

SYZ

Halbjahresbericht 2024
per 31. März 2024 (ungeprüft)

Vertraglicher Umbrella-Fonds schweizerischen Rechts
der Art «Übrige Fonds für traditionelle Anlagen»
aufgelegt für **Banque SYZ SA**, Genf
durch die Fondsleitung **Carne Global Fund Managers (Schweiz) AG**, Zürich

Inhaltsverzeichnis

1	Organisation und Management	3
1.1	Fondsleitung	3
1.2	Depotbank / Hauptzahlstelle	3
1.3	Prüfgesellschaft	3
2	Bericht der Prüfgesellschaft	4
3	Erläuterungen zum Halbjahresbericht	5
3.1	Grundsätze für die Bewertung sowie für die Berechnung des Nettoinventarwertes	5
3.1.1	Wechselkurse	5
3.2	Übrige Angaben	5
3.2.1	Identität der Vertragspartner bei OTC – Geschäften	5
3.2.2	Pooling	5
3.2.2.1	Übersicht der Fonds inklusive Anteilsquote an jedem Pool per Ende der Berichtsperiode	5
4	SYZ – Absolute Return	6
4.1	Vermögensrechnung	6
4.2	Erfolgsrechnung	6
4.3	Veränderung des Nettofondsvermögens	6
4.4	Anteilsscheinverkehr	7
4.5	Ausserbilanzgeschäfte	7
4.6	Kennzahlen und technische Daten	7
4.6.1	Informationen über Kosten und Tracking Error	7
4.6.2	Performancezahlen	8
4.7	Verwendung des Erfolgs	8
4.8	Wertpapierbestand	8
4.8.1	Inventar und Bestandesveränderungen	8
4.8.2	Bewertungskategorien KKV-FINMA Art. 84 Absatz 2	13
5	In Pools gehaltene Wertschriften	14
5.1	SYZ ARI CHF Principal Pool	14
5.1.1	Inventar und Bestandesveränderungen	14
5.1.2	Bewertungskategorien KKV-FINMA Art. 84 Absatz 2	16
5.1.3	Während der Berichtsperiode getätigte Devisentermingeschäfte	16
5.2	SYZ ARI CHF Equity Pool	17
5.2.1	Inventar und Bestandesveränderungen	17
5.2.2	Bewertungskategorien KKV-FINMA Art. 84 Absatz 2	17
5.3	SIP Liquidity Mgmt CHF Syz AM Pool	18
5.3.1	Inventar und Bestandesveränderungen	18
5.3.2	Bewertungskategorien KKV-FINMA Art. 84 Absatz 2	21

1 Organisation und Management

1.1 Fondsleitung

Carne Global Fund Managers (Schweiz) AG
Beethovenstrasse 48
8002 Zürich

1.2 Depotbank / Hauptzahlstelle

State Street Bank International GmbH, München, Zweigniederlassung Zürich
Beethovenstrasse 19
8027 Zürich

1.3 Prüfgesellschaft

bis zum 31.01.2024:
KPMG AG
Badenerstrasse 172
8004 Zürich

ab dem 01.02.2024:
Ernst & Young AG
Maagplatz 1
8005 Zürich

2 Bericht der Prüfungsgesellschaft

Für die Halbjahresberichte ist keine gesetzliche Prüfung vorgesehen.

3 Erläuterungen zum Halbjahresbericht

3.1 Grundsätze für die Bewertung sowie für die Berechnung des Nettoinventarwertes

3.1.1 Wechselkurse

Für die Umrechnung von Fremdwährungen gelten die folgenden Wechselkurse (in Schweizer Franken):

Einheit	Lokalwährung	=	Rechnungswährung	Einheit	Lokalwährung	=	Rechnungswährung
1	AUD	=	0.587617	100	MXN	=	5.418804
1	CAD	=	0.665583	100	NOK	=	8.302454
1	CHF	=	1.000000	1	PLN	=	0.225867
1	CNY	=	0.124622	100	RUB	=	0.972941
100	DKK	=	13.041338	100	SEK	=	8.423583
1	EUR	=	0.972756	100	TRY	=	2.784063
1	GBP	=	1.137809	1	USD	=	0.900700
100	HKD	=	11.508411	100	ZAR	=	4.756486
100	JPY	=	0.595130				

3.2 Übrige Angaben

3.2.1 Identität der Vertragspartner bei OTC – Geschäften

Während der Berichtsperiode wurden mit folgenden Gegenparteien OTC Geschäfte vorgenommen.

Teilvermögen	OTC - Gegenparteien
SYZ – Absolute Return	• State Street Bank & Trust

3.2.2 Pooling

Aufgrund der im Fondsvertrag dargelegten Möglichkeit der Fondsleitung, Teile oder die Gesamtheit der Vermögen verschiedener Fonds (inkl. allfälliger Teilvermögen) gemeinsam zu verwalten (Pooling), werden Käufe, Verkäufe und Verwaltungshandlungen (Transaktionen) nicht direkt auf Ebene der einzelnen Fonds, sondern auf Ebene von gemeinsam verwalteten Vermögen (Pools), an denen mehrere Fonds beteiligt sind, durchgeführt. Den Anlegern erwachsen daraus keine zusätzlichen Kosten. Das Pooling begründet keine Haftung zwischen den beteiligten kollektiven Kapitalanlagen bzw. den Fonds. Die Fondsleitung ist jederzeit in der Lage, die Anlagen der Pools den einzelnen beteiligten Fonds zuzuordnen. Die Pools bilden keine eigenen Sondervermögen, haben keine eigene Rechtspersönlichkeit und sind für die Anleger nicht unmittelbar zugänglich.

3.2.2.1 Übersicht der Fonds inklusive Anteilsquote an jedem Pool per Ende der Berichtsperiode

Teilvermögen	SYZ ARI CHF Principal Pool	SYZ ARI CHF Equity Pool	SIP Liquidity Mgmt CHF Syz AM Pool
Syz – Absolute Return CHF	100.00%	100.00%	0.12%
Weitere	-	-	99.88%
Total Pool	100.00%	100.00%	100.00%

Die Zuteilung der Vermögenswerte zum Ende der Berichtsperiode auf die einzelnen Fonds für den Ausweis der Wertpapier- und Wertrechtsbestände im vorliegenden Bericht erfolgt grundsätzlich nach ganzen Einheiten. Diese werden aufgrund der Anteilsquote der einzelnen beteiligten Fonds an jedem Pool zum Ende der Berichtsperiode ermittelt. Das gleiche Verfahren wird auf die auf Ebene des Pools gehaltenen Forderungen und Cash angewendet, wobei allfällige aus der Zuweisung ganzer Einheiten resultierende Vermögensdifferenzen über die Zuweisung von Cash ausgeglichen werden.

Die auf der Ebene des/der Pools getätigten Wertpapierkäufe und -verkäufe (Wertpapierbestandesveränderungen) sind am Ende des Berichts aufgeführt. Die Darstellung der Wertpapierkäufe und -verkäufe auf Ebene jedes Pools hat zur Folge, dass der Wertpapierbestand am Ende der Berichtsperiode sich nicht aus dem Wertpapierbestand zu Beginn der Berichtsperiode (Bericht der Vorperiode) korrigiert um die in der Berichtsperiode (im Pool) getätigten Transaktionen ermitteln lässt.

4 SYZ – Absolute Return

4.1 Vermögensrechnung

	31.03.2024	30.09.2023
	CHF	CHF
Vermögen		
Bankguthaben, einschliesslich Treuhandanlagen bei Drittbanken, aufgeteilt in:		
- Sichtguthaben	2'301'658.63	2'546'613.93
Geldmarktinstrumente	647'588.65	1'118'930.41
Effekten, einschliesslich ausgeliehene Effekten, aufgeteilt in:		
- Obligationen, Wandelobligationen, Optionsanleihen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte	12'354'862.88	14'800'814.34
- Aktien und sonstige Beteiligungswertpapiere und -rechte	464'191.57	415'650.31
- Anteile anderer kollektiver Kapitalanlagen	267'357.49	84'833.52
Derivative Finanzinstrumente	39'076.32	-132'241.00
Sonstige Vermögenswerte	135'505.19	128'797.95
Gesamtfondsvermögen	16'210'240.73	18'963'399.46
Andere Verbindlichkeiten	18'357.53	229'586.16
Nettofondsvermögen	16'191'883.20	18'733'813.30

4.2 Erfolgsrechnung

	01.10.2023 - 31.03.2024	01.10.2022 - 30.09.2023
	CHF	CHF
Ertrag		
Erträge der Bankguthaben	37'042.66	63'032.52
Erträge der Geldmarktinstrumente	4'266.96	9'168.68
Erträge der Effekten, aufgeteilt in:		
- Obligationen, Wandelobligationen, Optionsanleihen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte	96'626.77	228'651.68
- Aktien und sonstige Beteiligungswertpapiere und -rechte, einschliesslich Erträge aus Gratisaktien	3'944.25	2'376.30
- Anteile anderer kollektiver Kapitalanlagen	-	1'964.59
Sonstige Erträge	389.98	849.35
Einkauf in laufende Nettoerträge bei der Ausgabe von Anteilen	78.91	-45.20
Total Ertrag	142'349.53	305'997.92
Aufwand		
Passivzinsen	-	3'438.40
Negativzinsen	2'627.49	10'926.01
Prüfaufwand	9'210.60	18'657.68
Reglementarische Vergütungen an:		
- die Fondsleitung	58'089.60	160'735.22
Sonstige Aufwendungen	3'527.20	19'166.96
Teilübertrag von Aufwendungen auf realisierte Kapitalgewinne und -verluste	-	-28'498.98
Ausrichtung laufender Nettoerträge bei der Rücknahme von Anteilen	6'923.50	1'492.77
Total Aufwand	80'378.39	185'918.06
Nettoertrag	61'971.14	120'079.86
Realisierte Kapitalgewinne und -verluste	378'358.71	-1'696'069.35
Teilübertrag von Aufwendungen auf realisierte Kapitalgewinne und -verluste	-	-28'498.98
Realisierter Erfolg	440'329.85	-1'604'488.47
Nicht realisierte Kapitalgewinne und -verluste	529'491.81	3'054'347.45
Gesamterfolg	969'821.66	1'449'858.98

4.3 Veränderung des Nettofondsvermögens

	01.10.2023 - 31.03.2024	01.10.2022 - 30.09.2023
	CHF	CHF
Nettofondsvermögen zu Beginn der Berichtsperiode	18'733'813.30	46'786'813.68
Ausbezahlte Ausschüttungen	-64'137.18	-82'651.86
Abgeführte Verrechnungssteuer bei Wiederanlagen	-18'256.89	-6'371.89
Saldo aus Anteilsverkehr	-3'429'357.69	-29'413'835.61
Gesamterfolg	969'821.66	1'449'858.98
Nettofondsvermögen am Ende der Berichtsperiode	16'191'883.20	18'733'813.30

SYZ – Absolute Return

4.4 Anteilsscheinverkehr

	ISIN	01.10.2023 - 31.03.2024	01.10.2022 - 30.09.2023	01.10.2021 - 30.09.2022
Anteile A	CH0226422373			
Anteile zu Beginn der Berichtsperiode		3'627.200	4'247.200	5'669.200
Ausgegebene Anteile		531.000	-	225.000
Zurückgenommene Anteile		-1'997.000	-620.000	-1'647.000
Anteile am Ende der Berichtsperiode		2'161.200	3'627.200	4'247.200
Inventarwert pro Anteil		96.62	92.38	92.90
Nettofondsvermögen		208'806.54	335'064.62	394'570.03
Anteile C2	CH0245146250			
Anteile zu Beginn der Berichtsperiode		21'462.680	311'627.480	330'213.228
Ausgegebene Anteile		-	2'020.000	2'543.000
Zurückgenommene Anteile		-8'349.000	-292'184.800	-21'128.748
Anteile am Ende der Berichtsperiode		13'113.680	21'462.680	311'627.480
Inventarwert pro Anteil		96.41	92.80	93.05
Nettofondsvermögen		1'264'290.48	1'991'808.82	28'995'572.28
Anteile I1	CH0182982550			
Anteile zu Beginn der Berichtsperiode		1'585.000	1'965.000	2'945.000
Ausgegebene Anteile		-	-	-
Zurückgenommene Anteile		-1'395.000	-380.000	-980.000
Anteile am Ende der Berichtsperiode		190.000	1'585.000	1'965.000
Inventarwert pro Anteil		101.80	97.33	97.87
Nettofondsvermögen		19'342.31	154'261.36	192'314.51
Anteile I2	CH0182982568			
Anteile zu Beginn der Berichtsperiode		166'025.000	174'770.000	194'816.695
Ausgegebene Anteile		-	-	1'395.000
Zurückgenommene Anteile		-22'225.000	-8'745.000	-21'441.695
Anteile am Ende der Berichtsperiode		143'800.000	166'025.000	174'770.000
Inventarwert pro Anteil		102.22	97.89	98.44
Nettofondsvermögen		14'699'443.87	16'252'678.50	17'204'356.86

4.5 Ausserbilanzgeschäfte

Commitment – Ansatz II	Basiswertäquivalent	% des	Basiswertäquivalent	% des
	31.03.2024	Nettofondsvermögens	30.09.2023	Nettofondsvermögens
	CHF	31.03.2024	CHF	30.09.2023
Brutto-Gesamtengagement aus Derivaten	3'263'736.51	20.16%	5'480'245.06	29.25%
Netto-Gesamtengagement aus Derivaten	-	-	133'440.22	0.71%

4.6 Kennzahlen und technische Daten

4.6.1 Informationen über Kosten und Tracking Error

	ISIN	31.03.2024	30.09.2023	30.09.2022
Anteile A	CH0226422373			
Effektive Vergütungssätze an die Fondsleitung ¹		0.98%	0.99%	0.99%
Total Expense Ratio (TER) ²		1.13%	1.15%	1.06%
Tracking Error Minimum ³		3.37%	3.37%	2.22%
Tracking Error ³		3.40%	3.41%	4.98%
Tracking Error Maximum ³		5.14%	5.14%	4.99%
Anteile C2	CH0245146250			
Effektive Vergütungssätze an die Fondsleitung ¹		0.67%	0.66%	0.66%
Total Expense Ratio (TER) ²		0.81%	0.81%	0.73%
Tracking Error Minimum ³		3.37%	3.37%	2.21%
Tracking Error ³		3.40%	3.41%	4.98%
Tracking Error Maximum ³		5.13%	5.13%	4.99%

SYZ – Absolute Return

	ISIN	31.03.2024	30.09.2023	30.09.2022
Anteile I1	CH0182982550			
Effektive Vergütungssätze an die Fondsleitung ¹		0.90%	0.91%	0.91%
Total Expense Ratio (TER) ²		1.05%	1.07%	0.98%
Tracking Error Minimum ³		3.37%	3.37%	2.21%
Tracking Error ³		3.39%	3.40%	4.98%
Tracking Error Maximum ³		5.13%	5.13%	4.99%
Anteile I2	CH0182982568			
Effektive Vergütungssätze an die Fondsleitung ¹		0.65%	0.66%	0.66%
Total Expense Ratio (TER) ²		0.80%	0.82%	0.73%
Tracking Error Minimum ³		3.37%	3.37%	2.21%
Tracking Error ³		3.39%	3.40%	4.98%
Tracking Error Maximum ³		5.13%	5.13%	4.99%

¹ Aus der Verwaltungskommission werden Vergütungen für den Vertrieb des Anlagefonds an Vertriebssträger (Vertriebskommissionen) und Vermögensverwalter ausgerichtet.

² Die TER wird gemäss der jeweils gültigen „AMAS Richtlinie zur Berechnung und Offenlegung der TER“ berechnet.

³ Ex-Post Berechnung über 3 Jahre.

4.6.2 Performancezahlen ¹

Klassen	Währung	YTD	1 Monat	1 Jahr	3 Jahre	5 Jahre	seit Start
Anteile A	CHF	2.16%	1.07%	4.92%	-8.18%	-2.56%	0.21%
Anteile C2	CHF	2.23%	1.09%	5.25%	-7.28%	-0.96%	-0.90%
Anteile I1	CHF	2.23%	1.07%	5.06%	-7.90%	-2.09%	8.08%
Anteile I2	CHF	2.23%	1.09%	5.26%	-7.27%	-0.95%	11.17%

¹ Die vergangene Performance ist kein Indikator für die laufende oder künftige Wertentwicklung. Die Performancewerte beziehen sich auf den Nettoinventarwert und sind ohne die bei Ausgabe, Rücknahme oder Tausch anfallenden Kommissionen und Kosten (z.B. Transaktions- und Verwahrungskosten des Anlegers) gerechnet.

4.7 Verwendung des Erfolgs

	31.03.2024	30.09.2023
	CHF	CHF
Nettoertrag des Rechnungsjahres	61'971.14	120'079.86
Vortrag des Vorjahres	1'457.73	-
Zur Verteilung verfügbarer Erfolg	63'428.87	120'079.86
Ausschüttungen Anteile A	-	-269.02
Wiederanlage Anteile C2	-	-52'616.06
Ausschüttungen Anteile I1	-	-271.25
Ausschüttungen Anteile I2	-	-65'465.80
Vortrag auf neue Rechnung	63'428.87	1'457.73

4.8 Wertpapierbestand

4.8.1 Inventar und Bestandesveränderungen

Titel	Art. 84 951.312	Währung	% ¹	Maturität Commitment ⁵	Nominal per 30.09.2023	Käufe ²	Verkäufe ³	Nominal per 31.03.2024	Marktwert CHF	% des Gesamtfonds- vermögens ⁴
Total Effekten									13'734'010.99	84.72%
An einer Börse gehandelte Effekten									12'855'887.32	79.29%
Durch Pool gehaltene Aktien (Irland)									58'549.82	0.36%
Linde PLC	L1	USD			140.000			140.000	58'549.82	0.36%
Durch Pool gehaltene Aktien (Schweiz)									126'012.50	0.78%
Nestle SA	L1	CHF			440.000			440.000	42'130.00	0.26%
Novartis AG	L1	CHF			500.000			500.000	43'685.00	0.27%
Roche Holding AG	L1	CHF			175.000			175.000	40'197.50	0.25%
Durch Pool gehaltene Aktien (Vereinigte Staaten)									279'629.25	1.73%
Alphabet Inc	L1	USD			400.000			400.000	54'377.06	0.34%
Amazon.com Inc	L1	USD			400.000			400.000	64'987.31	0.40%
Apple Inc	L1	USD			280.000			280.000	43'246.57	0.27%
Mastercard Inc	L1	USD			130.000			130.000	56'387.51	0.35%
Microsoft Corp	L1	USD			160.000			160.000	60'630.80	0.37%
Durch Pool gehaltene Obligationen (CHF)									12'058'883.15	74.37%
Aargauische Kantonalbank	L1	CHF	0.110%	21.02.24	965.000			-	-	-
Aargauische Kantonalbank	L1	CHF	0.150%	15.11.24	-			1'803.000	1'788.22	0.01%

SYZ – Absolute Return

Titel	Art. 84 951.312	Wahrung	% ¹	Maturitat Commitment ⁵	Nominal per 30.09.2023	Kaufe ²	Verkaufe ³	Nominal per 31.03.2024	Marktwert CHF	% des Gesamtfonds- vermogens ⁴
Achmea Bank NV	L1	CHF	0.500%	27.10.23	9'930.000	-	-	-	-	-
Achmea Bank NV	L1	CHF	0.500%	03.10.25	150'000.000	-	-	150'000.000	147'786.00	0.91%
ADCB Finance Cayman Ltd	L1	CHF	0.500%	29.11.24	125'000.000	-	-	127'337.000	126'372.37	0.78%
ADCB Finance Cayman Ltd	L1	CHF	0.725%	15.02.24	8'815.000	-	-	-	-	-
Africa Finance Corp	L1	CHF	0.523%	20.12.23	15'892.000	-	-	-	-	-
Allreal Holding AG	L1	CHF	0.625%	10.05.24	15'292.000	-	-	14'710.000	14'690.88	0.09%
Amag Leasing AG	L1	CHF	0.000%	18.02.25	-	-	-	361.000	355.69	0.00%
Amag Leasing AG	L1	CHF	0.125%	12.02.24	62'110.000	-	-	-	-	-
Amag Leasing AG	L1	CHF	0.210%	27.06.24	16'836.000	-	-	11'237.000	11'188.68	0.07%
Amag Leasing AG	L1	CHF	0.250%	27.10.23	78'002.000	-	-	-	-	-
Amag Leasing AG	L1	CHF	0.875%	25.10.24	-	-	-	10'708.000	10'640.54	0.07%
Apple Inc	L1	CHF	0.375%	25.11.24	200'000.000	-	-	210'816.000	209'516.61	1.29%
ASB Bank Ltd	L1	CHF	0.200%	02.08.24	16'235.000	-	-	12'126.000	12'071.43	0.07%
AT&T Inc	L1	CHF	1.375%	04.12.24	-	-	-	51'503.000	51'472.10	0.32%
Axpo Holding AG	L1	CHF	0.250%	04.02.25	-	-	-	3'004.000	2'969.75	0.02%
Axpo Holding AG	L1	CHF	1.750%	29.05.24	50'100.000	-	-	30'598.000	30'601.06	0.19%
Axpo Holding AG	L1	CHF	3.125%	26.02.25	-	-	-	8'461.000	8'575.22	0.05%
Baloise Holding AG	L1	CHF	1.125%	19.12.24	-	-	-	2'169.000	2'162.71	0.01%
Baloise Life Ltd	L1	CHF	2.200%	19.06.48	100'000.000	-	-	100'000.000	99'477.00	0.61%
Banca Dello Stato del Cantone Ticino	L1	CHF	0.500%	24.06.24	5'308.000	-	-	3'738.000	3'728.66	0.02%
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA	L1	CHF	0.125%	27.08.26	200'000.000	-	-	200'000.000	192'886.00	1.19%
Banco de Chile	L1	CHF	0.250%	05.12.24	-	-	-	2'464.000	2'439.36	0.02%
Banco de Chile	L1	CHF	0.568%	21.11.23	21'522.000	-	-	-	-	-
Banco de Credito e Inversiones SA	L1	CHF	0.400%	22.11.24	-	-	-	17'354.000	17'208.23	0.11%
Banco del Estado de Chile	L1	CHF	0.693%	04.12.24	-	-	-	1'382.000	1'371.50	0.01%
Banco Santander Chile	L1	CHF	0.384%	27.09.24	5'362.000	-	-	3'125.000	3'103.13	0.02%
Banco Santander Chile	L1	CHF	0.441%	21.12.23	24'803.000	-	-	-	-	-
Banco Santander SA	L1	CHF	1.000%	10.12.24	-	-	-	18'381.000	18'301.96	0.11%
Banco Santander SA	L1	CHF	2.248%	30.01.26	200'000.000	-	-	200'000.000	202'650.00	1.25%
Bank Julius Baer & Co AG	L1	CHF	2.375%	06.09.27	150'000.000	-	-	150'000.000	153'480.00	0.95%
Bank of Montreal	L1	CHF	2.260%	01.02.29	200'000.000	-	-	200'000.000	206'822.00	1.28%
Banque Cantonale de Fribourg	L1	CHF	1.250%	03.06.24	6'434.000	-	-	4'266.000	4'263.44	0.03%
Banque Cantonale de Geneve	L1	CHF	1.125%	28.06.27	100'000.000	-	-	100'000.000	98'514.00	0.61%
Banque Cantonale Vaudoise	L1	CHF	1.500%	28.03.24	11'367.000	-	-	-	-	-
Banque Federative du Credit Mutuel SA	L1	CHF	0.320%	10.02.25	-	-	-	583.000	577.64	0.00%
Banque Federative du Credit Mutuel SA	L1	CHF	0.550%	08.12.23	2'895.000	-	-	-	-	-
Banque Federative du Credit Mutuel SA	L1	CHF	2.000%	22.05.24	2'166.000	-	-	1'634.000	1'634.49	0.01%
BKW AG	L1	CHF	0.000%	18.10.24	16'117.000	-	-	10'053.000	9'966.54	0.06%
BMW International Investment BV	L1	CHF	0.300%	05.09.24	-	-	-	2'271.000	2'259.87	0.01%
BP Capital Markets PLC	L1	CHF	1.750%	28.02.24	2'617.000	-	-	-	-	-
BPCE SA	L1	CHF	0.500%	08.11.23	23'806.000	-	-	-	-	-
Bucher Industries AG	L1	CHF	1.375%	02.10.24	-	-	-	1'496.000	1'493.31	0.01%
CA Auto Finance Suisse SA	L1	CHF	0.052%	20.12.24	-	-	-	22'101.000	21'833.58	0.13%
CA Auto Finance Suisse SA	L1	CHF	0.100%	23.10.23	180'448.000	-	-	-	-	-
Caisse de Refinancement de l'Habitat SA	L1	CHF	2.375%	05.03.24	6'327.000	-	-	-	-	-
Caisse des Depots et Consignations	L1	CHF	0.000%	16.06.26	200'000.000	-	-	200'000.000	194'808.00	1.20%
Canadian Imperial Bank of Commerce	L1	CHF	1.713%	13.07.27	150'000.000	-	-	-	-	-
Canton of Geneva Switzerland	L1	CHF	0.020%	27.11.24	100'000.000	-	-	-	-	-
Canton of Vaud	L1	CHF	0.500%	18.12.24	250'000.000	-	-	250'000.000	248'567.50	1.53%
Canton of Zurich	L1	CHF	0.000%	27.06.25	250'000.000	-	-	250'000.000	246'630.00	1.52%
CBQ Finance Ltd	L1	CHF	0.195%	22.04.24	38'433.000	-	-	33'939.000	33'888.09	0.21%
CBQ Finance Ltd	L1	CHF	0.380%	19.10.23	15'131.000	-	-	-	-	-
CBQ Finance Ltd	L1	CHF	0.735%	27.11.24	150'000.000	-	-	173'050.000	171'808.10	1.06%
Cellnex Telecom SA	L1	CHF	0.775%	18.02.27	125'000.000	-	-	-	-	-
Cembra Money Bank AG	L1	CHF	0.180%	05.10.23	42'314.000	-	-	-	-	-
Cembra Money Bank AG	L1	CHF	0.250%	23.05.24	8'504.000	-	-	14'211.000	14'182.58	0.09%
Cembra Money Bank AG	L1	CHF	2.411%	08.08.29	200'000.000	-	-	200'000.000	206'280.00	1.27%
Central American Bank for Economic Integration	L1	CHF	0.200%	25.03.24	14'712.000	-	-	-	-	-
Central American Bank for Economic Integration	L1	CHF	0.314%	05.09.24	250'000.000	-	-	251'791.000	250'410.79	1.55%
Central American Bank for Economic Integration	L1	CHF	2.138%	13.12.27	200'000.000	-	-	200'000.000	203'508.00	1.26%
Chocoladefabriken Lindt & Spruengli AG	L1	CHF	1.000%	08.10.24	-	-	-	3'335.000	3'326.66	0.02%
Citigroup Inc	L1	CHF	0.500%	22.11.24	-	-	-	6'838.000	6'792.87	0.04%
City of Geneva Switzerland	L1	CHF	1.625%	12.12.24	-	-	-	10'287.000	10'295.23	0.06%
City of Zurich Switzerland	L1	CHF	2.375%	21.02.24	29'532.000	-	-	-	-	-
Clariant AG	L1	CHF	2.750%	22.09.28	200'000.000	-	-	200'000.000	204'922.00	1.26%
Commerzbank AG	L1	CHF	3.263%	03.02.27	100'000.000	-	-	-	-	-
Cooperative Rabobank UA	L1	CHF	2.488%	25.01.29	200'000.000	-	-	200'000.000	205'686.00	1.27%
Corp Andina de Fomento	L1	CHF	0.510%	16.09.26	300'000.000	-	-	300'000.000	292'056.00	1.80%
Corp Andina de Fomento	L1	CHF	2.000%	05.02.24	42'851.000	-	-	-	-	-
Credit Agricole Home Loan SFH SA	L1	CHF	1.125%	05.06.24	2'113.000	-	-	1'184.000	1'183.17	0.01%
Credit Agricole SA/London	L1	CHF	0.200%	30.10.23	7'828.000	-	-	-	-	-
Credit Agricole SA/London	L1	CHF	0.625%	12.07.24	156'809.000	-	-	154'897.000	154'486.28	0.95%
Credit Suisse AG/London	L1	CHF	0.550%	15.04.24	-	-	-	2'644.000	2'642.94	0.02%
Credit Suisse Schweiz AG	L1	CHF	0.000%	17.12.24	-	-	-	1'286.000	1'272.63	0.01%
Credit Suisse Schweiz AG	L1	CHF	2.459%	22.11.24	-	-	-	6'231.000	6'271.50	0.04%
Deutsche Bahn Finance GMBH	L1	CHF	1.500%	26.08.24	1'609.000	-	-	901.000	901.00	0.01%
Deutsche Bank AG	L1	CHF	0.800%	07.02.25	-	-	-	14'181.000	14'076.06	0.09%
Deutsche Bank AG	L1	CHF	3.645%	27.01.29	200'000.000	-	-	200'000.000	207'684.00	1.28%
DH Switzerland Finance Sarl	L1	CHF	0.500%	08.12.23	16'375.000	-	-	-	-	-
Digital Intrepid Holding BV	L1	CHF	0.600%	02.10.23	16'718.000	-	-	-	-	-
Doha Finance Ltd	L1	CHF	0.465%	24.01.24	82'163.000	-	-	-	-	-

SYZ – Absolute Return

Titel	Art. 84 951.312	Wahrung	% ¹	Maturitat Commitment ⁵	Nominal per 30.09.2023	Kaufe ²	Verkaufe ³	Nominal per 31.03.2024	Marktwert CHF	% des Gesamtfonds- vermogens ⁴
EBN BV	L1	CHF	1.625%	03.10.23	3'431.000	-	-	-	-	-
Electricite de France SA	L1	CHF	0.300%	14.10.24	-	-	-	59'056.000	58'701.66	0.36%
Electricite de France SA	L1	CHF	2.300%	14.09.27	200'000.000	-	-	200'000.000	204'842.00	1.26%
Eli Lilly & Co	L1	CHF	0.150%	24.05.24	49'124.000	-	-	28'482.000	28'425.04	0.18%
Enel Finance International NV	L1	CHF	0.550%	03.09.24	9'244.000	-	-	9'007.000	8'968.27	0.06%
Engadiner Kraftwerke AG	L1	CHF	1.625%	25.04.24	3'850.000	-	-	6'466.000	6'465.35	0.04%
Engie SA	L1	CHF	1.625%	09.10.24	1'019.000	-	-	12'619.000	12'624.05	0.08%
European Investment Bank	L1	CHF	1.500%	02.08.24	2'574.000	-	-	1'683.000	1'683.34	0.01%
European Investment Bank	L1	CHF	1.625%	23.11.23	7'260.000	-	-	-	-	-
Export-Import Bank of Korea	L1	CHF	0.383%	11.07.24	11'581.000	-	-	6'490.000	6'465.99	0.04%
Federation des Caissees Desjardins du Quebec	L1	CHF	1.735%	31.01.28	150'000.000	-	-	150'000.000	152'352.00	0.94%
Firmenich International SA	L1	CHF	1.000%	19.12.23	99'309.000	-	-	-	-	-
First Abu Dhabi Bank PJSC	L1	CHF	0.401%	02.10.24	4'482.000	-	-	7'667.000	7'611.03	0.05%
Flughafen Zurich AG	L1	CHF	0.700%	22.05.24	37'607.000	-	-	22'269.000	22'240.05	0.14%
Fondo Financiero para el Desarrollo de la Cuenca del Plata	L1	CHF	0.578%	11.03.24	75'000.000	-	-	-	-	-
Fresenius SE & Co KGaA	L1	CHF	2.960%	18.10.28	200'000.000	-	-	200'000.000	209'434.00	1.29%
Geberit AG	L1	CHF	0.100%	17.10.24	-	-	-	2'031.000	2'015.16	0.01%
Givaudan SA	L1	CHF	1.750%	19.03.24	7'249.000	-	-	-	-	-
Glarner Kantonalbank	L1	CHF	1.000%	28.07.31	100'000.000	-	-	-	-	-
Glencore Finance Europe Ltd	L1	CHF	1.250%	09.10.24	-	-	-	15'209.000	15'172.50	0.09%
Goldman Sachs Group Inc/The	L1	CHF	0.500%	04.12.24	-	-	-	31'553.000	31'338.44	0.19%
Grand City Properties SA	L1	CHF	0.956%	01.09.26	125'000.000	-	-	-	-	-
Grande Dixence SA	L1	CHF	1.125%	04.07.24	-	-	-	2'193.000	2'189.27	0.01%
Graubuendner Kantonalbank	L1	CHF	0.100%	07.05.31	100'000.000	-	-	-	-	-
Graubuendner Kantonalbank	L1	CHF	1.375%	11.03.25	-	-	-	3'894.000	3'892.83	0.02%
GS Caltex Corp	L1	CHF	0.633%	31.01.24	28'728.000	-	-	-	-	-
GZO AG	L1	CHF	1.875%	12.06.24	34'229.000	-	-	19'181.000	19'140.72	0.12%
Heathrow Funding Ltd	L1	CHF	0.500%	17.05.24	81'187.000	-	-	55'391.000	55'307.91	0.34%
Helvetia Schweizerische Versicherungsgesellschaft AG	L1	CHF	1.450%	25.06.26	200'000.000	-	-	200'000.000	200'488.00	1.24%
Hilti AG	L1	CHF	0.200%	08.11.24	-	-	-	5'630.000	5'585.52	0.03%
Hilti AG	L1	CHF	1.875%	30.10.23	21'179.000	-	-	-	-	-
Holcim AG	L1	CHF	1.000%	11.12.24	-	-	-	44'064.000	43'909.78	0.27%
HSBC Holdings PLC	L1	CHF	1.805%	01.06.26	200'000.000	-	-	200'000.000	199'864.00	1.23%
HYPO NOE Landesbank fuer Niederoesterreich und Wien AG	L1	CHF	0.100%	27.11.24	-	-	-	1'983.000	1'963.96	0.01%
Hyundai Capital Services Inc	L1	CHF	0.260%	11.02.25	-	-	-	10'768.000	10'647.40	0.07%
Hyundai Capital Services Inc	L1	CHF	0.733%	26.02.24	22'219.000	-	-	-	-	-
Hyundai Capital Services Inc	L1	CHF	1.158%	14.06.24	12'546.000	-	-	7'992.000	7'984.01	0.05%
Intesa Sanpaolo Bank Ireland PLC	L1	CHF	0.250%	30.09.24	-	-	-	2'163.000	2'146.99	0.01%
Jackson National Life Global Funding	L1	CHF	0.300%	18.12.23	35'516.000	-	-	-	-	-
JPMorgan Chase & Co	L1	CHF	0.500%	04.12.23	18'358.000	-	-	-	-	-
Julius Baer Group Ltd	L1	CHF	0.375%	06.12.24	-	-	-	11'784.000	11'667.34	0.07%
Kanton Basel-Stadt	L1	CHF	0.000%	22.11.24	-	-	-	541.000	536.19	0.00%
Kernkraftwerk Leibstadt AG	L1	CHF	1.500%	07.08.24	2'359.000	-	-	21'626.000	21'606.54	0.13%
Kernkraftwerk Leibstadt AG	L1	CHF	2.000%	14.02.25	-	-	-	2'404.000	2'408.33	0.02%
Kiwibank Ltd	L1	CHF	0.250%	18.10.23	7'077.000	-	-	-	-	-
Korea Expressway Corp	L1	CHF	0.250%	07.06.24	42'808.000	-	-	24'619.000	24'554.99	0.15%
Korea Gas Corp	L1	CHF	0.000%	28.11.23	56'555.000	-	-	-	-	-
Korea Hydro & Nuclear Power Co Ltd	L1	CHF	0.000%	19.07.24	-	-	-	42'243.000	42'027.56	0.26%
Korea National Oil Corp	L1	CHF	0.000%	04.10.24	-	-	-	13'574.000	13'485.77	0.08%
Korea National Oil Corp	L1	CHF	0.263%	30.07.27	200'000.000	-	-	200'000.000	192'276.00	1.19%
Korea Railroad Corp	L1	CHF	0.000%	19.11.24	-	-	-	1'154.000	1'142.92	0.01%
Korea Western Power Co Ltd	L1	CHF	0.125%	27.02.24	43'826.000	-	-	-	-	-
Kraftwerke Linth-Limmern AG	L1	CHF	1.250%	11.09.24	7'925.000	-	-	20'845.000	20'801.23	0.13%
Kraftwerke Linth-Limmern AG	L1	CHF	2.000%	11.12.23	46'089.000	-	-	-	-	-
Kraftwerke Oberhasli AG	L1	CHF	1.875%	21.02.25	-	-	-	1'749.000	1'754.42	0.01%
Kuntarahoitus Oyj	L1	CHF	0.750%	17.09.24	-	-	-	2'404.000	2'396.07	0.01%
La Banque Postale SA	L1	CHF	2.773%	12.07.27	200'000.000	-	-	200'000.000	207'820.00	1.28%
Lloyds Banking Group PLC	L1	CHF	1.000%	04.03.25	150'000.000	-	-	162'018.000	161'373.22	1.00%
Lonza Swiss Finanz AG	L1	CHF	0.700%	12.07.24	33'478.000	-	-	19'589.000	19'545.90	0.12%
Lonza Swiss Finanz AG	L1	CHF	2.100%	12.09.29	150'000.000	-	-	150'000.000	152'617.50	0.94%
Luzerner Kantonalbank AG	L1	CHF	0.875%	14.05.31	100'000.000	-	-	-	-	-
Macquarie Bank Ltd/London	L1	CHF	0.750%	05.02.24	12'664.000	-	-	-	-	-
McDonald's Corp	L1	CHF	0.170%	04.10.24	-	-	-	2'392.000	2'376.45	0.01%
Mondelez International Inc	L1	CHF	0.617%	30.09.24	-	-	-	2'091.000	2'080.34	0.01%
Mondelez International Inc	L1	CHF	1.125%	21.12.23	19'988.000	-	-	-	-	-
Muenchener Hypothekenbank eG	L1	CHF	0.300%	20.12.24	-	-	-	19'565.000	19'392.83	0.12%
Muenchener Hypothekenbank eG	L1	CHF	0.350%	12.12.23	19'956.000	-	-	-	-	-
Muenchener Hypothekenbank eG	L1	CHF	3.125%	31.12.99	150'000.000	-	-	-	-	-
Nant de Drance SA	L1	CHF	0.875%	23.05.29	125'000.000	-	-	-	-	-
Nant de Drance SA	L1	CHF	1.750%	18.07.24	3'367.000	-	-	13'021.000	13'022.30	0.08%
National Australia Bank Ltd	L1	CHF	1.500%	07.02.24	35'258.000	-	-	-	-	-
Nederlandse Waterschapsbank NV	L1	CHF	1.250%	09.08.24	250'000.000	-	-	100'601.000	100'536.34	0.62%
Nestle SA	L1	CHF	0.250%	28.06.24	2'788.000	-	-	2'109.000	2'102.67	0.01%
Nestle SA	L1	CHF	1.875%	28.06.29	200'000.000	-	-	200'000.000	205'994.00	1.27%
Nordea Bank Abp	L1	CHF	0.250%	27.11.23	1'877.000	-	-	-	-	-
Nordea Bank Abp	L1	CHF	0.550%	23.06.25	150'000.000	-	-	150'000.000	148'546.50	0.92%
North American Development Bank	L1	CHF	0.200%	28.11.28	250'000.000	-	-	250'000.000	237'322.50	1.46%
Novartis AG	L1	CHF	0.250%	13.05.25	250'000.000	-	-	250'000.000	247'292.50	1.53%
Pargesa SA	L1	CHF	0.875%	24.04.24	11'796.000	-	-	7'703.000	7'696.84	0.05%
Partners Group Holding AG	L1	CHF	0.150%	07.06.24	15'753.000	-	-	13'863.000	13'825.57	0.09%
Pfandbriefbank schweizerischer Hypothekarinstitute AG	L1	CHF	0.000%	29.07.24	-	-	-	1'244.000	1'237.90	0.01%

SYZ – Absolute Return

Titel	Art. 84 951.312	Währung	% ¹	Maturität Commitment ⁵	Nominal per 30.09.2023	Käufe ²	Verkäufe ³	Nominal per 31.03.2024	Marktwert CHF	% des Gesamtfonds- vermögens ⁴
Pfandbriefbank schweizerischer Hypothekarinstitute AG	L1	CHF	0.125%	25.03.24	22'090.000	-	-	-	-	-
Pfandbriefbank schweizerischer Hypothekarinstitute AG	L1	CHF	0.750%	23.08.24	8'579.000	-	-	5'943.000	5'925.17	0.04%
Pfandbriefbank schweizerischer Hypothekarinstitute AG	L1	CHF	1.000%	21.05.24	21'372.000	-	-	21'152.000	21'135.08	0.13%
Pfandbriefbank schweizerischer Hypothekarinstitute AG	L1	CHF	1.125%	16.11.23	2'145.000	-	-	-	-	-
Pfandbriefbank schweizerischer Hypothekarinstitute AG	L1	CHF	1.375%	14.02.24	10'723.000	-	-	-	-	-
Pfandbriefbank schweizerischer Hypothekarinstitute AG	L1	CHF	1.375%	14.11.24	-	-	-	17'029.000	17'017.08	0.10%
Pfandbriefbank schweizerischer Hypothekarinstitute AG	L1	CHF	2.375%	25.01.24	22'541.000	-	-	-	-	-
Pfandbriefzentrale der schweizerischen Kantonalbanken AG	L1	CHF	0.000%	14.06.24	2'145.000	-	-	6'021.000	6'002.94	0.04%
Pfandbriefzentrale der schweizerischen Kantonalbanken AG	L1	CHF	0.010%	05.02.24	22'197.000	-	-	-	-	-
Pfandbriefzentrale der schweizerischen Kantonalbanken AG	L1	CHF	0.125%	17.07.24	13'619.000	-	-	18'916.000	18'838.44	0.12%
Pfandbriefzentrale der schweizerischen Kantonalbanken AG	L1	CHF	0.125%	02.12.24	-	-	-	1'142.000	1'131.95	0.01%
Pfandbriefzentrale der schweizerischen Kantonalbanken AG	L1	CHF	0.750%	15.04.24	-	-	-	733.000	732.78	0.00%
Pfandbriefzentrale der schweizerischen Kantonalbanken AG	L1	CHF	0.750%	23.09.24	-	-	-	18'027.000	17'962.10	0.11%
Pfandbriefzentrale der schweizerischen Kantonalbanken AG	L1	CHF	1.000%	22.09.28	150'000.000	-	-	150'000.000	148'489.50	0.92%
Pfandbriefzentrale der schweizerischen Kantonalbanken AG	L1	CHF	1.250%	17.07.24	-	-	-	3'221.000	3'217.78	0.02%
Pfandbriefzentrale der schweizerischen Kantonalbanken AG	L1	CHF	1.375%	16.04.25	-	-	-	1'202.000	1'202.24	0.01%
Pfandbriefzentrale der schweizerischen Kantonalbanken AG	L1	CHF	1.625%	31.10.24	-	-	-	7'265.000	7'270.09	0.04%
PSP Swiss Property AG	L1	CHF	0.500%	16.02.24	71'396.000	-	-	-	-	-
PSP Swiss Property AG	L1	CHF	2.000%	01.07.26	180'000.000	-	-	150'000.000	151'644.00	0.94%
Raiffeisen Schweiz Genossenschaft	L1	CHF	0.300%	22.04.25	-	-	-	300.000	296.34	0.00%
Raiffeisen Schweiz Genossenschaft	L1	CHF	0.350%	16.02.24	23'291.000	-	-	-	-	-
Repower AG	L1	CHF	2.550%	09.12.24	-	-	-	3'305.000	3'326.48	0.02%
Roche Kapitalmarkt AG	L1	CHF	0.100%	23.09.24	-	-	-	3'605.000	3'581.57	0.02%
Roche Kapitalmarkt AG	L1	CHF	0.500%	25.02.27	200'000.000	-	-	200'000.000	196'022.00	1.21%
Sandoz Group AG	L1	CHF	2.125%	17.11.26	-	-	-	200'000.000	203'216.00	1.25%
Santander Consumer Finance SA	L1	CHF	0.150%	10.12.24	-	-	-	10'822.000	10'717.03	0.07%
SGS SA	L1	CHF	0.450%	06.11.23	3'764.000	-	-	-	-	-
SGS SA	L1	CHF	1.750%	27.02.24	24'503.000	-	-	-	-	-
Sika AG	L1	CHF	0.625%	12.07.24	21'382.000	-	-	27'707.000	27'623.88	0.17%
Sika AG	L1	CHF	1.875%	14.11.23	15'227.000	-	-	-	-	-
Sika AG	L1	CHF	1.900%	28.11.25	100'000.000	-	-	100'000.000	100'765.00	0.62%
SIX Group AG	L1	CHF	0.125%	27.11.26	200'000.000	-	-	200'000.000	193'750.00	1.20%
Slovakia Government International Bond	L1	CHF	2.125%	16.10.23	1'255.000	-	-	-	-	-
Societe Generale SA	L1	CHF	0.700%	26.02.25	-	-	-	23'555.000	23'359.49	0.14%
Societe Generale SA	L1	CHF	0.875%	28.02.24	250'185.000	-	-	-	-	-
Spital Limmattal	L1	CHF	1.875%	29.11.23	15'527.000	-	-	-	-	-
Straumann Holding AG	L1	CHF	1.000%	03.10.23	34'433.000	-	-	-	-	-
Sulzer AG	L1	CHF	0.800%	23.09.25	150'000.000	-	-	150'000.000	148'159.50	0.91%
Sulzer AG	L1	CHF	1.600%	22.10.24	-	-	-	12'547.000	12'513.12	0.08%
Swiss Confederation Government Bond	L1	CHF	0.500%	27.06.32	500'000.000	-	-	500'000.000	494'605.00	3.05%
Swiss Confederation Government Bond	L1	CHF	1.250%	28.05.26	800'000.000	-	-	600'000.000	604'860.00	3.73%
Swiss Confederation Government Bond	L1	CHF	1.500%	24.07.25	600'000.000	-	-	600'000.000	604'380.00	3.73%
Swiss Life Holding AG	L1	CHF	0.250%	11.10.23	43'301.000	-	-	-	-	-
Swiss Life Holding AG	L1	CHF	2.259%	26.07.28	250'000.000	-	-	250'000.000	258'545.00	1.60%
Swiss Prime Site Finance AG	L1	CHF	1.000%	16.07.24	28'202.000	-	-	21'350.000	21'317.98	0.13%
Swiss Prime Site Finance AG	L1	CHF	2.000%	10.12.24	-	-	-	6'988.000	7'010.36	0.04%
Swiss Reinsurance Co Ltd	L1	CHF	1.000%	17.09.24	250'000.000	-	-	250'000.000	249'535.00	1.54%
Swisscom AG	L1	CHF	1.750%	10.07.24	17'758.000	-	-	15'918.000	15'922.78	0.10%
Swissgrid AG	L1	CHF	1.625%	30.01.25	-	-	-	3'665.000	3'670.86	0.02%
Syngenta Finance AG	L1	CHF	0.700%	09.12.26	200'000.000	-	-	200'000.000	195'308.00	1.20%
Temenos AG	L1	CHF	1.750%	05.04.24	180'000.000	-	-	150'000.000	149'661.00	0.92%
Thurgauer Kantonalbank	L1	CHF	1.750%	30.09.24	-	-	-	3'209.000	3'213.17	0.02%
Toronto-Dominion Bank/The	L1	CHF	2.203%	31.01.28	200'000.000	-	-	200'000.000	204'804.00	1.26%
TotalEnergies Capital International SA	L1	CHF	1.000%	29.08.24	-	-	-	1'695.000	1'691.44	0.01%
Trafigura Funding SA	L1	CHF	3.250%	30.09.24	100'000.000	-	-	100'000.000	99'634.00	0.61%
Valiant Bank AG	L1	CHF	0.125%	23.04.24	47'119.000	-	-	18'808.000	18'791.07	0.12%
Vodafone Group PLC	L1	CHF	0.375%	03.12.24	-	-	-	27'864.000	27'641.09	0.17%
VP Bank AG	L1	CHF	0.875%	07.10.24	-	-	-	5'823.000	5'797.96	0.04%
Walliser Kantonalbank	L1	CHF	0.200%	19.08.24	-	-	-	3'551.000	3'532.53	0.02%
Wells Fargo & Co	L1	CHF	0.500%	02.11.23	104'060.000	-	-	-	-	-
Wells Fargo & Co	L1	CHF	1.250%	03.09.24	3'646.000	-	-	20'328.000	20'297.51	0.13%
Westpac Banking Corp	L1	CHF	0.400%	06.06.24	14'584.000	-	-	11'555.000	11'529.58	0.07%
Woodside Finance Ltd	L1	CHF	1.000%	11.12.23	16'771.000	-	-	-	-	-
Zuercher Kantonalbank	L1	CHF	1.125%	29.01.24	5'941.000	-	-	-	-	-
Zürich Insurance Co Ltd	L1	CHF	0.100%	27.08.32	200'000.000	-	-	200'000.000	178'102.00	1.10%
Zürich Insurance Co Ltd	L1	CHF	0.500%	18.12.24	-	-	-	2'368.000	2'351.90	0.01%
Durch Pool gehaltene Obligationen (EUR)									65'455.11	0.40%
Argentine Republic Government International Bond	L1	EUR	0.125%	09.07.30	134'858.000	-	-	134'858.000	63'482.52	0.39%
Argentine Republic Government International Bond	L1	EUR	0.500%	09.07.29	4'152.000	-	-	4'152.000	1'972.59	0.01%
Durch Pool gehaltene Investmentfonds (Irland)									267'357.49	1.65%
iShares MSCI Global Semiconductors UCITS ETF	L1	USD	0.350%	-	9'000.000	-	-	9'000.000	61'502.50	0.38%
KraneShares MSCI China ESG Leaders UCITS ETF	L1	USD	0.400%	-	2'200.000	-	-	-	-	-
Xtrackers S&P 500 Equal Weight UCITS ETF	L1	USD	0.200%	-	-	-	-	2'500.000	205'854.99	1.27%
Nicht Notierte Wertpapiere									230'529.28	1.43%
Durch Pool gehaltene Obligationen (CHF)									224'301.02	1.39%
Credit Agricole next bank Suisse SA	L2	CHF	2.006%	17.01.25	-	-	-	21'632.000	21'672.67	0.13%
Credit Agricole next bank Suisse SA	L2	CHF	2.030%	20.12.24	-	-	-	48'072.000	48'157.57	0.30%

SYZ – Absolute Return

Titel	Art. 84 951.312	Währung	% ¹	Maturität Commitment ⁵	Nominal per 30.09.2023	Käufe ²	Verkäufe ³	Nominal per 31.03.2024	Marktwert CHF	% des Gesamtfonds- vermögens ⁴
Kernkraftwerk Leibstadt AG	L2	CHF	0.250%	30.04.24	32'170.000			18'027.000	18'002.30	0.11%
Limeco	L2	CHF	1.800%	05.12.24	-			13'821.000	13'833.30	0.09%
Schaffhauser Kantonalbank	L2	CHF	1.591%	21.03.25	-			30'045.000	30'021.87	0.19%
UBS AG/London	L2	CHF	0.440%	29.04.24	32'170.000			18'027.000	18'009.51	0.11%
Valiant Bank AG	L2	CHF	2.000%	26.08.24	90'076.000			50'475.000	50'536.07	0.31%
Valiant Bank AG	L2	CHF	2.200%	08.07.24	42'894.000			24'036.000	24'067.73	0.15%
Durch Pool gehaltene Obligationen (USD)									6'228.26	0.04%
Arendal S de RL de CV	L2	USD	25.000%	30.06.24	43'200.000			43'200.000	6'228.26	0.04%
Durch Pool gehaltene Strukturierte Produkte (USD)									0.00	0.00%
Arendal S de RL de CV	L2	USD		12.06.22	216'000.000			216'000.000	0.00	0.00%
Geldmarktinstrumente									647'594.39	4.00%
Durch Pool gehaltene Certificate of Deposit (CHF)									85'312.82	0.53%
Axpo Holding AG	L2	CHF	2.450%	17.01.24	107'234.000			-	-	-
Azienda Elettrica Ticinese	L2	CHF	2.530%	19.06.24	53'617.000			30'045.000	30'096.98	0.19%
Bank Cler AG	L2	CHF	2.045%	26.06.24	53'617.000			30'045.000	30'057.92	0.19%
City of Lausanne Switzerland	L2	CHF	1.765%	17.11.23	64'340.000			-	-	-
Controle Financier de la Ville de La Chaux-de-Fonds	L2	CHF	1.999%	18.10.23	21'447.000			-	-	-
Coöperatieve Rabobank UA	L2	CHF	0.000%	03.06.24	35'387.000			-	-	-
Coöperatieve Rabobank UA	L2	CHF	0.000%	25.07.24	32'170.000			18'027.000	17'947.14	0.11%
Gemeinde Schiers	L2	CHF	1.750%	27.10.23	8'579.000			-	-	-
IWB Industrielle Werke Basel	L2	CHF	2.000%	02.02.24	107'234.000			-	-	-
Morges City of	L2	CHF	1.990%	24.04.24	12'868.000			7'211.000	7'210.78	0.04%
Swiss Prime Site Finance AG	L2	CHF	2.090%	08.12.23	53'617.000			-	-	-
Durch Pool gehaltene Commercial Paper (CHF)									131'725.98	0.80%
Bayerische Landesbank	L2	CHF	0.000%	13.05.24	-			36'054.000	35'988.90	0.22%
DNB Bank ASA	L2	CHF	0.000%	31.07.24	32'170.000			18'027.000	17'945.34	0.11%
Jyske Bank A/S	L2	CHF	0.000%	31.05.24	53'617.000			30'045.000	29'969.60	0.18%
Landesbank Baden-Wuerttemberg	L2	CHF	0.000%	23.09.24	85'787.000			12'018.000	11'933.66	0.07%
Landesbank Baden-Wuerttemberg	L2	CHF	0.000%	06.12.24	-			12'018.000	11'901.27	0.07%
Swiss National Bank Bill	L2	CHF	0.000%	13.11.23	15'013.000			-	-	-
Swiss National Bank Bill	L2	CHF	0.000%	21.05.24	-			24'036.000	23'987.21	0.15%
Durch Pool gehaltene Obligationen (CHF)									430'555.59	2.67%
Banca Dello Stato del Cantone Ticino	L2	CHF	1.710%	19.04.24	-			60'090.000	60'090.00	0.37%
Bank Cler AG	L2	CHF	1.768%	15.11.24	-			30'045.000	30'042.60	0.19%
Banque SYZ SA	L2	CHF	2.260%	22.04.24	-			2'404.000	2'404.60	0.01%
BPCE SA	L1	CHF	1.808%	01.03.25	-			48'072.000	48'055.25	0.30%
Galenica AG	L2	CHF	2.050%	06.11.23	53'617.000			-	-	-
Galenica AG	L2	CHF	2.080%	05.12.23	42'894.000			-	-	-
IWB Industrielle Werke Basel	L2	CHF	1.600%	15.07.24	-			48'072.000	48'072.48	0.30%
Kantonsspital Aarau AG	L2	CHF	1.880%	30.11.23	62'196.000			-	-	-
Limeco	L2	CHF	1.770%	05.12.23	24'664.000			-	-	-
Luzerner Kantonsspital	L2	CHF	1.820%	24.06.24	-			18'027.000	18'036.01	0.11%
Reseau Hospitalier Neuchatelois	L2	CHF	1.640%	24.01.25	-			30'045.000	30'047.70	0.19%
Stiftung Kantonsspital Graubuenden	L2	CHF	1.860%	17.05.24	10'723.000			6'009.000	6'009.48	0.04%
Swiss National Bank Bill	L2	CHF	0.000%	16.10.23	10'723.000			-	-	-
Swissgrid AG	L2	CHF	1.980%	30.04.24	107'234.000			60'090.000	60'101.42	0.37%
Switzerland Treasury Bill	L2	CHF	0.000%	11.04.24	-			1'502.000	1'501.46	0.01%
Thurgauer Kantonalbank	L2	CHF	1.670%	12.04.24	-			60'090.000	60'090.00	0.37%
UBS AG/London	L2	CHF	2.050%	28.04.24	75'064.000			42'063.000	42'074.36	0.26%
Universitaetsspital Zuerich	L2	CHF	1.680%	29.05.24	-			24'036.000	24'030.23	0.15%
Sichtguthaben									2'301'648.23	14.20%
Derivative Finanzinstrumente									39'076.32	0.24%
Durch Pool gehaltene Devisentermingeschäfte									-14'583.42	-0.09%
Devisentermingeschäfte	L2	CHF/EUR		05.04.24		240'359	250'000		-2'795.59	-0.02%
Devisentermingeschäfte	L2	CHF/USD		05.04.24		708'614	800'000		-11'787.83	-0.07%
Durch Pool gehaltene Futures auf Anleihen									-	-
Euro-Bund Fut.	L1	EUR		07.12.23	17.000			-	-	-
Durch Pool gehaltene Futures auf Indizes									53'659.74	0.33%
EURO STOXX 50 Index Fut.	L1	EUR		15.12.23	7.000			-	-	-
EURO STOXX 50 Index Fut.	L1	EUR		21.06.24	-			5.000	6'639.06	0.04%
MSCI Emerging Markets Index Fut.	L1	USD		15.12.23	2.000			-	-	-
S+P 500 Emini Index Fut.	L1	USD		15.12.23	8.000			-	-	-
S+P 500 Emini Index Fut.	L1	USD		21.06.24	-			8.000	44'134.30	0.27%
Topix Index Fut.	L1	JPY		07.12.23	2.000			-	-	-
Topix Index Fut.	L1	JPY		13.06.24	-			1.000	2'886.38	0.02%
Sonstige Vermögenswerte									135'505.19	0.84%

SYZ – Absolute Return

Titel	Art. 84 951.312	Währung	% ¹	Maturität Commitment ⁵	Nominal per 30.09.2023	Käufe ²	Verkäufe ³	Nominal per 31.03.2024	Marktwert CHF	% des Gesamtfonds- vermögens ⁴
Gesamtfondsvermögen									16'210'240.73	100.00%
./. Andere Verbindlichkeiten									-18'357.53	
Total Nettofondsvermögen									16'191'883.20	

¹ Bei Investmentfonds die maximale oder applizierte Gebühr.

² Käufe umfassen unter anderem die Transaktionen: Gratistitel / Käufe / Konversionen / Namensänderungen / Splits / Stock- und Wahldividenden / Titelaufteilungen / Überträge / Umtausch zwischen Gesellschaften / Zuteilungen aus Bezugs- und Optionsrechten / Zuteilung von Bezugsrechten aus Basistiteln / Sacheinlagen.

³ Verkäufe umfassen unter anderem die Transaktionen: Auslosungen / Ausbuchungen infolge Verfall / Ausübungen von Bezugs- und Optionsrechten / Konversionen / Reverse Splits / Rückzahlungen / Überträge / Umtausch zwischen Gesellschaften / Sachauslagen.

⁴ Allfällige Abweichungen der Prozentzahlen des Gesamtfondsvermögens sind auf Rundungsdifferenzen zurückzuführen.

⁵ Private Equity eingegangene Verpflichtung in Millionen.

4.8.2 Bewertungskategorien KKV-FINMA Art. 84 Absatz 2

Titel	Art. 84 951.312	Marktwert CHF	% des Gesamtfonds- vermögens
a) Anlagen, die an einer Börse kotiert oder an einem anderen geregelten, dem Publikum offen stehenden Markt gehandelt werden	L1	12'957'602.31	79.92%
b) Anlagen, für die keine Kurse gemäss Buchstabe a verfügbar sind: bewertet aufgrund von am Markt beobachtbaren Parametern	L2	815'485.00	5.04%
c) Anlagen, die aufgrund von am Markt nicht beobachtbaren Parametern mit geeigneten Bewertungsmodellen unter Berücksichtigung der aktuellen Marktgegebenheiten bewertet werden.	L3	-	-

In Pools gehaltene Wertschriften
SYZ ARI CHF Principal Pool

5 In Pools gehaltene Wertschriften

5.1 SYZ ARI CHF Principal Pool

5.1.1 Inventar und Bestandesveränderungen

Titel	Art. 84 951.312	Währung	% ¹	Maturität Commitment ⁵	Nominal per 30.09.2023	Käufe ²	Verkäufe ³	Nominal per 31.03.2024	Marktwert CHF	% des Gesamtpool- vermögens ⁴
Total Effekten									11'574'666.44	84.01%
An einer Börse gehandelte Effekten									11'568'438.17	83.96%
Aktien (Irland)									58'549.82	0.42%
Linde PLC	L1	USD			140.000	-	-	140.000	58'549.82	0.42%
Aktien (Schweiz)									126'012.50	0.92%
Nestle SA	L1	CHF			440.000	-	-	440.000	42'130.00	0.31%
Novartis AG	L1	CHF			500.000	500.000	500.000	500.000	43'685.00	0.32%
Roche Holding AG	L1	CHF			175.000	-	-	175.000	40'197.50	0.29%
Sandoz Group AG	L1	CHF			-	100.000	100.000	-	-	-
Aktien (Vereinigte Staaten)									279'629.25	2.03%
Alphabet Inc	L1	USD			400.000	-	-	400.000	54'377.06	0.40%
Amazon.com Inc	L1	USD			400.000	-	-	400.000	64'987.31	0.47%
Apple Inc	L1	USD			280.000	-	-	280.000	43'246.57	0.31%
Mastercard Inc	L1	USD			130.000	-	-	130.000	56'387.51	0.41%
Microsoft Corp	L1	USD			160.000	-	-	160.000	60'630.80	0.44%
Obligationen (CHF)									10'771'434.00	78.18%
Achmea Bank NV	L1	CHF	0.500%	03.10.25	150'000.000	-	-	150'000.000	147'786.00	1.07%
ADCB Finance Cayman Ltd	L1	CHF	0.500%	29.11.24	125'000.000	-	-	125'000.000	124'055.00	0.90%
Apple Inc	L1	CHF	0.375%	25.11.24	200'000.000	-	-	200'000.000	198'772.00	1.44%
Baloise Life Ltd	L1	CHF	2.200%	19.06.48	100'000.000	-	-	100'000.000	99'477.00	0.72%
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA	L1	CHF	0.125%	27.08.26	200'000.000	-	-	200'000.000	192'886.00	1.40%
Banco Santander SA	L1	CHF	2.248%	30.01.26	200'000.000	-	-	200'000.000	202'650.00	1.47%
Bank Julius Baer & Co AG	L1	CHF	2.375%	06.09.27	150'000.000	-	-	150'000.000	153'480.00	1.11%
Bank of Montreal	L1	CHF	2.260%	01.02.29	200'000.000	-	-	200'000.000	206'822.00	1.50%
Banque Cantonale de Geneve	L1	CHF	1.125%	28.06.27	100'000.000	-	-	100'000.000	98'514.00	0.71%
CA Auto Finance Suisse SA	L1	CHF	0.100%	23.10.23	120'000.000	-	120'000.000	-	-	-
Caisse des Depots et Consignations	L1	CHF	0.000%	16.06.26	200'000.000	-	-	200'000.000	194'808.00	1.41%
Canadian Imperial Bank of Commerce	L1	CHF	1.713%	13.07.27	150'000.000	-	150'000.000	-	-	-
Canton of Geneva Switzerland	L1	CHF	0.020%	27.11.24	100'000.000	-	100'000.000	-	-	-
Canton of Vaud	L1	CHF	0.500%	18.12.24	250'000.000	-	-	250'000.000	248'567.50	1.80%
Canton of Zürich	L1	CHF	0.000%	27.06.25	250'000.000	-	-	250'000.000	246'630.00	1.79%
CBQ Finance Ltd	L1	CHF	0.735%	27.11.24	150'000.000	-	-	150'000.000	148'942.50	1.08%
Cellnex Telecom SA	L1	CHF	0.775%	18.02.27	125'000.000	-	125'000.000	-	-	-
Cembra Money Bank AG	L1	CHF	2.411%	08.08.29	200'000.000	-	-	200'000.000	206'280.00	1.50%
Central American Bank for Economic Integration	L1	CHF	0.314%	05.09.24	250'000.000	-	-	250'000.000	248'630.00	1.80%
Central American Bank for Economic Integration	L1	CHF	2.138%	13.12.27	200'000.000	-	-	200'000.000	203'508.00	1.48%
Clariant AG	L1	CHF	2.750%	22.09.28	200'000.000	-	-	200'000.000	204'922.00	1.49%
Commerzbank AG	L1	CHF	3.263%	03.02.27	100'000.000	-	100'000.000	-	-	-
Cooperatieve Rabobank UA	L1	CHF	2.488%	25.01.29	200'000.000	-	-	200'000.000	205'686.00	1.49%
Corp Andina de Fomento	L1	CHF	0.510%	16.09.26	300'000.000	-	-	300'000.000	292'056.00	2.12%
Credit Agricole SA/London	L1	CHF	0.625%	12.07.24	150'000.000	-	-	150'000.000	149'602.50	1.09%
Deutsche Bank AG	L1	CHF	3.645%	27.01.29	200'000.000	-	-	200'000.000	207'684.00	1.51%
Electricite de France SA	L1	CHF	2.300%	14.09.27	200'000.000	-	-	200'000.000	204'842.00	1.49%
Federation des Caisses Desjardins du Quebec	L1	CHF	1.735%	31.01.28	150'000.000	-	-	150'000.000	152'352.00	1.11%
Fondo Financiero para el Desarrollo de la Cuenca del Plata	L1	CHF	0.578%	11.03.24	75'000.000	-	75'000.000	-	-	-
Fresenius SE & Co KGaA	L1	CHF	2.960%	18.10.28	200'000.000	-	-	200'000.000	209'434.00	1.52%
Glarner Kantonalbank	L1	CHF	1.000%	28.07.31	100'000.000	-	100'000.000	-	-	-
Grand City Properties SA	L1	CHF	0.956%	01.09.26	125'000.000	-	125'000.000	-	-	-
Graubündner Kantonalbank	L1	CHF	0.100%	07.05.31	100'000.000	-	100'000.000	-	-	-
Helvetia Schweizerische Versicherungsgesellschaft AG	L1	CHF	1.450%	25.06.26	200'000.000	-	-	200'000.000	200'488.00	1.46%
HSBC Holdings PLC	L1	CHF	1.805%	01.06.26	200'000.000	-	-	200'000.000	199'864.00	1.45%
Korea National Oil Corp	L1	CHF	0.263%	30.07.27	200'000.000	-	-	200'000.000	192'276.00	1.40%
La Banque Postale SA	L1	CHF	2.773%	12.07.27	200'000.000	-	-	200'000.000	207'820.00	1.51%
Lloyds Banking Group PLC	L1	CHF	1.000%	04.03.25	150'000.000	-	-	150'000.000	149'410.50	1.08%
Lonza Swiss Finanz AG	L1	CHF	2.100%	12.09.29	150'000.000	-	-	150'000.000	152'617.50	1.11%
Luzerner Kantonalbank AG	L1	CHF	0.875%	14.05.31	100'000.000	-	100'000.000	-	-	-
Muenchener Hypothekenbank eG	L1	CHF	3.125%	31.12.99	150'000.000	-	150'000.000	-	-	-
Nant de Drance SA	L1	CHF	0.875%	23.05.29	125'000.000	-	125'000.000	-	-	-
Nederlandse Waterschapsbank NV	L1	CHF	1.250%	09.08.24	250'000.000	-	150'000.000	100'000.000	99'936.00	0.73%
Nestle SA	L1	CHF	1.875%	28.06.29	200'000.000	-	-	200'000.000	205'994.00	1.49%
Nordea Bank Abp	L1	CHF	0.550%	23.06.25	150'000.000	-	-	150'000.000	148'546.50	1.08%
North American Development Bank	L1	CHF	0.200%	28.11.28	250'000.000	-	-	250'000.000	237'322.50	1.72%
Novartis AG	L1	CHF	0.250%	13.05.25	250'000.000	-	-	250'000.000	247'292.50	1.79%
Pfandbriefzentrale der schweizerischen Kantonalbanken AG	L1	CHF	1.000%	22.09.28	150'000.000	-	-	150'000.000	148'489.50	1.08%
PSP Swiss Property AG	L1	CHF	2.000%	01.07.26	180'000.000	-	30'000.000	150'000.000	151'644.00	1.10%

In Pools gehaltene Wertschriften SYZ ARI CHF Principal Pool

Titel	Art. 84 951.312	Währung	% ¹	Maturität Commitment ⁵	Nominal per 30.09.2023	Käufe ²	Verkäufe ³	Nominal per 31.03.2024	Marktwert CHF	% des Gesamtpool- vermögens ⁴
Roche Kapitalmarkt AG	L1	CHF	0.500%	25.02.27	200'000.000	-	-	200'000.000	196'022.00	1.42%
Sandoz Group AG	L1	CHF	2.125%	17.11.26	-	200'000.000	-	200'000.000	203'216.00	1.47%
Sika AG	L1	CHF	1.900%	28.11.25	100'000.000	-	-	100'000.000	100'765.00	0.73%
SIX Group AG	L1	CHF	0.125%	27.11.26	200'000.000	-	-	200'000.000	193'750.00	1.41%
Societe Generale SA	L1	CHF	0.875%	28.02.24	200'000.000	-	200'000.000	-	-	-
Sulzer AG	L1	CHF	0.800%	23.09.25	150'000.000	-	-	150'000.000	148'159.50	1.08%
Swiss Confederation Government Bond	L1	CHF	0.500%	27.06.32	500'000.000	-	-	500'000.000	494'605.00	3.59%
Swiss Confederation Government Bond	L1	CHF	1.250%	28.05.26	800'000.000	-	200'000.000	600'000.000	604'860.00	4.39%
Swiss Confederation Government Bond	L1	CHF	1.500%	24.07.25	600'000.000	-	-	600'000.000	604'380.00	4.39%
Swiss Life Holding AG	L1	CHF	2.259%	26.07.28	250'000.000	-	-	250'000.000	258'545.00	1.88%
Swiss Reinsurance Co Ltd	L1	CHF	1.000%	17.09.24	250'000.000	-	-	250'000.000	249'535.00	1.81%
Syngenta Finance AG	L1	CHF	0.700%	09.12.26	200'000.000	-	-	200'000.000	195'308.00	1.42%
Temenos AG	L1	CHF	1.750%	05.04.24	180'000.000	-	30'000.000	150'000.000	149'661.00	1.09%
Toronto-Dominion Bank/The	L1	CHF	2.203%	31.01.28	200'000.000	-	-	200'000.000	204'804.00	1.49%
Trafigura Funding SA	L1	CHF	3.250%	30.09.24	100'000.000	-	-	100'000.000	99'634.00	0.72%
Zürich Insurance Co Ltd	L1	CHF	0.100%	27.08.32	200'000.000	-	-	200'000.000	178'102.00	1.29%
Obligationen (EUR)									65'455.11	0.47%
Argentine Republic Government International Bond	L1	EUR	0.125%	09.07.30	134'858.000	-	-	134'858.000	63'482.52	0.46%
Argentine Republic Government International Bond	L1	EUR	0.500%	09.07.29	4'152.000	-	-	4'152.000	1'972.59	0.01%
Investmentfonds (Irland)									267'357.49	1.94%
iShares MSCI Global Semiconductors UCITS ETF	L1	USD	0.350%		9'000.000	-	-	9'000.000	61'502.50	0.45%
KraneShares MSCI China ESG Leaders UCITS ETF	L1	USD	0.400%		2'200.000	-	2'200.000	-	-	-
Xtrackers S&P 500 Equal Weight UCITS ETF	L1	USD	0.200%		-	2'500.000	-	2'500.000	205'854.99	1.49%
Nicht Notierte Wertpapiere									6'228.27	0.05%
Obligationen (USD)									6'228.27	0.05%
Arendal S de RL de CV	L2	USD	25.000%	30.06.24	43'200.000	-	-	43'200.000	6'228.27	0.05%
Strukturierte Produkte (USD)									0.00	0.00%
Arendal S de RL de CV	L2	USD		12.06.22	216'000.000	-	-	216'000.000	0.00	0.00%
Sichtguthaben									2'058'706.55	14.94%
Derivative Finanzinstrumente									39'076.32	0.28%
Devisentermingeschäfte									-14'583.42	-0.11%
Devisentermingeschäfte	L2	CHF/EUR		05.04.24		240'359	250'000		-2'795.59	-0.02%
Devisentermingeschäfte	L2	CHF/USD		05.04.24		708'614	800'000		-11'787.83	-0.09%
Futures auf Anleihen									-	-
Euro-Bund Fut.	L1	EUR		07.12.23	17.000	-	17.000	-	-	-
Euro-Bund Fut.	L1	EUR		07.03.24	-	15.000	15.000	-	-	-
Ultra 10 Year US Treasury Note Fut.	L1	USD		19.03.24	-	15.000	15.000	-	-	-
Futures auf Indizes									53'659.74	0.39%
EURO STOXX 50 Index Fut.	L1	EUR		15.12.23	7.000	-	7.000	-	-	-
EURO STOXX 50 Index Fut.	L1	EUR		15.03.24	-	5.000	5.000	-	-	-
EURO STOXX 50 Index Fut.	L1	EUR		21.06.24	-	5.000	-	5.000	6'639.06	0.05%
MSCI Emerging Markets Index Fut.	L1	USD		15.12.23	2.000	-	2.000	-	-	-
S+P 500 Emini Index Fut.	L1	USD		15.12.23	8.000	1.000	9.000	-	-	-
S+P 500 Emini Index Fut.	L1	USD		15.03.24	-	9.000	9.000	-	-	-
S+P 500 Emini Index Fut.	L1	USD		21.06.24	-	8.000	-	8.000	44'134.30	0.32%
Topix Index Fut.	L1	JPY		07.12.23	2.000	-	2.000	-	-	-
Topix Index Fut.	L1	JPY		07.03.24	-	1.000	1.000	-	-	-
Topix Index Fut.	L1	JPY		13.06.24	-	1.000	-	1.000	2'886.38	0.02%
Sonstige Vermögenswerte									106'478.07	0.77%
Gesamtpoolvermögen									13'778'927.38	100.00%
./. Andere Verbindlichkeiten									-1.06	
Total Nettopoolvermögen									13'778'926.32	

¹ Bei Investmentfonds die maximale oder applizierte Gebühr.

² Käufe umfassen unter anderem die Transaktionen: Gratistitel / Käufe / Konversionen / Namensänderungen / Splits / Stock- und Wahldividenden / Titelaufteilungen / Überträge / Umtausch zwischen Gesellschaften / Zuteilungen aus Bezugs- und Optionsrechten / Zuteilung von Bezugsrechten aus Basistiteln / Sacheinlagen.

³ Verkäufe umfassen unter anderem die Transaktionen: Auslosungen / Ausbuchungen infolge Verfall / Ausübungen von Bezugs- und Optionsrechten / Konversionen / Reverse Splits / Rückzahlungen / Überträge / Umtausch zwischen Gesellschaften / Sachauslagen.

⁴ Allfällige Abweichungen der Prozentzahlen des Gesamtfondsvermögens sind auf Rundungsdifferenzen zurückzuführen.

⁵ Private Equity eingegangene Verpflichtung in Millionen.

In Pools gehaltene Wertschriften SYZ ARI CHF Principal Pool

5.1.2 Bewertungskategorien KKV-FINMA Art. 84 Absatz 2

Titel	Art. 84 951.312	Marktwert CHF	% des Gesamtpool- vermögens
a) Anlagen, die an einer Börse kotiert oder an einem anderen geregelten, dem Publikum offen stehenden Markt gehandelt werden	L1	11'622'097.91	84.35%
b) Anlagen, für die keine Kurse gemäss Buchstabe a verfügbar sind: bewertet aufgrund von am Markt beobachtbaren Parametern	L2	-8'355.15	-0.06%
c) Anlagen, die aufgrund von am Markt nicht beobachtbaren Parametern mit geeigneten Bewertungsmodellen unter Berücksichtigung der aktuellen Marktgegebenheiten bewertet werden.	L3	-	-

5.1.3 Während der Berichtsperiode getätigte Devisentermingeschäfte

Verkauf Währung	Verkauf Betrag	Kauf Währung	Kauf Betrag	Fälligkeit	Verkauf Währung	Verkauf Betrag	Kauf Währung	Kauf Betrag	Fälligkeit
JPY	24'000'000.00	CHF	143'311.51	11.12.2023	USD	300'000.00	CHF	253'741.08	21.03.2024
CHF	189'699.10	EUR	200'000.00	11.12.2023	USD	200'000.00	CHF	170'941.58	21.03.2024
EUR	250'000.00	CHF	235'442.98	11.01.2024	USD	284'475.76	CHF	250'000.00	21.03.2024
USD	250'000.00	CHF	217'800.18	11.01.2024	EUR	250'000.00	CHF	240'358.75	05.04.2024
EUR	250'000.00	CHF	232'153.85	21.03.2024	USD	800'000.00	CHF	708'613.68	05.04.2024

In Pools gehaltene Wertschriften SYZ ARI CHF Equity Pool

5.2 SYZ ARI CHF Equity Pool

5.2.1 Inventar und Bestandesveränderungen

Titel	Art. 84 951.312	Währung	% ¹	Maturität Commitment ⁵	Nominal per 30.09.2023	Käufe ²	Verkäufe ³	Nominal per 31.03.2024	Marktwert CHF	% des Gesamtpool- vermögens ⁴
Total Effekten									-	-
Sichtguthaben									32'681.30	99.91%
Sonstige Vermögenswerte									28.55	0.09%
Gesamtpoolvermögen									32'709.85	100.00%
./. Andere Verbindlichkeiten									-0.54	
Total Nettopoolvermögen									32'709.31	

¹ Bei Investmentfonds die maximale oder applizierte Gebühr.

² Käufe umfassen unter anderem die Transaktionen: Gratistitel / Käufe / Konversionen / Namensänderungen / Splits / Stock- und Wahldividenden / Titelaufteilungen / Überträge / Umtausch zwischen Gesellschaften / Zuteilungen aus Bezugs- und Optionsrechten / Zuteilung von Bezugsrechten aus Basistiteln / Sacheinlagen.

³ Verkäufe umfassen unter anderem die Transaktionen: Auslosungen / Ausbuchungen infolge Verfall / Ausübungen von Bezugs- und Optionsrechten / Konversionen / Reverse Splits / Rückzahlungen / Überträge / Umtausch zwischen Gesellschaften / Sachauslagen.

⁴ Allfällige Abweichungen der Prozentzahlen des Gesamtfondsvermögens sind auf Rundungsdifferenzen zurückzuführen.

⁵ Private Equity eingegangene Verpflichtung in Millionen.

5.2.2 Bewertungskategorien KKV-FINMA Art. 84 Absatz 2

Titel	Art. 84 951.312	Marktwert CHF	% des Gesamtpool- vermögens
a) Anlagen, die an einer Börse kotiert oder an einem anderen geregelten, dem Publikum offen stehenden Markt gehandelt werden	L1	-	-
b) Anlagen, für die keine Kurse gemäss Buchstabe a verfügbar sind: bewertet aufgrund von am Markt beobachtbaren Parametern	L2	-	-
c) Anlagen, die aufgrund von am Markt nicht beobachtbaren Parametern mit geeigneten Bewertungsmodellen unter Berücksichtigung der aktuellen Marktgegebenheiten bewertet werden.	L3	-	-

In Pools gehaltene Wertschriften

SIP Liquidity Mgmt CHF Syz AM Pool

5.3 SIP Liquidity Mgmt CHF Syz AM Pool

5.3.1 Inventar und Bestandesveränderungen

Titel	Art. 84 951.312	Währung	% ¹	Maturität Commitment ⁵	Nominal per 30.09.2023	Käufe ²	Verkäufe ³	Nominal per 31.03.2024	Marktwert CHF	% des Gesamtpool- vermögens ⁴
Total Effekten									1'796'764'840.80	94.04%
An einer Börse gehandelte Effekten									1'071'273'264.00	56.06%
Obligationen (CHF)									1'071'273'264.00	56.06%
Aargauische Kantonalbank	L1	CHF	0.110%	21.02.24	450'000.000	-	450'000.000	-	-	-
Aargauische Kantonalbank	L1	CHF	0.150%	15.11.24	-	1'500'000.000	-	1'500'000.000	1'487'700.00	0.08%
Achmea Bank NV	L1	CHF	0.500%	27.10.23	4'630'000.000	-	4'630'000.000	-	-	-
ADCB Finance Cayman Ltd	L1	CHF	0.500%	29.11.24	-	1'945'000.000	-	1'945'000.000	1'928'662.00	0.10%
ADCB Finance Cayman Ltd	L1	CHF	0.725%	15.02.24	4'110'000.000	600'000.000	4'710'000.000	-	-	-
Africa Finance Corp	L1	CHF	0.523%	20.12.23	7'410'000.000	270'000.000	7'680'000.000	-	-	-
Allreal Holding AG	L1	CHF	0.625%	10.05.24	7'130'000.000	5'110'000.000	-	12'240'000.000	12'224'088.00	0.64%
Amag Leasing AG	L1	CHF	0.000%	18.02.25	-	300'000.000	-	300'000.000	295'590.00	0.02%
Amag Leasing AG	L1	CHF	0.125%	12.02.24	28'960'000.000	200'000.000	29'160'000.000	-	-	-
Amag Leasing AG	L1	CHF	0.210%	27.06.24	7'850'000.000	1'500'000.000	-	9'350'000.000	9'309'795.00	0.49%
Amag Leasing AG	L1	CHF	0.250%	27.10.23	36'370'000.000	400'000.000	36'770'000.000	-	-	-
Amag Leasing AG	L1	CHF	0.875%	25.10.24	-	8'910'000.000	-	8'910'000.000	8'853'867.00	0.46%
Apple Inc	L1	CHF	0.375%	25.11.24	-	20'000'000.000	11'000'000.000	9'000'000.000	8'940'600.00	0.47%
ASB Bank Ltd	L1	CHF	0.200%	02.08.24	7'570'000.000	2'520'000.000	-	10'090'000.000	10'044'595.00	0.53%
AT&T Inc	L1	CHF	1.375%	04.12.24	-	42'855'000.000	-	42'855'000.000	42'829'287.00	2.24%
Axpo Holding AG	L1	CHF	0.250%	04.02.25	-	2'500'000.000	-	2'500'000.000	2'471'500.00	0.13%
Axpo Holding AG	L1	CHF	1.750%	29.05.24	23'360'000.000	2'100'000.000	-	25'460'000.000	25'462'546.00	1.33%
Axpo Holding AG	L1	CHF	3.125%	26.02.25	-	7'040'000.000	-	7'040'000.000	7'135'040.00	0.37%
Baloise Holding AG	L1	CHF	1.125%	19.12.24	-	1'805'000.000	-	1'805'000.000	1'799'765.50	0.09%
Banca Dello Stato del Cantone Ticino	L1	CHF	0.500%	24.06.24	2'475'000.000	635'000.000	-	3'110'000.000	3'102'225.00	0.16%
Banco de Chile	L1	CHF	0.250%	05.12.24	-	2'050'000.000	-	2'050'000.000	2'029'500.00	0.11%
Banco de Chile	L1	CHF	0.568%	21.11.23	10'035'000.000	-	10'035'000.000	-	-	-
Banco de Credito e Inversiones SA	L1	CHF	0.400%	22.11.24	-	14'440'000.000	-	14'440'000.000	14'318'704.00	0.75%
Banco del Estado de Chile	L1	CHF	0.693%	04.12.24	-	1'150'000.000	-	1'150'000.000	1'141'260.00	0.06%
Banco Santander Chile	L1	CHF	0.384%	27.09.24	2'500'000.000	100'000.000	-	2'600'000.000	2'581'800.00	0.14%
Banco Santander Chile	L1	CHF	0.441%	21.12.23	11'565'000.000	310'000.000	11'875'000.000	-	-	-
Banco Santander SA	L1	CHF	1.000%	10.12.24	-	15'295'000.000	-	15'295'000.000	15'229'231.50	0.80%
Banque Cantonale de Fribourg	L1	CHF	1.250%	03.06.24	3'000'000.000	550'000.000	-	3'550'000.000	3'547'870.00	0.19%
Banque Cantonale Vaudoise	L1	CHF	1.500%	28.03.24	5'300'000.000	100'000.000	5'400'000.000	-	-	-
Banque Federative du Credit Mutuel SA	L1	CHF	0.320%	10.02.25	-	485'000.000	-	485'000.000	480'538.00	0.03%
Banque Federative du Credit Mutuel SA	L1	CHF	0.550%	08.12.23	1'350'000.000	400'000.000	1'750'000.000	-	-	-
Banque Federative du Credit Mutuel SA	L1	CHF	2.000%	22.05.24	1'010'000.000	350'000.000	-	1'360'000.000	1'360'408.00	0.07%
BKW AG	L1	CHF	0.000%	18.10.24	7'515'000.000	850'000.000	-	8'365'000.000	8'293'061.00	0.43%
BMW International Investment BV	L1	CHF	0.300%	05.09.24	-	1'890'000.000	-	1'890'000.000	1'880'739.00	0.10%
BP Capital Markets PLC	L1	CHF	1.750%	28.02.24	1'220'000.000	1'050'000.000	2'270'000.000	-	-	-
BPCE SA	L1	CHF	0.500%	08.11.23	11'100'000.000	-	11'100'000.000	-	-	-
Bucher Industries AG	L1	CHF	1.375%	02.10.24	-	1'245'000.000	-	1'245'000.000	1'242'759.00	0.07%
CA Auto Finance Suisse SA	L1	CHF	0.052%	20.12.24	-	18'390'000.000	-	18'390'000.000	18'167'481.00	0.95%
CA Auto Finance Suisse SA	L1	CHF	0.100%	23.10.23	28'185'000.000	-	28'185'000.000	-	-	-
Caisse de Refinancement de l'Habitat SA	L1	CHF	2.375%	05.03.24	2'950'000.000	-	2'950'000.000	-	-	-
CBQ Finance Ltd	L1	CHF	0.195%	22.04.24	17'920'000.000	10'320'000.000	-	28'240'000.000	28'197'640.00	1.48%
CBQ Finance Ltd	L1	CHF	0.380%	19.10.23	7'055'000.000	-	7'055'000.000	-	-	-
CBQ Finance Ltd	L1	CHF	0.735%	27.11.24	-	19'180'000.000	-	19'180'000.000	19'026'560.00	1.00%
Cembra Money Bank AG	L1	CHF	0.180%	05.10.23	19'730'000.000	-	19'730'000.000	-	-	-
Cembra Money Bank AG	L1	CHF	0.250%	23.05.24	3'965'000.000	7'860'000.000	-	11'825'000.000	11'801'350.00	0.62%
Central American Bank for Economic Integration	L1	CHF	0.200%	25.03.24	6'860'000.000	-	6'860'000.000	-	-	-
Central American Bank for Economic Integration	L1	CHF	0.314%	05.09.24	-	1'490'000.000	-	1'490'000.000	1'481'507.00	0.08%
Chocoladefabriken Lindt & Sprüngli AG	L1	CHF	1.000%	08.10.24	-	2'775'000.000	-	2'775'000.000	2'768'062.50	0.14%
Citigroup Inc	L1	CHF	0.500%	22.11.24	-	5'690'000.000	-	5'690'000.000	5'652'446.00	0.30%
City of Geneva Switzerland	L1	CHF	1.625%	12.12.24	-	8'560'000.000	-	8'560'000.000	8'566'848.00	0.45%
City of Lausanne Switzerland	L1	CHF	1.375%	27.11.23	-	10'000'000.000	10'000'000.000	-	-	-
City of Zürich Switzerland	L1	CHF	2.375%	21.02.24	13'770'000.000	-	13'770'000.000	-	-	-
Corp Andina de Fomento	L1	CHF	2.000%	05.02.24	19'980'000.000	6'505'000.000	26'485'000.000	-	-	-
Credit Agricole Home Loan SFH SA	L1	CHF	1.125%	05.06.24	985'000.000	-	-	985'000.000	984'310.50	0.05%
Credit Agricole SA/London	L1	CHF	0.200%	30.10.23	3'650'000.000	-	3'650'000.000	-	-	-
Credit Agricole SA/London	L1	CHF	0.625%	12.07.24	3'175'000.000	900'000.000	-	4'075'000.000	4'063'997.50	0.21%
Credit Suisse AG/London	L1	CHF	0.550%	15.04.24	-	2'200'000.000	-	2'200'000.000	2'199'120.00	0.12%
Credit Suisse Schweiz AG	L1	CHF	0.000%	17.12.24	-	1'070'000.000	-	1'070'000.000	1'058'872.00	0.06%
Credit Suisse Schweiz AG	L1	CHF	2.459%	22.11.24	-	5'185'000.000	-	5'185'000.000	5'218'702.50	0.27%
Deutsche Bahn Finance GMBH	L1	CHF	1.500%	26.08.24	750'000.000	-	-	750'000.000	750'000.00	0.04%
Deutsche Bank AG	L1	CHF	0.800%	07.02.25	-	11'800'000.000	-	11'800'000.000	11'712'680.00	0.61%
DH Switzerland Finance Sarl	L1	CHF	0.500%	08.12.23	7'635'000.000	200'000.000	7'835'000.000	-	-	-
Digital Intrepid Holding BV	L1	CHF	0.600%	02.10.23	7'795'000.000	-	7'795'000.000	-	-	-
Doha Finance Ltd	L1	CHF	0.465%	24.01.24	38'310'000.000	3'725'000.000	42'035'000.000	-	-	-
EBN BV	L1	CHF	1.625%	03.10.23	1'600'000.000	-	1'600'000.000	-	-	-
Electricite de France SA	L1	CHF	0.300%	14.10.24	-	49'140'000.000	-	49'140'000.000	48'845'160.00	2.56%
Eli Lilly & Co	L1	CHF	0.150%	24.05.24	22'905'000.000	795'000.000	-	23'700'000.000	23'652'600.00	1.24%
Enel Finance International NV	L1	CHF	0.550%	03.09.24	4'310'000.000	3'185'000.000	-	7'495'000.000	7'462'771.50	0.39%
Engadiner Kraftwerke AG	L1	CHF	1.625%	25.04.24	1'795'000.000	3'585'000.000	-	5'380'000.000	5'379'462.00	0.28%
Engie SA	L1	CHF	1.625%	09.10.24	475'000.000	10'025'000.000	-	10'500'000.000	10'504'200.00	0.55%

In Pools gehaltene Wertschriften

SIP Liquidity Mgmt CHF Syz AM Pool

Titel	Art. 84 951.312	Wahrung	% ¹	Maturitat Commitment ⁵	Nominal per 30.09.2023	Kaufe ²	Verkaufe ³	Nominal per 31.03.2024	Marktwert CHF	% des Gesamtpool- vermogens ⁴
European Investment Bank	L1	CHF	1.500%	02.08.24	1'200'000.000	200'000.000	-	1'400'000.000	1'400'280.00	0.07%
European Investment Bank	L1	CHF	1.625%	23.11.23	3'385'000.000	-	3'385'000.000	-	-	-
Export-Import Bank of Korea	L1	CHF	0.383%	11.07.24	5'400'000.000	-	-	5'400'000.000	5'380'020.00	0.28%
Firnenich International SA	L1	CHF	1.000%	19.12.23	46'305'000.000	100'000.000	46'405'000.000	-	-	-
First Abu Dhabi Bank PJSC	L1	CHF	0.401%	02.10.24	2'090'000.000	4'290'000.000	-	6'380'000.000	6'333'426.00	0.33%
Flughafen Zurich AG	L1	CHF	0.700%	22.05.24	17'535'000.000	995'000.000	-	18'530'000.000	18'505'911.00	0.97%
Geberit AG	L1	CHF	0.100%	17.10.24	-	1'690'000.000	-	1'690'000.000	1'676'818.00	0.09%
Givaudan SA	L1	CHF	1.750%	19.03.24	3'380'000.000	555'000.000	3'935'000.000	-	-	-
Glencore Finance Europe Ltd	L1	CHF	1.250%	09.10.24	-	12'655'000.000	-	12'655'000.000	12'624'628.00	0.66%
Goldman Sachs Group Inc/The	L1	CHF	0.500%	04.12.24	-	26'255'000.000	-	26'255'000.000	26'076'466.00	1.36%
Grande Dixence SA	L1	CHF	1.125%	04.07.24	-	1'825'000.000	-	1'825'000.000	1'821'897.50	0.10%
Graubundner Kantonalbank	L1	CHF	1.375%	11.03.25	-	3'240'000.000	-	3'240'000.000	3'239'028.00	0.17%
GS Caltex Corp	L1	CHF	0.633%	31.01.24	13'395'000.000	6'490'000.000	19'885'000.000	-	-	-
GZO AG	L1	CHF	1.875%	12.06.24	15'960'000.000	-	-	15'960'000.000	15'926'484.00	0.83%
Heathrow Funding Ltd	L1	CHF	0.500%	17.05.24	37'855'000.000	8'235'000.000	-	46'090'000.000	46'020'865.00	2.41%
Hilti AG	L1	CHF	0.200%	08.11.24	-	4'685'000.000	-	4'685'000.000	4'647'988.50	0.24%
Hilti AG	L1	CHF	1.875%	30.10.23	9'875'000.000	-	9'875'000.000	-	-	-
Holcim AG	L1	CHF	1.000%	11.12.24	-	36'665'000.000	-	36'665'000.000	36'536'672.50	1.91%
HYPO NOE Landesbank fuer Niederoesterreich und Wien AG	L1	CHF	0.100%	27.11.24	-	1'650'000.000	-	1'650'000.000	1'634'160.00	0.09%
Hyundai Capital Services Inc	L1	CHF	0.260%	11.02.25	-	8'960'000.000	-	8'960'000.000	8'859'648.00	0.46%
Hyundai Capital Services Inc	L1	CHF	0.733%	26.02.24	10'360'000.000	755'000.000	11'115'000.000	-	-	-
Hyundai Capital Services Inc	L1	CHF	1.158%	14.06.24	5'850'000.000	800'000.000	-	6'650'000.000	6'643'350.00	0.35%
Intesa Sanpaolo Bank Ireland PLC	L1	CHF	0.250%	30.09.24	-	1'800'000.000	-	1'800'000.000	1'786'680.00	0.09%
Jackson National Life Global Funding	L1	CHF	0.300%	18.12.23	16'560'000.000	-	16'560'000.000	-	-	-
JPMorgan Chase & Co	L1	CHF	0.500%	04.12.23	8'560'000.000	420'000.000	8'980'000.000	-	-	-
Julius Baer Group Ltd	L1	CHF	0.375%	06.12.24	-	9'805'000.000	-	9'805'000.000	9'707'930.50	0.51%
Kanton Basel-Stadt	L1	CHF	0.000%	22.11.24	-	450'000.000	-	450'000.000	445'995.00	0.02%
Kernkraftwerk Leibstadt AG	L1	CHF	1.500%	07.08.24	1'100'000.000	16'895'000.000	-	17'995'000.000	17'978'804.50	0.94%
Kernkraftwerk Leibstadt AG	L1	CHF	2.000%	14.02.25	-	2'000'000.000	-	2'000'000.000	2'003'600.00	0.10%
Kiwibank Ltd	L1	CHF	0.250%	18.10.23	3'300'000.000	-	3'300'000.000	-	-	-
Korea Expressway Corp	L1	CHF	0.250%	07.06.24	19'960'000.000	525'000.000	-	20'485'000.000	20'431'739.00	1.07%
Korea Gas Corp	L1	CHF	0.000%	28.11.23	26'370'000.000	-	26'370'000.000	-	-	-
Korea Hydro & Nuclear Power Co Ltd	L1	CHF	0.000%	19.07.24	-	35'150'000.000	-	35'150'000.000	34'970'735.00	1.83%
Korea National Oil Corp	L1	CHF	0.000%	04.10.24	-	11'295'000.000	-	11'295'000.000	11'221'582.50	0.59%
Korea Railroad Corp	L1	CHF	0.000%	19.11.24	-	960'000.000	-	960'000.000	950'784.00	0.05%
Korea Western Power Co Ltd	L1	CHF	0.125%	27.02.24	20'435'000.000	635'000.000	21'070'000.000	-	-	-
Kraftwerke Linth-Limmern AG	L1	CHF	1.250%	11.09.24	3'695'000.000	13'650'000.000	-	17'345'000.000	17'308'575.50	0.91%
Kraftwerke Linth-Limmern AG	L1	CHF	2.000%	11.12.23	21'490'000.000	10'765'000.000	32'255'000.000	-	-	-
Kraftwerke Oberhasli AG	L1	CHF	1.875%	21.02.25	-	1'455'000.000	-	1'455'000.000	1'459'510.50	0.08%
Kuntarahoitus Oyj	L1	CHF	0.750%	17.09.24	-	2'000'000.000	-	2'000'000.000	1'993'400.00	0.10%
Lloyds Banking Group PLC	L1	CHF	1.000%	04.03.25	-	10'000'000.000	-	10'000'000.000	9'954'000.00	0.52%
Lonza Swiss Finanz AG	L1	CHF	0.700%	12.07.24	15'610'000.000	690'000.000	-	16'300'000.000	16'264'140.00	0.85%
Macquarie Bank Ltd/London	L1	CHF	0.750%	05.02.24	5'905'000.000	2'110'000.000	8'015'000.000	-	-	-
McDonald's Corp	L1	CHF	0.170%	04.10.24	-	2'460'000.000	470'000.000	1'990'000.000	1'977'065.00	0.10%
Mondelez International Inc	L1	CHF	0.617%	30.09.24	-	1'740'000.000	-	1'740'000.000	1'731'126.00	0.09%
Mondelez International Inc	L1	CHF	1.125%	21.12.23	9'320'000.000	725'000.000	10'045'000.000	-	-	-
Muenchener Hypothekenbank eG	L1	CHF	0.300%	20.12.24	-	16'280'000.000	-	16'280'000.000	16'136'736.00	0.84%
Muenchener Hypothekenbank eG	L1	CHF	0.350%	12.12.23	9'305'000.000	400'000.000	9'705'000.000	-	-	-
Nant de Drance SA	L1	CHF	1.750%	18.07.24	1'570'000.000	9'265'000.000	-	10'835'000.000	10'836'083.50	0.57%
National Australia Bank Ltd	L1	CHF	1.500%	07.02.24	16'440'000.000	200'000.000	16'640'000.000	-	-	-
Nederlandse Waterschapsbank NV	L1	CHF	1.250%	09.08.24	-	500'000.000	-	500'000.000	499'450.00	0.03%
Nestle SA	L1	CHF	0.250%	28.06.24	1'300'000.000	455'000.000	-	1'755'000.000	1'749'735.00	0.09%
Nordea Bank Abp	L1	CHF	0.250%	27.11.23	875'000.000	-	875'000.000	-	-	-
Pargesa SA	L1	CHF	0.875%	24.04.24	5'500'000.000	910'000.000	-	6'410'000.000	6'404'872.00	0.34%
Partners Group Holding AG	L1	CHF	0.150%	07.06.24	7'345'000.000	4'490'000.000	300'000.000	11'535'000.000	11'503'855.50	0.60%
Pfandbriefbank schweizerischer Hypothekarinstitute AG	L1	CHF	0.000%	29.07.24	-	1'035'000.000	-	1'035'000.000	1'029'928.50	0.05%
Pfandbriefbank schweizerischer Hypothekarinstitute AG	L1	CHF	0.125%	25.03.24	10'300'000.000	1'070'000.000	11'370'000.000	-	-	-
Pfandbriefbank schweizerischer Hypothekarinstitute AG	L1	CHF	0.750%	23.08.24	4'000'000.000	945'000.000	-	4'945'000.000	4'930'165.00	0.26%
Pfandbriefbank schweizerischer Hypothekarinstitute AG	L1	CHF	1.000%	21.05.24	9'965'000.000	7'635'000.000	-	17'600'000.000	17'585'920.00	0.92%
Pfandbriefbank schweizerischer Hypothekarinstitute AG	L1	CHF	1.125%	16.11.23	1'000'000.000	-	1'000'000.000	-	-	-
Pfandbriefbank schweizerischer Hypothekarinstitute AG	L1	CHF	1.375%	14.02.24	5'000'000.000	-	5'000'000.000	-	-	-
Pfandbriefbank schweizerischer Hypothekarinstitute AG	L1	CHF	1.375%	14.11.24	-	14'170'000.000	-	14'170'000.000	14'160'081.00	0.74%
Pfandbriefbank schweizerischer Hypothekarinstitute AG	L1	CHF	2.375%	25.01.24	10'510'000.000	-	10'510'000.000	-	-	-
Pfandbriefzentrale der schweizerischen Kantonalbanken AG	L1	CHF	0.000%	14.06.24	1'000'000.000	4'010'000.000	-	5'010'000.000	4'994'970.00	0.26%
Pfandbriefzentrale der schweizerischen Kantonalbanken AG	L1	CHF	0.010%	05.02.24	10'350'000.000	-	10'350'000.000	-	-	-
Pfandbriefzentrale der schweizerischen Kantonalbanken AG	L1	CHF	0.125%	17.07.24	6'350'000.000	9'390'000.000	-	15'740'000.000	15'675'466.00	0.82%
Pfandbriefzentrale der schweizerischen Kantonalbanken AG	L1	CHF	0.125%	02.12.24	-	950'000.000	-	950'000.000	941'640.00	0.05%
Pfandbriefzentrale der schweizerischen Kantonalbanken AG	L1	CHF	0.750%	15.04.24	-	610'000.000	-	610'000.000	609'817.00	0.03%
Pfandbriefzentrale der schweizerischen Kantonalbanken AG	L1	CHF	0.750%	23.09.24	-	15'000'000.000	-	15'000'000.000	14'946'000.00	0.78%
Pfandbriefzentrale der schweizerischen Kantonalbanken AG	L1	CHF	1.250%	17.07.24	-	2'680'000.000	-	2'680'000.000	2'677'320.00	0.14%
Pfandbriefzentrale der schweizerischen Kantonalbanken AG	L1	CHF	1.375%	16.04.25	-	1'000'000.000	-	1'000'000.000	1'000'200.00	0.05%
Pfandbriefzentrale der schweizerischen Kantonalbanken AG	L1	CHF	1.625%	31.10.24	-	6'045'000.000	-	6'045'000.000	6'049'231.50	0.32%
Province of Quebec Canada	L1	CHF	1.500%	05.02.24	-	5'205'000.000	5'205'000.000	-	-	-
PSP Swiss Property AG	L1	CHF	0.500%	16.02.24	33'290'000.000	-	33'290'000.000	-	-	-
Raiffeisen Schweiz Genossenschaft	L1	CHF	0.300%	22.04.25	-	250'000.000	-	250'000.000	246'950.00	0.01%
Raiffeisen Schweiz Genossenschaft	L1	CHF	0.350%	16.02.24	10'860'000.000	2'645'000.000	13'505'000.000	-	-	-
Repower AG	L1	CHF	2.550%	09.12.24	-	2'750'000.000	-	2'750'000.000	2'767'875.00	0.14%
Roche Kapitalmarkt AG	L1	CHF	0.100%	23.09.24	-	3'000'000.000	-	3'000'000.000	2'980'500.00	0.16%
Santander Consumer Finance SA	L1	CHF	0.150%	10.12.24	-	9'005'000.000	-	9'005'000.000	8'917'651.50	0.47%
SGS SA	L1	CHF	0.450%	06.11.23	1'755'000.000	320'000.000	2'075'000.000	-	-	-
SGS SA	L1	CHF	1.750%	27.02.24	11'425'000.000	5'200'000.000	16'625'000.000	-	-	-

In Pools gehaltene Wertschriften

SIP Liquidity Mgmt CHF Syz AM Pool

Titel	Art. 84 951.312	Wahrung	% ¹	Maturitat Commitment ⁵	Nominal per 30.09.2023	Kaufe ²	Verkaufe ³	Nominal per 31.03.2024	Marktwert CHF	% des Gesamtpool- vermogens ⁴
Sika AG	L1	CHF	0.625%	12.07.24	9'970'000.000	13'085'000.000	-	23'055'000.000	22'985'835.00	1.20%
Sika AG	L1	CHF	1.875%	14.11.23	7'100'000.000	-	7'100'000.000	-	-	-
Slovakia Government International Bond	L1	CHF	2.125%	16.10.23	585'000.000	-	585'000.000	-	-	-
Societe Generale SA	L1	CHF	0.700%	26.02.25	-	19'600'000.000	-	19'600'000.000	19'437'320.00	1.02%
Societe Generale SA	L1	CHF	0.875%	28.02.24	23'400'000.000	4'400'000.000	27'800'000.000	-	-	-
Spital Limmattal	L1	CHF	1.875%	29.11.23	7'240'000.000	-	7'240'000.000	-	-	-
Straumann Holding AG	L1	CHF	1.000%	03.10.23	16'055'000.000	-	16'055'000.000	-	-	-
Sulzer AG	L1	CHF	1.600%	22.10.24	-	10'440'000.000	-	10'440'000.000	10'411'812.00	0.54%
Swiss Life Holding AG	L1	CHF	0.250%	11.10.23	20'190'000.000	-	20'190'000.000	-	-	-
Swiss Prime Site Finance AG	L1	CHF	1.000%	16.07.24	13'150'000.000	4'615'000.000	-	17'765'000.000	17'738'352.50	0.93%
Swiss Prime Site Finance AG	L1	CHF	2.000%	10.12.24	-	5'815'000.000	-	5'815'000.000	5'833'608.00	0.31%
Swisscom AG	L1	CHF	1.750%	10.07.24	8'280'000.000	4'965'000.000	-	13'245'000.000	13'248'973.50	0.69%
Swissgrid AG	L1	CHF	1.625%	30.01.25	-	3'050'000.000	-	3'050'000.000	3'054'880.00	0.16%
Thurgauer Kantonalbank	L1	CHF	1.750%	30.09.24	-	2'670'000.000	-	2'670'000.000	2'673'471.00	0.14%
TotalEnergies Capital International SA	L1	CHF	1.000%	29.08.24	-	1'410'000.000	-	1'410'000.000	1'407'039.00	0.07%
Valiant Bank AG	L1	CHF	0.125%	23.04.24	21'970'000.000	5'180'000.000	11'500'000.000	15'650'000.000	15'635'915.00	0.82%
Vodafone Group PLC	L1	CHF	0.375%	03.12.24	-	23'185'000.000	-	23'185'000.000	22'999'520.00	1.20%
VP Bank AG	L1	CHF	0.875%	07.10.24	-	4'845'000.000	-	4'845'000.000	4'824'166.50	0.25%
Walliser Kantonalbank	L1	CHF	0.200%	19.08.24	-	2'955'000.000	-	2'955'000.000	2'939'634.00	0.15%
Wells Fargo & Co	L1	CHF	0.500%	02.11.23	48'520'000.000	-	48'520'000.000	-	-	-
Wells Fargo & Co	L1	CHF	1.250%	03.09.24	1'700'000.000	15'215'000.000	-	16'915'000.000	16'889'627.50	0.88%
Westpac Banking Corp	L1	CHF	0.400%	06.06.24	6'800'000.000	2'815'000.000	-	9'615'000.000	9'593'847.00	0.50%
Westpac Securities NZ Ltd/London	L1	CHF	0.375%	05.02.24	-	7'700'000.000	7'700'000.000	-	-	-
Woodside Finance Ltd	L1	CHF	1.000%	11.12.23	7'820'000.000	415'000.000	8'235'000.000	-	-	-
Zuercher Kantonalbank	L1	CHF	1.125%	29.01.24	2'770'000.000	150'000.000	2'920'000.000	-	-	-
Zurich Insurance Co Ltd	L1	CHF	0.500%	18.12.24	-	1'970'000.000	-	1'970'000.000	1'956'604.00	0.10%
Nicht Notierte Wertpapiere									186'638'145.00	9.77%
Obligationen (CHF)									186'638'145.00	9.77%
Credit Agricole next bank Suisse SA	L2	CHF	2.006%	17.01.25	-	18'000'000.000	-	18'000'000.000	18'033'840.00	0.94%
Credit Agricole next bank Suisse SA	L2	CHF	2.030%	20.12.24	-	40'000'000.000	-	40'000'000.000	40'071'200.00	2.10%
Kernkraftwerk Leibstadt AG	L2	CHF	0.250%	30.04.24	15'000'000.000	-	-	15'000'000.000	14'979'450.00	0.78%
Limeco	L2	CHF	1.800%	05.12.24	-	11'500'000.000	-	11'500'000.000	11'510'235.00	0.60%
Schaffhauser Kantonalbank	L2	CHF	1.591%	21.03.25	-	25'000'000.000	-	25'000'000.000	24'980'750.00	1.31%
UBS AG/London	L2	CHF	0.440%	29.04.24	15'000'000.000	-	-	15'000'000.000	14'985'450.00	0.79%
Valiant Bank AG	L2	CHF	2.000%	26.08.24	42'000'000.000	-	-	42'000'000.000	42'050'820.00	2.20%
Valiant Bank AG	L2	CHF	2.200%	08.07.24	20'000'000.000	-	-	20'000'000.000	20'026'400.00	1.05%
Geldmarktinstrumente									538'853'431.80	28.21%
Certificate of Deposit (CHF)									70'987'370.00	3.71%
Axpo Holding AG	L2	CHF	2.450%	17.01.24	50'000'000.000	-	50'000'000.000	-	-	-
Azienda Elettrica Ticinese	L2	CHF	2.530%	19.06.24	25'000'000.000	-	-	25'000'000.000	25'043'250.00	1.31%
Bank Cler AG	L2	CHF	2.045%	26.06.24	25'000'000.000	-	-	25'000'000.000	25'010'750.00	1.31%
City of Lausanne Switzerland	L2	CHF	1.765%	17.11.23	30'000'000.000	-	30'000'000.000	-	-	-
Controle Financier de la Ville de La Chaux-de-Fonds	L2	CHF	1.999%	18.10.23	10'000'000.000	-	10'000'000.000	-	-	-
Cooperative Rabobank UA	L2	CHF	0.000%	03.06.24	16'500'000.000	-	-	16'500'000.000	-	-
Cooperative Rabobank UA	L2	CHF	0.000%	25.07.24	15'000'000.000	-	-	15'000'000.000	14'933'550.00	0.78%
Gemeinde Schiers	L2	CHF	1.750%	27.10.23	4'000'000.000	-	4'000'000.000	-	-	-
IWB Industrielle Werke Basel	L2	CHF	2.000%	02.02.24	50'000'000.000	-	50'000'000.000	-	-	-
Morges City of	L2	CHF	1.990%	24.04.24	6'000'000.000	-	-	6'000'000.000	5'999'820.00	0.31%
Swiss Prime Site Finance AG	L2	CHF	2.090%	08.12.23	25'000'000.000	-	25'000'000.000	-	-	-
Commercial Paper (CHF)									109'607'251.40	5.74%
Bayerische Landesbank	L2	CHF	0.000%	13.05.24	-	30'000'000.000	-	30'000'000.000	29'945'830.80	1.57%
DNB Bank ASA	L2	CHF	0.000%	31.07.24	15'000'000.000	-	-	15'000'000.000	14'932'028.10	0.78%
Jyske Bank A/S	L2	CHF	0.000%	31.05.24	25'000'000.000	-	-	25'000'000.000	24'937'239.50	1.31%
Landesbank Baden-Wuerttemberg	L2	CHF	0.000%	23.09.24	40'000'000.000	-	30'000'000.000	10'000'000.000	9'929'884.60	0.52%
Landesbank Baden-Wuerttemberg	L2	CHF	0.000%	06.12.24	-	10'000'000.000	-	10'000'000.000	9'902'868.40	0.52%
Swiss National Bank Bill	L2	CHF	0.000%	13.11.23	7'000'000.000	-	7'000'000.000	-	-	-
Swiss National Bank Bill	L2	CHF	0.000%	21.05.24	-	20'000'000.000	-	20'000'000.000	19'959'400.00	1.04%
Obligationen (CHF)									358'258'810.40	18.76%
Banca Dello Stato del Cantone Ticino	L2	CHF	1.710%	19.04.24	-	50'000'000.000	-	50'000'000.000	50'000'000.00	2.62%
Bank Cler AG	L2	CHF	1.768%	15.11.24	-	25'000'000.000	-	25'000'000.000	24'998'000.00	1.31%
Banque SYZ SA	L2	CHF	2.260%	22.04.24	-	2'000'000.000	-	2'000'000.000	2'000'500.00	0.10%
BPCE SA	L1	CHF	1.808%	01.03.25	-	40'000'000.000	-	40'000'000.000	39'986'060.40	2.09%
Galenica AG	L2	CHF	2.050%	06.11.23	25'000'000.000	-	25'000'000.000	-	-	-
Galenica AG	L2	CHF	2.080%	05.12.23	20'000'000.000	-	20'000'000.000	-	-	-
IWB Industrielle Werke Basel	L2	CHF	1.600%	15.07.24	-	40'000'000.000	-	40'000'000.000	40'000'400.00	2.09%
Kantonsspital Aarau AG	L2	CHF	1.880%	30.11.23	29'000'000.000	-	29'000'000.000	-	-	-
Limeco	L2	CHF	1.770%	05.12.23	11'500'000.000	-	11'500'000.000	-	-	-
Luzerner Kantonsspital	L2	CHF	1.820%	24.06.24	-	15'000'000.000	-	15'000'000.000	15'007'500.00	0.79%
Luzerner Kantonsspital	L2	CHF	1.880%	22.03.24	-	15'000'000.000	15'000'000.000	-	-	-
Reseau Hospitalier Neuchatelois	L2	CHF	1.640%	24.01.25	-	25'000'000.000	-	25'000'000.000	25'002'250.00	1.31%
Stiftung Kantonsspital Graubunden	L2	CHF	1.860%	17.05.24	5'000'000.000	15'000'000.000	15'000'000.000	5'000'000.000	5'000'400.00	0.26%
Swiss National Bank Bill	L2	CHF	0.000%	16.10.23	5'000'000.000	-	5'000'000.000	-	-	-
Swiss National Bank Bill	L2	CHF	0.000%	27.12.23	-	5'000'000.000	5'000'000.000	-	-	-
Swissgrid AG	L2	CHF	1.980%	30.04.24	50'000'000.000	-	-	50'000'000.000	50'009'500.00	2.62%
Switzerland Treasury Bill	L2	CHF	0.000%	15.02.24	-	2'300'000.000	2'300'000.000	-	-	-

In Pools gehaltene Wertschriften SIP Liquidity Mgmt CHF Syz AM Pool

Titel	Art. 84 951.312	Währung	% ¹	Maturität Commitment ⁵	Nominal per 30.09.2023	Käufe ²	Verkäufe ³	Nominal per 31.03.2024	Marktwert CHF	% des Gesamtpool- vermögens ⁴
Switzerland Treasury Bill	L2	CHF	0.000%	29.02.24	-	300'000.000	300'000.000	-	-	-
Switzerland Treasury Bill	L2	CHF	0.000%	14.03.24	-	2'200'000.000	2'200'000.000	-	-	-
Switzerland Treasury Bill	L2	CHF	0.000%	11.04.24	-	1'250'000.000	-	1'250'000.000	1'249'550.00	0.07%
Thurgauer Kantonalbank	L2	CHF	1.670%	12.04.24	-	50'000'000.000	-	50'000'000.000	50'000'000.00	2.62%
UBS AG/London	L2	CHF	2.050%	28.04.24	35'000'000.000	-	-	35'000'000.000	35'009'450.00	1.83%
Universitaetsspital Zuerich	L2	CHF	1.680%	29.05.24	-	20'000'000.000	-	20'000'000.000	19'995'200.00	1.05%
Sichtguthaben									90'837'522.15	4.75%
Sonstige Vermögenswerte									23'075'333.94	1.21%
Gesamtpoolvermögen									1'910'677'696.89	100.00%
./. Andere Verbindlichkeiten									-804'053.58	
Total Nettopoolvermögen									1'909'873'643.31	

¹ Bei Investmentfonds die maximale oder applizierte Gebühr.

² Käufe umfassen unter anderem die Transaktionen: Gratistitel / Käufe / Konversionen / Namensänderungen / Splits / Stock- und Wahldividenden / Titelaufteilungen / Überträge / Umtausch zwischen Gesellschaften / Zuteilungen aus Bezugs- und Optionsrechten / Zuteilung von Bezugsrechten aus Basistiteln / Sacheinlagen.

³ Verkäufe umfassen unter anderem die Transaktionen: Auslosungen / Ausbuchungen infolge Verfall / Ausübungen von Bezugs- und Optionsrechten / Konversionen / Reverse Splits / Rückzahlungen / Überträge / Umtausch zwischen Gesellschaften / Sachauslagen.

⁴ Allfällige Abweichungen der Prozentzahlen des Gesamtfondsvermögens sind auf Rundungsdifferenzen zurückzuführen.

⁵ Private Equity eingegangene Verpflichtung in Millionen.

5.3.2 Bewertungskategorien KKV-FINMA Art. 84 Absatz 2

Titel	Art. 84 951.312	Marktwert CHF	% des Gesamtpool- vermögens
a) Anlagen, die an einer Börse kotiert oder an einem anderen geregelten, dem Publikum offen stehenden Markt gehandelt werden	L1	1'111'259'324.40	58.15%
b) Anlagen, für die keine Kurse gemäss Buchstabe a verfügbar sind: bewertet aufgrund von am Markt beobachtbaren Parametern	L2	685'505'516.40	35.89%
c) Anlagen, die aufgrund von am Markt nicht beobachtbaren Parametern mit geeigneten Bewertungsmodellen unter Berücksichtigung der aktuellen Marktgegebenheiten bewertet werden.	L3	-	-