

Swiss Life Funds (CH)

Money Market Swiss Francs

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

Halbjahresbericht per 30. Juni 2026

Ungeprüfter Halbjahresbericht per 30. Juni 2026

Inhaltsverzeichnis	Seite	ISIN
Organisation	2	
Swiss Life Funds (CH)		
Money Market Swiss Francs	4	
	A Dis	CH1238845866
	A Cap	CH1238845874

Verkaufsrestriktionen

Bei der Ausgabe und Rücknahme von Anteilen dieses Anlagefonds im Ausland kommen die dort geltenden Bestimmungen zur Anwendung.

- a) Für folgende Länder liegt eine Bewilligung für die Vertriebstätigkeit vor: - Schweiz
- b) Anteile dieses Anlagefonds 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 (unter anderem 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

Verwaltungsrat

Präsident

Per Erikson

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

Christoph Gisler

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

Philipp Menzi

Bereichsleiter Operations

Mark Fehlmann

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

Depotbank

UBS Switzerland AG
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 aus durch ihre langjährige Erfahrung in den übertragenen Bereichen. 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)

Money Market Swiss Francs

Art übrige Fonds für traditionelle Anlagen

Wichtigste Daten

	ISIN	30.6.2026	31.12.2025	31.12.2024
Nettofondsvermögen in CHF		2 213 633 386.70	1 725 119 336.11	1 536 708 848.71
Klasse A Dis	CH1238845866			
Nettoinventarwert pro Anteil in CHF		100.41	101.23	102.02
Anzahl Anteile im Umlauf		5 463 895.7110	4 928 056.1370	3 625 479.1990
Klasse A Cap	CH1238845874			
Nettoinventarwert pro Anteil in CHF		102.03	102.31	102.40
Anzahl Anteile im Umlauf		16 318 420.6370	11 986 181.6740	11 395 359.7530

Struktur des Wertpapierportfolios (ungeprüft)

Die 10 grössten Positionen in % des Gesamtfondsvermögens

Pfandbriefbank schweizerischer Hypothekarinstitute AG	8.80
Axpo Holding AG	5.04
PSP Swiss Property AG	4.42
Swiss Prime Site Finance AG	4.40
Banco Santander Chile SA	3.69
Scotiabank Chile SA	3.36
Ca Auto Finance Suisse SA	2.94
Banca Dello Stato Cantone Ticino	2.71
St Galler Kantonalbank AG	2.71
Luzerner Kantonalbank AG	2.41
Übrige	49.03
Total	89.51

Obige Prozentsätze können Rundungsdifferenzen enthalten.

Vermögensrechnung

	30.6.2026	31.12.2025
	CHF	CHF
Verkehrswerte		
Bankguthaben		
– auf Sicht	30 510 437.55	1 370 299.51
Bankguthaben auf Zeit	160 000 000.00	165 000 000.00
Effekten		
– Obligationen, Wandelobligationen, Optionsanleihen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte	1 981 947 247.66	1 447 741 279.18
Derivative Finanzinstrumente	-369 129.89	0.00
Sonstige Vermögenswerte	42 086 366.17	111 472 946.56
Gesamtfondsvermögen	2 214 174 921.49	1 725 584 525.25
Andere Verbindlichkeiten	-541 534.79	-465 189.14
Nettofondsvermögen	2 213 633 386.70	1 725 119 336.11

Erfolgsrechnung

	1.1.2026-30.6.2026	1.1.2025-31.12.2025
	CHF	CHF
Ertrag		
Erträge der Bankguthaben	172 314.24	694 442.22
Negativzinsen	-34 769.91	-218 515.38
Erträge der Geldmarktinstrumente	-6 660.00	223 922.72
Erträge der Effekten		
– aus Obligationen, Wandelobligationen, Optionsanleihen und sonstigen Forderungswertpapieren und -rechten	9 767 433.46	17 822 609.63
Einkauf in laufende Nettoerträge bei der Ausgabe von Anteilen	5 608 772.62	9 072 137.43
Total Ertrag	15 507 090.41	27 594 596.62
Aufwand		
Passivzinsen	-204.95	-259.97
Reglementarische Kommissionsvergütung an die Fondsleitung Klasse A Dis	-256 336.43	-427 151.99
Reglementarische Kommissionsvergütung an die Fondsleitung Klasse A Cap	-714 622.32	-1 376 121.04
Reglementarische Kommissionsvergütung an die Depotbank	-66 113.31	-122 786.29
Sonstige Aufwendungen	-17 154.73	-774.34
Ausrichtung laufender Nettoerträge bei der Rücknahme von Anteilen	-5 061 361.17	-10 771 850.52
Total Aufwand	-6 115 792.91	-12 698 944.15
Nettoertrag	9 391 297.50	14 895 652.47
Realisierte Kapitalgewinne und -verluste	-7 239 394.77	-2 000 379.32
Realisierter Erfolg	2 151 902.73	12 895 273.15
Nicht realisierte Kapitalgewinne und -verluste	-1 104 478.82	-9 275 056.21
Gesamterfolg	1 047 423.91	3 620 216.94

Veränderung des Nettofondsvermögens

	1.1.2026-30.6.2026	1.1.2025-31.12.2025
	CHF	CHF
Nettofondsvermögen zu Beginn des Rechnungsjahres	1 725 119 336.11	1 536 708 848.71
Ordentliche Jahresausschüttung	-4 816 780.12	-3 570 659.28
Abgeführte Verrechnungssteuer	-4 590 680.43	-6 093 113.44
Saldo aus dem Anteilverkehr	496 874 087.23	194 454 043.18
Gesamterfolg	1 047 423.91	3 620 216.94
Nettofondsvermögen am Ende der Berichtsperiode	2 213 633 386.70	1 725 119 336.11

Entwicklung der Anteile im Umlauf

	1.1.2026-30.6.2026	1.1.2025-31.12.2025
Klasse A Dis	Anzahl	Anzahl
Bestand Anfang Rechnungsjahr	4 928 056.1370	3 625 479.1990
Ausgegebene Anteile	8 177 945.9130	4 797 742.7890
Zurückgenommene Anteile	-7 642 106.3390	-3 495 165.8510
Bestand Ende Berichtsperiode	5 463 895.7110	4 928 056.1370

Differenz zwischen den ausgegebenen und zurückgenommenen Anteilen 535 839.5740 1 302 576.9380

	Anzahl	Anzahl
Klasse A Cap		
Bestand Anfang Rechnungsjahr	11 986 181.6740	11 395 359.7530
Ausgegebene Anteile	14 404 493.5020	21 685 006.2940
Zurückgenommene Anteile	-10 072 254.5390	-21 094 184.3730
Bestand Ende Berichtsperiode	16 318 420.6370	11 986 181.6740

Differenz zwischen den ausgegebenen und zurückgenommenen Anteilen 4 332 238.9630 590 821.9210

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							
Notes, fester Zins							
CHF							
AXPO HOLDING AG-REG-S STEP-UP 22-04.02.27*	CHF	33 520 000		33 520 000	33 613 856	1.52	
AXPO HOLDING AG-REG-S 2.00000% 22-15.09.26*	CHF	26 705 000	12 045 000	38 750 000	38 951 500	1.76	
AXPO HOLDING AG-REG-S 2.50000% 23-22.09.26*	CHF	24 270 000	14 555 000	38 825 000	39 003 595	1.76	
BKW AG-REG-S 0.87500% 22-27.04.26*	CHF	790 000		790 000			
EBN BV-REG-S 0.87500% 14-22.09.26*	CHF	2 750 000		2 750 000	2 753 575	0.12	
FREIBURGER KANTONALBANK 1.90000% 23-08.09.26*	CHF	4 830 000		4 830 000	4 844 490	0.22	
LONZA SWISS FINANCE AG-REG-S 0.35000% 20-22.09.26*	CHF	9 830 000	13 475 000	23 305 000	23 300 339	1.05	
MUENCHENER HYPOTHEKENBANK EG-REG-S 0.01000% 21-10.11.26*	CHF		1 550 000	1 550 000			
PFANDBRIEFBANK SCHWEIZERISC HYPO-REG-S 2.12500% 23-07.07.26*	CHF	16 285 000	97 710 000	113 995 000			
PFANDBRIEFBK SCHWEIZERISCHER HYPO-REG-S 0.25000% 18-16.11.26*	CHF		13 855 000	13 855 000	13 861 928	0.63	
PFANDBRIEFZENTR SCHWEIZ KAN BAN-REG-S 1.75000% 13-25.02.26*	CHF	16 570 000		16 570 000			
PRIMEO HOLDING AG/SWITZERLAND-REG-S 1.87500% 22-23.09.26*	CHF		5 560 000	5 560 000	5 578 348	0.25	
ROCHE KAPITALMARKT AG-REG-S 0.50000% 22-25.02.27*	CHF		38 405 000	38 405 000	38 477 970	1.74	
ROCHE KAPITALMARKT AG-REG-S 1.50000% 22-23.06.26*	CHF		2 265 000	2 265 000			
SWISSGRID AG-REG-S 1.90000% 23-30.06.26*	CHF	8 205 000	22 305 000	30 510 000			
VALIANT BANK AG-REG-S 0.20000% 19-29.01.27*	CHF		4 530 000	4 530 000	4 529 094	0.20	
Total CHF					204 914 694	9.25	
Total Notes, fester Zins					204 914 694	9.25	
Notes, Nullcoupon							
CHF							
PFANDBRIEFBK SCHWEIZERISCHER HYPO-REG-S 0.00000% 19-30.03.26*	CHF	3 035 000	3 035 000				
Total CHF						0.00	
Total Notes, Nullcoupon						0.00	
Medium-Term Notes, fester Zins							
CHF							
ACHMEA BANK NV-REG-S 2.47000% 23-16.10.26*	CHF	8 400 000	3 200 000	11 600 000	11 669 600	0.53	
ATHENE GLOBAL FUNDING-REG-S 0.50000% 21-15.01.27*	CHF		24 095 000	24 095 000	24 070 905	1.09	
BANCO DE CREDITO E INVERSIONES SA-REG-S 0.10000% 20-18.09.26*	CHF		19 265 000	19 265 000	19 251 515	0.87	
BANCO DE CREDITO E INVERSIONES-REG-S 0.38500% 21-15.12.26*	CHF		12 945 000	12 945 000	12 939 822	0.58	
BANCO DE CREDITO E INVERSIONES SA-REG-S 0.59940% 22-26.04.27*	CHF		18 995 000	18 995 000	19 015 895	0.86	
BANCO SANTANDER CHILE SA-REG-S 0.29750% 21-22.10.26*	CHF	4 870 000	13 310 000	18 180 000	18 178 182	0.82	
BANCO SANTANDER CHILE 2.44500% 24-25.01.27*	CHF		62 775 000	62 775 000	63 484 358	2.87	
BANCO SANTANDER SA-REG-S 2.24750% 23-30.01.26*	CHF	17 115 000		17 115 000			
BANK OF NOVA SCOTIA/THE-REG-S 2.04250% 23-04.05.26*	CHF	1 000 000		1 000 000			
BANQUE FEDERATIVE D CREDIT MUTUEL-REG-S 0.60000% 17-05.04.27*	CHF		1 500 000	1 500 000	1 501 950	0.07	
BANQUE FEDERTIVE DU CREDIT MUTUEL-REG-S 2.30000% 23-30.01.27*	CHF		14 350 000	14 350 000	14 512 155	0.66	
BASELANDSCHAFTLICHE KANTONALBANK 0.37500% 18-23.03.26*	CHF	11 770 000		11 770 000			
BAT INTERNATIONAL FINANCE PLC-REG-S 1.37500% 14-08.09.26*	CHF	29 305 000	12 395 000	41 700 000			
BAWAG PSK-REG-S 1.58500% 23-16.12.26*	CHF		5 675 000	5 675 000	5 706 780	0.26	
BERN, CANTON OF-REG-S 2.25000% 11-20.04.26*	CHF	3 895 000		3 895 000			
BPCE SA-REG-S 2.38250% 23-12.06.26*	CHF	6 540 000	7 685 000	14 225 000			
CANADIAN IMPERIAL BK OF COMMERCE-REG-S 0.28250% 22-03.02.27*	CHF		16 750 000	16 750 000	16 741 625	0.76	
CITIGROUP INC-REG-S 0.75000% 19-02.04.26*	CHF	45 040 000		45 040 000			
CORPORACION ANDINA DE FOMENTO-REG-S 0.50000% 15-26.02.26*	CHF	1 135 000		1 135 000			
CREDIT AGRICOLE HOME LOAN SFH SA-REG-S 0.25000% 15-18.06.26*	CHF	880 000		880 000			
CREDIT AGRICOLE HOME LOAN SFH SA-REG-S 0.10000% 16-26.01.26*	CHF	7 035 000		7 035 000			
CREDIT AGRICOLE SA 2.50750% 23-27.04.27*	CHF		8 570 000	8 570 000	8 712 262	0.39	
CREDIT AGRICOLE SA LONDON-REG-S 0.55000% 16-14.12.26*	CHF		11 675 000	11 675 000	11 679 670	0.53	
CREDIT AGRICOLE SA LONDON-REG-S 0.50000% 20-01.10.26*	CHF		5 000 000	5 000 000	5 001 000	0.23	
ENBW INTERNATIONAL FINANCE BV 2.25000% 23-15.06.26*	CHF	9 910 000		11 875 000			
ENGIE SA REG-S 2.34000% 23-04.01.27*	CHF		27 490 000	27 490 000	27 753 904	1.25	
FIRST ABU DHABI BANK PJSC 0.14750% 21-17.11.26*	CHF	16 270 000	7 130 000	23 400 000	23 374 260	1.06	
FIRST ABU DHABI BANK PJSC-REG-S 1.06250% 22-14.04.26*	CHF	14 500 000		14 500 000			
GLENORE CAPITAL FINANCE DAC-REG-S 1.00000% 20-30.03.27*	CHF		47 055 000	47 055 000	47 205 576	2.13	
HEATHROW FUNDING LTD-REG-S 0.45000% 19-15.10.26*	CHF	4 385 000		4 385 000	4 383 685	0.20	
HOLCIM HELVETIA FINANCE AG-REG-S 0.25000% 21-18.03.27*	CHF		20 590 000	20 590 000	20 550 879	0.93	
HOLCIM HELVETIA FINANCE AG-REG-S 0.37500% 22-19.10.26*	CHF		21 715 000	21 715 000	21 710 657	0.98	
HYPO VORARLBERG BANK AG-REG-S 0.50000% 22-07.04.27*	CHF		3 000 000	3 000 000	3 002 400	0.14	
HYPO VORARLBERG BANK AG-REG-S 2.37500% 23-04.05.26*	CHF	1 000 000		1 000 000			
HYUNDAI CAPITAL SERVICES INC-REG-S 1.87800% 22-14.06.27*	CHF		5 915 000	5 915 000	5 991 895	0.27	
HYUNDAI CAPITAL SERVICES INC-REG-S 2.74750% 23-11.05.26*	CHF	11 320 000	6 990 000	18 310 000			
KOMMUNALKREDIT AUSTRIA AG-REG-S 3.37500% 06-22.06.26*	CHF	48 995 000		48 995 000			
KOREA DEVELOPMENT BANK/THE-REG-S 0.94000% 22-28.04.27*	CHF		17 995 000	17 995 000	18 084 975	0.82	
KOREA DEVELOPMENT BANK/THE 2.22250% 23-24.07.26*	CHF		8 825 000	8 825 000	8 835 590	0.40	
KOREA LAND & HOUSING CORP 1.82250% 24-13.02.26*	CHF	11 965 000		11 965 000			
LANDESBANK BADEN-WUERTTEMBERG 2.12500% 23-27.02.26*	CHF	14 015 000		14 015 000			
LANSFORSKRINGAR HYPOTEK AB-REG-S 0.20000% 18-17.04.26*	CHF	3 200 000		3 200 000			
LUZERNER KANTONALBANK-REG-S 0.35000% 18-05.02.27*	CHF		53 275 000	53 275 000	53 312 293	2.41	
MERCEDES-BENZ INTERNATIONAL FIN 1.96000% 23-12.10.26*	CHF		11 070 000	11 070 000	11 118 708	0.50	
METROPOLITAN LIFE GLOBAL FUNDING-REG-S 0.30000% 17-19.01.26*	CHF	10 435 000		10 435 000			
METROPOLITAN LIFE GLOBAL FUNDING-REG-S 2.15000% 22-07.12.26*	CHF		4 620 000	4 620 000	4 654 650	0.21	
MUENCHENER HYPOTHEKENBANK EG-REG-S 0.25000% 21-30.03.27*	CHF		400 000	400 000	399 320	0.02	
MUENCHENER HYPOTHEKENBANK-REG-S 0.40000% 22-25.02.26*	CHF	12 800 000	9 200 000	22 000 000			
MUENCHENER HYPOTHEKENBANK EG-REG-S 0.37500% 22-07.04.26*	CHF	2 900 000		2 900 000			
NORDEA BANK ABP-REG-S 0.12500% 20-02.06.26*	CHF	200 000		200 000			
PFANDBRIEFBK SCHWEIZERISCHER HYPO-REG-S 2.75000% 11-15.12.26*	CHF		35 355 000	35 355 000	35 768 654	1.62	
PFANDBRIEFBK SCHWEIZERISCHER HYPO-REG-S 0.37500% 18-12.05.27*	CHF		30 825 000	30 825 000	30 874 320	1.39	
RAIFFEISENLANDESBANK OBEROE AG-REG-S 0.17500% 19-29.10.26*	CHF	14 320 000	9 460 000	23 780 000	23 780 000	1.07	
ROYAL BANK OF CANADA-REG-S 0.40000% 22-05.10.26*	CHF		5 840 000	5 840 000	5 841 168	0.26	
ROYAL BANK OF CANADA-REG-S 1.45000% 22-04.05.27*	CHF		12 965 000	12 965 000	13 075 203	0.59	
ROYAL BANK OF CANADA-REG-S 1.47500% 23-30.01.26*	CHF	20 015 000		20 015 000			
SANTANDER UK PLC-REG-S 2.01000% 23-12.09.26*	CHF		1 500 000	1 500 000	1 505 100	0.07	
SCOTIABANK CHILE SA-REG-S 0.38500% 21-22.07.26*	CHF	27 380 000	31 345 000	58 725 000	58 725 000	2.65	

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
SCOTIABANK CHILE SA-REG-S 0.41800% 21-31.03.27*	CHF		15 690 000		15 690 000	15 696 276	0.71	
SOCIETE GENERALE SA 2.27750% 23-27.02.26*	CHF	14 635 000		14 635 000				
SPAREBANK 1 BOLIGKREDIT AS-REG-S 0.50750% 22-06.04.27*	CHF		19 385 000		19 385 000	19 427 647	0.88	
SWISS REINSURANCE CO LTD-REG-S 0.75000% 15-21.01.27*	CHF		13 990 000		13 990 000	14 026 374	0.63	
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC-REG-S 0.83200% 25-07.09.26*	CHF		3 225 000		3 225 000	3 227 258	0.15	
TORONTO-DOMINION BANK-REG-S 1.97000% 23-18.09.26*	CHF		7 440 000		7 440 000	7 466 040	0.34	
VOLKSWAGEN FINANCIAL SERVICES NV 2.20750% 24-12.02.27*	CHF		40 100 000		40 100 000	40 521 050	1.83	
WALLISER KANTONALBANK-REG-S 0.80000% 24-25.11.26*	CHF	235 000		235 000				
WESTPAC BANKING CORP-REG-S 0.25000% 19-29.01.27*	CHF		6 845 000		6 845 000	6 842 947	0.31	
Total CHF						759 621 544	34.31	
Total Medium-Term Notes, fester Zins						759 621 544	34.31	
Medium-Term Notes, Nullcoupon								
CHF								
UBS SWITZERLAND AG-REG-S 0.00000% 21-27.01.27*	CHF		4 200 000	4 000 000	200 000	199 720	0.01	
Total CHF						199 720	0.01	
Total Medium-Term Notes, Nullcoupon						199 720	0.01	
Anleihen, fester Zins								
CHF								
AARGAUISCHE KANTONALBANK 0.25000% 17-07.09.26*	CHF	5 000 000		5 000 000				
AARGAUISCHE KANTONALBANK-REG-S 0.12500% 19-11.02.26*	CHF	14 355 000		14 355 000				
AEROPORT INTERNATIONAL DE GENEVE-REG-S 2.20000% 22-22.09.26*	CHF	1 095 000	5 245 000		6 340 000	6 363 458	0.29	
AMAG LEASING AG-REG-S 2.25000% 22-06.02.26*	CHF	30 890 000		30 890 000				
BANCA DELLO STATO CANTONE TICINO 0.85000% 24-27.11.26*	CHF		30 000 000		30 000 000	30 057 000	1.36	
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENT-REG-S 0.12500% 20-27.08.26*	CHF		9 200 000		9 200 000	9 195 400	0.42	
BANK CLER AG-REG-S 0.37500% 19-26.04.27*	CHF		1 290 000		1 290 000	1 289 226	0.06	
BANQUE CANTONALE DE GENEVE-REG-S 0.12500% 19-23.04.26*	CHF	8 965 000		8 965 000				
BANQUE CANTONALE NEUCHATELOISE-REG-S 0.35000% 18-14.09.26*	CHF	1 000 000			1 000 000	1 000 300	0.05	
BANQUE CANTONALE VAUDOISE 1.62500% 11-30.11.26*	CHF	1 080 000			1 080 000	1 085 616	0.05	
BASELANDSCHAFTLICHE KANTONALBANK-REG-S 0.01000% 22-28.07.26*	CHF	4 000 000		4 000 000				
BERNER KANTONALBANK AG-REG-S 0.40000% 18-03.05.27*	CHF		18 055 000		18 055 000	18 065 833	0.82	
CA AUTO FINANCE SUISSSE SA-REG-S 2.90250% 23-20.07.26*	CHF	44 500 000	20 500 000		65 000 000	65 071 500	2.94	
CEMBRA MONEY BANK AG-REG-S 0.15250% 19-14.10.26*	CHF	9 905 000	4 070 000		13 975 000	13 969 410	0.63	
CEMBRA MONEY BANK LTD-REG-S 0.87500% 18-08.06.26*	CHF	18 435 000	2 350 000	20 785 000				
CEMBRA MONEY BANK LTD-REG-S 3.11250% 22-28.04.27*	CHF		24 135 000		24 135 000	24 663 557	1.11	
COOP-GRUPPE GENOSSENSCHAFT 0.50000% 16-19.05.26*	CHF	31 945 000	5 010 000	36 955 000				
CREDIT AGRICOLE NEXT BANK SUISSSE-REG-S 1.89840% 23-23.09.26*	CHF	8 780 000			8 780 000	8 813 364	0.40	
CREDIT AGRICOLE NEXT BANK SUISSSE-REG-S 1.46250% 24-25.03.27*	CHF		2 000 000		2 000 000	2 017 600	0.09	
EMISSIONSZENTRALE GEM WOHNBAUTR-REG-S 1.25000% 12-15.06.27*	CHF		13 580 000		13 580 000	13 710 368	0.62	
EMMI FINANZ AG-REG-S 1.10000% 24-28.08.26*	CHF	9 710 000	8 185 000		17 895 000	17 918 264	0.81	
EUROFMA EUROPEAN RALRADMAT FIN CO-REG-S 3.00000% 06-15.05.26*	CHF		3 170 000	3 170 000				
FONDO FINANCIERO-REG-S 0.55600% 21-03.09.26*	CHF	18 195 000	8 295 000		26 490 000	26 492 649	1.20	
FREIBURGER KANTONALBANK 1.45000% 12-07.06.27*	CHF		11 055 000		11 055 000	11 167 761	0.50	
FREIBURGER KANTONALBANK 0.30000% 17-17.02.27*	CHF		34 295 000		34 295 000	34 298 430	1.55	
GENEVA, CANTON OF-REG-S 1.25000% 12-26.10.26*	CHF		3 940 000		3 940 000	3 953 790	0.18	
GENEVA, CANTON OF-REG-S 0.30000% 18-27.11.26*	CHF		1 380 000		1 380 000	1 380 690	0.06	
GLARNER KANTONALBANK-REG-S 0.40000% 18-30.11.26*	CHF		2 760 000		2 760 000	2 761 380	0.12	
GLARNER KANTONALBANK-REG-S 1.05000% 22-19.06.26*	CHF	28 625 000	7 650 000	36 275 000				
GRAUBUENDNER KANTONALBANK-REG-S 0.30000% 18-20.02.26*	CHF	4 845 000		4 845 000				
HELVETIA BALOISE HOLDING AG-REG-S 0.25000% 20-16.12.26*	CHF		7 275 000		7 275 000	7 274 273	0.33	
HELVETIA SCHWEIZ VERSICHERUNGSGES-REG-S 1.45000% 22-25.06.26*	CHF		3 345 000	3 345 000				
HILTI AG 1.74250% 23-10.11.26*	CHF		6 145 000		6 145 000	6 175 725	0.28	
KOREA HOUSING FINANCE CORP 1.77800% 24-01.02.27*	CHF		5 210 000		5 210 000	5 252 201	0.24	
KRAFTWERKE LINTH-LIMMERN AG-REG-S 2.37500% 13-10.12.26*	CHF		32 185 000		32 185 000	32 461 791	1.47	
KRAFTWERKE LINTH-LIMMERN AG-REG-S 2.35000% 23-01.03.27*	CHF		3 680 000		3 680 000	3 725 632	0.17	
KRAFTWERKE OBERHASLI AG 0.70000% 17-30.01.26*	CHF	5 475 000		5 475 000				
LGT BANK AG-REG-S 0.20000% 16-12.10.26*	CHF	15 135 000	9 000 000		24 135 000	24 127 760	1.09	
LIECHTENSTEINISCHE LANDESBANK AG-REG-S 0.12500% 19-28.05.26*	CHF	5 750 000		5 750 000				
NANT DE DRANCE SA-REG-S 2.00000% 16-02.02.26*	CHF	36 120 000		36 120 000				
NATIONWIDE BUILDING SOCIETY-REG-S 1.75750% 23-23.01.26*	CHF	2 960 000		2 960 000				
NIDWALDNER KANTONALBANK 0.25000% 16-27.05.26*	CHF	5 000 000		5 000 000				
PFANDBREFBK SCHWEZERSHR HYPO INST-REG-S 3.25000% 07-15.06.27*	CHF		21 625 000		21 625 000	22 247 800	1.00	
PFANDBREFBK SCHWEZERSHR HYPO INST-REG-S 2.50000% 11-16.02.27*	CHF		13 370 000		13 370 000	13 563 865	0.61	
PFANDBREFBK SCHWEIZERISCHER HYPO-REG-S 1.00000% 14-07.07.26*	CHF	2 710 000		2 710 000				
PFANDBREFBK SCHWEIZERISCHER HYPO-REG-S 0.37500% 15-26.01.26*	CHF	17 180 000		17 180 000				
PFANDBREFBK SCHWEIZERISCHER-REG-S 0.25000% 16-05.08.26*	CHF	1 875 000			1 875 000	1 875 188	0.08	
PFANDBREFBK SCHWEIZERISCHER HYPO-REG-S 0.25000% 17-18.01.27*	CHF		51 445 000		51 445 000	51 486 156	2.33	
PFANDBREFBK SCHWEIZERISCHER HYPO-REG-S 0.25000% 17-27.04.26*	CHF	17 000 000	4 360 000	21 360 000				
PFANDBREFBK SCHWEIZERISCHER HYPO INST 0.75000% 24-20.10.26*	CHF		8 000 000		8 000 000	8 015 200	0.36	
PFANDBREFBK SCHWISCHER HYPO INST-REG-S 0.25000% 17-20.10.26*	CHF	13 130 000	69 670 000	65 575 000	17 225 000	17 231 890	0.78	
PFANDBREFBK SCHWZERSHR HYPO INST-REG-S 2.50000% 11-30.03.26*	CHF	11 850 000		11 850 000				
PFANDBRIEFZENTR SCHWEIZ KNTNLBKN-REG-S 2.37500% 11-06.04.26*	CHF	7 535 000		7 535 000				
PFANDBRIEFZENTR SCHWEIZ KANTNLBKN-REG-S 1.75000% 11-02.09.26*	CHF		26 890 000	26 890 000				
PFANDBRIEFZENTR SCHWEIZ KANTONAL-REG-S 1.62500% 14-17.06.26*	CHF	39 620 000	252 150 000	291 770 000				
PFANDBRIEFZENTR SCHWEIZ KANTON-REG-S 0.12500% 15-25.02.26*	CHF	6 725 000		6 725 000				
PFANDBRIEFZENTR SCHWEIZ KANTONALB-REG-S 0.05000% 16-06.11.26*	CHF		1 000 000	1 000 000				
PFANDBRIEFZENTR SCHWEIZ KANTONAL-REG-S 0.37500% 17-07.12.26*	CHF		30 265 000		30 265 000	30 307 371	1.37	
PFANDBRIEFZENTR SCHWEIZ KANTON-REG-S 0.25000% 17-12.05.26*	CHF	3 160 000		3 160 000				
PSP SWISS PROPERTY AG-REG-S 0.37500% 16-29.04.26*	CHF	15 220 000		15 220 000				
PSP SWISS PROPERTY AG-REG-S 0.70000% 19-08.02.27*	CHF		41 225 000		41 225 000	41 282 715	1.86	
PSP SWISS PROPERTY AG-REG-S 2.00000% 23-01.07.26*	CHF	30 940 000	7 390 000		38 330 000	38 330 000	1.73	
PSP SWISS PROPERTY AG 1.80000% 23-11.12.26*	CHF		18 085 000		18 085 000	18 193 510	0.82	
RAIFFEISEN SCHWEIZ GENOSSENSCHAFT 2.62500% 11-04.02.26*	CHF	10 080 000		10 080 000				
SCHAFFHAUSER KANTONALBANK 0.37500% 15-16.02.27*	CHF		20 060 000	2 000 000	18 060 000	18 079 866	0.82	
SCHWYZER KANTONALBANK 0.25000% 16-19.02.26*	CHF	5 350 000		5 350 000				
SIKA AG-REG-S 0.60000% 18-27.03.26*	CHF	6 410 000		6 410 000				
SWISS PRIME SITE FINANCE AG-REG-S 0.82500% 17-11.05.26*	CHF	45 285 000	5 065 000	50 350 000				
SWISS PRIME SITE FINANCE AG-REG-S 1.25000% 19-02.04.27*	CHF		29 250 000		29 250 000	29 399 175	1.33	
SWISSCOM AG-REG-S 1.50000% 14-14.07.26*	CHF	11 690 000		11 690 000				
SWITZERLAND-REG-S 1.25000% 14-28.05.26*	CHF	2 710 000		2 710 000				
TESSIN, CANTON OF 0.49104% 25-19.03.26*	CHF	1 300 000		1 300 000				
THURGAUER KANTONALBANK 1.50000% 13-04.03.27*	CHF		1 225 000		1 225 000	1 235 290	0.06	
UBS GROUP AG-REG-S 1.25000% 16-23.02.26*	CHF	35 000 000		35 000 000				

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
UBS SWITZERLAND AG-REG-S 1.87500% 22-29.06.26*	CHF	11 000 000		11 000 000				
UBS SWITZERLAND AG-REG-S 1.82000% 23-18.10.26*	CHF	16 160 000	3 550 000		19 710 000	19 804 608	0.89	
UBS SWITZERLAND AG-REG-S 1.54270% 24-22.01.27*	CHF		21 545 000		21 545 000	21 704 433	0.98	
UNION BANCAIRE PRIVEE UBPA-REG-S 0.20000% 21-15.12.26*	CHF	13 680 000	18 825 000		32 505 000	32 482 247	1.47	
VISECA PAYMENT SERVICES AG 2.25000% 23-27.10.26*	CHF		10 105 000		10 105 000	10 167 651	0.46	
WALLISER KANTONALBANK-REG-S 0.20000% 17-02.02.26*	CHF	7 645 000		7 645 000				
WALLISER KANTONALBANK-REG-S 0.30000% 19-01.02.27*	CHF		3 115 000		3 115 000	3 113 754	0.14	
WINTERTHUR, CITY OF-REG-S 0.05000% 17-17.03.26*	CHF	3 880 000		3 880 000				
ZUERCHER KANTONALBANK-REG-S 0.12500% 16-13.05.26*	CHF	3 590 000		3 590 000				
ZUERCHER KANTONALBANK-REG-S 0.25000% 17-27.01.26*	CHF	9 805 000		9 805 000				
ZUERCHER KANTONALBANK-REG-S 0.15000% 19-25.01.27*	CHF		3 490 000	2 490 000	1 000 000	999 600	0.05	
ZUGER KANTONALBANK 0.50000% 15-03.03.27*	CHF		10 155 000		10 155 000	10 170 233	0.46	
Total CHF						761 983 526	34.41	
EUR								
LANDESBANK BADEN-WUERTTEMBERG-REG-S-SUB 2.87500% 16-28.09.26*	EUR		22 300 000		22 300 000	20 573 956	0.93	
Total EUR						20 573 956	0.93	
Total Anleihen, fester Zins						782 557 482	35.34	
Anleihen, Nullcoupon								
CHF								
BASEL-STADT, CANTON OF-REG-S 0.00000% 16-04.09.26*	CHF		3 020 000	3 020 000				
PFANDBRIEFBANK SCHWEIZERISCHER-REG-S 0.00000% 22-26.05.26*	CHF	3 500 000		3 500 000				
PFANDBRIEFZENTR SCHWEIZ KANTONAL-REG-S 0.00000% 16-02.10.26*	CHF		6 720 000		6 720 000	6 719 328	0.30	
SWISSGRID AG-REG-S 0.00000% 21-30.06.26*	CHF		9 860 000	9 860 000				
VALIANT BANK AG-REG-S 0.00000% 21-20.01.26*	CHF	16 790 000		16 790 000				
Total CHF						6 719 328	0.30	
Total Anleihen, Nullcoupon						6 719 328	0.30	
Total Effekten, die an einer Börse gehandelt werden						1 754 012 768	79.22	

Effekten, die nicht an einer Börse oder einem andern geregelten Markt gehandelt werden

Anleihen, fester Zins								
CHF								
BANCA DELLO STATO DEL CANTONE 0.13000% 25-17.07.26**	CHF	30 000 000			30 000 000	29 996 700	1.35	
BANK VONTOBEL AG-REG-S 0.25000% 26-31.08.26**	CHF		50 000 000		50 000 000	49 969 500	2.26	
BERNER KANTONALBANK 0.54000% 25-23.02.26**	CHF	20 000 000		20 000 000				
CREDIT AGRICOLE NEXT BANK SUISSE SA 0.39000% 25-01.07.26**	CHF	25 000 000		25 000 000				
SCHAFFHAUSER KANTONALBANK 0.09000% 25-30.03.26**	CHF	30 000 000		30 000 000				
ST GALLER KANTONALBANK AG 0.09000% 25-17.07.26**	CHF	60 000 000			60 000 000	59 992 800	2.71	
SWISS PRIME SITE 0.20250% 25-27.02.26**	CHF	27 000 000		27 000 000				
SWISS PRIME SITE FINANCE AG 0.22250% 26-27.08.26**	CHF		48 000 000		48 000 000	47 981 280	2.17	
SWISS PRIME SITE FINANCE AG 0.25450% 26-18.08.26**	CHF		20 000 000		20 000 000	19 996 600	0.90	
UNIVERSITAETSSPITAL ZUERICH-REG-S 0.22000% 26-02.06.26**	CHF		10 000 000	10 000 000				
WALLISER KANTONALBANK 0.10000% 25-17.07.26**	CHF	20 000 000			20 000 000	19 997 600	0.90	
Total CHF						227 934 480	10.29	
Total Anleihen, fester Zins						227 934 480	10.29	
Anleihen, Nullcoupon								
CHF								
SCHWEIZERISCHE BUNDESBAHNEN SBB-REG-S 0.00000% 25-23.01.26**	CHF	60 000 000		60 000 000				
Total CHF							0.00	
Total Anleihen, Nullcoupon							0.00	
Total Effekten, die nicht an einer Börse oder einem andern geregelten Markt gehandelt werden						227 934 480	10.29	

Nicht-Effekten

Treasury-Bills, Nullcoupon								
CHF								
SWISS NATIONAL BANK BILL-REG-S TB 0.00000% 09.02.26-09.03.26**	CHF		20 000 000	20 000 000				
SWISS NATIONAL BANK BILL-REG-S TB 0.00000% 09.02.26-04.05.26**	CHF		20 000 000	20 000 000				
SWISS NATIONAL BANK BILL-REG-S TB 0.00000% 16.02.26-16.03.26**	CHF		20 000 000	20 000 000				
SWISS NATIONAL BANK BILL-REG-S TB 0.00000% 26.05.26-22.06.26**	CHF		20 000 000	20 000 000				
Total CHF							0.00	
Total Treasury-Bills, Nullcoupon							0.00	
Total Nicht-Effekten							0.00	
Total Wertschriften (davon ausgeliehen)						1 981 947 248	89.51 (0.00)	
Bankguthaben auf Sicht						30 510 438	1.38	
Bankguthaben auf Zeit						160 000 000	7.23	
Derivative Finanzinstrumente						-369 130	-0.02	
Sonstige Vermögenswerte						42 086 365	1.90	
Gesamtfondsvermögen						2 214 174 921	100.00	
Andere Verbindlichkeiten						-541 534		
Nettofondsvermögen						2 213 633 387		

Bewertungskategorie	Verkehrswert per 30.6.2026	in % des Gesamt- fondsvermögens ³
Anlagen bewertet zu den Kursen, die am Hauptmarkt bezahlt werden	1 754 012 768	79.22
Anlagen bewertet aufgrund von am Markt beobachtbaren Parametern	227 565 350	10.27
Anlagen bewertet mit geeigneten Bewertungsmodellen unter Berücksichtigung der aktuellen Marktgegebenheiten	–	–
Total	1 981 578 118	89.49

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 Derivate auf Devisen

Verkauf Währung	Verkauf Betrag	Kauf Währung	Kauf Betrag	Fälligkeit	Wiederbeschaffungswert in CHF	In % des Vermögens
Devisentermingeschäfte**						
EUR	17 750 000	CHF	15 989 633	28.09.2026	-284 023	-0.01
EUR	2 780 000	CHF	2 502 855	28.09.2026	-45 921	0.00
EUR	2 360 000	CHF	2 124 523	28.09.2026	-39 186	-0.01
					-369 130	-0.02

Obige Angaben können Rundungsdifferenzen enthalten.

** bewertet aufgrund von am Markt beobachtbaren Parametern

Während der Berichtsperiode getätigte Derivate auf Devisen

Verkauf Währung	Verkauf Betrag	Kauf Währung	Kauf Betrag	Fälligkeit
Devisentermingeschäfte				
EUR	17 750 000	CHF	15 989 633	28.09.2026
EUR	2 780 000	CHF	2 502 855	28.09.2026
EUR	2 360 000	CHF	2 124 523	28.09.2026

Ergänzende Angaben

Derivative Finanzinstrumente

Risikomessverfahren Commitment-Ansatz I:
Art. 34 KKV-FINMA

Position	Betrag in CHF	in % des Nettofonds- vermögens
Total engagementerhöhende Positionen	–	–
Total engagementreduzierende Positionen	21 110 141.02	0.95%

Pensionsgeschäfte

Per Bilanzstichtag waren keine Effekten in Pension gegeben.

Vergütung an die Fondsleitung

Verwaltungskommission

- Effektiv erhobene Verwaltungskommission:
 - Klasse A Dis: 0.093625% p.a.;
 - Klasse A Cap: 0.093625% p.a.;
- Maximale Verwaltungskommission für alle Klassen
gemäss Fondsvertrag: 0.50% p.a.;
- Effektiv erhobene Depotbankkommission für alle
Klassen: 0.006375% p.a.;
- Maximale Depotbankkommission für alle Klassen
gemäss Fondsvertrag: 0.25% p.a.

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.

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 A Dis:	0.10%
Klasse A Cap:	0.10%

Umrechnungskurse

EUR 1 = CHF 0.922243	USD 1 = CHF 0.806650
GBP 1 = CHF 1.070626	

(OTC-)Derivate

Führt der Anlagefonds ausserbörsliche Transaktionen (OTC-Geschäfte) durch, so kann es dadurch Risiken im Zusammenhang mit der Kreditwürdigkeit der OTC-Gegenpartei ausgesetzt sein: bei Abschluss von Terminkontrakten, Optionen und Swap-Transaktionen oder Verwendung sonstiger derivativer Techniken unterliegt der Anlagefonds dem Risiko, dass eine OTC-Gegenpartei ihren Verpflichtungen aus einem bestimmten oder mehreren Verträgen nicht nachkommt (bzw. nicht nachkommen kann). Das Kontrahentenrisiko kann durch die Hinterlegung einer Sicherheit verringert werden. Falls dem Anlagefonds ein Wertpapier gemäss einer anwendbaren Vereinbarung geschuldet wird, wird dieses Wertpapier in einer Depotbank/Verwahrstelle für den Anlagefonds verwahrt. Konkurs- und Insolvenzfälle bzw. sonstige Kreditausfallereignisse bei der OTC-Gegenpartei, der Depotbank oder innerhalb ihres Unterverwahrstellen-/Korrespondenzbanknetzwerks können dazu führen, dass die Rechte oder die Anerkennung des Anlagefonds in Zusammenhang mit dem Wertpapier verzögert, eingeschränkt oder sogar ausgeschlossen werden könnten, was den Anlagefonds zwingen würde, seinen Verpflichtungen im Rahmen der OTC-Transaktion nachzukommen, und zwar trotz eines Wertpapiers, das zuvor zur Verfügung gestellt wurde, um eine solche Verpflichtung abzusichern.

Gegenparteien, Art und Höhe der entgegengenommenen Sicherheiten aus OTC-Derivaten:

Stichtag: 30.6.2026		Swiss Life Funds (CH)
		Money Market Swiss Francs
Währung:		CHF
Gegenparteien und Kurswert der OTC Derivate		
Zürcher Kantonalbank		-369 129.89
Art und Höhe der entgegengenommenen Sicherheiten:		
– Anleihen		-
– Aktien		-
– Barmittel		-
– Anlagefonds		-
– Geldmarktanlagen		-
– Übrige Sicherheiten		-
Total entgegengenommenen Sicherheiten		-