



**SwissLife**  
Asset Managers

# Swiss Life Index Funds (LUX)

Income (EUR)

Balance (EUR)

Dynamic (EUR)

Fonds Commun de Placement (FCP) nach Luxemburger Recht

R.C.S. Luxemburg K 954

## Halbjahresbericht mit ungeprüftem Geschäftsbericht zum 28. Februar 2021

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

Vertriebsbeschränkungen

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

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

## Inhaltsverzeichnis

Organisation und Verwaltung	1
Allgemeine Informationen zum Fonds	3
Informationen für die Inhaber von Einheiten	4
Nettovermögensaufstellung	5
Statistische Informationen	7
Wertentwicklung	8
<b>Swiss Life Index Funds (LUX) Income (EUR)</b>	
Anlagenübersicht	9
Sektorstruktur und geographische Verteilung der Anlagen	10
<b>Swiss Life Index Funds (LUX) Balance (EUR)</b>	
Anlagenübersicht	11
Sektorstruktur und geographische Verteilung der Anlagen	12
<b>Swiss Life Index Funds (LUX) Dynamic (EUR)</b>	
Anlagenübersicht	13
Sektorstruktur und geographische Verteilung der Anlagen	14
Anmerkungen zum Geschäftsbericht	15
Verordnung über Wertpapierfinanzierungsgeschäfte	22

## Organisation und Verwaltung

### Geschäftssitz

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

Franziska Feitzinger  
Swiss Life Asset Managers Luxembourg  
Großherzogtum Luxemburg

### Verwaltungsgesellschaft

#### Eingetragener Sitz:

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

Tilo Georg Reichert  
Swiss Life Asset Managers Luxembourg  
Großherzogtum Luxemburg

Giedre Plentaite-Bartkiene  
Swiss Life Asset Managers Luxembourg  
Großherzogtum Luxemburg

### Verwaltungsrat der Verwaltungsgesellschaft

#### Vorsitzender:

Dagmar Maroni (bis 29. November 2020)  
Head Business & Product Management  
Swiss Life Asset Management AG

Thomas Albert  
Swiss Life Asset Managers Luxembourg  
Großherzogtum Luxemburg

Robin van Berkel (seit 30. November 2020)  
COO Swiss Life Asset Managers und CEO  
Swiss Life Asset Management AG

### Portfolioverwaltung

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

#### Verwaltungsratsmitglieder:

Uwe Druckenmüller  
Geschäftsführender Direktor  
Swiss Life Asset Managers Luxembourg

### Verwaltungs- und Registerstelle

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

Thomas Albert (seit 22. Dezember 2020)  
Geschäftsführender Direktor  
Swiss Life Asset Managers Luxembourg

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

Per Erikson  
Chief Executive Officer Swiss Life Asset Managers  
Deutschland

### Depot- und Zahlstelle („Depotstelle“)

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

Thomas Nummer  
Partner  
Trinova Group

### Vertretungs- und Domizilstelle

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

### Leitende Mitarbeiter der Verwaltungsgesellschaft

Uwe Druckenmüller  
Swiss Life Asset Managers Luxembourg  
Großherzogtum Luxemburg

### Wirtschaftsprüfer

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

Jasmin Heitz  
Swiss Life Asset Managers Luxembourg  
Großherzogtum Luxemburg

## Organisation und Verwaltung (Fortsetzung)

### Rechtsbeistand

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

### Vertrieb in der Bundesrepublik Deutschland

#### Zahlstelle:

Landesbank Hessen-Thüringen  
Girozentrale, Neue Mainzer Straße 52-58,  
D-60311 Frankfurt am Main, Deutschland

#### Informationsstelle:

Swiss Life Invest GmbH  
Zeppelinstr. 1,  
D-85748 Garching, Deutschland

### Vertrieb in der Republik Österreich

#### Zahlstelle:

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

## Allgemeine Informationen zum Fonds

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

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

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

Der Fonds ist als Umbrellafonds eingerichtet und hat zum 28. Februar 2021 eine Anteilklasse pro Teilfonds ausgegeben. Der Verwaltungsrat führt für jeden Teilfonds einen separaten Anlagepool.

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

Zum 28. Februar 2021 standen den Anlegern drei Teilfonds zur Verfügung:

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

Die Einheiten jedes Teilfonds sind in zwei Klassen unterteilt: Einheiten der Klasse R und Einheiten der Klasse I.

Einheiten der Klasse R und Einheiten der Klasse I unterscheiden sich durch das Zielpublikum der Anleger und den Satz der Zeichnungssteuer.

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

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

Zurzeit wird die Klasse R ausgegeben.

## Informationen für die Inhaber von Einheiten

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

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

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

## Nettovermögensaufstellung

(in der Währung des Teilfonds)

		Swiss Life Index Funds (LUX) Income (EUR)	Swiss Life Index Funds (LUX) Balance (EUR)	Swiss Life Index Funds (LUX) Dynamic (EUR)
	Anmerkungen	EUR	EUR	EUR
<b>VERMÖGENSWERTE</b>				
Wertpapierbestand zu Einstandspreisen		111 383 513	95 690 049	35 933 553
Nicht realisierter Nettogewinn/ (-verlust)		11 617 482	7 632 396	3 384 654
Wertpapierbestand zum Marktwert	2.3	123 000 995	103 322 445	39 318 207
Bareinlagen bei Banken		22 616 267	19 367 910	7 979 744
Forderungen für ausgegebene Fondseinheiten		78 169	23 050	11 521
Forderungen aus Dividenden, netto		517	722	387
Nicht realisierter Gewinn aus Finanztermingeschäften	2.4, 6	928 757	1 539 595	871 930
		<b>146 624 705</b>	<b>124 253 722</b>	<b>48 181 789</b>
<b>VERBINDLICHKEITEN</b>				
Verbindlichkeiten für zurückgenommene Fondseinheiten		28 602	11 418	13 060
Verbindlichkeiten aus Managementgebühren	3	299 837	271 753	113 438
Verbindlichkeiten aus Depotgebühren	4	11 592	9 568	4 423
Verbindlichkeiten aus der <i>Taxe d'abonnement</i>	5	6 677	6 573	2 814
Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühren	4	13 420	11 594	6 632
Fällige Gebühren der Registerstelle	4	6 988	5 103	3 141
Verbindlichkeiten aus Honoraren		12 259	12 259	12 259
Nicht realisierter Verlust aus Finanztermingeschäften	2.4, 6	912 200	530 873	119 167
		<b>1 291 575</b>	<b>859 141</b>	<b>274 934</b>
<b>GESAMTVERMÖGEN</b>		<b>145 333 130</b>	<b>123 394 581</b>	<b>47 906 855</b>

## Nettvermögensaufstellung (Fortsetzung)

(in der Währung des Teilfonds)

	Anmerkungen	Konsolidiert EUR
<b>VERMÖGENSWERTE</b>		
Wertpapierbestand zu Einstandspreisen		243 007 115
Nicht realisierter Nettogewinn/ (-verlust)		22 634 532
Wertpapierbestand zum Marktwert	2.3	265 641 647
Bareinlagen bei Banken		49 963 921
Forderungen für ausgegebene Fondseinheiten		112 740
Forderungen aus Dividenden, netto		1 626
Nicht realisierter Gewinn aus Finanztermingeschäften	2.4, 6	3 340 282
		<b>319 060 216</b>
<b>VERBINDLICHKEITEN</b>		
Verbindlichkeiten für zurückgenommene Fondseinheiten		53 080
Verbindlichkeiten aus Managementgebühren	3	685 028
Verbindlichkeiten aus Depotgebühren	4	25 583
Verbindlichkeiten aus der <i>Taxe d'abonnement</i>	5	16 064
Verbindlichkeiten aus Verwaltungsgebühren	4	31 646
Fällige Gebühren der Registerstelle	4	15 232
Verbindlichkeiten aus Honoraren		36 777
Nicht realisierter Verlust aus Finanztermingeschäften	2.4, 6	1 562 240
		<b>2 425 650</b>
<b>GESAMTVERMÖGEN</b>		<b>316 634 566</b>



## Statistische Informationen

### Swiss Life Index Funds (LUX) Income (EUR)

	Währung	28/02/21	31/08/20	31/08/19
<b>R-Einheiten - Thesaurierung</b>				
Anzahl Anteile		877 833.995	866 399.551	869 323.922
Nettoinventarwert je Anteil	EUR	165.56	162.65	164.28
Gesamtnettovermögen	EUR	145 333 130	140 918 483	142 809 306

### Swiss Life Index Funds (LUX) Balance (EUR)

	Währung	28/02/21	31/08/20	31/08/19
<b>R-Einheiten - Thesaurierung</b>				
Anzahl Anteile		694 454.966	642 861.024	613 213.887
Nettoinventarwert je Anteil	EUR	177.69	170.86	170.12
Gesamtnettovermögen	EUR	123 394 581	109 839 663	104 317 463

### Swiss Life Index Funds (LUX) Dynamic (EUR)

	Währung	28/02/21	31/08/20	31/08/19
<b>R-Einheiten - Thesaurierung</b>				
Anzahl Anteile		250 051.636	232 850.216	223 559.172
Nettoinventarwert je Anteil	EUR	191.59	180.31	177.99
Gesamtnettovermögen	EUR	47 906 855	41 984 166	39 790 460

## Performance

### Swiss Life Index Funds (LUX) Income (EUR)

	Währung	28.02.2021	31.08.2020	31.08.2019
<b>R-Einheiten - Thesaurierung</b>				
Performance	EUR	1.79%	(0.99%)	5.07%

### Swiss Life Index Funds (LUX) Balance (EUR)

	Währung	28.02.2021	31.08.2020	31.08.2019
<b>R-Einheiten - Thesaurierung</b>				
Performance	EUR	4.00%	0.43%	3.82%

### Swiss Life Index Funds (LUX) Dynamic (EUR)

	Währung	28.02.2021	31.08.2020	31.08.2019
<b>R-Einheiten - Thesaurierung</b>				
Performance	EUR	6.26%	1.30%	2.87%

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

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

Die Performancedaten wurden nicht geprüft.

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

## Swiss Life Index Funds (LUX) Income (EUR)

### Anlagenübersicht

Nominal wert/ Menge	Bezeichnung	Kurs Währung	Kosten EUR	Marktwert EUR	% des Nettovermögens
<b>Investmentfonds</b>					
<b>Offene Anlagefonds</b>					
37 000	AMUNDI ETF CASH 3 MONTHS EUROMTS INVESTMENT GRADE UCITS	EUR	4 472 866	4 314 200	2.97
52 039	AMUNDI GOVT BOND EUROMTS BROAD INVESTMENT GRADE UCITS ETF - C	EUR	12 108 677	13 081 069	9.00
49	AMUNDI ULTRA SHORT TERM BOND SRI	EUR	5 011 452	4 966 298	3.42
481	BNP PARIBAS ASSET MANAGEMENT FRANCE - BNP PARIBAS MONEY 3M SICAV - I	EUR	11 175 007	11 082 586	7.63
74 629	DB X-TRACKERS II - IBOXX SOVEREIGNS EUROZONE TOTAL RETURN INDEX ETF - 1C	EUR	16 482 695	18 780 388	12.91
80 200	DB X-TRACKERS II - IBOXX SOVEREIGNS EUROZONE 5-7 TOTAL RETURN INDEX ETF - 1C	EUR	18 718 021	19 937 720	13.71
9 887	ISHARES AEX UCITS ETF	EUR	505 655	643 347	0.44
26 810	ISHARES CORE EUR CORP BOND UCITS ETF	EUR	3 492 130	3 604 873	2.48
94 200	ISHARES EDGE MSCI EUROPE MINIMUM VOLATILITY UCITS ETF	EUR	3 657 684	4 263 492	2.93
52 035	ISHARES EDGE S&P 500 MINIMUM VOLATILITY UCITS ETF - C	USD	2 015 957	2 862 397	1.97
41 250	ISHARES MSCI EM UCITS ETF USD	USD	1 365 463	1 769 896	1.22
24 354	ISHARES MSCI EMERGING MARKETS MINIMUM VOLATILITY UCITS ETF	USD	568 160	663 224	0.46
11 000	ISHARES USD CORP BOND UCITS ETF	EUR	1 184 984	1 145 760	0.79
868.02	LOMBARD ODIER SHORT-TERM MONEY MARKET - IC	USD	8 217	8 014	0.01
13 960	LYXOR ETF FTSE MIB	EUR	300 744	307 952	0.21
31 250	LYXOR EURO GOVERNMENT BOND DR UCITS ETF	EUR	5 158 712	6 059 038	4.17
39 836	LYXOR MULTI UNITS - HONG KONG UCITS ETF	EUR	980 017	1 134 286	0.78
570	SWISS LIFE FUND (F) MONEY MARKET EURO - I	EUR	14 260 193	14 151 059	9.74
90 000	VANGUARD FTSE 100 UCITS ETF - D	GBP	2 893 374	2 969 511	2.04
178 500	VANGUARD S&P 500 UCITS ETF	EUR	6 532 862	10 763 193	7.41
22 390	XTRACKERS SICAV SPAIN UCITS ETF	EUR	490 643	492 692	0.34
<b>Gesamtsumme offene Anlagefonds</b>			<b>111 383 513</b>	<b>123 000 995</b>	<b>84.63</b>
<b>Gesamtsumme der Anlagefonds</b>			<b>111 383 513</b>	<b>123 000 995</b>	<b>84.63</b>
<b>Gesamtsumme der Anlagen</b>			<b>111 383 513</b>	<b>123 000 995</b>	<b>84.63</b>

## Swiss Life Index Funds (LUX) Income (EUR)

### Sektorstruktur und geographische Verteilung der Anlagen

<b>Sektorstruktur</b>	<b>%</b>	<b>Geographische Verteilung</b>	<b>%</b>
Investmentfonds	84.63	Luxemburg	40.93
		Frankreich	23.96
		Irland	19.74
	<b>84.63</b>		<b>84.63</b>

## Swiss Life Index Funds (LUX) Balance (EUR)

### Anlagenübersicht

Nominal wert/ Menge	Bezeichnung	Kurs Währung	Kosten EUR	Marktwert EUR	% des Nettovermögens
<b>Investmentfonds</b>					
<b>Offene Anlagefonds</b>					
48 600	AMUNDI GOVT BOND EUROMTS BROAD INVESTMENT GRADE UCITS ETF - C	EUR	11 276 616	12 216 606	9.90
94	AMUNDI ULTRA SHORT TERM BOND SRI	EUR	9 604 309	9 527 183	7.72
520	BNP PARIBAS ASSET MANAGEMENT FRANCE - BNP PARIBAS MONEY 3M SICAV - I	EUR	12 077 803	11 981 174	9.71
42 180	DB X-TRACKERS II - IBOXX SOVEREIGNS EUROZONE TOTAL RETURN INDEX ETF - 1C	EUR	9 782 935	10 614 597	8.60
40 260	DB X-TRACKERS II - IBOXX SOVEREIGNS EUROZONE 5-7 TOTAL RETURN INDEX ETF - 1C	EUR	9 640 211	10 008 636	8.11
17 623	ISHARES AEX UCITS ETF	EUR	941 143	1 146 729	0.93
19 190	ISHARES CORE EUR CORP BOND UCITS ETF	EUR	2 501 094	2 580 287	2.09
132 550	ISHARES EDGE MSCI EUROPE MINIMUM VOLATILITY UCITS ETF	EUR	5 379 923	5 999 213	4.86
72 580	ISHARES EDGE S&P 500 MINIMUM VOLATILITY UCITS ETF - C	USD	2 920 494	3 992 558	3.24
57 615	ISHARES MSCI EM UCITS ETF USD	USD	1 995 952	2 472 062	2.00
22 582	ISHARES MSCI EMERGING MARKETS MINIMUM VOLATILITY UCITS ETF	USD	537 068	614 968	0.50
4 600	ISHARES USD CORP BOND UCITS ETF	USD	511 851	475 917	0.39
405 000	LOMBARD ODIER SHORT-TERM MONEY MARKET - IC	USD	3 826 526	3 739 093	3.03
19 593	LYXOR ETF FTSE MIB	EUR	435 688	432 214	0.35
58 914	LYXOR MULTI UNITS - HONG KONG UCITS ETF	EUR	1 552 156	1 677 511	1.36
510	SWISS LIFE FUND (F) MONEY MARKET EURO - I	EUR	12 738 236	12 661 474	10.25
130 850	VANGUARD FTSE 100 UCITS ETF - D	GBP	4 309 975	4 317 339	3.50
136 600	VANGUARD S&P 500 UCITS ETF	EUR	5 047 401	8 236 707	6.68
28 547	XTRACKERS SICAV SPAIN UCITS ETF	EUR	610 668	628 177	0.51
<b>Gesamtsumme offene Anlagefonds</b>			<b>95 690 049</b>	<b>103 322 445</b>	<b>83.73</b>
<b>Gesamtsumme der Anlagefonds</b>			<b>95 690 049</b>	<b>103 322 445</b>	<b>83.73</b>
<b>Gesamtsumme der Anlagen</b>			<b>95 690 049</b>	<b>103 322 445</b>	<b>83.73</b>

## Swiss Life Index Funds (LUX) Balance (EUR)

### Sektorstruktur und geographische Verteilung der Anlagen

<b>Sektorstruktur</b>	<b>%</b>	<b>Geographische Verteilung</b>	<b>%</b>
Investmentfonds	83.73	Luxemburg	31.51
		Frankreich	28.04
		Irland	24.18
	<b>83.73</b>		<b>83.73</b>

## Swiss Life Index Funds (LUX) Dynamic (EUR)

### Anlagenübersicht

Nominal wert/ Quantity	Bezeichnung	Kurs Währung	Kosten EUR	Marktwert EUR	% des Nettovermögens
<b>Investmentfonds</b>					
<b>Offene Anlagefonds</b>					
7 000	AMUNDI ETF CASH 3 MONTHS EUROMTS INVESTMENT GRADE UCITS	EUR	845 027	816 200	1.70
3 000	AMUNDI GOVT BOND EUROMTS BROAD INVESTMENT GRADE UCITS ETF - C	EUR	773 055	754 112	1.57
34	AMUNDI ULTRA SHORT TERM BOND SRI	EUR	3 470 892	3 446 002	7.19
143	BNP PARIBAS ASSET MANAGEMENT FRANCE - BNP PARIBAS MONEY 3M SICAV - I	EUR	3 318 532	3 294 823	6.88
13 257	DB X-TRACKERS II - IBOXX SOVEREIGNS EUROZONE TOTAL RETURN INDEX ETF - 1C	EUR	3 111 980	3 336 124	6.96
11 090	DB X-TRACKERS II - IBOXX SOVEREIGNS EUROZONE 5-7 TOTAL RETURN INDEX ETF - 1C	EUR	2 677 854	2 756 974	5.75
2 395	INVESCO MARKETS PLC- S&P 500 UCITS ETF	USD	772 892	1 412 651	2.95
11 442	ISHARES AEX UCITS ETF	EUR	607 499	744 531	1.55
4 080	ISHARES CORE EUR CORP BOND UCITS ETF	EUR	534 077	548 597	1.15
69 850	ISHARES EDGE MSCI EUROPE MINIMUM VOLATILITY UCITS ETF	EUR	2 816 308	3 161 411	6.60
29 618	ISHARES EDGE S&P 500 MINIMUM VOLATILITY UCITS ETF - C	USD	1 182 712	1 629 258	3.40
30 902	ISHARES MSCI EM UCITS ETF USD	USD	1 062 029	1 325 899	2.77
12 400	ISHARES MSCI EMERGING MARKETS MINIMUM VOLATILITY UCITS ETF	USD	295 703	337 685	0.70
400 600	LOMBARD ODIER SHORT-TERM MONEY MARKET - IC	USD	3 871 561	3 698 471	7.72
10 214	LYXOR ETF FTSE MIB	EUR	227 737	225 317	0.47
29 598	LYXOR MULTI UNITS - HONG KONG UCITS ETF	EUR	770 894	842 770	1.76
220	SWISS LIFE FUND (F) MONEY MARKET EURO - I	EUR	5 492 375	5 461 813	11.41
55 586	VANGUARD FTSE 100 UCITS ETF - D	GBP	1 842 174	1 834 036	3.83
55 500	VANGUARD S&P 500 UCITS ETF	EUR	1 932 935	3 346 539	6.99
15 678	XTRACKERS SICAV SPAIN UCITS ETF	EUR	327 317	344 994	0.72
<b>Gesamtsumme offene Anlagefonds</b>			<b>35 933 553</b>	<b>39 318 207</b>	<b>82.07</b>
<b>Gesamtsumme der Anlagefonds</b>			<b>35 933 553</b>	<b>39 318 207</b>	<b>82.07</b>
<b>Gesamtsumme der Anlagen</b>			<b>35 933 553</b>	<b>39 318 207</b>	<b>82.07</b>

## Swiss Life Index Funds (LUX) Dynamic (EUR)

### Sektorstruktur und geographische Verteilung der Anlagen

<b>Sektorstruktur</b>	<b>%</b>
Investmentfonds	82.07
	<b>82.07</b>

<b>Geographische Verteilung</b>	<b>%</b>
Irland	29.93
Frankreich	27.65
Luxemburg	24.49
	<b>82.07</b>



## Anmerkungen zum Geschäftsbericht

### 1 - Allgemeines

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

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

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

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

Zum 28. Februar 2021 waren drei Teilfonds aktiv:

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

Zum 28. Februar 2021 hat der Fonds die folgenden Anteilklassen in den folgenden Teilfonds ausgegeben:

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

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

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

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

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

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

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

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

## Anmerkungen zum Geschäftsbericht (Fortsetzung)

### 2 - Wichtige Grundsätze der Rechnungslegung

#### 2.1 Präsentation des Geschäftsberichts

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

#### 2.2 Berechnung des Nettoinventarwerts

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

#### 2.3 Bewertungsgrundsätze

2.3.1 Wertpapiere, darunter Finanzanlagen („Derivate“), die an einem geregelten Markt oder einem anderen geregelten Markt gehandelt werden, werden auf Grundlage des letzten verfügbaren Schlusskurses am vorangegangenen Werktag bewertet oder zum Durchschnittspreis der Wertpapiere (der Durchschnitt aus dem letzten verfügbaren Angebotspreis und Briefkurs) am entsprechenden Wertpapiermarkt, an dem die Vermögenswerte des Fonds am Bewertungstag notiert oder gehandelt werden, es sei denn, dieser Preis gibt den Marktwert der jeweiligen Vermögenswerte nicht wieder. Wenn ein Wertpapier an verschiedenen geregelten Märkten notiert oder gehandelt wird, wird es auf Grundlage des letzten verfügbaren Kurses am entsprechenden Markt bewertet, der in der Regel der hauptsächliche Markt dieses Vermögenswertes ist.

2.3.2 Sollten Vermögenswerte des Fonds am Bewertungstag nicht an einem geregelten Markt oder an einem anderen geregelten Markt notiert oder gehandelt werden oder nicht börsennotiert sein oder wenn der gemäß Abschnitt (2.3.1) oder (2.3.4) bis (2.3.7) ermittelte Wert börsennotierter oder an einem anderen geregelten Markt gehandelter Wertpapiere nicht deren Verkehrswert wiedergibt, dann muss ihr Wert auf Grundlage des angemessen voraussehbaren Verkaufspreises ermittelt werden, der umsichtig und in gutem Glauben vom Verwaltungsrat der Gesellschaft bestimmt wird.

2.3.3 Geldmarktinstrumente werden auf linearer Grundlage über einen Zeitraum vom Kauf bis zur Fälligkeit bewertet und andere liquide Vermögenswerte werden zu ihrem Nominalwert zzgl. angefallener Zinsen bewertet.

2.3.4 Einheiten oder Anteile offener OGAW und/oder anderer OGA werden zum letzten festgestellten und verfügbaren Nettoinventarwert bewertet. Sollte dieser Preis nicht repräsentativ für den Verkehrswert der Vermögenswerte sein, so wird der Preis durch den Verwaltungsrat der Verwaltungsgesellschaft auf fairer und gerechter Grundlage ermittelt. Einheiten oder Anteile geschlossener OGA werden zu ihrem letzten verfügbaren Börsenwert bewertet.

2.3.5 Devisentermin- und Optionsgeschäfte werden grundsätzlich zu den letzten verfügbaren Markt- oder Händlerpreisen bewertet. Wenn der Bewertungstag eines Optionsgeschäfts gleichzeitig dessen Abrechnungszeitpunkt ist, werden die jeweiligen Optionsgeschäfte zum entsprechenden Abrechnungspreis bewertet.

2.3.6 Der Liquidationswert von nicht an geregelten Märkten, an Börsen in anderen Staaten oder an anderen geregelten Märkten gehandelten Future-, Termin- oder Optionskontrakten muss bedeuten, dass deren Nettoliquidationswert gemäß den vom Verwaltungsrat der Verwaltungsgesellschaft aufgestellten Richtlinien auf einer Basis bestimmt wird, die in einem konsistenten Verhältnis zu allen anderen Arten von Kontrakten steht. Der Liquidationswert von an geregelten Märkten, an Börsen in anderen Staaten oder an anderen geregelten Märkten gehandelten Future-, Termin- oder Optionskontrakten muss auf den letzten verfügbaren Abrechnungspreisen dieser Kontrakte an geregelten Märkten, an Börsen in anderen Staaten oder an anderen geregelten Märkten basieren, an denen diese Future-, Termin- oder Optionskontrakte gehandelt werden; wenn ein Future-, Termin- oder Optionskontrakt nicht an dem Tag liquidiert werden konnte, in Bezug auf den das Nettovermögen bestimmt wurde, gilt als Grundlage für die Bestimmung des Liquidationswerts eines solchen Kontrakts der Wert, den der Verwaltungsrat der Verwaltungsgesellschaft als fair und angemessen betrachtet.

2.3.7 Nicht offiziell an einem geregelten Markt oder an einem anderen geregelten Markt notierte oder gehandelte Finanzinstrumente („Derivate“) werden nach allgemein anerkannten und von einem Wirtschaftsprüfer verifizierbaren Bewertungsregeln bewertet.

2.3.8 Alle anderen Wertpapiere und Vermögenswerte werden zum Verkehrswert bewertet, der vom Verwaltungsrat der Verwaltungsgesellschaft bestimmt wird.

## Anmerkungen zum Geschäftsbericht (Fortsetzung)

### 2.4 Bewertung von Termingeschäften

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

### 2.5 Bewertung von Devisentermingeschäften

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

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

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

### 2.7 Umrechnung ausländischer Währungen

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

### 2.8 Bilanzierung von Portfoliotransaktionen der Wertpapiere

Portfoliotransaktionen der Wertpapiere werden zum Bankwerktag nach dem Transaktionsdatum bilanziert.

### 2.9 Forderungen für verkaufte Wertpapiere, Verbindlichkeiten für erworbene Wertpapiere

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

### 2.10 Erfassung von Erträgen

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

### 2.11 Wertpapierleihgeschäfte

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

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

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

### 2.12 Pensionsgeschäfte

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

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

### 2.13 Forderungen und Verbindlichkeiten aus Kassadevisen

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

## Anmerkungen zum Geschäftsbericht (Fortsetzung)

### 3 - Managementgebühren und Anlageverwaltungsgebühren

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

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

Zum 28. Februar 2021 gelten für die Verwaltungsgebühr folgende Sätze:

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

### 4 - Gebühren der Depot- und Verwaltungsstelle

Die Depot- und Zahlstelle ist zum Erhalt einer Gebühr von höchstens 0.05% berechtigt, die nach den Prozentzahlen des jeweiligen durchschnittlichen Gesamtnettovermögens des Teilfonds im betreffenden Monat berechnet und monatlich aus dem Fondsvermögen gezahlt wird.

Die Verwaltungsstelle ist zum Erhalt einer Gebühr von höchstens 0.13% berechtigt, die als jährliche Prozentzahl des durchschnittlichen Gesamtnettovermögens jedes Teilfonds berechnet und monatlich aus dem Fondsvermögen gezahlt wird.

Die fälligen Gebühren der Registerstelle können sich auf bis zu 0.06% pro Jahr belaufen und werden jeden Monat auf Grundlage des am Bewertungstag ermittelten Nettoinventarwerts berechnet. Ungeachtet dieser Gebühren erhält die Registerstelle die üblichen Bankgebühren für jede Transaktion.

### 5 - Besteuerung

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

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

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

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

## Anmerkungen zum Geschäftsbericht (Fortsetzung)

### 6 - Finanztermingeschäfte

Zum 28. Februar 2021 wiesen die Teilfonds die nachstehend detailliert aufgeführten Positionen aus Termingeschäften auf:

#### Swiss Life Index Funds (LUX) Income (EUR)

Vertragswährung	Bezeichnung	Fälligkeit	Anzahl der gekauften Kontrakte	Anzahl der verkauften Kontrakte	Verpflichtung EUR	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) EUR
EUR	EURO BUND	Mar. 21	37	-	3 812 258	(130 610)
EUR	EURO BUXL	Mar. 21	43	-	6 886 493	(542 340)
USD	US 10 YR NOTE FUTURE	Jun. 21	155	-	14 180 480	(211 500)
EUR	CAC 40	Mar. 21	37	-	2 110 191	(27 750)
EUR	EURO STOXX 50	Mar. 21	328	-	11 927 523	381 970
JPY	NIKKEI 225 OSE	Mar. 21	17	-	3 807 832	378 601
USD	S&P 500 EMINI	Mar. 21	19	-	2 982 858	91 611
CAD	S&P/TSE 60 IX FUT	Mar. 21	14	-	1 952 976	60 058
CHF	SWISS MKT INDEX FUT	Mar. 21	11	-	1 053 323	16 517
					<b>48 713 934</b>	<b>16 557</b>

#### Swiss Life Index Funds (LUX) Balance (EUR)

Vertragswährung	Bezeichnung	Fälligkeit	Anzahl der gekauften Kontrakte	Anzahl der verkauften Kontrakte	Verpflichtung EUR	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) EUR
EUR	EURO BUND	Mar. 21	20	-	2 060 680	(70 600)
EUR	EURO BUXL	Mar. 21	24	-	3 843 624	(302 560)
USD	US 10 YR NOTE FUTURE	Jun. 21	87	-	7 959 366	(118 713)
EUR	CAC 40	Mar. 21	52	-	2 965 674	(39 000)
EUR	DAX INDEX	Mar. 21	3	-	1 033 972	39 563
EUR	EURO STOXX 50	Mar. 21	442	-	16 073 065	512 179
JPY	NIKKEI 225 OSE	Mar. 21	22	-	4 927 783	489 954
USD	S&P 500 EMINI	Mar. 21	64	-	10 047 520	408 239
CAD	S&P/TSE 60 IX FUT	Mar. 21	16	-	2 231 972	68 638
CHF	SWISS MKT INDEX FUT	Mar. 21	14	-	1 340 593	21 022
					<b>52 484 249</b>	<b>1 008 722</b>

#### Swiss Life Index Funds (LUX) Dynamic (EUR)

Vertragswährung	Bezeichnung	Fälligkeit	Anzahl der gekauften Kontrakte	Anzahl der verkauften Kontrakte	Verpflichtung EUR	Nicht realisierter Gewinn/(Verlust) EUR
EUR	EURO BUND	Mar. 21	4	-	412 136	(14 120)
EUR	EURO BUXL	Mar. 21	5	-	800 755	(63 100)
USD	US 10 YR NOTE FUTURE	Jun. 21	17	-	1 555 278	(23 197)
EUR	CAC 40	Mar. 21	25	-	1 425 805	(18 750)
EUR	DAX INDEX	Mar. 21	2	-	689 315	26 375
EUR	EURO STOXX 50	Mar. 21	235	-	8 545 634	278 870
JPY	NIKKEI 225 OSE	Mar. 21	13	-	2 911 872	283 641
USD	S&P 500 EMINI	Mar. 21	36	-	5 651 730	229 634
CAD	S&P/TSE 60 IX FUT	Mar. 21	10	-	1 394 983	42 899
CHF	SWISS MKT INDEX FUT	Mar. 21	7	-	670 297	10 511
					<b>24 057 805</b>	<b>752 763</b>

## Anmerkungen zum Geschäftsbericht (Fortsetzung)

### 7 - Wechselkurse

Folgende Wechselkurse wurden für die Erstellung dieses Geschäftsberichts verwendet:

1 EUR =	1.53665	CAD	1 EUR =	1.09885	CHF
1 EUR =	0.86820	GBP	1 EUR =	129.31825	JPY
1 EUR =	1.21380	USD			

### 8 - Wertpapierleihgeschäfte

Zum 28. Februar 2021 waren alle Wertpapierleihgeschäfte durch Wertpapiere besichert, die an einer EU-Börse notiert sind.

Die beliebigen Wertpapiere hatten folgenden Marktwert:

Teilfonds	Marktwert der verliehenen Wertpapiere (EUR)
Swiss Life Index Funds (LUX) Income (EUR)	6 563 592
Swiss Life Index Funds (LUX) Balance (EUR)	5 313 613
Swiss Life Index Funds (LUX) Dynamic (EUR)	1 546 709

Die Gegenpartei und die Leihstelle für Wertpapierbeleihungen ist Société Générale (France).

Im Folgenden wird der Betrag unbarer Sicherheiten für Aktienleihgeschäfte aufgeführt:

#### Swiss Life Index Funds (LUX) Income (EUR)

Art des Instruments	Name des Emittenten	Rating	Währung	Gezahlter Sicherheitsbetrag Sicherheitsbetrag (in der Währung des Teilfonds)
Aktien	Michelin (CGDE) (FR)	-	EUR	2 858 903
Aktien	Delta Air Lines INC (US)		EUR	1 647 739
Aktien	Safran SA (FR)		EUR	787 224
Aktien	Bayerische Motoren Werke AG (DE)		EUR	772 558
Aktien	Teleperformance (FR)		EUR	706 904
Aktien	E.ON SE (DE)		EUR	118 039
				<b>6 891 367</b>

#### Swiss Life Index Funds (LUX) Balance (EUR)

Art des Instruments	Name des Emittenten	Rating	Währung	Gezahlter Sicherheitsbetrag Sicherheitsbetrag (in der Währung des Teilfonds)
Aktien	Teleperformance (FR)	-	EUR	2 036 837
Aktien	Vinci SA (FR)		EUR	1 239 672
Aktien	Bayerische Motoren Werke AG (DE)		EUR	858 000
Aktien	Bayer AG-REG (DE)		EUR	804 649
Aktien	Michelin (CGDE) (FR)		EUR	531 900
Aktien	E.ON SE (DE)		EUR	340 529
Aktien	Delta Air Lines INC (US)		EUR	145 453
Aktien	Sanofi (FR)		EUR	121 040
				<b>6 078 080</b>

## Anmerkungen zum Geschäftsbericht (Fortsetzung)

### Swiss Life Index Funds (LUX) Dynamic (EUR)

Art des Instruments	Name des Emittenten	Rating	Währung	Gezahlter Sicherheitsbetrag Sicherheitsbetrag (in der Währung des Teilfonds)
Aktien	Vinci SA (FR)	-	EUR	831 284
Aktien	Delta Air Lines INC (US)		EUR	355 244
Aktien	Safran SA (FR)		EUR	265 162
Aktien	Teleperformance (FR)		EUR	158 430
Aktien	Michelin (CGDE) (FR)		EUR	20 094
				1 630 213

Für den zum 28. Februar 2021 abgeschlossenen Zeitraum wurden vom Fonds folgende Erträge aus Wertpapierbeleihungen erzielt:

Teilfonds	Währung	Gesamtbruttobetrag der Erträge aus Wertpapierbeleihungen (in der Währung des Teilfonds)	Direkte und indirekte Kosten und Gebühren, die abgezogen wurden von den Bruttoerträgen aus Wertpapierbeleihungen (in der Währung des Teilfonds)	Gesamtnettobetrag der Erträge aus Wertpapierbeleihungen (in der Währung des Teilfonds)
Swiss Life Index Funds (LUX) Income (EUR)	EUR	28 285	4 242	24 043
Swiss Life Index Funds (LUX) Balance (EUR)	EUR	25 390	3 808	21 582
Swiss Life Index Funds (LUX) Dynamic (EUR)	EUR	10 345	1 552	8 793

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

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

## 9 - COVID-19

Anfang 2020 wurde bestätigt, dass es ein neues Coronavirus gibt, das als COVID-19 bezeichnet wird. Seitdem hat sich COVID-19 weltweit verbreitet. COVID-19 beeinträchtigte Unternehmen und die Wirtschaftsaktivität. Vor allem in der ersten Jahreshälfte kam es hierdurch zu Bewegungen an den weltweiten Börsenmärkten.

Swiss Life Asset Managers und Swiss Life Asset Managers Luxembourg haben interne Vorsichtsmaßnahmen getroffen, die einen reibungslosen Geschäftsbetrieb sicherstellen sollen, falls die Bedrohung zunimmt und in diesem Zuge auf staatlicher und lokaler Ebene behördliche Maßnahmen ergriffen werden.

Für Swiss Life Asset Managers und Swiss Life Asset Managers Luxembourg hat der Schutz der Gesundheit aller Mitarbeiter und der Interessen der Anleger und Kunden Vorrang. Als spezielle Maßnahme arbeiteten Mitarbeiter deshalb von zuhause aus und tun dies teilweise immer noch. Dies soll sicherstellen, dass Mitarbeiter ihrer Tätigkeit nachgehen können, um die betriebliche Kontinuität zu gewährleisten und aufrechtzuerhalten. Für Swiss Life Asset Managers und Swiss Life Asset Managers Luxembourg ist Fernarbeit unabhängig vom Standort nichts Neues. Regelmäßige Verfahren und Kontrollen bleiben bestehen und werden je nach Bedarf angepasst, wenn die Situation dies erfordert.

Swiss Life Asset Managers und Swiss Life Asset Managers Luxembourg überwachen und analysieren auch weiterhin genau die aktuellen Entwicklungen auf den Finanzmärkten.

## Verordnung über Wertpapierfinanzierungsgeschäfte

### Wertpapierleihgeschäfte

Im Zuge der Verordnung 2015/2365 des Europäischen Parlaments und des Rates vom 25. November 2015 über die Transparenz von Wertpapierfinanzierungsgeschäften unterlagen dieser Verordnung im am 28. Februar 2021 zu Ende gegangenen Zeitraum nur Wertpapierleihgeschäfte:

	Swiss Life Index Funds (LUX) Income (EUR)	Swiss Life Index Funds (LUX) Balance (EUR)	Swiss Life Index Funds (LUX) Dynamic (EUR)
<b>Betrag der Wertpapierleihgeschäfte, in absoluten Beträgen (in der Währung des Teilfonds) Währung des Teilfonds</b>	Siehe Anmerkung 8	Siehe Anmerkung 8	Siehe Anmerkung 8
Anteil der gesamten beleihbaren Vermögenswerte*	5.34%	5.14%	3.93%
Anteil des verwalteten Vermögens	4.52%	4.31%	3.23%
<b>Laufzeit der Wertpapierbeleihungen aufgeschlüsselt nach folgenden Laufzeitbändern</b>			
Weniger als ein Tag	-	-	-
Ein Tag bis eine Woche	-	-	-
Eine Woche bis ein Monat	-	-	-
Ein bis drei Monate	-	-	-
Drei Monate bis ein Jahr	-	-	-
Mehr als ein Jahr	-	-	-
Offene Laufzeit	Siehe Anmerkung 8	Siehe Anmerkung 8	Siehe Anmerkung 8
<b>Gegenpartei</b>			
Name der Gegenpartei	Société Générale	Société Générale	Société Générale
Land des Sitzes der Gegenpartei	Frankreich	Frankreich	Frankreich
Bruttovolumen ausstehender Transaktionen	Siehe Anmerkung 8	Siehe Anmerkung 8	Siehe Anmerkung 8
<b>Angaben zu den Sicherheiten</b>			
<i>Art der Sicherheiten</i>			
Bargeldanlagen	-	-	-
Wertpapiere	Siehe Anmerkung 8	Siehe Anmerkung 8	Siehe Anmerkung 8
<i>Qualität der Sicherheiten</i>			
Emittent	Siehe Anmerkung 8	Siehe Anmerkung 8	Siehe Anmerkung 8
Rating	Siehe Anmerkung 8	Siehe Anmerkung 8	Siehe Anmerkung 8
<b>Laufzeit der Sicherheit aufgeschlüsselt folgenden Laufzeitbändern</b>			
Weniger als ein Tag	-	-	-
Ein Tag bis eine Woche	-	-	-
Eine Woche bis ein Monat	-	-	-
Ein bis drei Monate	-	-	-
Drei Monate bis ein Jahr	-	-	-
Mehr als ein Jahr	-	-	-
Offene Laufzeit	Siehe Anmerkung 8	Siehe Anmerkung 8	Siehe Anmerkung 8
<b>Angaben zu Rendite und Kosten der Wertpapierbeleihungen</b>	Siehe Anmerkung 8	Siehe Anmerkung 8	Siehe Anmerkung 8
<b>Verwahrung der vom Fonds im Rahmen von Wertpapierbeleihungen erhaltenen Sicherheit</b>			
Name der Depotstelle	Société Générale	Société Générale	Société Générale
Wertpapiere	Siehe Anmerkung 8	Siehe Anmerkung 8	Siehe Anmerkung 8
Bargeldanlagen	-	-	-

Alle Transaktionen sind zweiseitige Transaktionen.

Sicherheiten für Wertpapierleihgeschäfte werden nicht wiederverwendet.

\* Der Anteil der gesamten beleihbaren Vermögenswerte bildet den Marktwert der beleihbaren Wertpapiere / den Marktwert des Portfolios des Teilfonds ab.



Verordnung über Wertpapierfinanzierungsgeschäfte (Fortsetzung)

Teilfonds	Währung	Zehn größte Emittenten von Sicherheiten für alle Wertpapierfinanzierungsgeschäfte und Total Return Swaps	Beträge der als Sicherheiten erhaltenen Wertpapiere und Rohstoffe
Swiss Life Index Funds (LUX) Income (EUR)	EUR	MICHELIN (CGDE) (FR)	2 858 903
	EUR	DELTA AIR LINES INC (US)	1 647 739
	EUR	SAFRAN SA (FR)	787 224
	EUR	BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG (DE)	772 558
	EUR	TELEPERFORMANCE (FR)	706 904
	EUR	E.ON SE (DE)	118 039
Swiss Life Index Funds (LUX) Balance (EUR)	EUR	TELEPERFORMANCE (FR)	2 036 837
	EUR	VINCI SA (FR)	1 239 672
	EUR	BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG (DE)	858 000
	EUR	BAYER AG-REG (DE)	804 649
	EUR	MICHELIN (CGDE) (FR)	531 900
	EUR	E.ON SE (DE)	340 529
	EUR	DELTA AIR LINES INC (US)	145 453
	EUR	SANOFI (FR)	121 040
Swiss Life Index Funds (LUX) Dynamic (EUR)	EUR	VINCI SA (FR)	831 284
	EUR	DELTA AIR LINES INC (US)	355 244
	EUR	SAFRAN SA (FR)	265 162
	EUR	TELEPERFORMANCE (FR)	158 430
	EUR	MICHELIN (CGDE) (FR)	20 094

