstruktur und Geographische Verteilung der Anlagen	14
Anmerkungen zum Geschäftsbericht	15
Sonstige Informationen	22

Organisation und Verwaltung

Geschäftssitz

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

Verwaltungsgesellschaft

Eingetragener Sitz:

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

Verwaltungsrat der Verwaltungsgesellschaft

Vorsitzender:

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

Verwaltungsratsmitglieder:

Uwe Druckenmüller Stellvertretender Generaldirektor Swiss Life Asset Managers Luxembourg

Thomas Albert
Geschäftsführender Direktor
Swiss Life Asset Managers Luxembourg

Per Erikson Geschäftsführender Direktor Swiss Life Asset Managers Germany

Thomas Nummer Partner Trinova Group

Leitende Mitarbeiter der Verwaltungsgesellschaft

Thomas Albert
Swiss Life Asset Managers Luxembourg
Großherzogtum Luxemburg

Uwe Druckenmüller Swiss Life Asset Managers Luxembourg Großherzogtum Luxemburg

Jasmin Heitz Swiss Life Asset Managers Luxembourg Großherzogtum Luxemburg Franziska Feitzinger Swiss Life Asset Managers Luxembourg Großherzogtum Luxemburg

Tilo Georg Reichert Swiss Life Asset Managers Luxembourg Großherzogtum Luxemburg

Giedre Plentaite-Bartkiene Swiss Life Asset Managers Luxembourg Großherzogtum Luxemburg

Portfolioverwaltung

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

Verwaltungs- und Registerstelle

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

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

Depot- und Zahlstelle ("Depotstelle")

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

Vertretungs- und Domizilstelle

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

Wirtschaftsprüfer

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

Rechtsbeistand

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

Organisation und Verwaltung (Fortsetzung)

Vertrieb 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 Zeppelinstr. 1, D-85748 Garching, Deutschland

Vertrieb in der Republik Österreich

Zahlstelle:

Erste Bank der österreichischen Sparkassen AG Am Belvedere 1, A-1100, Wien, Österreich

Allgemeine Informationen zum Fonds

Swiss Life Index Funds (LUX) (der "Fonds") wurde am 12. Juni 2008 auf unbestimmte Zeit nach Luxemburger Recht als Fonds Commun de Placement (FCP) gegründet. Der Fonds unterliegt den Bestimmungen von Teil I des geänderten Luxemburger Gesetzes vom 17. Dezember 2010 über Organismen für gemeinsame Anlagen (das "Gesetz von 2010") und wird verwaltet von Swiss Life Asset Managers Luxembourg (die "Verwaltungsgesellschaft"), einer gemäß Kapitel 15 des Gesetzes von 2010 organisierten Aktiengesellschaft ("Société Anonyme").

Die Verwaltungsvorschriften des Fonds wurden im Luxemburger Handelsregister hinterlegt und am 15. Juli 2008 im *Recueil des Sociétés et Associations* ("Mémorial") veröffentlicht.

Die Verwaltungsgesellschaft ist im Luxemburger Handelsregister unter der Nummer B 171.124 eingetragen.

Der Fonds ist als Umbrellafonds eingerichtet und hat zum 28. Februar 2023 eine Anteilklasse pro Teilfonds ausgegeben. Der Verwaltungsrat führt für jeden Teilfonds einen separaten Anlagepool.

Die Vermögenswerte des Teilfonds werden unter Berücksichtigung der im Prospekt beschriebenen Anlagebeschränkungen in die in den Anlagezielen genannten Wertpapiere und Instrumente angelegt. Jeder Teilfonds verfolgt eine unabhängige Anlagepolitik.

Zum 28. Februar 2023 standen 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 Einheiten jedes Teilfonds sind in zwei Klassen unterteilt: Einheiten der Klasse R und Einheiten der Klasse I. Einheiten der Klasse R und Einheiten der Klasse I unterscheiden sich durch das Zielpublikum der Anleger und den Satz der Zeichnungssteuer.

- Anteile der Klasse R stehen allen Anlegern offen.
- Anteile der Klasse I sind beschränkt auf institutionelle Anleger im Sinne von Artikel 174 des geänderten Gesetzes von 2010.

Einheiten aller Klassen können entweder (i) ausschüttende Einheiten sein, bei denen Anspruch auf eine jährliche Dividende besteht und deren Nettoinventarwert sich um den Betrag der erfolgten Ausschüttung reduziert ("ausschüttende Einheiten") oder (ii) thesaurierende Anteile, bei denen kein Anspruch auf eine Dividende besteht, deren Nettoinventarwert sich am Datum der Dividendenzahlung nicht ändert und bei denen sich der Prozentanteil am gesamten Nettoinventarwert, der auf die thesaurierenden Anteile zurückzuführen ist, entsprechend erhöht ("thesaurierende Einheiten").

Zurzeit wird die Klasse R ausgegeben.

Informationen für die Inhaber von Einheiten

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

Das Geschäftsjahr beginnt jedes Jahr am 1. September und endet am 31. August des darauf folgenden Jahres.

Die Liste der Bestandsveränderungen ist am eingetragenen Sitz der Verwaltungsgesellschaft und bei der Vertretung im Ausland erhältlich.

Nettovermögensaufstellung

(in der Währung des Teilfonds)

		Swiss Life Index Funds (LUX) Income (EUR)	Swiss Life Index Funds (LUX) Balance (EUR)	Swiss Life Index Funds (LUX) Dynamic (EUR)
	Anmerkungen	EUR	EUR	EUR
VERMÖGENSWERTE				
Wertpapierbestand zu Einstandspreisen		127 492 307	110 099 578	46 177 330
Nicht realisierter Nettogewinn/ (-verlust)		(6 439 249)	(2 586 232)	633 289
Wertpapierbestand zum Marktwert	2.3	121 053 058	107 513 346	46 810 619
Bareinlagen bei Banken	7	13 038 782	18 717 793	7 790 610
Forderungen für ausgegebene Fondseinheiten		11 237	3 122	705
Forderungen aus Dividenden, netto		4 598	5 335	4 189
Nicht realisierter Gewinn aus Finanztermingeschäften	2.4, 6	1 442 776	2 271 072	1 389 018
Sonstige Aktiva		209	233	203
		135 550 660	128 510 901	55 995 344
VERBINDLICHKEITEN				
Verbindlichkeiten für zurückgenommene Fondseinheiten		12 272	5 006	-
Verbindlichkeiten aus Managementgebühren	3	292 308	295 632	137 042
Verbindlichkeiten aus Depotgebühren	4	16 485	15 267	6 387
Verbindlichkeiten aus der "Taxe d'abonnement"	5	5 778	6 923	3 721
Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühren	4	20 877	19 676	12 326
Fällige Gebühren der Registerstelle	4	10 018	6 204	4 287
Verbindlichkeiten aus Honoraren		35 370	35 174	35 174
Nicht realisierter Verlust aus Finanztermingeschäften	2.4, 6	60 034	64 704	25 565
		453 142	448 586	224 502
GESAMTVERMÖGEN		135 097 518	128 062 315	55 770 842

Nettovermögensaufstellung (Fortsetzung)

(in der Währung des Teilfonds)

		Konsolidiert
	Anmerkungen	EUR
VERMÖGENSWERTE		
Wertpapierbestand zu Einstandspreisen		283 769 215
Nicht realisierter Nettogewinn/ (-verlust)		(8 392 192)
Wertpapierbestand zum Marktwert	2.3	275 377 023
Bareinlagen bei Banken	7	39 547 185
Forderungen für ausgegebene Fondseinheiten		15 064
Forderungen aus Dividenden, netto		14 122
Nicht realisierter Gewinn aus Finanztermingeschäften	2.4, 6	5 102 866
Sonstige Aktiva		645
		320 056 905
VERBINDLICHKEITEN		
Verbindlichkeiten für zurückgenommene Fondseinheiten		17 278
Verbindlichkeiten aus Managementgebühren	3	724 982
Verbindlichkeiten aus Depotgebühren	4	38 139
Verbindlichkeiten aus der "Taxe d'abonnement"	5	16 422
Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühren	4	52 879
Fällige Gebühren der Registerstelle	4	20 509
Verbindlichkeiten aus Honoraren		105 718
Nicht realisierter Verlust aus Finanztermingeschäften	2.4, 6	150 303
		1 126 230
GESAMTVERMÖGEN		318 930 675

Statistische Informationen

Swiss Life Index Funds (LUX) Income (EUR)

	Währung	28/02/23	31/08/22	31/08/21
R-Einheiten - Thesaurierung				
Anzahl der Einheiten Nettoinventarwert pro Einheit	EUR	910 016.069 148.46	901 482.896 151.88	886 546.651 174.21
Gesamtvermögen	EUR	135 097 518	136 916 275	154 442 075

Swiss Life Index Funds (LUX) Balance (EUR)

	Währung	28/02/23	31/08/22	31/08/21
R-Einheiten - Thesaurierung				
Anzahl der Einheiten Nettoinventarwert pro Einheit	EUR	744 753.908 171.95	734 954.247 170.82	720 088.099 192.56
Gesamtvermögen	EUR	128 062 315	125 545 298	138 663 686

Swiss Life Index Funds (LUX) Dynamic (EUR)

	Währung	28/02/23	31/08/22	31/08/21
R-Einheiten - Thesaurierung				
Anzahl der Einheiten		279 722.011	272 850.819	262 077.024
Nettoinventarwert pro Einheit	EUR	199.38	192.83	213.64
Gesamtvermögen	EUR	55 770 842	52 612 825	55 990 551

Wertentwicklung

Swiss Life Index Funds (LUX) Income (EUR)

	<u> </u>			
	Währung	28/02/23	31/08/22	31/08/21
R-Einheiten - Thesaurierung				
Wertentwicklung	EUR	(2.25%)	(12.82%)	7.11%
Swiss Life Index Funds (LUX) Balanc	e (EUR)			
	Währung	28/02/23	31/08/22	31/08/21
R-Einheiten - Thesaurierung				
Wertentwicklung	EUR	0.66%	(11.29%)	12.70%
Swiss Life Index Funds (LUX) Dynam	ic (EUR)			
	Währung	28/02/23	31/08/22	31/08/21
R-Einheiten - Thesaurierung				
Wertentwicklung	EUR	3.40%	(-9.74%)	18.49%

Die historische Performance ist kein Indikator für die laufende oder zukünftige Performance.

Die Performancedaten berücksichtigen keine etwaigen erhobenen Provisionen und Kosten bei Ausgabe und Rücknahme der Einheiten.

Die Performancedaten wurden nicht geprüft.

Die Teilfonds haben keinen Vergleichsindex, sodass die Wertentwicklung der Teilfonds nicht mit einem Benchmark verglichen werden kann.

Swiss Life Index Funds (LUX) Income (EUR)

Anlagenübersicht

Nominal wert/ Menge	Bezeichnung	Kurs Währung	Kosten EUR	Marktwert EUR	% des Nettovermögens
Investmentfond	5				
Offe	ne Investmentfonds				
37 000	AMUNDI ETF CASH 0-6 MONTHS EUROMTS INVESTMENT GRADE UCITS	EUR	4 472 866	4 277 940	3.17
111 039	AMUNDI GOVT BOND EUROMTS BROAD INVESTMENT GRADE UCITS ETF - C	EUR	25 757 313	22 445 690	16.61
331	BNP PARIBAS ASSET MANAGEMENT FRANCE - BNP PARIBAS MONEY 3M SICAV - I	EUR	7 667 365	7 620 944	5.64
84 200	ISHARES EDGE MSCI EUROPE MINIMUM VOLATILITY UCITS ETF	EUR	4 178 954	4 359 034	3.23
27 035	ISHARES EDGE S&P 500 MINIMUM VOLATILITY UCITS ETF - C	USD	1 047 399	1 886 969	1.40
71 000	ISHARES EUR GOVT BOND 3-5YR UCITS ETF	EUR	11 883 845	10 995 060	8.14
8 000	ISHARES EURO GOVERNMENT BOND 15-30YR UCITS ETF	EUR	2 234 886	1 396 480	1.03
40 000	ISHARES MSCI EM UCITS ETF USD	USD	1 361 200	1 414 050	1.05
868.02	LOMBARD ODIER SHORT-TERM MONEY MARKET - IC	USD	8 217	9 401	0.0
31 250	LYXOR EURO GOVERNMENT BOND DR UCITS ETF	EUR	5 158 712	4 881 459	3.6
570	SWISS LIFE FUND (F) MONEY MARKET EURO - I	EUR	14 260 193	14 152 171	10.48
55 000	VANGUARD FTSE 100 UCITS ETF - D	GBP	1 959 130	2 166 533	1.60
98 500	VANGUARD S&P 500 UCITS ETF	EUR	4 206 152	7 019 800	5.20
114 129	XTRACKERS II EUROZONE GOVERNMENT BOND UCITS ETF - C	EUR	26 091 461	23 143 079	17.12
72 700	XTRACKERS II EUROZONE GOVERNMENT BOND 5-7 UCITS ETF - C	EUR	17 204 614	15 284 448	11.3
Gesa	amtsumme offene Investmentfonds		127 492 307	121 053 058	89.60
Gesamtsumme	der Investmentfonds		127 492 307	121 053 058	89.60
Gesamtsumme	der Anlagen		127 492 307	121 053 058	89.60

Swiss Life Index Funds (LUX) Income (EUR)

Sektorstruktur und geographische Verteilung der Anlagen

Sektorstruktur	%
Investmentfonds	89.60
	89.60

Geographische Verteilung	%
Luxemburg	48.68
Irland	21.64
Frankreich	19.28
	89.60

Swiss Life Index Funds (LUX) Balance (EUR)

Anlagenübersicht

Nominal wert/ Menge	Bezeichnung	Kurs Währung	Kosten EUR	Marktwert EUR	% des Nettovermögens
estmentfonds	3				
Offe	ne Investimentfonds				
99 600	AMUNDI GOVT BOND EUROMTS BROAD INVESTMENT GRADE UCITS ETF - C	EUR	22 909 278	20 133 383	15.72
370	BNP PARIBAS ASSET MANAGEMENT FRANCE - BNP PARIBAS MONEY 3M SICAV - I	EUR	8 573 849	8 518 880	6.6
137 550	ISHARES EDGE MSCI EUROPE MINIMUM VOLATILITY UCITS ETF	EUR	6 895 693	7 120 964	5.5
37 580	ISHARES EDGE S&P 500 MINIMUM VOLATILITY UCITS ETF - C	USD	1 512 154	2 622 981	2.0
45 000	ISHARES EUR GOVT BOND 3-5YR UCITS ETF	EUR	7 532 015	6 968 700	5.4
3 000	ISHARES EURO GOVERNMENT BOND 15-30YR UCITS ETF	EUR	838 082	523 680	0.4
60 000	ISHARES MSCI EM UCITS ETF USD	USD	2 041 800	2 121 075	1.6
860	SWISS LIFE FUND (F) MONEY MARKET EURO - I	EUR	21 419 876	21 352 399	16.6
93 850	VANGUARD FTSE 100 UCITS ETF - D	GBP	3 362 387	3 696 894	2.89
134 600	VANGUARD S&P 500 UCITS ETF	EUR	6 275 180	9 592 538	7.49
75 680	XTRACKERS II EUROZONE GOVERNMENT BOND UCITS ETF - C	EUR	17 799 852	15 346 390	11.9
45 260	XTRACKERS II EUROZONE GOVERNMENT BOND 5-7 UCITS ETF - C	EUR	10 939 412	9 515 462	7.43
Gesa	amtsumme offene Investimentfonds		110 099 578	107 513 346	83.9
amtsumme (der Investimentfonds		110 099 578	107 513 346	83.9
amtsumme (der Anlagen		110 099 578	107 513 346	83.95

Swiss Life Index Funds (LUX) Balance (EUR)

Sektorstruktur und geographische Verteilung der Anlagen

Sektorstruktur	%
Investmentfonds	83.95
	83.95

Geographische Verteilung	%
Luxemburg	35.13
Irland	25.49
Frankreich	23.33
	83.95

Swiss Life Index Funds (LUX) Dynamic (EUR)

Anlagenübersicht

Nominal wert/ Menge	Bezeichnung	Kurs Währung	Kosten EUR	Marktwert EUR	% des Nettovermögens
nvestmentfonds	3	<u>, </u>			
Offe	ne Investimentfonds				
7 000	AMUNDI ETF CASH 0-6 MONTHS EUROMTS INVESTMENT GRADE UCITS	EUR	845 027	809 340	1.45
20 500	AMUNDI GOVT BOND EUROMTS BROAD INVESTMENT GRADE UCITS ETF - C	EUR	4 840 462	4 143 919	7.43
353	BNP PARIBAS ASSET MANAGEMENT FRANCE - BNP PARIBAS MONEY 3M SICAV - I	EUR	8 124 579	8 127 472	14.57
5 395	INVESCO MARKETS PLC- S&P 500 UCITS ETF	USD	2 985 035	3 890 912	6.98
82 850	ISHARES EDGE MSCI EUROPE MINIMUM VOLATILITY UCITS ETF	EUR	4 159 332	4 289 145	7.69
19 618	ISHARES EDGE S&P 500 MINIMUM VOLATILITY UCITS ETF - C	USD	783 390	1 369 283	2.46
11 000	ISHARES EUR GOVT BOND 3-5YR UCITS ETF	EUR	1 841 159	1 703 460	3.05
1 000	ISHARES EURO GOVERNMENT BOND 15-30YR UCITS ETF	EUR	279 361	174 560	0.3
35 000	ISHARES MSCI EM UCITS ETF USD	USD	1 191 050	1 237 294	2.22
360	SWISS LIFE FUND (F) MONEY MARKET EURO - I	EUR	8 964 190	8 938 213	16.02
56 586	VANGUARD FTSE 100 UCITS ETF - D	GBP	2 037 942	2 229 008	4.00
41 000	VANGUARD S&P 500 UCITS ETF	EUR	2 037 367	2 921 947	5.24
18 757	XTRACKERS II EUROZONE GOVERNMENT BOND UCITS ETF - C	EUR	4 423 611	3 803 544	6.82
15 090	XTRACKERS II EUROZONE GOVERNMENT BOND 5-7 UCITS ETF - C	EUR	3 664 825	3 172 522	5.69
Gesa	amtsumme offene Investimentfonds		46 177 330	46 810 619	83.93
esamtsumme (der Investimentfonds		46 177 330	46 810 619	83.93
esamtsumme (der Anlagen		46 177 330	46 810 619	83.93

Swiss Life Index Funds (LUX) Dynamic (EUR)

Sektorstruktur und geographische Verteilung der Anlagen

Sektorstruktur	%
Investmentfonds	83.93
	83.93

Geographische Verteilung	%
Frankreich	32.05
Irland	31.94
Luxemburg	19.94

Anmerkungen zum Geschäftsbericht

1 - Allgemeines

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

Hauptziel des Fonds ist die aktive Verwaltung verschiedener Portfolios zugunsten der Inhaber von Einheiten gemäß der jeweiligen Anlagestrategie der einzelnen Teilfonds.

Im Rahmen der Einschränkungen des geänderten Gesetzes von 2010 kann der Fonds in ein breites Spektrum aus Wertpapieren investieren.

Der Verwaltungsrat der Verwaltungsgesellschaft legt die Anlageziele und die Anlagepolitik der einzelnen Teilfonds fest, die in den Datenblättern beschrieben werden, und ist verantwortlich für die Anwendung dieser Richtlinien.

Zum 28. Februar 2023 waren 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 28. Februar 2023 hat der Fonds die folgenden Anteilklassen in den folgenden Teilfonds ausgegeben:

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

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

Dieser Teilfonds nutzt internationale Diversifizierungschancen und investiert nach Abzug liquider Vermögenserte mindestens zwei Drittel seines Nettovermögens in Aktien- und Anleiheindexprodukte durch die Anlage über OGAW und/oder OGA (darunter Indexfonds ("ETF")) oder Derivate. Bis zu einem Drittel seines Nettovermögens kann in Vermögenswerte angelegt werden, die im Einklang mit den dargelegten Bestimmungen stehen. Anlagen des Teilfonds in anderen OGA dürfen die im Prospekt dargelegten Höchstgrenzen auf keinen Fall überschreiten.

Darüber hinaus und zusätzlich zur oben genannten Vorschrift muss mindestens 51% des Nettovermögens des Gesamtportfolios des Teilfonds direkt oder indirekt in Geldmarktinstrumente, Anleihen, Papiere oder ähnliche fest oder variabel verzinsliche Schuldtitel angelegt werden.

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

Dieser Teilfonds nutzt internationale Diversifizierungschancen und investiert nach Abzug liquider Vermögenserte mindestens zwei Drittel seines Nettovermögens in Aktien- und Anleiheindexprodukte durch die Anlage über OGAW und/oder OGA (darunter Indexfonds ("ETF")) oder Derivate. Bis zu einem Drittel seines Nettovermögens kann in andere Vermögenswerte angelegt werden, die im Einklang mit den dargelegten Bestimmungen stehen. Anlagen des Teilfonds in anderen OGA dürfen die im Prospekt dargelegten Höchstgrenzen auf keinen Fall überschreiten.

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

Dieser Teilfonds nutzt internationale Diversifizierungschancen und investiert nach Abzug liquider Vermögenserte mindestens zwei Drittel seines Nettovermögens in Aktien- und Anleiheindexprodukte durch die Anlage über OGAW und/oder OGA (darunter Indexfonds ("ETF")) oder Derivate. Bis zu einem Drittel seines Nettovermögens kann in andere Vermögenswerte angelegt werden, die im Einklang mit den dargelegten Bestimmungen stehen. Anlagen des Teilfonds in anderen OGA dürfen die im Prospekt dargelegten Höchstgrenzen auf keinen Fall überschreiten.

2 - Wichtige Grundsätze der Rechnungslegung

2.1 Präsentation des Geschäftsberichts

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

2.2 Berechnung des Nettoinventarwerts

Der Nettoinventarwert (NIW) pro Einheit wird zum Bewertungstag auf Grundlage der Schlusskurse des vorangegangenen Werktags ermittelt, indem das dem entsprechenden Teilfonds zuzuschreibende Nettovermögen an diesem Bewertungstag, also der Anteil der Vermögenswerte abzüglich des Anteil der Verbindlichkeiten, die diesem Teilfonds zuzuschreiben sind, geteilt wird durch die Anzahl der dann ausstehenden Einheiten, gemäß den weiter unten dargelegten Bewertungsregeln. Der NIW pro Einheit kann nach dem Ermessen der Verwaltungsgesellschaft auf die nächste Stelle der entsprechenden Währung auf- oder abgerundet werden.

2.3 Bewertungsgrundsätze

- 2.3.1 Wertpapiere, darunter Finanzanlagen ("Derivate"), die an einem geregelten Markt oder einem anderen geregelten Markt gehandelt werden, werden auf Grundlage des letzten verfügbaren Schlusskurses am vorangegangenen Werktag bewertet oder zum Durchschnittspreis der Wertpapiere (der Durchschnitt aus dem letzten verfügbaren Angebotspreis und Briefkurs) am entsprechenden Wertpapiermarkt, an dem die Vermögenswerte des Fonds am Bewertungstag notiert oder gehandelt werden, es sei denn, dieser Preis gibt den Marktwert der jeweiligen Vermögenswerte nicht wieder. Wenn ein Wertpapier an verschiedenen geregelten Märkten notiert oder gehandelt wird, wird es auf Grundlage des letzten verfügbaren Kurses am entsprechenden Markt bewertet, der in der Regel der hauptsächliche Markt dieses Vermögenswertes ist.
- 2.3.2 Sollten Vermögenswerte des Fonds am Bewertungstag nicht an einem geregelten Markt oder an einem anderen geregelten Markt notiert oder gehandelt werden oder nicht börsennotiert sein oder wenn der gemäß Abschnitt (2.3.1) oder (2.3.4) bis (2.3.7) ermittelte Wert börsennotierter oder an einem anderen geregelten Markt gehandelter Wertpapiere nicht deren Verkehrswert wiedergibt, dann muss ihr Wert auf Grundlage des angemessen voraussehbaren Verkaufspreises ermittelt werden, der umsichtig und in gutem Glauben vom Verwaltungsrat der Gesellschaft bestimmt wird.
- 2.3.3 Geldmarktinstrumente werden auf linearer Grundlage über einen Zeitraum vom Kauf bis zur Fälligkeit bewertet und andere liquide Vermögenswerte werden zu ihrem Nominalwert zzgl. angefallener Zinsen bewertet.
- 2.3.4 Einheiten oder Anteile offener OGAW und/oder anderer OGA werden zum letzten festgestellten und verfügbaren Nettoinventarwert bewertet. Sollte dieser Preis nicht repräsentativ für den Verkehrswert der Vermögenswerte sein, so wird der Preis durch den Verwaltungsrat der Verwaltungsgesellschaft auf fairer und gerechter Grundlage ermittelt.

Einheiten oder Anteile geschlossener OGA werden zu ihrem letzten verfügbaren Börsenwert bewertet.

- 2.3.5 Devisentermin- und Optionsgeschäfte werden grundsätzlich zu den letzten verfügbaren Markt- oder Händlerpreisen bewertet. Wenn der Bewertungstag eines Optionsgeschäfts gleichzeitig dessen Abrechnungszeitpunkt ist, werden die jeweiligen Optionsgeschäfte zum entsprechenden Abrechnungspreis bewertet.
- 2.3.6 Der Liquidationswert von nicht an geregelten Märkten, an Börsen in anderen Staaten oder an anderen geregelten Märkten gehandelten Future-, Termin- oder Optionskontrakten muss bedeuten, dass deren Nettoliquidationswert gemäß den vom Verwaltungsrat der Verwaltungsgesellschaft aufgestellten Richtlinien auf einer Basis bestimmt wird, die in einem konsistenten Verhältnis zu allen anderen Arten von Kontrakten steht. Der Liquidationswert von an geregelten Märkten, an Börsen in anderen Staaten oder an anderen geregelten Märkten gehandelten Future-, Termin- oder Optionskontrakten muss auf den letzten verfügbaren Abrechnungspreisen dieser Kontrakte an geregelten Märkten, an Börsen in anderen Staaten oder an anderen geregelten Märkten basieren, an denen diese Future-, Termin- oder Optionskontrakte gehandelt werden; wenn ein Future-, Termin- oder Optionskontrakt nicht an dem Tag liquidiert werden konnte, in Bezug auf den das Nettovermögen bestimmt wurde, gilt als Grundlage für die Bestimmung des Liquidationswerts eines solchen Kontrakts der Wert, den der Verwaltungsrat der Verwaltungsgesellschaft als fair und angemessen betrachtet.
- 2.3.7 Nicht offiziell an einem geregelten Markt oder an einem anderen geregelten Markt notierte oder gehandelte Finanzinstrumente ("Derivate") werden nach allgemein anerkannten und von einem Wirtschaftsprüfer verifizierbaren Bewertungsregeln bewertet.
- 2.3.8 Alle anderen Wertpapiere und Vermögenswerte werden zum Verkehrswert bewertet, der vom Verwaltungsrat der Verwaltungsgesellschaft bestimmt wird.

2.4 Bewertung von Termingeschäften

Nicht realisierte Gewinne oder Verluste werden in der Nettovermögensaufstellung unter "Nicht realisierte Gewinne/Verluste aus Finanztermingeschäften" erfasst.

2.5 Bewertung von Devisentermingeschäften

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

2.6 Realisierter Nettogewinn/ (-verlust) aus dem Verkauf von Wertpapieren

Realisierte Gewinne oder Verluste aus dem Verkauf von Wertpapieren werden auf Grundlage der Durchschnittspreise der verkauften Wertpapiere berechnet.

2.7 Umrechnung ausländischer Währungen

Bankkonten, sonstige Nettovermögenswerte und die Bewertung von Wertpapieranlagen, die in anderen Währungen lauten als die Bilanzierungswährung der unterschiedlichen Teilfonds, werden zu den Devisenmittelkassakursen am Bewertungsdatum umgerechnet. Erträge und Aufwendungen, die in anderen Währungen lauten als die Währung der unterschiedlichen Teilfonds, werden zu den Devisenmittelkassakursen am Zahlungsdatum umgerechnet. Preise von Wertpapieren, die in anderen Währungen lauten als die Bilanzierungswährung der unterschiedlichen Teilfonds, werden zum maßgeblichen Devisenmittelkassakurs am Tag des Erwerbs umgerechnet.

2.8 Bilanzierung von Portfoliotransaktionen der Wertpapiere

Portfoliotransaktionen der Wertpapiere werden zum Bankwerktag nach dem Transaktionsdatum bilanziert.

2.9 Forderungen für verkaufte Wertpapiere, Verbindlichkeiten für erworbene Wertpapiere

Der Posten "Forderungen aus verkauften Wertpapieren" kann Forderungen aus Fremdwährungsgeschäften enthalten. Der Posten "Verbindlichkeiten aus erworbenen Wertpapieren" kann Verbindlichkeiten aus Fremdwährungsgeschäften enthalten.

2.10 Erfassung von Erträgen

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

2.11 Wertpapierleihgeschäfte

Der Fonds kann Wertpapierleihgeschäfte tätigen, wenn dies mit den für OGA geltenden Regeln im Einklang steht:

Der Fonds kann Wertpapiere entweder direkt oder über ein standardisiertes Leihsystem verleihen oder ausleihen, das von einer anerkannten Clearingstelle betrieben wird oder von einem Finanzinstitut, das auf diese Art von Geschäfte spezialisiert ist und vernünftigen aufsichtsrechtlichen Bestimmungen unterliegt, die von der CSSF als gleichwertig mit dem Gemeinschaftsrecht angesehen werden.

Bei Leihgeschäften muss der Fonds für die Laufzeit der Vereinbarung jederzeit eine Sicherheit in Höhe von mindestens 90% der globalen Bewertung der beliehenen Wertpapiere erhalten.

2.12 Pensionsgeschäfte

Der Fonds kann Pensionsgeschäfte abschließen. Diese bestehen aus dem Kauf und Verkauf von Wertpapieren unter Einschluss einer Klausel, die den Verkäufer zum Rückkauf der Wertpapiere vom Käufer berechtigt bzw. verpflichtet, zum Preis und zu den Bedingungen, die beide Partien vertraglich vereinbaren.

Der Fonds kann bei Pensionsgeschäften oder mehreren aufeinanderfolgenden Pensionsgeschäften als Käufer oder Verkäufer auftreten.

2.13 Forderungen und Verbindlichkeiten aus Kassadevisen

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

3 - Managementgebühren und Anlageverwaltungsgebühren

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

Die Managementgebühr ist rückwirkend für jedes Quartal zu zahlen und wird an jedem Bewertungstag als Prozentanteil des NIW auf Grundlage des NIW des Teilfonds ermittelt.

Zum 28. Februar 2023 gelten für die Verwaltungsgebühr folgende Sätze:

Teilfonds	Anteilsklasse	Jährliche Verwaltungsgebühr
Swiss Life Index Funds (LUX) Income (EUR)	R-Anteile - Thesaurierend	1.30%
Swiss Life Index Funds (LUX) Balance (EUR)	R-Anteile - Thesaurierend	1.40%
Swiss Life Index Funds (LUX) Dynamic (EUR)	R-Anteile - Thesaurierend	1.50%

4 - Gebühren der Depot- und Verwaltungsstelle

Die Depot- und Verwaltungsstelle ist zum Erhalt einer Gebühr berechtigt. Sie wird berechnet als Prozentanteil am jeweiligen durchschnittlichen Gesamtnettoinventarwert der Teilfonds im betreffenden Monat. Die Gebühr wird monatlich aus dem Fondsvermögen gezahlt. Zum 28. Februar 2023 gilt für Depotgebühren (einschließlich der Gebühren für Unterdepotstellen) ein Satz von 0.00986 %.

Die Verwaltungsstelle ist zum Erhalt einer Gebühr berechtigt. Sie wird berechnet als Prozentanteil am durchschnittlichen Gesamtnettoinventarwert der Teilfonds. Die Gebühr wird monatlich aus dem Fondsvermögen gezahlt. Zum 28. Februar 2023 gilt für Verwaltungsgebühren ein effektiver Satz von 0.0174 %.

5 - Besteuerung

Gemäß geltendem Recht unterliegt der Fonds in Luxemburg einer *taxe d'abonnement* von 0.05 %. Für institutionelle Teilfonds oder Klassen liegt dieser Satz allerdings bei jährlich 0.01 %. Jeder Teilfonds des Fonds unterliegt einer *taxe d'abonnement* von 0.01 %, die vierteljährlich auf Grundlage des Nettovermögens des entsprechenden Teilfonds berechnet wird und am Ende des betreffenden Quartals zu zahlen ist. Diese Steuer wird vierteljährlich auf Grundlage des Nettovermögens des entsprechenden Teilfonds berechnet und ist am Ende des betreffenden Quartals zu zahlen.

Anteile der Klasse "R", die allen Anlegern offensteht, unterliegen einer *taxe d'abonnement* von jährlich 0.05 % der Nettovermögenswerte, die am Ende des betreffenden Quartals berechnet wird und zu zahlen ist.

Anteile der Klasse "I", die institutionellen Anlegern vorbehalten ist, unterliegen einer taxe d'abonnement von jährlich 0.01 % der Nettovermögenswerte, die am Ende des betreffenden Quartals berechnet wird und zu zahlen ist.

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

6 - Finanztermingeschäfte

Zum 28. Februar 2023 wiesen die Teilfonds die nachstehend detailliert aufgeführten Positionen aus Terminkontrakten auf: In Anmerkung 7 finden Sie genauere Informationen zu den Sicherheiten.

Alle Termingeschäfte werden mit der Maklergesellschaft SOCIETE GENERALE gehalten.

Swiss Life Index Funds (LUX) Income (EUR)

Währungs- vertrag	Einzelheiten	Fälligkeit	Anzahl der gekauften Verträge	Anzahl der verkauften Kontrakte	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) EUR
USD	US LONG BOND	Jun-23	70	-	(33 003)
USD	US 10 YR NOTE FUTURE	Jun-23	70	-	(4 641)
EUR	EURO STOXX 50	Mar-23	463	-	1 435 299
JPY	NIKKEI 225 OSE	Mar-23	8	-	(13 457)
USD	S&P 500 EMINI	Mar-23	9	-	(8 932)
CAD	S&P/TSE 60 IX FUT	Mar-23	11	-	7 476
					1 382 742

Swiss Life Index Funds (LUX) Balance (EUR)

Währungs- vertrag	Einzelheiten	Fälligkeit	Anzahl der gekauften Verträge	Anzahl der verkauften Kontrakte	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) EUR
USD	US LONG BOND	Jun-23	42	-	(19 802)
USD	US 10 YR NOTE FUTURE	Jun-23	45	-	(2 984)
EUR	EURO STOXX 50	Mar-23	728	-	2 256 801
JPY	NIKKEI 225 OSE	Mar-23	12	-	(20 186)
USD	S&P 500 EMINI	Mar-23	21	-	(21 733)
CAD	S&P/TSE 60 IX FUT	Mar-23	21	-	14 272
					2 206 368

Swiss Life Index Funds (LUX) Dynamic (EUR)

Währungs- vertrag	Einzelheiten	Fälligkeit	Anzahl der gekauften Verträge	Anzahl der verkauften Kontrakte	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) EUR
USD	US LONG BOND	Jun-23	10	-	(4 715)
USD	US 10 YR NOTE FUTURE	Jun-23	12	-	(796)
EUR	EURO STOXX 50	Mar-23	445	-	1 379 500
JPY	NIKKEI 225 OSE	Mar-23	7	-	(11 775)
USD	S&P 500 EMINI	Mar-23	8	-	(8 279)
CAD	S&P/TSE 60 IX FUT	Mar-23	14	-	9 518
					1 363 453

7 - Wechselkurse

Folgende Wechselkurse wurden für die Erstellung dieses Geschäftsberichts verwendet:

1 EUR =	1.44380	CAD	1 EUR =	0.87595	GBP
1 FUR =	144.45600	JPY	1 EUR =	1.06050	USD

8 - Wertpapierleihgeschäfte

Zum 28. Februar 2023 waren alle Wertpapierleihgeschäfte durch Wertpapiere besichert, die an einer EU-Börse notiert sind.

Die beliehenen Wertpapiere hatten folgenden Marktwert:

Teilfond	Marktwert der ausgeliehener Wertpapiere (EUR)
Swiss Life Index Funds (LUX) Income (EUR)	3 119 580
Swiss Life Index Funds (LUX) Balance (EUR)	4 753 743
Swiss Life Index Funds (LUX) Dynamic (EUR)	2 545 384

Die Gegenpartei und die Leihstelle für Wertpapierbeleihungen ist SOCEIETE GENERALE (FRANCE).

Im Folgenden wird der Betrag unbarer Sicherheiten für Aktienleihgeschäfte aufgeführt:

Swiss Life Index Funds (LUX) Income (EUR)

Art des			Erhalte	ener Sicherheitsbetrag (in der Währung des
Instruments	Name des Emittenten	Rating	Währung	Teilfonds)
Aktien	CONTINENTAL AG	-	EUR	154 677
Aktien	KERING	-	EUR	67 929
Aktien	ORANGE	-	EUR	1 246 574
Anleihe	TOTAL 2.50PCT 03/2026	A+	EUR	1 792 220
Aktien	WORLDLINE SA	-	EUR	28 525
				3 289 925

Swiss Life Index Funds (LUX) Balance (EUR)

Art des			Erha	Itener Sicherheitsbetrag (in der Währung des
Instruments	Name des Emittenten	Rating	Währung	` Teilfonds)
Aktien	CONTINENTAL AG	-	EUR	134 063
Aktien	KERING	-	EUR	3 121 945
Aktien	PROSUS NV	-	EUR	80 033
Aktien	PORSCHE AUTOMOBIL HLDG SE	-	EUR	9 765
Aktien	SAFRAN SA	-	EUR	1 483 360
Aktien	VINCI SA	-	EUR	167 394
				4 996 560

Swiss Life Index Funds (LUX) Dynamic (EUR)

Art des				Erhaltener Sicherheitsbetrag (in der Währung des
Instruments	Name des Emittenten	Rating	Währung	Teilfonds)
Aktien	Henkel AG AND Co KGaA	-	EUR	2 697 712
				2 697 712

Für den zum 28. Februar 2023 abgeschlossenen Zeitraum wurden vom Fonds folgende Erträge aus Wertpapierbeleihungen erzielt:

		Direkte und indirekte Kosten und Gebühren, die		
Teilfonds	Währung	Gesamtbruttobetrag der Erträge aus Wertpapierbeleihungen (in der Währung des Teilfonds)	von Bruttoerträgen aus Wertpapierbeleihungen abgezogen werden (in der Währung des Teilfonds)	Gesamtnettobetrag der Erträge aus Wertpapierbeleihungen (in der Währung des Teilfonds)
Swiss Life Index Funds (LUX) Income (EUR)	EUR	11 605	1 741	9 864
Swiss Life Index Funds (LUX) Balance (EUR)	EUR	12 527	1 879	10 648
Swiss Life Index Funds (LUX) Dynamic (EUR)	EUR	9 756	1 463	8 293

Der Unterschied zwischen dem Netto- und dem Bruttobetrag wird durch die Gewinnbeteiligung, die hier genau angegeben wird, erklärt:

- 85% für den Teilfonds;
- 15% für Société Générale.

Sonstige Informationen

1 - Verordnung über Wertpapierfinanzierungsgeschäfte

Wertpapierleihgeschäfte

Im Zuge der 2015/ 2365 des Europäischen Parlaments und des Rates vom 25. November 2015 über die Transparenz von Wertpapierfinanzierungsgeschäften unterlagen dieser Verordnung im am 28. Februar 2023 zu Ende gegangenen Zeitraum nur Wertpapierleihgeschäfte:

	Swiss Life Index Funds (LUX) Income (EUR)	Swiss Life Index Funds (LUX) Balance (EUR)	Swiss Life Index Funds (LUX) Dynamic (EUR)
Betrag der Wertpapierleihgeschäfte, in absoluten Beträgen (in der Währung des Teilfonds) Währung des Teilfonds	Siehe Anmerkung 9	Siehe Anmerkung 9	Siehe Anmerkung 9
Anteil der gesamten beleihbaren Vermögenswerte*	2.58%	4.42%	5.44%
Anteil des verwalteten Vermögens	2.31%	3.71%	4.56%
Laufzeit der Wertpapierbeleihungen aufgeschlüsselt nach folgenden Laufzeitbändern			
Weniger als ein Tag	-	-	-
Ein Tag bis eine Woche	-	-	-
Eine Woche bis ein Monat	-	-	-
Ein bis drei Monate	-	-	-
Drei Monate bis ein Jahr	-	-	-
Mehr als ein Jahr	1 792 220	-	-
Offene Laufzeit	Siehe Anmerkung 9	Siehe Anmerkung 9	Siehe Anmerkung 9
Gegenpartei			
Name der Gegenpartei	Société Générale	Société Générale	Société Générale
Land des Sitzes der Gegenpartei	Frankreich	Frankreich	Frankreich
Bruttovolumen ausstehender Transaktionen	Siehe Anmerkung 9	Siehe Anmerkung 9	Siehe Anmerkung 9
Angaben zu den Sicherheiten			
Art der Sicherheiten			
Bargeldanlagen			
Wertpapiere	Siehe Anmerkung 9	Siehe Anmerkung 9	Siehe Anmerkung 9
Qualität der Sicherheiten			
Emittent	Siehe Anmerkung 9	Siehe Anmerkung 9	Siehe Anmerkung 9
Rating	Siehe Anmerkung 9	Siehe Anmerkung 9	Siehe Anmerkung 9
Laufzeit der Sicherheit aufgeschlüsselt			
folgenden Laufzeitbändern			
Weniger als ein Tag	-	-	-
Ein Tag bis eine Woche	-	-	-
Eine Woche bis ein Monat	-	-	-
Ein bis drei Monate	-	-	-
Drei Monate bis ein Jahr	-	-	-
Mehr als ein Jahr	-	-	-
Offene Laufzeit	Siehe Anmerkung 9	Siehe Anmerkung 9	Siehe Anmerkung 9
Angaben zu Rendite und Kosten der Wertpapierbeleihungen	Siehe Anmerkung 9	Siehe Anmerkung 9	Siehe Anmerkung 9
Verwahrung der vom Fonds im Rahmen von			
Wertpapierbeleihungen erhaltenen Sicherheit	0 :/// 0/ / :	0 :/// 0/ / :	0 :/// 0/ / :
Name der Depotstelle	Société Générale	Société Générale	Société Générale
Wertpapiere	Siehe Anmerkung 9	Siehe Anmerkung 9	Siehe Anmerkung 9
Bargeldanlagen	-	-	-

Alle Transaktionen sind zweiseitige Transaktionen.

Sicherheiten für Wertpapierleihgeschäfte werden nicht wiederverwendet.

^{*} Der Anteil der gesamten beleihbaren Vermögenswerte bildet den Marktwert der beliehenen Wertpapiere / den Marktwert des Portfolios des Teilfonds ab.

Sonstige Informationen (Fortsetzung)

Teilfond	Währung	Zehn größte Emittenten von Sicherheiten für alle Wertpapierfinanzierungsgeschäfte und Total Return Swaps	Beträge der als Sicherheiten erhaltenen Wertpapiere und Rohstoffe Erhaltene
Swiss Life Index Funds (LUX) Income (EUR)	EUR	CONTINENTAL AG	154 677
	EUR	KERING	67 929
	EUR	ORANGE	1 246 574
	EUR	TOTAL 2.50PCT 03/2026	1 792 220
	EUR	WORLDLINE SA	28 525
Swiss Life Index Funds (LUX) Balance (EUR)	EUR	CONTINENTAL AG	134 063
	EUR	KERING	3 121 945
	EUR	PROSUS NV	80 033
	EUR	PORSCHE AUTOMOBIL HLDG SE	9 765
	EUR	SAFRAN SA	1 483 360
	EUR	VINCI SA	167 394
Swiss Life Index Funds (LUX) Dynamic (EUR)	EUR	Henkel AG AND Co KGaA	2 697 712

