

Swiss Life Funds (CH)

Swiss Life Funds (CH) – Portfolio Global Income (CHF)
Swiss Life Funds (CH) – Portfolio Global Balanced (CHF)

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

Halbjahresbericht per 30. Juni 2026

Ungeprüfter Halbjahresbericht per 30. Juni 2026

Inhaltsverzeichnis	Seite	ISIN
Organisation	3	
Swiss Life Funds (CH)		
– Portfolio Global Income (CHF)	5	AM Cap/ CH1328734525 F Cap/ CH0469808114 R Dis ¹ / CH0007294892
Swiss Life Funds (CH)		
– Portfolio Global Balanced (CHF)	12	R Dis ¹ / CH0007294918

¹ ehemals: A1

Verkaufsrestriktionen

Bei der Ausgabe und Rücknahme von Anteilen von Teilvermögen dieses Umbrella-Fonds im Ausland kommen die dort geltenden Bestimmungen zur Anwendung.

- a) Für folgende Länder liegt eine Bewilligung für die Vertriebstätigkeit vor: - Schweiz
- b) Anteile von Teilvermögen dieses Umbrella-Fonds dürfen US-Personen weder angeboten, verkauft noch ausgeliefert werden.

US-Person bedeutet:

- (i) ein US-amerikanischer Staatsbürger (inklusive doppelter oder mehrfacher Staatsbürgerschaft);
- (ii) eine in den USA wohnhafte Person (Resident Alien, der eine Green Card besitzt oder den «Substantial Presence Test» besteht);
- (iii) eine Personengesellschaft oder eine Gesellschaft in den USA oder unter US-Recht oder dem Recht eines US-Bundesstaates;
- (iv) einen Nachlass eines Erblassers, der US-Staatsbürger oder in den USA wohnhaft ist;
- (v) einen Trust, wenn (x) ein US-Gericht gemäss geltendem Gesetz Anordnungen oder Urteile bezüglich wesentlicher Aspekte der Trust-Verwaltung treffen kann und (y) eine oder mehrere US-Personen die Befugnis haben, die wesentlichen Entscheidungen des Trusts zu kontrollieren;
- (vi) eine Person, die dem US-amerikanischen Steuerrecht aus anderen Gründen unterliegt (u. a. doppelter Wohnsitz, Ehepartner mit gemeinsamer Einreichung, Verzicht auf US-Staatsbürgerschaft oder langfristige, dauerhafte Niederlassung in den USA).

Dieser Absatz und die hier verwendeten Begriffe sind in Übereinstimmung mit dem US Internal Revenue Code auszulegen.

Die Fondsleitung und die Depotbank können gegenüber natürlichen oder juristischen Personen in bestimmten Ländern und Gebieten den Verkauf, die Vermittlung oder Übertragung von Anteilen untersagen oder beschränken.

Internetadresse

www.swisslife-am.com

Organisation

Fondsleitung

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

Christoph Gisler

Bereichsleiter Infrastructure Equity, mit Verwaltungsratsmandaten innerhalb der Swiss Life-Gruppe

Philipp Menzi

Bereichsleiter Operations

Verwaltungsrat

Präsident

Per Erikson

Group Chief Investment Officer und Mitglied der Konzernleitung der Swiss Life-Gruppe, mit Verwaltungsratsmandaten innerhalb der Swiss Life-Gruppe.

Mitglieder

Pascal Kistler

Head Legal & Compliance Swiss Life Asset Managers, Swiss Life Investment Management Holding AG

Beat Kunz

mit einer Mitgliedschaft in einem Anlageausschuss einer Swiss Life-Stiftung, stellvertretender Leiter des Anlageausschusses der Personalvorsorgekasse der Stadt Bern und Mitglied des Anlageausschusses der Atupri Gesundheitsversicherung

Dr. Rolf Aeberli

Head Corporate Mandates Swiss Life AG, mit Verwaltungsratsmandaten innerhalb der Swiss Life-Gruppe, Präsident des Verwaltungsrates der First Swiss Mobility 2022-1 AG, der First Swiss Mobility 2023-1 AG, der First Swiss Mobility 2023-2 AG und der RWA Consulting AG sowie Mitglied des Verwaltungsrates der Zwei Wealth Experts AG

Geschäftsleitung

Robin van Berkel

CEO, mit Verwaltungsratsmandaten innerhalb der Swiss Life-Gruppe

Daniel Berner

Stellvertretender CEO, Bereichsleiter Securities, Mitglied des Verwaltungsrates der Swiss Credit Partners AG

Paolo di Stefano

Bereichsleiter Real Estate, mit Verwaltungsratsmandaten innerhalb der Swiss Life-Gruppe

Mark Fehlmann

Bereichsleiter Sales & Marketing, mit einem Verwaltungsratsmandat innerhalb der Swiss Life-Gruppe

Depotbank

UBS Switzerland AG, Zürich
Bahnhofstrasse 45
8001 Zürich

Prüfgesellschaft

PricewaterhouseCoopers AG
Birchstrasse 160
8050 Zürich

Übertragung der Fondsadministration

Folgende Teilaufgaben sind an die UBS Fund Management (Switzerland) AG, Aeschenvorstadt 1, 4051 Basel, übertragen: Buchhaltung, Steuern, Berechnung von Vergütungen, NAV-Berechnung, Kursinformationen, Kontrolle der Einhaltung der reglementarischen Anlagerichtlinien und Erstellen von Halbjahres- und Jahresberichten. Die UBS Fund Management (Switzerland) AG ist als Fondsleitung von Wertschriften-, Spezial- und Immobilienfonds seit ihrer Gründung im Jahre 1959 im Fondsgeschäft tätig und bietet Dienstleistungen im administrativen Bereich für Kollektivanlagen an.

Die genaue Ausführung des Auftrages regelt ein zwischen der Fondsleitung Swiss Life Asset Management AG und der UBS Fund Management (Switzerland) AG abgeschlossener Vertrag.

Weiterdelegation

Die Administration des Anlagefonds, insbesondere Führung der Buchhaltung, Berechnung der Nettoinventarwerte, Steuerabrechnungen, Betrieb der IT-Systeme sowie Erstellung der Rechenschaftsberichte, ist an Northern Trust Global Services SE, Leudelange, Luxembourg, Zweigniederlassung Basel, weiterdelegiert. Die genaue Ausführung dieser Arbeiten ist in einem zwischen UBS Fund Management (Switzerland) AG und Northern Trust Global Services SE, Leudelange, Luxembourg, Zweigniederlassung Basel abgeschlossenen Vertrag geregelt.

Übertragung weiterer Teilaufgaben

Die interne Revision ist an das Konzernrevisorat der Swiss Life-Gruppe übertragen. Weitere Teilaufgaben im Bereich Legal & Compliance und Risk Management sind an die Swiss Life Investment Management Holding AG übertragen. IT-Infrastrukturdienstleistungen, Applikationsentwicklung und -betrieb sowie IT- Risk Management und IT-Security sind an die Swiss Life Investment Management Holding AG übertragen. Die Beauftragten zeichnen sich durch ihre langjährige Erfahrung in den übertragenen Bereichen aus. Die genaue Ausführung der Aufträge regeln zwischen der Fondsleitung Swiss Life Asset Management AG und den Beauftragten abgeschlossene Verträge.

Zahlstelle

UBS Switzerland AG
Bahnhofstrasse 45
8001 Zürich

Swiss Life Funds (CH)

– Portfolio Global Income (CHF)

Art übrige Fonds für traditionelle Anlagen

Wichtigste Daten

	ISIN	30.6.2026	31.12.2025	31.12.2024
Nettofondsvermögen in CHF		274 707 046.15	269 760 391.67	300 726 615.91
Klasse AM Cap	CH1328734525			¹
Nettoinventarwert pro Anteil in CHF		110.46	107.17	103.38
Ausgabe- und Rücknahmepreis pro Anteil in CHF ²		110.44	107.17	103.38
Anzahl Anteile im Umlauf		50 000.0000	50 000.0000	250 000.0000
Klasse F Cap	CH0469808114			
Nettoinventarwert pro Anteil in CHF		112.07	108.84	105.07
Ausgabe- und Rücknahmepreis pro Anteil in CHF ²		112.05	108.84	105.07
Anzahl Anteile im Umlauf		1 294 736.0000	1 300 876.0000	1 448 658.0000
Klasse R Dis³	CH0007294892			
Nettoinventarwert pro Anteil in CHF		115.11	112.69	109.81
Ausgabe- und Rücknahmepreis pro Anteil in CHF ²		115.09	112.69	109.81
Anzahl Anteile im Umlauf		1 077 914.9490	1 089 915.7020	1 117 159.4580

¹ Siehe Ergänzende Angaben

² Erstemission per 12.3.2024

³ ehemals: A1

Struktur des Wertpapierportfolios (ungeprüft)

Die 10 grössten Positionen in % des Gesamtfondsvermögens	
Swiss Life iFunds (CH) Bond Global Government + (CHF hedged)	17.77
Swiss Life iFunds (CH) Equity Switzerland	10.42
Invesco MSCI USA UCITS ETF	7.73
Swiss Life Funds (LUX) Bond Emerging Mrkt Corp-Am-CHF HDG-Cap	7.72
Swiss Life iFunds (CH) Bond Global Corporates	7.01
Swiss Life iFunds (CH) Bond CHF Domestic	6.34
Swiss Life iFunds (CH) Equity Small & Mid Cap	4.13
Swiss Life iFunds (CH) Bond Swiss Francs Foreign	4.11
Swiss Life Flex Funds (CH)-Dynamic Allocation (CHF hedged) I Dis	3.08
Swiss Life Funds (LUX) Bond Global High Yield-Am-CHF Hedged-Cap	3.04
Übrige	24.22
Total	95.57

Obige Prozentsätze können Rundungsdifferenzen enthalten.

Vermögensrechnung

	30.6.2026	31.12.2025
	CHF	CHF
Verkehrswerte		
Bankguthaben		
– auf Sicht	10 656 132.32	24 008 833.14
Effekten		
– Anteile anderer kollektiver Kapitalanlagen	263 274 522.28	245 568 418.50
Derivative Finanzinstrumente	199 070.47	370 754.52
Sonstige Vermögenswerte	1 337 270.94	610 634.67
Gesamtfondsvermögen	275 466 996.01	270 558 640.83
Kurzfristige Bankverbindlichkeiten	-237 903.84	-265 649.16
Andere Verbindlichkeiten	-522 046.02	-532 600.00
Nettofondsvermögen	274 707 046.15	269 760 391.67

Erfolgsrechnung

	1.1.2026-30.6.2026	1.1.2025-31.12.2025
	CHF	CHF
Ertrag		
Erträge der Bankguthaben	420 105.35	563 224.15
Negativzinsen	-23 968.44	-36 409.33
Ertrag aus Reverse Repos	0.00	7 869.44
Erträge der Effekten		
– aus Anteilen anderer kollektiver Kapitalanlagen	3 577 090.15	5 595 039.18
Erträge der Effektenleihe	4 824.10	38 969.83
Einkauf in laufende Nettoerträge bei der Ausgabe von Anteilen	209 999.72	266 264.90
Total Ertrag	4 188 050.88	6 434 958.17
Aufwand		
Passivzinsen	-187.87	-730.02
Prüfaufwand	0.00	-14 263.80
Reglementarische Kommissionsvergütung an die Fondsleitung Klasse AM Cap	0.00	0.00
Reglementarische Kommissionsvergütung an die Fondsleitung Klasse F Cap	-423 922.04	-889 476.13
Reglementarische Kommissionsvergütung an die Fondsleitung Klasse R Dis ¹	-606 099.20	-1 219 119.35
Reglementarische Kommissionsvergütung an die Depotbank ²	-19 288.67	-29 496.65
Sonstige Aufwendungen	-1 817.10	-1 380.20
Ausrichtung laufender Nettoerträge bei der Rücknahme von Anteilen	-229 627.77	-780 490.09
Total Aufwand	-1 280 942.65	-2 934 956.24
Nettoertrag	2 907 108.23	3 500 001.93
Realisierte Kapitalgewinne und -verluste	4 507 012.69	5 524 199.41
Realisierter Erfolg	7 414 120.92	9 024 201.34
Nicht realisierte Kapitalgewinne und -verluste	1 639 328.62	1 667 010.70
Gesamterfolg	9 053 449.54	10 691 212.04

¹ ehemals: A1

² Enthält die Depotbankkommission von jährlich CHF 10 750.00

Veränderung des Nettofondsvermögens

	1.1.2026-30.6.2026	1.1.2025-31.12.2025
	CHF	CHF
Nettofondsvermögen zu Beginn des Rechnungsjahres	269 760 391.67	300 726 615.91
Ordentliche Jahresausschüttung	-1 342 631.33	-1 163 032.11
Abgeführte Verrechnungssteuer	-761 795.39	-913 418.07
Saldo aus dem Anteilverkehr	-2 002 368.34	-39 580 986.10
Gesamterfolg	9 053 449.54	10 691 212.04
Nettofondsvermögen am Ende der Berichtsperiode	274 707 046.15	269 760 391.67

Entwicklung der Anteile im Umlauf

	1.1.2026-30.6.2026	1.1.2025-31.12.2025
	Anzahl	Anzahl
Klasse AM Cap		
Bestand Anfang Rechnungsjahr	50 000.0000	250 000.0000
Ausgegebene Anteile	0.0000	0.0000
Zurückgenommene Anteile	0.0000	-200 000.0000
Bestand Ende Berichtsperiode	50 000.0000	50 000.0000
Differenz zwischen den ausgegebenen und zurückgenommenen Anteilen	0.0000	-200 000.0000
Klasse F Cap		
Bestand Anfang Rechnungsjahr	1 300 876.0000	1 448 658.0000
Ausgegebene Anteile	148 731.0000	221 436.0000
Zurückgenommene Anteile	-154 871.0000	-369 218.0000
Bestand Ende Berichtsperiode	1 294 736.0000	1 300 876.0000
Differenz zwischen den ausgegebenen und zurückgenommenen Anteilen	-6 140.0000	-147 782.0000
Klasse R Dis¹		
Bestand Anfang Rechnungsjahr	1 089 915.7020	1 117 159.4580
Ausgegebene Anteile	17 479.4030	28 324.6430
Zurückgenommene Anteile	-29 480.1560	-55 568.3990
Bestand Ende Berichtsperiode	1 077 914.9490	1 089 915.7020
Differenz zwischen den ausgegebenen und zurückgenommenen Anteilen	-12 000.7530	-27 243.7560

¹ ehemals: A1

Inventar des Fondsvermögens

Titel		31.12.2025 Anzahl/ Nominal	Käufe ¹	Verkäufe ²	30.6.2026 Anzahl/ Nominal	Verkehrswert ³ in CHF	in % ³	Davon ausgeliehen Anzahl/Nominal
Effekten, die an einer Börse gehandelt werden								
Investmentzertifikate, open end								
Asien ohne Japan								
MULTI UNITS LUX-AMUNDI MSCI PAC EX JAPAN UCITS ETF-SHS -DIST*	USD	15 000			15 000	1 436 482	0.52	
Total Asien ohne Japan						1 436 482	0.52	
China								
ISHARES MSCI CHINA USD ACC-CAPITALISATION*	USD	50 000			50 000	212 310	0.08	36 825
Total China						212 310	0.08	
Europa								
ISHARES MSCI EUROPE CONSUMER DISCRETIONARY SEC UCITS ETF-ACC*	EUR	250 000		250 000				
SSGA SPDR MSCI EUROPE UTILITIES UCITS ACCUM - ETF*	EUR	30 000		8 000	22 000	5 387 836	1.96	
Total Europa						5 387 836	1.96	
Global								
ISHARES MSCI ACWI UCITS-ETF-USD*	USD	20 000		15 000	5 000	487 580	0.18	
SPDR BLOOMBERG GLOBAL AGGRE BD UCITS ETF- ACCUM SHS HEDG CHF*	CHF	5 000			5 000	136 300	0.05	
STATE STREET GLOBAL TREASURY BOND - SHS -I CHF HEDGED- CAP*	CHF	350 000		350 000				
SWISSCANTO CH GOLD ETF-ANTEILE -EA (CHF)-DISTRIBUTIVE*	CHF		7 500		7 500	7 234 500	2.63	
Total Global						7 858 380	2.85	
Schweiz								
IMMOFONDS SCHWEIZ IMMOBILIEN-ANLAGEFONDS*	CHF	3 743			3 743	2 567 698	0.93	
ROTH RE SWISS-A*	CHF		13 000		13 000	2 207 400	0.80	
SCHRODER IMMOPLUS*	CHF	6 161		6 161				
SOLVALOR 61 FONDS DE PLACEMENT IMMOBILIER*	CHF		3 624		3 624	1 359 000	0.49	
SWISS LIFE REF CH ESG SWISS PROPERTIES-ANTEILE*	CHF	13 933			13 933	2 056 511	0.75	
SWISSCANTO (CH) REAL ESTATE FUND IFCA*	CHF	6 494			6 494	1 386 469	0.50	
UBS (CH) PROP FUND - SWISS RESIDENTIAL 'ANFOS'*	CHF	26 382			26 382	2 701 517	0.98	
UBS (CH) PROP FUND - SWISS MIXED 'SIMA'*	CHF	49 712			49 712	7 784 899	2.83	
UBS (CH) PROP FUND - SWISS COMMERCIAL 'SWISSREAL'*	CHF	12 092		12 092				
UBS (CH) PROPERTY FUND-SWISS RESIDENTIAL SIAT-ANTEILE*	CHF	10 364			10 364	2 658 366	0.97	
UBS (CH) PROPERTY FUND - DIRECT LIVINGPLUS-ANTEILE*	CHF	20 162			20 162	2 979 944	1.08	
UBS (CH) PROPERTY FUND - DIRECT MIXED URBAN-ANTEILE*	CHF	19 444			19 444	3 009 931	1.09	
Total Schweiz						28 711 735	10.42	
Vereinigte Staaten von Amerika								
INVECO MSCI USA UCITS ETF-ACCUM SHS USD*	USD		120 000		120 000	21 282 008	7.73	
Total Vereinigte Staaten von Amerika						21 282 008	7.73	
Total Investmentzertifikate, open end						64 888 751	23.56	
Total Effekten, die an einer Börse gehandelt werden						64 888 751	23.56	
Effekten, die nicht an einer Börse oder einem andern geregelten Markt gehandelt werden								
Investmentzertifikate, open end								
Global								
JPMORGAN GLOBAL RESEARCH ENHANCED INDEX EQUITY-ACCUM SHS USD**	USD	18 000		18 000				
LO FUNDS - SHORT-TERM MONEY MARKET USD-SHS -N- CAP**	USD	447 000		447 000				
PARAMETRIC ALTER-MORGAN STANLEY ALPHA TRK UCITS FD-A-ACC-CHF**	CHF	27 985			27 985	2 930 310	1.06	
PICTET CH-SHORT-TERM MONEY MARKET USD-UNITS -I DY-**	USD	9 000		2 000	7 000	6 311 827	2.29	
SWISS LIFE FLEX FUNDS CH-DYNAMIC ALLOCATION (CHF HGD) I DIS**	CHF	9 200		1 500	7 700	8 475 313	3.08	
SWISS LIFE FUNDS (CH) MONEY MARKET SWISS FRANCS A CAP**	CHF	110 500	40 000	85 000	65 500	6 683 031	2.43	
SWISS LIFE FUNDS LUX-BOND EMERGING MRKT CORP-AM-CHF HDG-CAP**	CHF	1 060	1 100		2 160	21 260 189	7.72	
SWISS LIFE FUNDS LUX-BD GLOBAL HIGH YIELD-AM-CHF HEDGED-CAP**	CHF	490	250		740	8 379 775	3.04	
SWISS LIFE IFUNDS (CH) BOND SWISS FRANCS FOREIGN CHF-IA**	CHF	10 200	1 000		11 200	11 329 136	4.11	
SWISS LIFE IFUNDS (CH)-BOND GLOBAL CORPORATES (CHF)**	CHF	30 300	2 000	7 000	25 300	19 310 225	7.01	
SWISS LIFE IFUNDS CH BOND GLOBAL GOVT-CHF HDG-I-A1-DIS**	CHF	64 800	3 000		67 800	48 954 990	17.77	
SWISS LIFE IFUNDS CH BOND GLOBAL CORP ST CHF HDG-I-A1-DIST**	CHF	10 000	8 000	10 000	8 000	5 906 240	2.14	
SYZ AM CH LIQUIDITY MANAGEMENT-CHF-I3-DISTRIBUTION**	CHF	1 500			1 500	1 315 095	0.48	
Total Global						140 856 130	51.13	
Schweiz								
SWISS LIFE IFUNDS CH-EQUITY SMALL & MID CAP-I-A1-DIS**	CHF	3 950			3 950	11 367 192	4.13	
SWISS LIFE IFUNDS CH BOND-CHF DOMESTIC-I-A1-DIS**	CHF	20 200	1 000	5 000	16 200	17 457 606	6.34	
SWISS LIFE IFUNDS CH EQUITY SWITZERLAND CHF-L-A1**	CHF	12 450			12 450	28 704 844	10.41	
Total Schweiz						57 529 641	20.87	
Total Investmentzertifikate, open end						198 385 771	72.01	
Total Effekten, die nicht an einer Börse oder einem andern geregelten Markt gehandelt werden						198 385 771	72.01	
Total Wertschriften (davon ausgeliehen)						263 274 522 5 565 951	95.57 2.02)	
Bankguthaben auf Sicht						10 656 132	3.87	
Derivative Finanzinstrumente						199 070	0.07	
Sonstige Vermögenswerte						1 337 272	0.49	
Gesamtfondsvermögen						275 466 996	100.00	
Kurzfristige Bankverbindlichkeiten						-237 904		
Andere Verbindlichkeiten						-522 046		
Nettofondsvermögen						274 707 046		

Bewertungskategorie	Verkehrswert per 30.6.2026	in % des Gesamt- fondsvermögens ³
Anlagen bewertet zu den Kursen, die am Hauptmarkt bezahlt werden	65 087 821	23.63
Anlagen bewertet aufgrund von am Markt beobachtbaren Parametern	198 385 771	72.01
Anlagen bewertet mit geeigneten Bewertungsmodellen unter Berücksichtigung der aktuellen Marktgegebenheiten	–	–
Total	263 473 592	95.64

¹ «Käufe» umfassen die Transaktionen: Gratistitel / Käufe / Konversionen / Namensänderungen / «Splits» / Stock-/Wahldividenden / Titelaufteilungen / Überträge / Umbuchungen infolge Redenominierung in Euro / Umtausch zwischen Gesellschaften / Zuteilung aus Bezugs-/Optionsrechten / Zuteilung von Bezugsrechten ab Basistiteln / Sacheinlagen

² «Verkäufe» umfassen die Transaktionen: Auslosungen / Ausbuchung infolge Verfall / Ausübung von Bezugs-/Optionsrechten / «Reverse splits» / Rückzahlungen / Überträge / Umbuchungen infolge Redenominierung in Euro / Umtausch zwischen Gesellschaften / Verkäufe / Sachauslagen

³ Allfällige Abweichungen in den Totalisierungen sind auf Rundungsdifferenzen zurückzuführen

* bewertet zu den Kursen, die am Hauptmarkt bezahlt werden (Art. 88 Abs. 1 KAG)

** bewertet aufgrund von am Markt beobachtbaren Parametern

Derivative Finanzinstrumente

Gemäss KKV-FINMA Art. 23

Am Ende der Berichtsperiode offene engagementerhöhende Derivate

Instrument	Anzahl Kontrakte	Währung	Deckung in CHF	Variation Margin in CHF	In % des Vermögens
Futures auf Indices/Commodities/Währungen					
EURO STOXX 50 INDEX FUTURE 18.09.26*	40	EUR	2 344 710	24 532	0.01
SWISS MARKET INDEX FUTURE 18.09.26*	28	CHF	3 980 760	119 336	0.04
FTSE 100 INDEX FUTURE 18.09.26*	3	GBP	338 580	-128	0.00
NIKKEI 225 (OSE) INDEX FUTURE 10.09.26*	5	JPY	1 741 848	137 755	0.05
S&P500 EMINI FUTURE 18.09.26*	24	USD	7 306 555	47 043	0.02
MINI MSCI EMERGING MARKETS INDEX FUTURE 18.09.26*	100	USD	7 087 631	-129 468	-0.05
			22 800 084	199 070	0.07

Obige Angaben können Rundungsdifferenzen enthalten.

* bewertet zu den Kursen, die am Hauptmarkt bezahlt werden (Art. 88 Abs. 1 KAG)

Während der Berichtsperiode getätigte engagementerhöhende Derivate

Instrument	Währung	Käufe/ Kontrakte	Verkäufe/ Kontrakte
Futures auf Indices/Commodities/Währungen			
EURO STOXX 50 INDEX FUTURE 18.09.26	EUR	70	30
SWISS MARKET INDEX FUTURE 18.09.26	CHF	38	10
EURO STOXX 50 INDEX FUTURE 20.03.26	EUR	40	80
SWISS MARKET INDEX FUTURE 20.03.26	CHF	20	68
EURO STOXX 50 INDEX FUTURE 19.06.26	EUR	100	100
SWISS MARKET INDEX FUTURE 19.06.26	CHF	73	73
FTSE 100 INDEX FUTURE 20.03.26	GBP	0	15
FTSE 100 INDEX FUTURE 19.06.26	GBP	3	3
FTSE 100 INDEX FUTURE 18.09.26	GBP	3	0
S&P500 EMINI FUTURE 20.03.26	USD	12	98
NASDAQ 100 E-MINI FUTURE 20.03.26	USD	0	10
NIKKEI 225 (OSE) INDEX FUTURE 13.03.26	JPY	0	15
MINI MSCI EMERGING MARKETS INDEX FUTURE 20.03.26	USD	0	100
S&P500 EMINI FUTURE 18.06.26	USD	98	98
NIKKEI 225 (OSE) INDEX FUTURE 11.06.26	JPY	10	10
MINI MSCI EMERGING MARKETS INDEX FUTURE 19.06.26	USD	100	100
NIKKEI 225 (OSE) INDEX FUTURE 10.09.26	JPY	5	0
S&P500 EMINI FUTURE 18.09.26	USD	28	4
MINI MSCI EMERGING MARKETS INDEX FUTURE 18.09.26	USD	100	0

Ergänzende Angaben

Derivative Finanzinstrumente

Risikomessverfahren Commitment-Ansatz II:
Art. 35ff KKV-FINMA

Position	Betrag in CHF	in % des Nettofonds- vermögens
Brutto Gesamtengagement aus Derivaten	22 800 083.74	8.30%
Netto Gesamtengagement aus Derivaten	–	–
Engagement aus Effektenleihe und Pensionsgeschäften	–	–

Pensionsgeschäfte

Per Bilanzstichtag waren keine Effekten in Pension gegeben.

Vergütung an die Fondsleitung

Verwaltungskommission

- Effektiv erhobene Verwaltungskommission:
 - Klasse AM Cap: 0.00% p.a.;
 - Klasse F Cap: 0.60% p.a.;
 - Klasse R Dis¹: 1.00% p.a.;
- Maximale erhobene Verwaltungskommission für alle Klassen gemäss Fondsvertrag: 2.00% p.a.;
- Effektiv erhobene Depotbankkommission für alle Klassen: 0.006375% p.a.;
- Maximale erhobene Depotbankkommission für alle Klassen gemäss Fondsvertrag: 0.25% p.a.

Die Verwaltungskommission der Zielfonds, in die das Vermögen der Teilvermögen investiert wird, darf unter Berücksichtigung von allfälligen Retrozessionen und Rabatten maximal 3% betragen. Die maximale effektive Verwaltungskommission der Zielfonds beträgt 0.77%.

Gebührenteilungsvereinbarungen («commission sharing agreements») und geldwerte Vorteile («soft commissions»)

Die Fondsleitung hat keine Gebührenteilungsvereinbarungen («commission sharing agreements») geschlossen. Die Fondsleitung hat keine Vereinbarungen bezüglich so genannten «soft commissions» geschlossen.

¹ ehemals: A1

Total Expense Ratio (TER)

Diese Kennziffer wurde gemäss der «Richtlinie zur Berechnung und Offenlegung der Total Expense Ratio (TER) von kollektiven Kapitalanlagen» der Asset Management Association Switzerland (AMAS) in der aktuell gültigen Fassung berechnet und drückt die Gesamtheit derjenigen Kommissionen und Kosten, die laufend dem Fondsvermögen belastet werden (Betriebsaufwand), retrospektiv in einem %-Satz des Fondsvermögens aus.

TER für die letzten 12 Monate:

Klasse AM Cap:	0.02%
Klasse F Cap:	0.62%
Klasse R Dis ¹ :	1.02%

Zusammengesetzte TER für die letzten 12 Monate:

Klasse AM Cap:	0.26%
Klasse F Cap:	0.86%
Klasse R Dis ¹ :	1.26%

¹ ehemals: A1

Ausgabe- und Rücknahmepreis

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

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

Umrechnungskurse

CAD 1 = CHF 0.568564	HKD 1 = CHF 0.102862
EUR 1 = CHF 0.922243	JPY 1 = CHF 0.004963
GBP 1 = CHF 1.070626	USD 1 = CHF 0.806650

Swiss Life Funds (CH)

– Portfolio Global Balanced (CHF)

Art übrige Fonds für traditionelle Anlagen

Wichtigste Daten

	ISIN	30.6.2026	31.12.2025	31.12.2024
Nettofondsvermögen in CHF		308 882 585.83	309 353 133.75	346 231 885.26
Klasse F Cap	CH1137234295		¹	
Nettoinventarwert pro Anteil in CHF		N/A	N/A	98.23
Ausgabe- und Rücknahmepreis pro Anteil in CHF ²		N/A	N/A	98.23
Anzahl Anteile im Umlauf		0.0000	0.0000	221 253.0000
Klasse R Dis³	CH0007294918			
Nettoinventarwert pro Anteil in CHF		137.09	132.32	128.02
Ausgabe- und Rücknahmepreis pro Anteil in CHF ²		137.06	132.32	128.02
Anzahl Anteile im Umlauf		2 253 180.5950	2 337 954.8280	2 534 803.7330

¹ Im Umlauf bis am 6.11.2025

² Siehe Ergänzende Angaben

³ ehemals: A1

Struktur des Wertpapierportfolios (ungeprüft)

Die 10 grössten Positionen in % des Gesamtfondsvermögens	
Swiss Life iFunds (CH) Equity Switzerland	17.74
Invesco MSCI USA UCITS ETF Acc	10.30
Swiss Life iFunds (CH) Bond Global Government + (CHF hedged)	8.08
Swiss Life Funds (LUX) - Bond Emerging Mrkt Corp	7.78
Swiss Life iFunds (CH) Bond CHF Domestic	5.74
Swiss Life iFunds (CH) Equity Small & Mid Cap	4.74
Swiss Life iFunds (CH) Bond Global Corporates	3.89
JPMorgan US Research Enhanced Index Equity ESG UCITS ETF	3.54
Pictet CH - Short - Term Money Market USD	3.20
Swiss Life Flex Funds (CH) - Dynamic Allocation (CHF hedged) I	3.02
Übrige	26.37
Total	94.40

Obige Prozentsätze können Rundungsdifferenzen enthalten.

Vermögensrechnung

	30.6.2026	31.12.2025
	CHF	CHF
Verkehrswerte		
Bankguthaben		
– auf Sicht	15 860 399.18	30 047 948.38
Effekten		
– Anteile anderer kollektiver Kapitalanlagen	292 602 552.79	279 266 406.02
Derivative Finanzinstrumente	183 762.66	451 839.32
Sonstige Vermögenswerte	1 296 159.03	1 039 900.23
Gesamtfondsvermögen	309 942 873.66	310 806 093.95
Kurzfristige Bankverbindlichkeiten	-110 755.23	-455 976.40
Andere Verbindlichkeiten	-949 532.60	-996 983.80
Nettofondsvermögen	308 882 585.83	309 353 133.75

Erfolgsrechnung

	1.1.2026-30.6.2026	1.1.2025-31.12.2025
	CHF	CHF
Ertrag		
Erträge der Bankguthaben	223 535.84	1 133 147.77
Negativzinsen	-32 580.52	-58 189.00
Ertrag aus Reverse Repos	0.00	6 054.40
Erträge der Effekten		
– aus Anteilen anderer kollektiver Kapitalanlagen	3 524 469.70	6 631 668.11
Ausgleichszahlungen aus Securities Lending	348.00	3 240.00
Erträge der Effektenleihe	22 748.76	24 396.23
Einkauf in laufende Nettoerträge bei der Ausgabe von Anteilen	22 093.61	74 708.25
Total Ertrag	3 760 615.39	7 815 025.76
Aufwand		
Passivzinsen	-206.36	-1 266.82
Prüfaufwand	0.00	-14 263.80
Reglementarische Kommissionsvergütung an die Fondsleitung Klasse F Cap	0.00	-126 999.18
Reglementarische Kommissionsvergütung an die Fondsleitung Klasse R Dis ¹	-1 886 830.26	-3 917 960.59
Reglementarische Kommissionsvergütung an die Depotbank ²	-20 372.79	-31 888.28
Steuerrechtliche Anpassung aufgrund von Erträgen aus Zielfonds Klasse R Dis ^{1/3}	0.00	144 929.16
Sonstige Aufwendungen	-1 768.05	-1 380.20
Ausrichtung laufender Nettoerträge bei der Rücknahme von Anteilen	-106 851.31	-431 752.16
Total Aufwand	-2 016 028.77	-4 380 581.87
Nettoertrag	1 744 586.62	3 434 443.89
Realisierte Kapitalgewinne und -verluste	5 557 062.62	13 782 070.73
Steuerrechtliche Anpassung aufgrund von Erträgen aus Zielfonds Klasse R Dis ^{1/3}	0.00	-144 929.16
Realisierter Erfolg	7 301 649.24	17 071 585.46
Nicht realisierte Kapitalgewinne und -verluste	6 721 789.13	-2 240 024.44
Gesamterfolg	14 023 438.37	14 831 561.02

¹ ehemals: A1

² Enthält die Depotbankkommission von jährlich CHF 10 750.00

³ gemäss ESTV Kreisschreiben Nr. 24 vom 20.11.2017 Ziffer 2.8.3

Veränderung des Nettofondsvermögens

	1.1.2026-30.6.2026	1.1.2025-31.12.2025
	CHF	CHF
Nettofondsvermögen zu Beginn des Rechnungsjahres	309 353 133.75	346 231 885.26
Ordentliche Jahresausschüttung	-3 291 319.77	-3 934 748.09
Abgeführte Verrechnungssteuer	0.00	-94 005.38
Saldo aus dem Anteilverkehr	-11 202 666.52	-47 681 559.06
Gesamterfolg	14 023 438.37	14 831 561.02
Nettofondsvermögen am Ende der Berichtsperiode	308 882 585.83	309 353 133.75

Entwicklung der Anteile im Umlauf

	1.1.2026-30.6.2026	1.1.2025-31.12.2025
Klasse F Cap		Anzahl
Bestand Anfang Rechnungsjahr		221 253.0000
Ausgegebene Anteile		36 280.0000
Zurückgenommene Anteile		-257 533.0000
Bestand Ende Berichtsperiode		0.0000

Differenz zwischen den ausgegebenen und zurückgenommenen Anteilen -84 774.2330 -196 848.9050

Klasse R Dis¹	Anzahl	Anzahl
Bestand Anfang Rechnungsjahr	2 337 954.8280	2 534 803.7330
Ausgegebene Anteile	21 495.7470	41 642.3940
Zurückgenommene Anteile	-106 269.9800	-238 491.2990
Bestand Ende Berichtsperiode	2 253 180.5950	2 337 954.8280

Differenz zwischen den ausgegebenen und zurückgenommenen Anteilen -84 774.2330 -196 848.9050

¹ ehemals: A1

Inventar des Fondsvermögens

Titel		31.12.2025 Anzahl/ Nominal	Käufe ¹	Verkäufe ²	30.6.2026 Anzahl/ Nominal	Verkehrswert ³ in CHF	in % ³	Davon ausgeliehen Anzahl/Nominal
Effekten, die an einer Börse gehandelt werden								
Investmentzertifikate, open end								
Asien ohne Japan								
MULTI UNITS LUX-AMUNDI MSCI PAC EX JAPAN UCITS ETF-SHS -DIST*	USD	30 000			30 000	2 872 965	0.93	
Total Asien ohne Japan						2 872 965	0.93	
China								
ISHARES MSCI CHINA USD ACC-CAPITALISATION*	USD	350 000		350 000				
Total China							0.00	
Europa								
ISHARES MSCI EUROPE CONSUMER DISCRETIONARY SEC UCITS ETF-ACC*	EUR	500 000		500 000				
SPDR BLOOMBERG GLOBAL AGGRE BD UCITS ETF- ACCUM SHS HEDG CHF*	EUR	35 000			35 000	8 571 556	2.77	3 460
Total Europa						8 571 556	2.77	
Global								
ISHARES MSCI ACWI UCITS-ETF-USD*	USD	70 000		40 000	30 000	2 925 478	0.94	
SPDR BLOOMBERG GLOBAL AGGRE BD UCITS ETF- ACCUM SHS HEDG CHF*	CHF	80 000		70 000	10 000	272 600	0.09	
SWISSCANTO CH GOLD ETF-ANTEILE -EA (CHF)-DISTRIBUTIVE*	CHF		8 500		8 500	8 199 100	2.65	
Total Global						11 397 178	3.68	
Schweiz								
IMMOFONDS SCHWEIZ IMMOBILIEN-ANLAGEFONDS*	CHF	4 211			4 211	2 888 746	0.93	
ROTH RE SWISS-A*	CHF		15 000		15 000	2 547 000	0.82	
SCHRODER IMMOPLUS*	CHF	12 112		12 112				
SOLVALOR 61 FONDS DE PLACEMENT IMMOBIER*	CHF		3 625		3 625	1 359 375	0.44	
SWISS LIFE REF CH ESG SWISS PROPERTIES-ANTEILE*	CHF	13 333			13 333	1 967 951	0.63	
SWISSCANTO (CH) REAL ESTATE FUND IFCA*	CHF	12 799			12 799	2 732 587	0.88	
UBS (CH) PROP FUND - SWISS RESIDENTIAL 'ANFOS'*	CHF	43 152		15 000	28 152	2 882 765	0.93	
UBS (CH) PROP FUND - SWISS MIXED 'SIMA'*	CHF	49 407			49 407	7 737 136	2.50	
UBS (CH) PROP FUND - SWISS COMMERCIAL 'SWISSREAL'*	CHF	23 835		23 835				
UBS (CH) PROPERTY FUND-SWISS RESIDENTIAL SIAT-ANTEILE*	CHF	5 833			5 833	1 496 165	0.48	
UBS (CH) PROPERTY FUND - DIRECT LIVINGPLUS-ANTEILE*	CHF	25 340			25 340	3 745 252	1.21	
UBS (CH) PROPERTY FUND - DIRECT MIXED URBAN-ANTEILE*	CHF	23 854			23 854	3 692 599	1.19	
Total Schweiz						31 049 575	10.02	
Vereinigte Staaten von Amerika								
INVECO MSCI USA UCITS ETF-ACCUM SHS USD*	USD	40 000	140 000		180 000	31 923 012	10.30	
JPM US RESEARCH ENHANCED IDX EQUITY ESG UCITS ETF-ACC-USD*	USD	183 000			183 000	10 979 749	3.54	56 577
Total Vereinigte Staaten von Amerika						42 902 761	13.84	
Total Investmentzertifikate, open end						96 794 035	31.23	
Total Effekten, die an einer Börse gehandelt werden						96 794 035	31.23	
Effekten, die nicht an einer Börse oder einem andern geregelten Markt gehandelt werden								
Investmentzertifikate, open end								
Global								
JPMORGAN GLOBAL RESEARCH ENHANCED INDEX EQUITY-ACCUM SHS USD**	USD	40 000		40 000				
LO FUNDS - SHORT-TERM MONEY MARKET USD-SHS -N- CAP**	USD	500 000		500 000				
PARAMETRIC ALTER-MORGAN STANLEY ALPHA TRK UCITS FD-A-ACC-CHF**	CHF	19 942			19 942	2 088 144	0.67	
PICTET CH-SHORT-TERM MONEY MARKET USD-UNITS -I DY-**	USD	15 000		4 000	11 000	9 918 585	3.20	
SWISS LIFE FLEX FUNDS CH-DYNAMIC ALLOCATION (CHF HGD) I DIS**	CHF	9 500		1 000	8 500	9 355 865	3.02	
SWISS LIFE FUNDS (CH) MONEY MARKET SWISS FRANCS A CAP**	CHF	50 000	60 000	100 000	10 000	1 020 310	0.33	
SWISS LIFE FUNDS LUX-BOND EMERGING MRKT CORP-AM-CHF HDG-CAP**	CHF	1 250	1 200		2 450	24 114 566	7.78	
SWISS LIFE FUNDS LUX-BD GLOBAL HIGH YIELD-AM-CHF HEDGED-CAP**	CHF	550	250		800	9 059 216	2.92	
SWISS LIFE IFUNDS (CH) BOND SWISS FRANCS FOREIGN CHF-IA**	CHF	7 250	1 000		8 250	8 345 123	2.69	
SWISS LIFE IFUNDS (CH)-BOND GLOBAL CORPORATES (CHF)**	CHF	21 300		5 500	15 800	12 059 350	3.89	
SWISS LIFE IFUNDS CH BOND GLOBAL GOVT-CHF HDG-I-A1-DIS**	CHF	36 700	4 000	6 000	34 700	25 055 135	8.08	
SWISS LIFE IFUNDS CH BOND GLOBAL CORP ST CHF HDG-I-A1-DIST**	CHF	11 500	9 000	11 500	9 000	6 644 520	2.14	
SYZ AM CH LIQUIDITY MANAGEMENT-CHF-I3-DISTRIBUTION**	CHF	800			800	701 384	0.23	
Total Global						108 362 197	34.96	
Schweiz								
SWISS LIFE IFUNDS CH-EQUITY SMALL & MID CAP-I-A1-DIS**	CHF	5 100			5 100	14 676 627	4.74	
SWISS LIFE IFUNDS CH BOND-CHF DOMESTIC-I-A1-DIS**	CHF	21 500	1 000	6 000	16 500	17 780 895	5.74	
SWISS LIFE IFUNDS CH EQUITY SWITZERLAND CHF-L-A1**	CHF	24 850		1 000	23 850	54 988 799	17.73	
Total Schweiz						87 446 321	28.20	
Total Investmentzertifikate, open end						195 808 518	63.17	
Total Effekten, die nicht an einer Börse oder einem andern geregelten Markt gehandelt werden						195 808 518	63.17	
Total Wertschriften (davon ausgeliehen)						292 602 553 11 942 333	94.40 (3.85)	
Bankguthaben auf Sicht						15 860 399	5.12	
Derivative Finanzinstrumente						183 763	0.06	
Sonstige Vermögenswerte						1 296 159	0.42	
Gesamtfondsvermögen						309 942 874	100.00	
Kurzfristige Bankverbindlichkeiten						-110 755		
Andere Verbindlichkeiten						-949 533		
Nettofondsvermögen						308 882 586		

Bewertungskategorie	Verkehrswert per 30.6.2026	in % des Gesamt- fondsvermögens ³
Anlagen bewertet zu den Kursen, die am Hauptmarkt bezahlt werden	96 977 798	31.29
Anlagen bewertet aufgrund von am Markt beobachtbaren Parametern	195 808 518	63.17
Anlagen bewertet mit geeigneten Bewertungsmodellen unter Berücksichtigung der aktuellen Marktgegebenheiten	–	–
Total	292 786 316	94.46

¹ «Käufe» umfassen die Transaktionen: Gratistitel / Käufe / Konversionen / Namensänderungen / «Splits» / Stock-/Wahldividenden / Titelaufteilungen / Überträge / Umbuchungen infolge Redenominierung in Euro / Umtausch zwischen Gesellschaften / Zuteilung aus Bezugs-/Optionsrechten / Zuteilung von Bezugsrechten ab Basistiteln / Sacheinlagen

² «Verkäufe» umfassen die Transaktionen: Auslosungen / Ausbuchung infolge Verfall / Ausübung von Bezugs-/Optionsrechten / «Reverse splits» / Rückzahlungen / Überträge / Umbuchungen infolge Redenominierung in Euro / Umtausch zwischen Gesellschaften / Verkäufe / Sachauslagen

³ Allfällige Abweichungen in den Totalisierungen sind auf Rundungsdifferenzen zurückzuführen

* bewertet zu den Kursen, die am Hauptmarkt bezahlt werden (Art. 88 Abs. 1 KAG)

** bewertet aufgrund von am Markt beobachtbaren Parametern

Derivative Finanzinstrumente

Gemäss KKV-FINMA Art. 23

Am Ende der Berichtsperiode offene engagementerhöhende Derivate

Instrument	Anzahl Kontrakte	Währung	Deckung in CHF	Variation Margin in CHF	In % des Vermögens
Futures auf Indices/Commodities/Währungen					
EURO STOXX 50 INDEX FUTURE 18.09.26*	60	EUR	3 517 066	36 798	0.01
FTSE 100 INDEX FUTURE 18.09.26*	5	GBP	564 300	-214	0.00
NIKKEI 225 (OSE) INDEX FUTURE 10.09.26*	10	JPY	3 483 696	275 509	0.09
S&P500 EMINI FUTURE 18.09.26*	27	USD	8 219 874	52 924	0.02
MINI MSCI EMERGING MARKETS INDEX FUTURE 18.09.26*	140	USD	9 922 682	-181 254	-0.06
			25 707 618	183 763	0.06

Obige Angaben können Rundungsdifferenzen enthalten.

* bewertet zu den Kursen, die am Hauptmarkt bezahlt werden (Art. 88 Abs. 1 KAG)

Während der Berichtsperiode getätigte engagementerhöhende Derivate

Instrument	Währung	Käufe/ Kontrakte	Verkäufe/ Kontrakte
Futures auf Indices/Commodities/Währungen			
EURO STOXX 50 INDEX FUTURE 18.09.26	EUR	85	25
EURO STOXX 50 INDEX FUTURE 20.03.26	EUR	50	135
SWISS MARKET INDEX FUTURE 20.03.26	CHF	20	40
EURO STOXX 50 INDEX FUTURE 19.06.26	EUR	135	135
SWISS MARKET INDEX FUTURE 19.06.26	CHF	30	30
FTSE 100 INDEX FUTURE 20.03.26	GBP	0	30
FTSE 100 INDEX FUTURE 19.06.26	GBP	5	5
FTSE 100 INDEX FUTURE 18.09.26	GBP	5	0
S&P500 EMINI FUTURE 20.03.26	USD	10	102
NASDAQ 100 E-MINI FUTURE 20.03.26	USD	0	15
NIKKEI 225 (OSE) INDEX FUTURE 13.03.26	JPY	8	18
MINI MSCI EMERGING MARKETS INDEX FUTURE 20.03.26	USD	0	140
S&P500 EMINI FUTURE 18.06.26	USD	102	102
NIKKEI 225 (OSE) INDEX FUTURE 11.06.26	JPY	18	18
MINI MSCI EMERGING MARKETS INDEX FUTURE 19.06.26	USD	140	140
NIKKEI 225 (OSE) INDEX FUTURE 10.09.26	JPY	10	0
S&P500 EMINI FUTURE 18.09.26	USD	37	10
MINI MSCI EMERGING MARKETS INDEX FUTURE 18.09.26	USD	140	0

Ergänzende Angaben

Derivative Finanzinstrumente

Risikomessverfahren Commitment-Ansatz II:
Art. 35ff KKV-FINMA

Position	Betrag in CHF	in % des Nettofonds- vermögens
Brutto Gesamtengagement aus Derivaten	25 707 618.39	8.32%
Netto Gesamtengagement aus Derivaten	–	–
Engagement aus Effektenleihe und Pensionsgeschäften	–	–

Pensionsgeschäfte

Per Bilanzstichtag waren keine Effekten in Pension gegeben.

Vergütung an die Fondsleitung

Verwaltungskommission

- Effektiv erhobene Verwaltungskommission:
Klasse R Dis¹: 1.25% p.a.;
- Maximale erhobene Verwaltungskommission für alle
Klassen gemäss Fondsvertrag: 2.00% p.a.;
- Effektiv erhobene Depotbankkommission für alle
Klassen: 0.006375% p.a.;
- Maximale erhobene Depotbankkommission
für alle Klassen gemäss Fondsvertrag: 0.25% p.a.

Die Verwaltungskommission der Zielfonds, in die das Vermögen der Teilvermögen investiert wird, darf unter Berücksichtigung von allfälligen Retrozessionen und Rabatten maximal 3% betragen. Die maximale effektive Verwaltungskommission der Zielfonds beträgt 0.77%.

Gebührenteilungsvereinbarungen («commission sharing agreements») und geldwerte Vorteile («soft commissions»)

Die Fondsleitung hat keine Gebührenteilungsvereinbarungen («commission sharing agreements») geschlossen. Die Fondsleitung hat keine Vereinbarungen bezüglich so genannten «soft commissions» geschlossen.

¹ ehemals: A1

Total Expense Ratio (TER)

Diese Kennziffer wurde gemäss der «Richtlinie zur Berechnung und Offenlegung der Total Expense Ratio (TER) von kollektiven Kapitalanlagen» der Asset Management Association Switzerland (AMAS) in der aktuell gültigen Fassung berechnet und drückt die Gesamtheit derjenigen Kommissionen und Kosten, die laufend dem Fondsvermögen belastet werden (Betriebsaufwand), retrospektiv in einem %-Satz des Fondsvermögens aus.

TER für die letzten 12 Monate:

Klasse R Dis¹: 1.26%

Zusammengesetzte TER für die letzten 12 Monate

Klasse R Dis¹: 1.51%

¹ ehemals: A1

Ausgabe- und Rücknahmepreis

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

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

Umrechnungskurse

EUR 1 = CHF 0.922243
GBP 1 = CHF 1.070626

JPY 1 = CHF 0.004963
USD 1 = CHF 0.806650

Effektenleihe

Die Gesellschaft darf ebenfalls Teile ihres Wertpapierbestandes an Dritte ausleihen. Im Allgemeinen dürfen Ausleihungen nur über anerkannte Clearinghäuser, wie Clearstream International oder Euroclear, sowie über erstrangige Finanzinstitute, welche in dieser Aktivität spezialisiert sind, innerhalb deren festgesetzten Rahmenbedingungen erfolgen. Collateral erhält man in Verbindung mit ausgeliehenen Wertpapieren. Collateral setzt sich aus hochwertigen Wertpapieren zusammen, welche zumindest dem Betrag des Marktwertes der ausgeliehenen Wertpapiere entsprechen.

Effektenleihe und Sicherheiten

Berichtszeitraum:	Swiss Life Funds (CH)	Swiss Life Funds (CH)
1. Januar 2026 -	– Portfolio Global	– Portfolio Global
30. Juni 2026	Income (CHF)	Balanced (CHF)
Kontrahentenrisiko aus der Effektenleihe per 30. Juni 2026		
UBS AG		
– Marktwert der verliehenen Effekten	5 565 951.15 CHF	11 942 332.74 CHF
– Sicherheiten	5 944 147.30 CHF	12 639 412.29 CHF
Aufschlüsselung der Sicherheiten (Gewichtung in %) per 30. Juni 2026		
nach Art der Vermögenswerte:		
– Anleihen	100.00	100.00
– Aktien	-	-
Effektenleihe		
Erträge aus der Effektenleihe	6 891.57 CHF	32 498.23 CHF
Operative Kosten der Effektenleihe	2 067.47 CHF	9 749.47 CHF
Fondserträge aus der Effektenleihe	4 824.10 CHF	22 748.76 CHF

Der Marktwert der verliehenen Effekten sowie die Werte der erhaltenen Sicherheiten für ausgeliehene Wertschriften in der Tabelle Effektenleihe und Sicherheiten beziehen sich auf die Daten der Depotbank per Monatsultimo.

Die Ausgleichszahlungen und die Kommissionserträge aus Effektenleihe in den Erfolgsrechnungen sowie die im Inventar ausgewiesenen, ausgeliehenen Werte stammen hingegen aus der Wertschriftenbuchhaltung. Die Wertschriftenbuchhaltung verbucht die ausgeliehenen Wertschriften an T+1 gegenüber der Depotbank.