

*Swiss Life Funds (F) ESG  
Money Market Euro*

*Information Périodique au 30.06.2025*

**État du patrimoine**

| <b>Éléments de l'état du patrimoine</b>  | <i>Devise de comptabilité de l'OPC : EUR</i> | <b>Montant à l'arrêté périodique</b> |
|--|--|--------------------------------------|
| a) Titres financiers éligibles mentionnés au 1° du I de l'article L.214-20 / 1° du I de l'article L.214-24-55 du code monétaire et financier |  | 6 383 215 935,65                     |
| b) Avoirs bancaires  |  | 1 307 012 338,58                     |
| c) Autres actifs détenus par l'OPC   |  | 980 015 632,60                       |
| d) Total des actifs détenus par l'OPC (lignes a+b+c)   |  | <b>8 670 243 906,83</b>              |
| e) Passif  |  | -224 311 608,51                      |
| f) Valeur nette d'inventaire (lignes d+e = actif net OPC)  |  | <b>8 445 932 298,32</b>              |

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

| <b>Parts ou actions</b>  | <b>Nombre de parts ou actions en circulation</b> | <i>Devise parts ou actions</i> | <b>Valeur nette d'inventaire par part ou action (Valeur liquidative)</b> |
|--------------------------|--|--------------------------------|--|
| ACTION I / FR0010089649  | 288 210,10                                       | EUR                            | 26 957,95  |
| ACTION P / FR0010540385  | 3 614 338,761                                    | EUR                            | 116,487  |
| ACTION I2 / FR001400OU77 | 25 036,003                                       | EUR                            | 10 191,46  |
| ACTION I3 / FR001400ZAY6 | 20,00  | EUR                            | 10 026,70  |

**Portefeuille titres**

| Éléments du portefeuille titres   | Pourcentage |                  |
|---|-------------|------------------|
|   | Actif net   | Total des actifs |
| a) Les titres financiers éligibles et les instruments du marché monétaire admis à la négociation sur un marché réglementé au sens de l'article L. 422-1 du code monétaire et financier.   | 75,58       | 73,62            |
| b) Les titres financiers éligibles et les instruments du marché monétaire admis à la négociation sur un autre marché réglementé, en fonctionnement régulier, reconnu, ouvert au public et dont le siège est situé dans un Etat membre de l'Union européenne ou dans un autre Etat partie à l'accord sur l'Espace économique européen.   | -           | -                |
| c) Les titres financiers éligibles et les instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs d'un pays tiers ou négociés sur un autre marché d'un pays tiers, réglementé, en fonctionnement régulier, reconnu et ouvert au public, pour autant que cette bourse ou ce marché ne figure pas sur une liste établie par l'Autorité des marchés financiers ou que le choix de cette bourse ou de ce marché soit prévu par la loi ou par le règlement ou les statuts de l'OPC / du fonds d'investissement à vocation générale. | -           | -                |
| d) Les titres financiers nouvellement émis mentionnés au 4° du I de l'article R. 214-11 / 4° du I de l'article R.214-32-18 du code monétaire et financier.  | -           | -                |
| e) Les autres actifs  | 9,79        | 9,54             |

## Répartition des actifs par devise

| Devises (10 principales devises) | Montant<br>En devise de comptabilité<br>de l'OPC | Pourcentage  |                  |
|----------------------------------|--|--------------|------------------|
|                                  | EUR  | Actif net    | Total des actifs |
| Euro                             | 6 383 215 935,65                                 | 75,58        | 73,62            |
| -                                | -  | -            | -                |
| -                                | -  | -            | -                |
| -                                | -  | -            | -                |
| -                                | -  | -            | -                |
| -                                | -  | -            | -                |
| -                                | -  | -            | -                |
| -                                | -  | -            | -                |
| -                                | -  | -            | -                |
| -                                | -  | -            | -                |
| -                                | -  | -            | -                |
| Autres devises                   | -  | -            | -                |
| <b>Total</b>                     | <b>6 383 215 935,65</b>                          | <b>75,58</b> | <b>73,62</b>     |

## Répartition des actifs par pays de résidence de l'émetteur

| Pays (10 principaux pays) | Pourcentage  |                  |
|---------------------------|--------------|------------------|
|                           | Actif net    | Total des actifs |
| France                    | 22,45        | 21,87            |
| Pays-Bas                  | 12,68        | 12,35            |
| Royaume-Uni               | 10,84        | 10,56            |
| Canada                    | 6,95         | 6,77             |
| États-Unis                | 6,31         | 6,15             |
| Danemark                  | 2,89         | 2,82             |
| Allemagne                 | 2,79         | 2,72             |
| Luxembourg                | 2,79         | 2,72             |
| Suède                     | 1,72         | 1,67             |
| Belgique                  | 1,42         | 1,38             |
| Autres pays               | 4,74         | 4,61             |
| <b>Total</b>              | <b>75,58</b> | <b>73,62</b>     |

## Répartition des actifs par secteur économique

| Secteur économique (10 principaux secteurs) | Pourcentage  |                  |
|---|--------------|------------------|
|   | Actif net    | Total des actifs |
| Banques                                     | 31,15        | 30,34            |
| Expert en finance                           | 15,91        | 15,50            |
| Industries diversifiées                     | 3,72         | 3,62             |
| Boissons non alcoolisées                    | 3,66         | 3,57             |
| Électricité conventionnelle                 | 3,03         | 2,96             |
| Détaillants et grossistes Alimentation      | 1,78         | 1,73             |
| Véhicules commerciaux et camions            | 1,72         | 1,67             |
| Composants et équipements électriques       | 1,42         | 1,38             |
| Services multiples aux collectivités        | 1,33         | 1,29             |
| Fournisseurs industriels                    | 1,18         | 1,15             |
| Autres secteurs                             | 10,68        | 10,41            |
| <b>Total</b>                                | <b>75,58</b> | <b>73,62</b>     |

## Ventilation des autres actifs par nature

| Nature d'actifs   | Pourcentage |                  |
|---|-------------|------------------|
|   | Actif net   | Total des actifs |
| <b>Parts d'OPC</b>  | <b>9,79</b> | <b>9,54</b>      |
| - OPCVM et équivalents d'autres Etats membres de l'Union européenne | 9,79        | 9,54             |
| - FIA et équivalents d'autres Etats membres de l'Union européenne   | -           | -                |
| - Autres OPC et fonds d'investissements                             | -           | -                |
| <b>Autres actifs</b>  | <b>-</b>    | <b>-</b>         |
| <b>Total</b>  | <b>9,79</b> | <b>9,54</b>      |

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

| Éléments du portefeuille titres   | Mouvements<br>(en montant) |                              |
|---|----------------------------|------------------------------|
|   | Acquisitions               | Cessions /<br>Remboursements |
| <i>Devise de comptabilité de l'OPC : EUR</i>  |                            |                              |
| a) Les titres financiers éligibles et les instruments du marché monétaire admis à la négociation sur un marché réglementé au sens de l'article L. 422-1° du code monétaire et financier.  | 34 939 014<br>319,23       | 33 764 547<br>231,98         |
| b) Les titres financiers éligibles et les instruments du marché monétaire admis à la négociation sur un autre marché réglementé, en fonctionnement régulier, reconnu, ouvert au public et dont le siège est situé dans un Etat membre de l'Union européenne ou dans un autre Etat partie à l'accord sur l'Espace économique européen.   | -                          | -                            |
| c) Les titres financiers éligibles et les instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs d'un pays tiers ou négociés sur un autre marché d'un pays tiers, réglementé, en fonctionnement régulier, reconnu et ouvert au public, pour autant que cette bourse ou ce marché ne figure pas sur une liste établie par l'Autorité des marchés financiers ou que le choix de cette bourse ou de ce marché soit prévu par la loi ou par le règlement ou les statuts de l'OPC / du fonds d'investissement à vocation générale. | -                          | -                            |
| d) Les titres financiers nouvellement émis mentionnés au 4° du I de l'article R. 214-11 / 4° du I de l'article R.214-32-18 du code monétaire et financier.  | -                          | -                            |
| e) Les autres actifs  | 501 982 226,03             | 378 142 944,94               |
| <b>Total sur la période</b>   | <b>35 440 996 545,26</b>   | <b>34 142 690 176,92</b>     |

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

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

**Information sur les commissions de surperformance (en EUR)**

| Commission de surperformance (frais variables) : montant et % des frais sur la période | Montant | % |
|--|---------|---|
| Catégorie de part :  |         |   |
| ACTION I / FR0010089649  | -       | - |
| ACTION P / FR0010540385  | -       | - |
| ACTION I2 / FR001400OU77   | -       | - |
| ACTION I3 / FR001400ZAY6   | -       | - |

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

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

**Informations relatives aux opérations de financement sur titres et contrat d'échange sur rendement global (TRS) au 30/06/2025 :**

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

**Informations générales :**

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

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

**Données sur la concentration :**

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

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

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

## Swiss Life Funds (F) ESG Money Market Euro

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

### Données sur la réutilisation des garanties (collatéral) :

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

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

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

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

Néant.

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

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

**Inventaire au 30.06.2025**

| Code valeur               | Libellé valeur                          | Statut Valeur | Quantité      | Valeur boursière | Devise de cotation | % Actif net |
|---------------------------|---|---------------|---------------|------------------|--------------------|-------------|
| <b>Valeurs mobilières</b> |   |               |               |                  |                    |             |
| <b>Obligation</b>         |   |               |               |                  |                    |             |
| XS3045692129              | ABN AMRO BANK NV FRN 09/04/2027         | PROPRE        | 15 000 000,00 | 15 115 980,00    | EUR                | 0,18        |
| XS3009627939              | ABN AMRO BANK NV FRN 25/02/2027         | PROPRE        | 32 600 000,00 | 32 702 766,97    | EUR                | 0,39        |
| FR001400L4Y2              | ALD SA FRN 06/10/2025                   | PROPRE        | 17 100 000,00 | 17 242 232,10    | EUR                | 0,20        |
| XS3084345167              | AMERICAN HONDA FINANCE FRN 28/05/2027   | PROPRE        | 17 500 000,00 | 17 547 306,88    | EUR                | 0,21        |
| XS3019213654              | BANK OF AMERICA CORP FRN 10/03/2027     | PROPRE        | 80 000 000,00 | 80 150 000,00    | EUR                | 0,95        |
| XS2733010628              | BANK OF NOVA SCOTIA FRN 12/12/2025      | PROPRE        | 40 000 000,00 | 40 113 080,00    | EUR                | 0,47        |
| XS2692247468              | BANK OF NOVA SCOTIA FRN 22/09/2025      | PROPRE        | 34 000 000,00 | 34 052 125,78    | EUR                | 0,40        |
| XS2793212197              | BANK OF NOVA SCOTIA FRN 26/03/2026      | PROPRE        | 37 000 000,00 | 37 046 854,33    | EUR                | 0,44        |
| XS2842855814              | BANK OF NOVA SOCITA FRN 17/06/2026      | PROPRE        | 25 000 000,00 | 25 046 452,78    | EUR                | 0,30        |
| FR001400SJ03              | BANQUE FED CRED MUTUEL FRN 12/09/2026   | PROPRE        | 20 000 000,00 | 20 021 240,00    | EUR                | 0,24        |
| DE000BLB9V03              | BAYERISCHE LANDESBANK FRN 31/01/2026    | PROPRE        | 27 200 000,00 | 27 376 796,98    | EUR                | 0,32        |
| BE6355573369              | BELFIUS BANK SA NV FRN 17/09/2026       | PROPRE        | 20 000 000,00 | 20 010 962,22    | EUR                | 0,24        |
| XS2768933603              | BMW FINANCE NV FRN 19/02/2026           | PROPRE        | 16 000 000,00 | 16 044 397,33    | EUR                | 0,19        |
| DE000A4D6AJ5              | BMW US CAPITAL LLC FRN 29/01/2027       | PROPRE        | 10 000 000,00 | 10 046 313,33    | EUR                | 0,12        |
| FR001400OGI0              | BPCE SA FRN 06/03/2026                  | PROPRE        | 20 000 000,00 | 20 053 533,33    | EUR                | 0,24        |
| XS2864386441              | CANADIAN IMPERIAL BANK FRN 17/07/2026   | PROPRE        | 30 000 000,00 | 30 211 435,00    | EUR                | 0,36        |
| XS2793782611              | CANADIAN IMPERIAL BANK FRN 27/03/2026   | PROPRE        | 15 000 000,00 | 15 022 491,25    | EUR                | 0,18        |
| XS3002415142              | CARLSBERG BREWERIES A S FRN 28/02/2027  | PROPRE        | 59 114 000,00 | 59 320 647,77    | EUR                | 0,70        |
| XS3090072391              | CATERPILLAR FINL SERVICE FRN 10/06/2027 | PROPRE        | 37 500 000,00 | 37 613 270,83    | EUR                | 0,45        |
| XS2982340254              | CENTRAL BANKS OF SAVINGS FRN 22/01/2027 | PROPRE        | 20 000 000,00 | 20 141 363,33    | EUR                | 0,24        |
| XS2723549528              | CIE DE SAINT GOBAIN SA 3.75% 29/11/2026 | PROPRE        | 5 600 000,00  | 5 821 779,95     | EUR                | 0,07        |
| XS3085615345              | COCA COLA EUROPACIFIC FRN 03/06/2027    | PROPRE        | 10 000 000,00 | 10 028 207,50    | EUR                | 0,12        |
| XS3081756002              | DAIMLER TRUCK INTL FRN 27/05/2027       | PROPRE        | 4 200 000,00  | 4 213 841,80     | EUR                | 0,05        |
| DE000A3826Q8              | DEUTSCHE BANK FRN 15/01/2026            | PROPRE        | 12 700 000,00 | 12 810 152,74    | EUR                | 0,15        |
| XS2844409271              | DIAGEO FINANCE PLC FRN 20/06/2026       | PROPRE        | 37 500 000,00 | 37 556 354,17    | EUR                | 0,44        |
| XS2932830958              | DSV FINANCE BV FRN 06/11/2026           | PROPRE        | 25 600 000,00 | 25 785 251,56    | EUR                | 0,31        |

## Swiss Life Funds (F) ESG Money Market Euro

| Code valeur  | Libellé valeur                           | Statut Valeur | Quantité      | Valeur boursière | Devise de cotation | % Actif net |
|--------------|--|---------------|---------------|------------------|--------------------|-------------|
| XS2932831766 | DSV FINANCE BV 2.875% 06/11/2026         | PROPRE        | 42 400 000,00 | 43 424 767,34    | EUR                | 0,51        |
| XS2972906064 | FED CAISSES DESJARDINS FRN 14/01/2027    | PROPRE        | 58 400 000,00 | 58 806 293,67    | EUR                | 0,70        |
| XS2742659738 | FED CAISSES DESJARDINS FRN 17/01/2026    | PROPRE        | 37 000 000,00 | 37 278 694,28    | EUR                | 0,44        |
| XS2764789231 | FORTIVE CORPORATION 3.70% 13/02/2026     | PROPRE        | 19 111 000,00 | 19 530 441,94    | EUR                | 0,23        |
| DE000HCB0B02 | HAMBURG COMMERCIAL BANK FRN 05/12/2025   | PROPRE        | 30 000 000,00 | 30 204 895,83    | EUR                | 0,36        |
| XS2697966690 | ING BANK NV FRN 02/10/2026               | PROPRE        | 6 000 000,00  | 6 077 260,67     | EUR                | 0,07        |
| XS2775174340 | KBC IFIMA SA FRN 04/03/2026              | PROPRE        | 65 800 000,00 | 65 973 847,26    | EUR                | 0,78        |
| FR001400KI02 | KERING 3.75% 05/09/2025                  | PROPRE        | 30 800 000,00 | 31 783 334,30    | EUR                | 0,38        |
| XS2780024977 | KONINKIJE AHOLD DLHAIZE FRN 11/03/2026   | PROPRE        | 26 180 000,00 | 26 239 170,44    | EUR                | 0,31        |
| XS2752465810 | LANDBK HESSEN THUERINGEN FRN 23/01/2026  | PROPRE        | 28 000 000,00 | 28 203 314,22    | EUR                | 0,33        |
| DE000LB38937 | LB BADEN WUERTTEMBERG FRN 28/11/2025     | PROPRE        | 42 000 000,00 | 42 169 221,50    | EUR                | 0,50        |
| XS2989575589 | LEASYS SPA FRN 29/01/2027                | PROPRE        | 25 000 000,00 | 25 137 991,67    | EUR                | 0,30        |
| XS2963566380 | MACQUARIE BANK LTD FRN 18/12/2026        | PROPRE        | 25 000 000,00 | 25 064 466,67    | EUR                | 0,30        |
| XS3103548056 | MACQUARIE BANK LTD FRN 25/06/2027        | PROPRE        | 25 000 000,00 | 25 027 267,36    | EUR                | 0,30        |
| DE000A4ECAU6 | MERCEDES BENZ INT FRN 11/06/2027         | PROPRE        | 15 000 000,00 | 15 008 403,75    | EUR                | 0,18        |
| XS3076324030 | MET LIFE GLOB FRN 21/05/2027             | PROPRE        | 23 300 000,00 | 23 421 367,11    | EUR                | 0,28        |
| XS2928675904 | MITSUB HC CAP UK PLC FRN 31/10/2025      | PROPRE        | 16 000 000,00 | 16 064 820,44    | EUR                | 0,19        |
| XS2780858994 | NATIONAL BANK OF CANADA FRN 06/03/2026   | PROPRE        | 73 000 000,00 | 73 218 026,67    | EUR                | 0,87        |
| XS2926254561 | NATIONAL BANK OF CANADA VAR 27/10/2025   | PROPRE        | 15 000 000,00 | 15 086 867,88    | EUR                | 0,18        |
| XS3068753451 | NATIONWIDE BLDG SOCIETY FRN 09/05/2027   | PROPRE        | 20 000 000,00 | 20 117 351,11    | EUR                | 0,24        |
| XS2710354544 | NATIONWIDE BLDG SOCIETY 4.50% 01/11/2026 | PROPRE        | 30 000 000,00 | 31 768 569,86    | EUR                | 0,38        |
| XS3106532412 | NATWEST MARKETS NV FRN 30/06/2027        | PROPRE        | 8 000 000,00  | 8 006 560,00     | EUR                | 0,09        |
| XS2745115597 | NATWEST MARKETS PLC FRN 09/01/2026       | PROPRE        | 25 000 000,00 | 25 225 669,44    | EUR                | 0,30        |
| XS3072253019 | NATWEST MARKETS PLC FRN 14/05/2027       | PROPRE        | 15 000 000,00 | 15 083 533,33    | EUR                | 0,18        |
| XS2906229138 | NATWEST MARKETS PLC FRN 25/09/2026       | PROPRE        | 20 000 000,00 | 20 031 691,67    | EUR                | 0,24        |
| XS2820449945 | NOVO NORDISK A/S 3.375% 21/05/2026       | PROPRE        | 65 000 000,00 | 65 875 460,96    | EUR                | 0,78        |
| XS3002552134 | NOVO NORDISK FINANCE NL FRN 27/05/2027   | PROPRE        | 90 682 000,00 | 90 974 509,90    | EUR                | 1,08        |
| XS3002812066 | OP CORPORATE BANK PLC FRN 19/05/2027     | PROPRE        | 20 000 000,00 | 20 081 293,33    | EUR                | 0,24        |
| XS2982074358 | ROYAL BANK OF CANADA FRN 04/08/2026      | PROPRE        | 19 600 000,00 | 19 700 493,56    | EUR                | 0,23        |
| XS2931921113 | ROYAL BANK OF CANADA FRN 04/11/2026      | PROPRE        | 55 000 000,00 | 55 271 348,61    | EUR                | 0,65        |
| XS3031467171 | ROYAL BANK OF CANADA FRN 24/03/2027      | PROPRE        | 55 700 000,00 | 55 763 163,80    | EUR                | 0,66        |

## Swiss Life Funds (F) ESG Money Market Euro

| Code valeur                     | Libellé valeur                             | Statut Valeur | Quantité      | Valeur boursière        | Devise de cotation | % Actif net  |
|---------------------------------|--|---------------|---------------|-------------------------|--------------------|--------------|
| FR001400Y1H8                    | SANOFI FRN 11/03/2027                      | PROPRE        | 3 300 000,00  | 3 306 600,46            | EUR                | 0,04         |
| XS3078501767                    | SIEMENS FINANCIERINGSMAT FRN 27/05/2027    | PROPRE        | 15 000 000,00 | 15 046 545,83           | EUR                | 0,18         |
| XS2733106657                    | SIEMENS FINANCIERINGSMAT 4.188% 18/12/2025 | PROPRE        | 24 000 000,00 | 24 034 888,00           | EUR                | 0,28         |
| FR001400N9V5                    | SOCIETE GENERALE FRN 19/01/2026            | PROPRE        | 10 000 000,00 | 10 069 940,00           | EUR                | 0,12         |
| FR001400KZP3                    | SOCIETE GENERALE 4.25% 28/09/2026          | PROPRE        | 22 500 000,00 | 23 780 937,33           | EUR                | 0,28         |
| XS2919743927                    | STANDARD CHARTERED BANK FRN 15/10/2026     | PROPRE        | 20 000 000,00 | 20 120 113,33           | EUR                | 0,24         |
| XS3099153051                    | SWISSCOM FINANCE FRN 30/06/2027            | PROPRE        | 14 400 000,00 | 14 407 776,00           | EUR                | 0,17         |
| XS2827693446                    | SWISSCOM FINANCE 3.5% 29/05/2026           | PROPRE        | 25 826 000,00 | 26 169 446,88           | EUR                | 0,31         |
| FR001400L248                    | THALES SA 4% 18/10/2025                    | PROPRE        | 21 200 000,00 | 21 869 818,36           | EUR                | 0,26         |
| XS2803392021                    | TORONTO DOMINION BANK FRN 16/04/2026       | PROPRE        | 50 000 000,00 | 50 324 666,67           | EUR                | 0,60         |
| XS2737063722                    | TOYOTO MOTOR FINANCE BV FRN 22/12/2025     | PROPRE        | 15 000 000,00 | 15 009 742,50           | EUR                | 0,18         |
| XS2800795291                    | UBS AG LONDON FRN 12/04/2026               | PROPRE        | 40 000 000,00 | 40 257 327,78           | EUR                | 0,48         |
| FR001400WL94                    | VINCI SA FRN 14/01/2027                    | PROPRE        | 10 000 000,00 | 10 058 131,94           | EUR                | 0,12         |
| XS2744130852                    | VOLVO TREASURY AB FRN 09/01/2026           | PROPRE        | 12 800 000,00 | 12 900 211,20           | EUR                | 0,15         |
| XS3026747876                    | VOLVO TREASURY AB FRN 17/03/2027           | PROPRE        | 30 000 000,00 | 30 036 160,00           | EUR                | 0,36         |
| XS2824777267                    | VOLVO TREASURY AB FRN 22/05/2026           | PROPRE        | 24 000 000,00 | 24 084 800,00           | EUR                | 0,29         |
| <b>Total Obligation</b>         |  |               |               | <b>2 048 192 042,78</b> |                    | <b>24,25</b> |
| <b>O.P.C.V.M.</b>               |  |               |               |                         |                    |              |
| FR0007045109                    | ARKEA SUPPORT MONETAIRE FCP                | PROPRE        | 17 500,00     | 199 826 550,00          | EUR                | 2,37         |
| FR0013067790                    | BFT AUREUS ISR FCP                         | PROPRE        | 23 000,00     | 246 458 800,00          | EUR                | 2,92         |
| FR0010216804                    | BNP PARIBAS INVEST 3M SUSTAINABLE FCP      | PROPRE        | 300,00        | 189 381 178,20          | EUR                | 2,24         |
| FR0013113222                    | CANDRIAM MONETAIRE SICAV                   | PROPRE        | 1 000,00      | 108 148 600,00          | EUR                | 1,28         |
| FR0013368065                    | CM AM MONEPLUS FCP                         | PROPRE        | 300,00        | 34 723 890,00           | EUR                | 0,41         |
| FR0010885236                    | OSTRUM SRI MONEY PLUS FCP                  | PROPRE        | 5,00          | 557 192,50              | EUR                | 0,01         |
| FR0011060870                    | SWISS LIFE FUNDS F ESG SHORT TERM EURO FCP | PROPRE        | 2 200,00      | 48 009 302,00           | EUR                | 0,57         |
| <b>Total O.P.C.V.M.</b>         |  |               |               | <b>827 105 512,70</b>   |                    | <b>9,79</b>  |
| <b>Total Valeurs mobilières</b> |  |               |               | <b>2 875 297 555,48</b> |                    | <b>34,04</b> |
| <b>Swap de Taux</b>             |  |               |               |                         |                    |              |
| SWAP04096009                    | 2221369762#\$_2025080                      | PROPRE        | 30 800 000,00 | -218 339,11             | EUR                | -0,00        |
| SWAP04231256                    | 2353428762#\$_2026021                      | PROPRE        | 24 100 000,00 | -201 846,53             | EUR                | -0,00        |
| SWAP04261052                    | 2409967232#L_2026021                       | PROPRE        | 5 000 000,00  | 41 876,87               | EUR                | 0,00         |

## Swiss Life Funds (F) ESG Money Market Euro

| Code valeur                   | Libellé valeur       | Statut Valeur | Quantité         | Valeur boursière     | Devise de cotation | % Actif net  |
|-------------------------------|----------------------|---------------|------------------|----------------------|--------------------|--------------|
| SWAP04268705                  | 2430945922#S_2026042 | PROPRE        | 107 000 000,00   | -1 336 864,89        | EUR                | -0,02        |
| SWAP04276300                  | 2441053252#S_2026042 | PROPRE        | 25 826 000,00    | -338 279,64          | EUR                | -0,00        |
| SWAP04286883                  | 2463551222#L_2026042 | PROPRE        | 8 000 000,00     | 99 011,84            | EUR                | 0,00         |
| SWAP04296953                  | 2488817422#L_2026042 | PROPRE        | 10 000 000,00    | 124 940,65           | EUR                | 0,00         |
| SWAP04339578                  | 2534367362#S_2025070 | PROPRE        | 30 000 000,00    | -32 935,06           | EUR                | -0,00        |
| SWAP04341338                  | 2536701642#S_2025091 | PROPRE        | 10 000 000,00    | -12 594,45           | EUR                | -0,00        |
| SWAP04351611                  | 2549884682#S_2025091 | PROPRE        | 38 000 000,00    | -21 531,84           | EUR                | -0,00        |
| SWAP04351614                  | 2549918972#S_2025092 | PROPRE        | 30 000 000,00    | -21 218,44           | EUR                | -0,00        |
| SWAP04353527                  | 2559414192#S_2026092 | PROPRE        | 22 500 000,00    | -545 331,28          | EUR                | -0,01        |
| SWAP04441631                  | 2587976702#S_2026110 | PROPRE        | 42 400 000,00    | -141 047,21          | EUR                | -0,00        |
| SWAP04539242                  | 2618766512           | PROPRE        | 30 000 000,00    | 55 824,29            | EUR                | 0,00         |
| SWAP04590827                  | 2640443342           | PROPRE        | 5 600 000,00     | -6 539,24            | EUR                | -0,00        |
| SWAP04679428                  | 2738200112           | PROPRE        | 92 000 000,00    | 12 909,48            | EUR                | 0,00         |
| SWAP04686080                  | 2754873332           | PROPRE        | 22 500 000,00    | 15 793,39            | EUR                | 0,00         |
| SWAP04686079                  | 2754919292           | PROPRE        | 30 000 000,00    | 38 661,70            | EUR                | 0,00         |
| SWAP04694976                  | 2767362612           | PROPRE        | 30 000 000,00    | 40 674,26            | EUR                | 0,00         |
| SWAP04702455                  | 2785804172           | PROPRE        | 24 000 000,00    | 299 857,55           | EUR                | 0,00         |
| SWAP04702884                  | 2788512492           | PROPRE        | 42 000 000,00    | 38 201,00            | EUR                | 0,00         |
| <b>Total Swap de Taux</b>     |                      |               |                  | <b>-2 108 776,66</b> |                    | <b>-0,02</b> |
| <b>Liquidites</b>             |                      |               |                  |                      |                    |              |
| <b>APPELS DE MARGES</b>       |                      |               |                  |                      |                    |              |
|                               | APPEL DE MARGE EUR   | PROPRE        | 2 108 776,83     | 2 108 776,83         | EUR                | 0,02         |
| <b>Total APPELS DE MARGES</b> |                      |               |                  | <b>2 108 776,83</b>  |                    | <b>0,02</b>  |
| <b>AUTRES</b>                 |                      |               |                  |                      |                    |              |
|                               | PROV INTCREDCPTDEPCE | PROPRE        | 1 321 496,74     | 1 321 496,74         | EUR                | 0,02         |
| <b>Total AUTRES</b>           |                      |               |                  | <b>1 321 496,74</b>  |                    | <b>0,02</b>  |
| <b>BANQUE OU ATTENTE</b>      |                      |               |                  |                      |                    |              |
|                               | ACH DIFF TITRES EUR  | PROPRE        | -219 510 456,60  | -219 510 456,60      | EUR                | -2,60        |
|                               | BANQUE EUR BNP       | PROPRE        | 5 368,31         | 5 368,31             | EUR                | 0,00         |
|                               | BANQUE EUR SWISSLIFE | PROPRE        | 1 307 006 970,16 | 1 307 006 970,16     | EUR                | 15,47        |
|                               | BANQUE GBP SWISSLIFE | PROPRE        | 0,01             | 0,01                 | GBP                | 0,00         |

## Swiss Life Funds (F) ESG Money Market Euro

| Code valeur                      | Libellé valeur                                    | Statut Valeur | Quantité      | Valeur boursière        | Devise de cotation | % Actif net  |
|----------------------------------|---|---------------|---------------|-------------------------|--------------------|--------------|
|                                  | BANQUE USD SWISSLIFE                              | PROPRE        | 0,12          | 0,10                    | USD                | 0,00         |
| <b>Total BANQUE OU ATTENTE</b>   |   |               |               | <b>1 087 501 881,98</b> |                    | <b>12,88</b> |
| <b>DEPOSIT DE GARANTIE</b>       |   |               |               |                         |                    |              |
|                                  | DEPOSIT OTC VERSE                                 | PROPRE        | 1 708 796,82  | 1 708 796,82            | EUR                | 0,02         |
| <b>Total DEPOSIT DE GARANTIE</b> |   |               |               | <b>1 708 796,82</b>     |                    | <b>0,02</b>  |
| <b>DEPOTS A TERME</b>            |   |               |               |                         |                    |              |
|                                  | DEP EUR 0.2 01/09/25                              | PROPRE        | 50 000 000,00 | 51 217 364,38           | EUR                | 0,61         |
|                                  | DEP EUR 0.3 05/12/25                              | PROPRE        | 45 000 000,00 | 45 730 321,50           | EUR                | 0,54         |
|                                  | DEP EUR 0.3 12/06/26                              | PROPRE        | 50 000 000,00 | 50 055 612,60           | EUR                | 0,59         |
| <b>Total DEPOTS A TERME</b>      |   |               |               | <b>147 003 298,48</b>   |                    | <b>1,74</b>  |
| <b>FRAIS DE GESTION</b>          |   |               |               |                         |                    |              |
|                                  | PRCOMGESTFIN                                      | PROPRE        | -804 280,49   | -804 280,49             | EUR                | -0,01        |
|                                  | PRCOMGESTFIN                                      | PROPRE        | -206 119,51   | -206 119,51             | EUR                | -0,00        |
|                                  | PRCOMGESTFIN                                      | PROPRE        | -21 767,36    | -21 767,36              | EUR                | -0,00        |
|                                  | PRCOMGESTFIN                                      | PROPRE        | -24,62        | -24,62                  | EUR                | -0,00        |
|                                  | PRN-1COMGESTFIN                                   | PROPRE        | -687 534,13   | -687 534,13             | EUR                | -0,01        |
|                                  | PRN-1COMGESTFIN                                   | PROPRE        | -185 053,95   | -185 053,95             | EUR                | -0,00        |
|                                  | PRN-1COMGESTFIN                                   | PROPRE        | -19 837,24    | -19 837,24              | EUR                | -0,00        |
|                                  | PRN-1COMGESTFIN                                   | PROPRE        | -6,92         | -6,92                   | EUR                | -0,00        |
| <b>Total FRAIS DE GESTION</b>    |   |               |               | <b>-1 924 624,22</b>    |                    | <b>-0,02</b> |
| <b>Total Liquidites</b>          |   |               |               | <b>1 237 719 626,63</b> |                    | <b>14,65</b> |
| <b>Creances negociables</b>      |   |               |               |                         |                    |              |
| <b>Interets postcomptes.</b>     |   |               |               |                         |                    |              |
| XS3058655328                     | BANK OF MONTREAL OISEST+0.34% 15/05/2026          | PROPRE        | 38 000 000,00 | 38 220 424,06           | EUR                | 0,45         |
| FR0128691344                     | BANQUE FEDERATIVE DU CRE OISEST+0.32% 08/07/2025  | PROPRE        | 48 000 000,00 | 49 563 571,46           | EUR                | 0,59         |
| FR0128813906                     | BANQUE PALATINE SA OISEST+.30% 26/09/2025         | PROPRE        | 42 000 000,00 | 42 983 444,35           | EUR                | 0,51         |
| FR0128730605                     | BARCLAYS BANK IRELAND PLC OISEST+0.31% 24/07/2025 | PROPRE        | 70 000 000,00 | 72 138 818,31           | EUR                | 0,85         |
| FR0128771856                     | BFCM BANQUE FEDER CRE OISEST+0.32% 12/082025      | PROPRE        | 42 000 000,00 | 43 203 104,47           | EUR                | 0,51         |
| FR0129259372                     | BNP PARIBAS OISEST +0.15% 29/09/2025              | PROPRE        | 60 000 000,00 | 60 013 854,00           | EUR                | 0,71         |
| FR0128786714                     | BPCE OISEST+0.26% 26/08/2025                      | PROPRE        | 20 000 000,00 | 20 552 866,72           | EUR                | 0,24         |
| FR0129111136                     | BRED BANQUE POPULAIRE OISEST + 0.17% 04/07/2025   | PROPRE        | 85 000 000,00 | 85 486 609,89           | EUR                | 1,01         |
| FR0128806777                     | BRED BANQUE POPULAIREF OISEST+0.32% 04/09/2025    | PROPRE        | 25 000 000,00 | 25 646 212,15           | EUR                | 0,30         |
| FR0128959469                     | CAISSE FEDERALE DU OISEST+0.35% 04/12/2025        | PROPRE        | 20 000 000,00 | 20 309 872,34           | EUR                | 0,24         |

## Swiss Life Funds (F) ESG Money Market Euro

| Code valeur                        | Libellé valeur                                     | Statut Valeur | Quantité      | Valeur boursière        | Devise de cotation | % Actif net  |
|------------------------------------|--|---------------|---------------|-------------------------|--------------------|--------------|
| FR0128720572                       | CRCAM NORD DE FRANCE OISEST+0.28% 11/09/2025       | PROPRE        | 10 000 000,00 | 10 249 875,64           | EUR                | 0,12         |
| FR0128570373                       | CRED AGRICOLE LEASING FACT OISEST+0.28% 04/07/2025 | PROPRE        | 15 000 000,00 | 15 487 835,96           | EUR                | 0,18         |
| FR0128730159                       | CREDIT INDUSTRIEL ET OISEST+0.32% 23/07/2025       | PROPRE        | 42 000 000,00 | 43 297 833,95           | EUR                | 0,51         |
| FR0129258465                       | ENGIE SA OISEST +0.15% 28/07/2025                  | PROPRE        | 42 000 000,00 | 42 011 956,47           | EUR                | 0,50         |
| FR0129162071                       | ENGIE SA OISEST+0.21% 24/07/2025                   | PROPRE        | 40 000 000,00 | 40 174 994,78           | EUR                | 0,48         |
| FR0129255024                       | ENGIE SA OISEST+.15% 16/07/2025                    | PROPRE        | 30 000 000,00 | 30 025 886,25           | EUR                | 0,36         |
| XS2898885434                       | LLOYDS BANK CORPO MRKT PLC OISEST+0.29% 04/09/2025 | PROPRE        | 20 000 000,00 | 20 515 049,89           | EUR                | 0,24         |
| XS3063712668                       | LLOYDS BANK CORPORATION OISEST+0.34% 30/03/2026    | PROPRE        | 24 000 000,00 | 24 102 842,67           | EUR                | 0,29         |
| XS2845239388                       | MAREX FINANCIAL OISEST + 0.60% 04/08/2025          | PROPRE        | 50 000 000,00 | 50 215 379,44           | EUR                | 0,59         |
| XS2931575885                       | MAREX FINANCIAL 2.52% 27/10/2025                   | PROPRE        | 70 000 000,00 | 70 335 330,17           | EUR                | 0,83         |
| XS2908585263                       | NATIONAL BANK OF CANADA OISEST+0.27% 26/09/2025    | PROPRE        | 24 000 000,00 | 24 007 327,67           | EUR                | 0,28         |
| FR0128570480                       | NORMANDIE SEINE OISEST+0.29% 15/07/2025            | PROPRE        | 15 000 000,00 | 15 472 594,55           | EUR                | 0,18         |
| XS3041490437                       | QATAR NATIONAL BANK LONDON OISEST+0.36% 30/09/2025 | PROPRE        | 30 000 000,00 | 30 197 253,92           | EUR                | 0,36         |
| XS2928626287                       | STANDARD CHARTED OISEST+0.33% 22/10/2025           | PROPRE        | 16 000 000,00 | 16 334 359,46           | EUR                | 0,19         |
| XS2867295680                       | THE TORONTO DOMINION BANK OISEST+0.305% 18/08/2025 | PROPRE        | 25 000 000,00 | 25 784 805,00           | EUR                | 0,31         |
| XS2929415102                       | TORONTO DOM BK LONDON OISEST + 0.34% 24/11/2025    | PROPRE        | 16 000 000,00 | 16 337 234,31           | EUR                | 0,19         |
| XS2867298510                       | UBS AG OISEST+0.31% 18/07/2025                     | PROPRE        | 30 000 000,00 | 30 937 364,17           | EUR                | 0,37         |
| XS2908892438                       | UBS AG OISEST+0.33% 23/10/2025                     | PROPRE        | 40 000 000,00 | 40 970 295,11           | EUR                | 0,49         |
| FR0129208064                       | VEOLIA ENVIRONMENT OISEST + 0.33% 22/05/2026       | PROPRE        | 34 000 000,00 | 34 090 278,50           | EUR                | 0,40         |
| <b>Total Interets postcomptes.</b> |  |               |               | <b>1 038 667 275,66</b> |                    | <b>12,30</b> |
| <b>Interets precomptes.</b>        |  |               |               |                         |                    |              |
| XS3037644021                       | AKZO NOBEL NV ZCP 25/09/2025                       | PROPRE        | 42 000 000,00 | 41 786 556,02           | EUR                | 0,49         |
| FR0129251080                       | ALSTOM SA ZCP 07/07/2025                           | PROPRE        | 25 000 000,00 | 24 991 435,78           | EUR                | 0,30         |
| XS3110350298                       | AMCOR UK FINANCE PLC ZCP 02/09/2025                | PROPRE        | 40 000 000,00 | 39 854 203,89           | EUR                | 0,47         |
| XS3101989609                       | AMCOR UK FINANCE PLC ZCP 18/07/2025                | PROPRE        | 40 000 000,00 | 39 961 181,51           | EUR                | 0,47         |
| XS3101863846                       | AVERY DENNISON TREASURY MANAGE ZCP 18/09/2025      | PROPRE        | 25 000 000,00 | 24 882 494,78           | EUR                | 0,29         |
| XS3081760020                       | AVERY DENNISON TREASURY MANAGE ZCP 22/08/2025      | PROPRE        | 20 000 000,00 | 19 938 927,40           | EUR                | 0,24         |
| XS3085062233                       | AVERY DENNISON TREASURY MANAGE ZCP 27/08/2025      | PROPRE        | 28 000 000,00 | 27 905 500,59           | EUR                | 0,33         |
| FR0129254563                       | AVRIL ZCP 15/09/2025                               | PROPRE        | 14 000 000,00 | 13 927 750,23           | EUR                | 0,16         |
| XS2957334381                       | BANCO SANTANDER SA ZCP 04/12/2025                  | PROPRE        | 30 000 000,00 | 29 731 086,92           | EUR                | 0,35         |
| BE6365549219                       | BARRY CALLEBAUT SERVICES N V ZCP 11/08/2025        | PROPRE        | 20 000 000,00 | 19 945 775,83           | EUR                | 0,24         |

## Swiss Life Funds (F) ESG Money Market Euro

| Code valeur  | Libellé valeur                                    | Statut Valeur | Quantité       | Valeur boursière | Devise de cotation | % Actif net |
|--------------|---|---------------|----------------|------------------|--------------------|-------------|
| BE6365863446 | BARRY CALLEBAUT SERVICES N.V. ZCP 26/09/2025      | PROPRE        | 40 000 000,00  | 39 759 418,46    | EUR                | 0,47        |
| FR0128691567 | BPIFRANCE ZCP 01/07/2025                          | PROPRE        | 42 000 000,00  | 42 000 000,00    | EUR                | 0,50        |
| FR0129253185 | BPIFRANCE ZCP 1206/2026                           | PROPRE        | 32 000 000,00  | 31 401 708,10    | EUR                | 0,37        |
| FR0129228385 | CA CONSUMER FINANCE ZCP 26/05/2026                | PROPRE        | 42 000 000,00  | 41 236 092,59    | EUR                | 0,49        |
| XS3072315149 | CARLSBERG BREWERIES ZCP 12/09/2025                | PROPRE        | 20 000 000,00  | 19 914 509,63    | EUR                | 0,24        |
| FR0128765007 | CARREFOUR BANQUE ZCP 01/07/2025                   | PROPRE        | 30 000 000,00  | 30 000 000,00    | EUR                | 0,36        |
| FR0129229417 | CDC HABITAT ZCP 26/05/2026                        | PROPRE        | 8 500 000,00   | 8 341 318,23     | EUR                | 0,10        |
| XS3104457117 | CLEARSTREAM BANKING ZCP 04/07/2025                | PROPRE        | 35 000 000,00  | 34 994 242,92    | EUR                | 0,41        |
| XS3101875261 | COCA COLA EUROPEAN PARTNERS PL ZCP 02/07/2025     | PROPRE        | 120 000 000,00 | 119 993 423,42   | EUR                | 1,42        |
| XS3111824127 | COCA COLA EUROPEAN ZCP 23/07/2025                 | PROPRE        | 120 000 000,00 | 119 853 840,11   | EUR                | 1,42        |
| DE000CZ451F2 | COMMERZBANK AG ZCP 26/02/2026                     | PROPRE        | 34 000 000,00  | 33 528 497,90    | EUR                | 0,40        |
| FR0129111706 | COMPAGNIE GENERALE DE LOCATION ZCP 07/10/2025     | PROPRE        | 5 000 000,00   | 4 971 757,34     | EUR                | 0,06        |
| FR0129163277 | COMPAGNIE GENERALE DE LOCATION ZCP 28/10/2025     | PROPRE        | 14 000 000,00  | 13 904 566,01    | EUR                | 0,16        |
| FR0129233922 | COMPAGNIE GENERALE DE LOCATION ZCP 28/11/2025     | PROPRE        | 24 000 000,00  | 23 792 883,15    | EUR                | 0,28        |
| FR0129083889 | COMPAGNIE GENERALE DE ZCP 27/08/2025              | PROPRE        | 10 200 000,00  | 10 165 791,18    | EUR                | 0,12        |
| FR0129258572 | COMPAGNIE GENERALE ZCP 28/07/2025                 | PROPRE        | 10 000 000,00  | 9 985 014,21     | EUR                | 0,12        |
| FR0129157733 | COVIVIO SA ZCP 25/08/2025                         | PROPRE        | 32 000 000,00  | 31 898 828,77    | EUR                | 0,38        |
| FR0128720697 | CRED AGRICOLE LEASING ZCP 25/09/2025              | PROPRE        | 30 000 000,00  | 29 850 699,95    | EUR                | 0,35        |
| XS3099785449 | DANAHER CORPORATION ZCP 16/09/2025                | PROPRE        | 20 000 000,00  | 19 905 682,91    | EUR                | 0,24        |
| FR0129253615 | DANONE SA ZCP 15/07/2025                          | PROPRE        | 16 000 000,00  | 15 987 549,43    | EUR                | 0,19        |
| FR0129162345 | DANONE ZCP 24/07/2025                             | PROPRE        | 50 000 000,00  | 49 935 575,78    | EUR                | 0,59        |
| XS3047438083 | DEUTSCHE BANK AG ZCP 02/04/2026                   | PROPRE        | 30 000 000,00  | 29 528 613,94    | EUR                | 0,35        |
| XS3008634936 | DEUTSCHE BANK AG ZCP 17/02/2026                   | PROPRE        | 24 000 000,00  | 23 680 732,85    | EUR                | 0,28        |
| FR0129229250 | EDENRED ZCP 21/07/2025                            | PROPRE        | 40 000 000,00  | 39 955 145,16    | EUR                | 0,47        |
| FR0129157782 | EDENRED ZCP 25/08/2025                            | PROPRE        | 20 000 000,00  | 19 935 241,61    | EUR                | 0,24        |
| ES0530674528 | ENDESA SA ZCP 29/08/2025                          | PROPRE        | 60 000 000,00  | 59 801 150,45    | EUR                | 0,71        |
| XS3013863207 | GOLDMAN SACHS STEP COMPLIANT CDN 24/02/2026       | PROPRE        | 34 000 000,00  | 33 524 453,69    | EUR                | 0,40        |
| XS3087667302 | HEINEKEN NV ZCP 04/12/2025                        | PROPRE        | 16 000 000,00  | 15 852 493,56    | EUR                | 0,19        |
| XS2858866275 | HEWLETT PACKARD INT ZCP 07/07/2025                | PROPRE        | 15 000 000,00  | 14 994 630,30    | EUR                | 0,18        |
| XS3095446251 | HEWLETT PACKARD INTERNATIONAL BANK CDN 10/06/2026 | PROPRE        | 18 000 000,00  | 17 653 685,27    | EUR                | 0,21        |
| XS3036981754 | HEWLETT PACKARD INTERNATIONAL ZCP 23/03/2026      | PROPRE        | 15 000 000,00  | 14 772 853,70    | EUR                | 0,17        |

## Swiss Life Funds (F) ESG Money Market Euro

| Code valeur  | Libellé valeur                                | Statut Valeur | Quantité      | Valeur boursière | Devise de cotation | % Actif net |
|--------------|---|---------------|---------------|------------------|--------------------|-------------|
| XS3084320335 | IBERDROLA INTERNATIONAL BV ZCP 04/07/2025     | PROPRE        | 75 000 000,00 | 74 987 090,32    | EUR                | 0,89        |
| XS3107127014 | IBERDROLA INTERNATIONAL BV ZCP 26/09/2025     | PROPRE        | 45 000 000,00 | 44 778 073,01    | EUR                | 0,53        |
| FR0129156537 | ITM ENTREPRISES SA ZCP 31/07/2025             | PROPRE        | 28 000 000,00 | 27 946 736,36    | EUR                | 0,33        |
| FR0129228799 | ITM ENTREPRISES ZCP 14/07/2025                | PROPRE        | 32 000 000,00 | 31 974 233,18    | EUR                | 0,38        |
| XS3104247815 | ITT INDUSTRIES LUXE ZCP 11/07/2025            | PROPRE        | 5 000 000,00  | 4 996 766,63     | EUR                | 0,06        |
| XS3092477366 | ITT INDUSTRIES LUXEMBOURG SARL ZCP 03/07/2025 | PROPRE        | 14 000 000,00 | 13 998 108,99    | EUR                | 0,17        |
| XS3099830500 | ITT INDUSTRIES LUXEMBOURG SARL ZCP 16/07/2025 | PROPRE        | 14 000 000,00 | 13 986 427,40    | EUR                | 0,17        |
| XS3105153293 | ITT INDUSTRIES LUXEMBOURG SARL ZCP 23/07/2025 | PROPRE        | 10 000 000,00 | 9 985 719,54     | EUR                | 0,12        |
| FR0129259901 | JYSKE BANK A/S ZCP 11/07/2025                 | PROPRE        | 75 000 000,00 | 74 960 100,18    | EUR                | 0,89        |
| FR0129259919 | JYSKE BANK ZCP 07/07/2025                     | PROPRE        | 90 000 000,00 | 89 971 270,67    | EUR                | 1,07        |
| FR0129251601 | KERING FINANCE ZCP 08/09/2025                 | PROPRE        | 16 000 000,00 | 15 936 712,39    | EUR                | 0,19        |
| FR0129133908 | KERING FINANCE ZCP 11/07/2025                 | PROPRE        | 16 000 000,00 | 15 991 174,88    | EUR                | 0,19        |
| FR0129258259 | KERING FINANCE ZCP 25/08/2025                 | PROPRE        | 38 000 000,00 | 37 880 513,19    | EUR                | 0,45        |
| XS3107143052 | KONINKLIJKE AHOLD D ZCP 03/07/2025            | PROPRE        | 40 000 000,00 | 39 995 513,58    | EUR                | 0,47        |
| XS3099967393 | KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV ZCP 17/07/2025  | PROPRE        | 24 000 000,00 | 23 978 367,08    | EUR                | 0,28        |
| FR0129026110 | L OCCITANE INTERNATIONAL ZCP 15/07/2025       | PROPRE        | 20 000 000,00 | 19 982 961,47    | EUR                | 0,24        |
| FR0129251569 | LOC D EQUIPMENTS ZCP 08/12/2025               | PROPRE        | 22 000 000,00 | 21 795 778,69    | EUR                | 0,26        |
| FR0129103968 | L'OCCITANE INTERNATIONAL S.A. ZCP 17/07/2025  | PROPRE        | 22 000 000,00 | 21 978 885,05    | EUR                | 0,26        |
| FR0129100709 | LOC.D'EQUIPMENTS ZCP 08/09/2025               | PROPRE        | 25 000 000,00 | 24 898 398,77    | EUR                | 0,29        |
| FR0129228765 | LOUIS DREYFUS COMPANY BV ZCP 10/07/2025       | PROPRE        | 21 600 000,00 | 21 588 625,68    | EUR                | 0,26        |
| XS3077159021 | LSEG NETHERLAND BV ZCP 16/07/2025             | PROPRE        | 35 000 000,00 | 34 969 940,65    | EUR                | 0,41        |
| XS2901965314 | LSEG NETHERLANDS B V 11/07/2025               | PROPRE        | 34 000 000,00 | 33 980 091,25    | EUR                | 0,40        |
| FR0129063311 | LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITT ZCP 16/04/2026 | PROPRE        | 22 500 000,00 | 22 148 860,10    | EUR                | 0,26        |
| XS3074415863 | NATIONAL GRID NORTH ZCP 14/07/2025            | PROPRE        | 30 000 000,00 | 29 977 684,46    | EUR                | 0,35        |
| XS3090962401 | NATWEST MARKETS NV ZCP 03/06/2026             | PROPRE        | 40 000 000,00 | 39 258 238,00    | EUR                | 0,46        |
| XS3108515076 | NESTLE FINANCE INTE ZCP 28/07/2025            | PROPRE        | 50 000 000,00 | 49 925 946,99    | EUR                | 0,59        |
| FR0129134971 | NEXITY ZCP 16/07/2025                         | PROPRE        | 18 000 000,00 | 17 973 468,05    | EUR                | 0,21        |
| XS3063731536 | NOMURA BANK INTERNATIONAL CDN 28/10/2025      | PROPRE        | 32 000 000,00 | 31 778 476,75    | EUR                | 0,38        |
| XS3101337106 | NV ENECO BEHEER ZCP 17/07/2025                | PROPRE        | 40 000 000,00 | 39 963 957,15    | EUR                | 0,47        |
| FR0129213684 | PR FINANCE SA ZCP 05/09/2025                  | PROPRE        | 10 000 000,00 | 9 961 900,27     | EUR                | 0,12        |
| XS3093338534 | RELX PLC ZCP 09/07/2025                       | PROPRE        | 28 000 000,00 | 27 987 179,02    | EUR                | 0,33        |

## Swiss Life Funds (F) ESG Money Market Euro

| Code valeur                       | Libellé valeur                                    | Statut Valeur | Quantité       | Valeur boursière        | Devise de cotation | % Actif net  |
|-----------------------------------|---|---------------|----------------|-------------------------|--------------------|--------------|
| XS3103526599                      | RELX (INVESTMENTS) PLC ZCP 21/07/2025             | PROPRE        | 42 000 000,00  | 41 951 630,21           | EUR                | 0,50         |
| XS3107127956                      | RELX PLC ZCP 28/07/2025                           | PROPRE        | 21 000 000,00  | 20 966 980,21           | EUR                | 0,25         |
| FR0129254282                      | RTE RESEAU DE TRANS ELETRI ZCP 15/07/2025         | PROPRE        | 20 000 000,00  | 19 984 152,91           | EUR                | 0,24         |
| XS3089744216                      | SAP SE ZCP 07/08/2025                             | PROPRE        | 38 000 000,00  | 37 920 216,45           | EUR                | 0,45         |
| XS3058655591                      | SHS NEDERLAND HOLDING ZCP 17/09/2025              | PROPRE        | 21 000 000,00  | 20 897 492,46           | EUR                | 0,25         |
| XS3049425849                      | SSE PLC ZCP 08/07/2025                            | PROPRE        | 37 500 000,00  | 37 485 076,04           | EUR                | 0,44         |
| XS3054666626                      | SSE PLC ZCP 15/07/2025                            | PROPRE        | 20 000 000,00  | 19 983 681,51           | EUR                | 0,24         |
| XS3059579501                      | SSE PLC ZCP 22/07/2025                            | PROPRE        | 32 000 000,00  | 31 960 271,97           | EUR                | 0,38         |
| XS3087737444                      | SSE PLC ZCP 29/08/2025                            | PROPRE        | 37 000 000,00  | 36 873 995,28           | EUR                | 0,44         |
| XS3066587430                      | SSE PLC ZCP 31/07/2025                            | PROPRE        | 10 000 000,00  | 9 982 207,84            | EUR                | 0,12         |
| XS3101456963                      | STANLEY BLACK AND DECKER INC ZCP 21/08/2025       | PROPRE        | 30 000 000,00  | 29 904 317,56           | EUR                | 0,35         |
| BE6359037080                      | SUMITOMO MITSUI BAN CDN 31/07/2025                | PROPRE        | 100 000 000,00 | 99 825 692,36           | EUR                | 1,18         |
| BE6363069632                      | SUMITOMO MITSUI BANKING CORPRATION ZCP 01/10/2025 | PROPRE        | 40 000 000,00  | 39 793 693,50           | EUR                | 0,47         |
| FR0129061778                      | TECHNIP EUROCASH ZCP 07/07/2025                   | PROPRE        | 25 000 000,00  | 24 991 723,98           | EUR                | 0,30         |
| FR0129102382                      | UNIVERSAL MUSIC GROUP ZCP 22/07/2025              | PROPRE        | 30 000 000,00  | 29 963 644,36           | EUR                | 0,35         |
| FR0129109825                      | UNIVERSAL MUSIC GROUP ZCP 30/09/2025              | PROPRE        | 17 000 000,00  | 16 908 490,95           | EUR                | 0,20         |
| FR0129254183                      | VEOLIA ENVIRONMENT ZCP 13/10/2025                 | PROPRE        | 24 000 000,00  | 23 857 162,62           | EUR                | 0,28         |
| XS2857881614                      | VOLVO TREASURY AB ZCP 04/07/2025                  | PROPRE        | 55 000 000,00  | 54 990 651,10           | EUR                | 0,65         |
| XS3053418946                      | VOLVO TREASURY AB ZCP 11/07/2025                  | PROPRE        | 15 000 000,00  | 14 991 117,83           | EUR                | 0,18         |
| XS3107136510                      | VOLVO TREASURY AB ZCP 28/07/2025                  | PROPRE        | 8 000 000,00   | 7 987 548,31            | EUR                | 0,09         |
| XS3104403707                      | WOLTERS KLUWER NV ZCP 10/07/2025                  | PROPRE        | 15 000 000,00  | 14 992 571,19           | EUR                | 0,18         |
| FR0129179109                      | WORLDLINE ZCP 07/07/2025                          | PROPRE        | 14 000 000,00  | 13 994 593,55           | EUR                | 0,17         |
| <b>Total Interets precomptes.</b> |   |               |                | <b>2 903 789 425,51</b> |                    | <b>34,38</b> |
| <b>Taux revisable</b>             |   |               |                |                         |                    |              |
| FR0128569649                      | ALLIANZ BANQUE E3R+0.38% 24/04/2026               | PROPRE        | 10 000 000,00  | 10 045 601,58           | EUR                | 0,12         |
| FR0128809862                      | ALLIANZ BANQUE E3R+0.4% 1609/2026                 | PROPRE        | 10 000 000,00  | 10 004 346,27           | EUR                | 0,12         |
| FR0128865484                      | ALLIANZ BANQUE E3R+0.4% 21/10/2026                | PROPRE        | 10 000 000,00  | 10 054 810,03           | EUR                | 0,12         |
| FR0128691252                      | ALLIANZ BANQUE E3R+0.41% 08/07/2026               | PROPRE        | 10 000 000,00  | 10 058 210,67           | EUR                | 0,12         |
| FR0129031151                      | ALLIANZ BANQUE SA E3R+0.38% 03/02/2027            | PROPRE        | 10 000 000,00  | 10 048 349,83           | EUR                | 0,12         |
| FR0129106904                      | BANQUE STELLANTIS E3M+0.48% 19/03/2027            | PROPRE        | 25 000 000,00  | 25 028 248,61           | EUR                | 0,30         |
| FR0128719368                      | BANQUE STELLANTIS FRANCE E3R+0.35% 22/07/2026     | PROPRE        | 10 000 000,00  | 10 051 763,00           | EUR                | 0,12         |

## Swiss Life Funds (F) ESG Money Market Euro

| Code valeur   | Libellé valeur                                 | Statut Valeur | Quantité      | Valeur boursière        | Devise de cotation | % Actif net   |
|---|--|---------------|---------------|-------------------------|--------------------|---------------|
| FR0128866219  | BANQUE STELLANTIS FRANCE E3R+0.50% 21/10/2026  | PROPRE        | 15 000 000,00 | 15 093 938,25           | EUR                | 0,18          |
| FR0129255339  | CA CONSUMER FINANCE E3R+0.44% 16/06/2027       | PROPRE        | 16 000 000,00 | 16 014 606,44           | EUR                | 0,19          |
| FR0128765965  | CARREFOUR BANQUE E3R+0.58% 18/09/2026          | PROPRE        | 25 000 000,00 | 25 028 604,02           | EUR                | 0,30          |
| FR0128766799  | CARREFOUR BANQUE E3R+0.6% 14/10/2026           | PROPRE        | 35 000 000,00 | 35 237 002,50           | EUR                | 0,42          |
| FR0128734938  | EIFPAGE E3R 29/01/2026                         | PROPRE        | 32 000 000,00 | 32 170 056,89           | EUR                | 0,38          |
| FR0128931708  | EIFPAGE E3R+0.90% 13/11/2026                   | PROPRE        | 40 000 000,00 | 40 203 862,22           | EUR                | 0,48          |
| FR0129207868  | ELECTRICITE DE FRANCE E3R+0.6% 19/05/2027      | PROPRE        | 40 000 000,00 | 40 153 419,00           | EUR                | 0,48          |
| FR0128193895  | LA CAISS FEDERALE CRDT DU E3R+0.45% 05/09/2025 | PROPRE        | 10 000 000,00 | 10 019 890,33           | EUR                | 0,12          |
| FR0128359033  | LA CAISS FEDERALE CRDT DU E3R+0.50% 02/01/2026 | PROPRE        | 25 000 000,00 | 25 195 493,06           | EUR                | 0,30          |
| FR0128190743  | LA CAISS FEDERALE CRDT DU E3R+0.51% 29/08/2025 | PROPRE        | 20 000 000,00 | 20 050 289,11           | EUR                | 0,24          |
| FR0128810985  | PALATINE E3R+0.30% 17/09/2025                  | PROPRE        | 17 500 000,00 | 18 027 930,18           | EUR                | 0,21          |
| FR0128345149  | SOCRAM BANQUE E3R+0.7% 28/11/2025              | PROPRE        | 10 000 000,00 | 10 037 564,16           | EUR                | 0,12          |
| XS2899604818  | STANDARD CHARTERED E3R+0.45% 09/09/2026        | PROPRE        | 20 000 000,00 | 20 043 205,55           | EUR                | 0,24          |
| <b>Total Taux revisable</b>                             |  |               |               | <b>392 567 191,70</b>   |                    | <b>4,65</b>   |
| <b>Total Creances negociables</b>                       |  |               |               | <b>4 335 023 892,87</b> |                    | <b>51,33</b>  |
| <b>Total Swiss Life Funds (F) ESG Money Market Euro</b> |  |               |               | <b>8 445 932 298,32</b> |                    | <b>100,00</b> |

**ANNEXE AU RAPPORT**  
**destinée aux souscripteurs suisses**

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

**Représentant en Suisse :**

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

**Agent payeur en Suisse :**

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

Clôture annuelle du fonds : 31-déc.

Fortune moyenne du fonds pour la période du 28/06/24 au 30/06/25 : 7 390 702 125,28

**Action I FR0010089649**

Commission de gestion de la direction de l'OPCVM : 0,30 % TTC

Fortune moyenne de la part I pour la période du 28/06/24 au 30/06/25 : 6 830 969 337,89

extrait du compte de résultat

| Charges en euro                                    | Rapport semestriel<br>27/06/2024 | Rapport annuel<br>31/12/2024 | Rapport semestriel<br>30/06/2025 |
|--|----------------------------------|------------------------------|----------------------------------|
| Commission de la direction de l'OPCVM              | 3 844 521,36                     | 7 918 909,58                 | 4 156 162,13                     |
| Rémunération en fonction de la performance         | 0,00                             | 0,00                         | 0,00                             |
| Commission de la banque dépositaire                | 0,00                             | 0,00                         | 0,00                             |
| Autres charges                                     |                                  |                              |                                  |
| Impôts   | 0,00                             | 0,00                         | 0,00                             |
| Total des charges d'exploitation hors bonification | 3 844 521,36                     | 7 918 909,58                 | 4 156 162,13                     |
| Total des charges d'exploitation avec bonification | 3 844 521,36                     | 7 918 909,58                 | 4 156 162,13                     |

**TER y compris rémunération en fonction de la performance**

$$(((7918909.58-3844521.36)+4156162.13)/6830969337.89)*100$$

TER 0,12 %

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

0,00 %

Swiss Life Funds (F) ESG Money Market Euro

**Action P**

**FR0010540385**

Commission de gestion de la direction de l'OPCVM : 0,60 % TTC

Fortune moyenne de la part P pour la période du 28/06/24 au 30/06/25 : 465 014 825,39

extrait du compte de résultat

| Charges en euro                                    | Rapport semestriel<br>27/06/2024 | Rapport annuel<br>31/12/2024 | Rapport semestriel<br>30/06/2025 |
|--|----------------------------------|------------------------------|----------------------------------|
| Commission de la direction de l'OPCVM              | 863 208,52                       | 2 028 405,82                 | 1 199 666,01                     |
| Rémunération en fonction de la performance         | 0,00                             | 0,00                         | 0,00                             |
| Commission de la banque dépositaire                | 0,00                             | 0,00                         | 0,00                             |
| Autres charges                                     |                                  |                              |                                  |
| Impôts   | 0,00                             | 0,00                         | 0,00                             |
| Total des charges d'exploitation hors bonification | 863 208,52                       | 2 028 405,82                 | 1 199 666,01                     |
| Total des charges d'exploitation avec bonification | 863 208,52                       | 2 028 405,82                 | 1 199 666,01                     |

**TER y compris rémunération en fonction de la performance**

$$(((2028405.82-863208.52)+1199666.01)/465014825.39)*100$$

TER 0,51 %

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

0,00 %

Swiss Life Funds (F) ESG Money Market Euro

**Action I2**

**FR001400OU77**

Commission de gestion de la direction de l'OPCVM :

0,30 % TTC

Fortune moyenne de la part I2 pour la période du 27/10/24 au 30/06/25 :

94 517 692,30

extrait du compte de résultat

| Charges en euro                                    | Rapport semestriel<br>27/06/2024 | Rapport annuel<br>31/12/2024 | Rapport semestriel<br>30/06/2025 |
|--|----------------------------------|------------------------------|----------------------------------|
| Commission de la direction de l'OPCVM              | 0,00                             | 46,24                        | 83 869,32                        |
| Rémunération en fonction de la performance         | 0,00                             | 0,00                         | 0,00                             |
| Commission de la banque dépositaire                | 0,00                             | 0,00                         | 0,00                             |
| Autres charges                                     |                                  |                              |                                  |
| Impôts   | 0,00                             | 0,00                         | 0,00                             |
| Total des charges d'exploitation hors bonification | 0,00                             | 46,24                        | 83 869,32                        |
| Total des charges d'exploitation avec bonification | 0,00                             | 46,24                        | 83 869,32                        |

**TER annualisé sur 7 mois, y compris rémunération en fonction de la performance**

$$(((46.24-0)+83869.32)/94517692.3)*0.99*100$$

TER

**0,09** %

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

**0,00** %

Swiss Life Funds (F) ESG Money Market Euro

**Action I3**

**FR001400ZAY6**

Commission de gestion de la direction de l'OPCVM : 0,30 % TTC

Fortune moyenne de la part I3 pour la période du 20/05/25 au 30/06/25 : 200 269,70

extrait du compte de résultat

| Charges en euro                                    | Rapport semestriel<br>27/06/2024 | Rapport annuel<br>31/12/2024 | Rapport semestriel<br>30/06/2025 |
|--|----------------------------------|------------------------------|----------------------------------|
| Commission de la direction de l'OPCVM              | 0,00                             | 0,00                         | 31,54                            |
| Rémunération en fonction de la performance         | 0,00                             | 0,00                         | 0,00                             |
| Commission de la banque dépositaire                | 0,00                             | 0,00                         | 0,00                             |
| Autres charges                                     |                                  |                              |                                  |
| Impôts   | 0,00                             | 0,00                         | 0,00                             |
| Total des charges d'exploitation hors bonification | 0,00                             | 0,00                         | 31,54                            |
| Total des charges d'exploitation avec bonification | 0,00                             | 0,00                         | 31,54                            |

**TER annualisé sur 1,5 mois, y compris rémunération en fonction de la performance**

$$(((0-0)+31.54)/200269.7)*8.69*100$$

TER 0,14 %

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

0,00 %

**Bilan****Actif**

|  | 30.06.2025              | - |
|--|-------------------------|---|
| Devise   | EUR                     | - |
| <b>Immobilisations corporelles nettes</b>  | -                       | - |
| <b>Titres financiers</b>   |                         |   |
| <b>Actions et valeurs assimilées (A) <sup>(1)</sup></b>                            | -                       | - |
| Négoiciées sur un marché réglementé ou assimilé                                    | -                       | - |
| Non négoiciées sur un marché réglementé ou assimilé                                | -                       | - |
| <b>Obligations convertibles en actions (B) <sup>(1)</sup></b>                      | -                       | - |
| Négoiciées sur un marché réglementé ou assimilé                                    | -                       | - |
| Non négoiciées sur un marché réglementé ou assimilé                                | -                       | - |
| <b>Obligations et valeurs assimilées (C) <sup>(1)</sup></b>                        | <b>2 048 192 042,78</b> | - |
| Négoiciées sur un marché réglementé ou assimilé                                    | 2 048 192 042,78        | - |
| Non négoiciées sur un marché réglementé ou assimilé                                | -                       | - |
| <b>Titres de créances (D)</b>  | <b>4 335 023 892,87</b> | - |
| Négoiciées sur un marché réglementé ou assimilé                                    | 4 335 023 892,87        | - |
| Non négoiciées sur un marché réglementé ou assimilé                                | -                       | - |
| <b>Parts d'OPC et de fonds d'investissements (E)</b>                               | <b>827 105 512,70</b>   | - |
| OPCVM  | 827 105 512,70          | - |
| FIA et équivalents d'autres Etats membres de l'Union Européenne                    | -                       | - |
| Autres OPC et fonds d'investissement   | -                       | - |
| <b>Dépôts (F)</b>  | <b>147 003 298,48</b>   | - |
| <b>Instruments financiers à terme (G)</b>  | <b>2 876 527,86</b>     | - |
| <b>Opérations temporaires sur titres (H)</b>                                       | -                       | - |
| Créances représentatives de titres financiers reçus en pension                     | -                       | - |
| Créances représentatives de titres donnés en garantie                              | -                       | - |
| Créances représentatives de titres financiers prêtés                               | -                       | - |
| Titres financiers empruntés  | -                       | - |
| Titres financiers donnés en pension  | -                       | - |
| Autres opérations temporaires  | -                       | - |
| <b>Prêts (I)</b>   | -                       | - |
| <b>Autres actifs éligibles (J)</b>   | -                       | - |
| <b>Sous-total actifs éligibles I =<br/>(A + B + C + D + E + F + G + H + I + J)</b> | <b>7 360 201 274,69</b> | - |
| <b>Créances et comptes d'ajustement actifs</b>                                     | <b>3 030 293,56</b>     | - |
| <b>Comptes financiers</b>  | <b>1 307 012 338,58</b> | - |
| <b>Sous-total actifs autres que les actifs éligibles II</b>                        | <b>1 310 042 632,14</b> | - |
| <b>Total Actif I + II</b>  | <b>8 670 243 906,83</b> | - |

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

**Bilan****Passif**

|   | 30.06.2025              | - |
|---|-------------------------|---|
| Devise  | EUR                     | - |
| <b>Capitaux propres :</b>   |                         |   |
| Capital   | 8 335 461 451,05        | - |
| Report à nouveau sur revenu net   | -                       | - |
| Report à nouveau des plus et moins-values réalisées nettes              | -                       | - |
| Résultat net de l'exercice  | 110 470 847,27          | - |
| <b>Capitaux propres I</b>   | <b>8 445 932 298,32</b> | - |
| <b>Passifs de financement II <sup>(1)</sup></b>                         | -                       | - |
| <b>Capitaux propres et passifs de financement (I+II) <sup>(1)</sup></b> | -                       | - |
| <b>Passifs éligibles :</b>  |                         |   |
| <b>Instruments financiers (A)</b>                                       | -                       | - |
| Opérations de cession sur instruments financiers                        | -                       | - |
| Opérations temporaires sur titres financiers                            | -                       | - |
| <b>Instruments financiers à terme (B)</b>                               | <b>2 876 527,69</b>     | - |
| <b>Emprunts</b>   | -                       | - |
| <b>Autres passifs éligibles (C)</b>                                     | -                       | - |
| <b>Sous-total passifs éligibles III = A + B + C</b>                     | <b>2 876 527,69</b>     | - |
| <b>Autres passifs :</b>   |                         |   |
| <b>Dettes et comptes d'ajustement passifs</b>                           | <b>221 435 080,82</b>   | - |
| <b>Concours bancaires</b>   | -                       | - |
| <b>Sous-total autres passifs IV</b>                                     | <b>221 435 080,82</b>   | - |
| <b>Total Passifs: I + II + III + IV</b>                                 | <b>8 670 243 906,83</b> | - |

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

## Compte de résultat

|   | 30.06.2025            | -        |
|---|-----------------------|----------|
| Devise  | EUR                   | -        |
| <b>Revenus financiers nets</b>  |                       |          |
| <b>Produits sur opérations financières</b>                                  |                       |          |
| Produits sur actions  | -                     | -        |
| Produits sur obligations  | 33 208 569,72         | -        |
| Produits sur titres de créance  | 59 110 991,85         | -        |
| Produits sur des parts d'OPC <sup>(1)</sup>                                 | -                     | -        |
| Produits sur instruments financiers à terme                                 | 346 187,98            | -        |
| Produits sur opérations temporaires sur titres                              | 26 673,15             | -        |
| Produits sur prêts et créances  | -                     | -        |
| Produits sur autres actifs et passifs éligibles                             | 1 695 253,77          | -        |
| Autres produits financiers  | 8 991 301,13          | -        |
| <b>Sous-total Produits sur opérations financières</b>                       | <b>103 378 977,60</b> | <b>-</b> |
| <b>Charges sur opérations financières</b>                                   |                       |          |
| Charges sur opérations financières  | -                     | -        |
| Charges sur instruments financiers à terme                                  | -724 145,52           | -        |
| Charges sur opérations temporaires sur titres                               | -                     | -        |
| Charges sur emprunts  | -                     | -        |
| Charges sur autres actifs et passifs éligibles                              | -                     | -        |
| Charges sur passifs de financement  | -                     | -        |
| Autres charges financières  | -                     | -        |
| <b>Sous-total charges sur opérations financières</b>                        | <b>-724 145,52</b>    | <b>-</b> |
| <b>Total Revenus financiers nets (A)</b>                                    | <b>102 654 832,08</b> | <b>-</b> |
| <b>Autres produits :</b>  |                       |          |
| Rétrocession des frais de gestion au bénéfice de l'OPC                      | -                     | -        |
| Versements en garantie de capital ou de performance                         | -                     | -        |
| Autres produits   | -                     | -        |
| <b>Autres charges :</b>   |                       |          |
| Frais de gestion de la société de gestion                                   | -5 439 729,00         | -        |
| Frais d'audit, d'études des fonds de capital investissement                 | -                     | -        |
| Impôts et taxes   | -                     | -        |
| Autres charges  | -12 000,00            | -        |
| <b>Sous-total Autres produits et Autres charges (B)</b>                     | <b>-5 451 729,00</b>  | <b>-</b> |
| <b>Sous total Revenus nets avant compte de régularisation<br/>C = A - B</b> | <b>97 203 103,08</b>  | <b>-</b> |
| <b>Régularisation des revenus nets de l'exercice (D)</b>                    | <b>10 211 716,22</b>  | <b>-</b> |
| <b>Sous-total revenus nets I = C + D</b>                                    | <b>107 414 819,30</b> | <b>-</b> |

<sup>(1)</sup> Conformément aux principes de la transparence fiscale, les produits des parts d'OPC ont pu être retraités en fonction des revenus sous-jacents.

**Compte de résultat (suite)**

|  | 30.06.2025            | -        |
|--|-----------------------|----------|
| Devise   | EUR                   | -        |
| <b>Plus ou moins-values réalisées nettes avant compte de régularisations :</b>               |                       |          |
| Plus et moins-values réalisées   | 1 688 055,45          | -        |
| Frais de transactions externes et frais de cession   | -4 338,96             | -        |
| Frais de recherche   | -                     | -        |
| Quote-part des plus-values réalisées restituées aux assureurs                                | -                     | -        |
| Indemnités d'assurance perçues   | -                     | -        |
| Versements en garantie de capital ou de performance reçus                                    | -                     | -        |
| <b>Sous total plus ou moins-values réalisées nettes avant compte de régularisations E</b>    | <b>1 683 716,49</b>   | <b>-</b> |
| <b>Régularisations des plus ou moins-values réalisées nettes F</b>                           | <b>1 079 746,13</b>   | <b>-</b> |
| <b>Plus ou moins-values réalisées nettes II = E + F</b>                                      | <b>2 763 462,62</b>   | <b>-</b> |
| <b>Plus ou moins-values latentes nettes avant compte de régularisations :</b>                |                       |          |
| Variation des plus ou moins-values latentes yc les écarts de change sur les actifs éligibles | -228 219,27           | -        |
| Ecart de change sur les comptes financiers en devises  | -0,02                 | -        |
| Versements en garantie de capital ou de performance à recevoir                               | -                     | -        |
| Quote-part des plus-values latentes à restituer aux assureurs                                | -                     | -        |
| <b>Sous total plus ou moins-values latentes nettes avant compte de régularisation G</b>      | <b>-228 219,29</b>    | <b>-</b> |
| <b>Régularisations des plus ou moins-values latentes nettes H</b>                            | <b>520 784,64</b>     | <b>-</b> |
| <b>Plus ou moins-values latentes nettes III = G + H</b>                                      | <b>292 565,35</b>     | <b>-</b> |
| <b>Acomptes :</b>  |                       |          |
| Acomptes sur revenus nets versés au titre de l'exercice J                                    | -                     | -        |
| Acomptes sur plus ou moins-values réalisées nettes versés au titre de l'exercice K           | -                     | -        |
| <b>Total acomptes versés au titre de l'exercice IV = J + K</b>                               | <b>-</b>              | <b>-</b> |
| <b>Impôt sur le résultat V</b>   | <b>-</b>              | <b>-</b> |
| <b>Résultat net I + II + III - IV - V</b>  | <b>110 470 847,27</b> | <b>-</b> |

**Evolution du nombre de parts ou actions au cours de la période****ACTION I / FR0010089649**

|   | En parts ou actions | En montant              |
|---|---------------------|-------------------------|
| Parts ou actions souscrites durant l'exercice | 1 727 434,031       | 45 962 503 370,37       |
| Parts ou actions rachetées durant l'exercice  | 1 678 695,126       | 44 661 585 265,59       |
| <b>Solde net des souscriptions/rachats</b>    | <b>48 738,905</b>   | <b>1 300 918 104,78</b> |

**ACTION P / FR0010540385**

|   | En parts ou actions | En montant            |
|---|---------------------|-----------------------|
| Parts ou actions souscrites durant l'exercice | 6 462 493,335       | 743 618 341,93        |
| Parts ou actions rachetées durant l'exercice  | 7 112 107,559       | 818 916 430,67        |
| <b>Solde net des souscriptions/rachats</b>    | <b>-649 614,224</b> | <b>-75 298 088,74</b> |

**ACTION I2 / FR0014000U77**

|   | En parts ou actions | En montant            |
|---|---------------------|-----------------------|
| Parts ou actions souscrites durant l'exercice | 50 367,008          | 510 808 432,67        |
| Parts ou actions rachetées durant l'exercice  | 25 331,005          | 257 266 204,58        |
| <b>Solde net des souscriptions/rachats</b>    | <b>25 036,003</b>   | <b>253 542 228,09</b> |

**ACTION I3 / FR001400ZAY6**

|   | En parts ou actions | En montant        |
|---|---------------------|-------------------|
| Parts ou actions souscrites durant l'exercice | 20                  | 200 000,00        |
| Parts ou actions rachetées durant l'exercice  | -                   | -                 |
| <b>Solde net des souscriptions/rachats</b>    | <b>20</b>           | <b>200 000,00</b> |

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

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

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

**fr.swisslife-am.com**

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