

# SYZ

**Jahresbericht 2024**  
per 30. September 2024 (geprüft)

**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

<b>1</b>	<b>Organisation und Management</b>	<b>3</b>
1.1	Fondsleitung	3
1.2	Depotbank / Hauptzahlstelle	3
1.3	Prüfgesellschaft	3
1.4	Delegation der Anlageentscheide	3
1.5	Delegation weiterer Teilaufgaben	3
<b>2</b>	<b>Bericht der Prüfgesellschaft</b>	<b>4</b>
<b>3</b>	<b>Erläuterungen zum Jahresbericht</b>	<b>7</b>
3.1	Grundsätze für die Bewertung sowie für die Berechnung des Nettoinventarwertes	7
3.1.1	Berechnung der Nettoinventarwerte	7
3.1.2	Wechselkurse	7
3.2	Angelegenheiten von besonderer wirtschaftlicher oder rechtlicher Bedeutung	8
3.2.1	Änderungen des Fondsvertrages	8
3.2.2	Kündigung und Auflösung von Teilvermögen	8
3.2.3	Wesentliche Fragen der Auslegung von Gesetz und Fondsvertrag	8
3.2.4	Wechsel von Fondsleitung und Depotbank	8
3.2.5	Änderungen der geschäftsführenden Personen der Fondsleitung	8
3.2.6	Rechtsstreitigkeiten	8
3.3	Übrige Angaben	8
3.3.1	Sacheinlagen SE / Sachauslagen SA	8
3.3.2	Identität der Vertragspartner bei OTC – Geschäften	8
3.3.3	Pooling	8
3.3.3.1	Übersicht der Fonds inklusive Anteilsquote an jedem Pool per Ende der Berichtsperiode	9
<b>4</b>	<b>SYZ – Absolute Return CHF</b>	<b>10</b>
4.1	Vermögensrechnung	10
4.2	Erfolgsrechnung	10
4.3	Veränderung des Nettofondsvermögens	10
4.4	Anteilsscheinverkehr	11
4.5	Ausserbilanzgeschäfte	11
4.6	Kennzahlen und technische Daten	11
4.6.1	Informationen über Kosten	11
4.6.2	Performancezahlen	12
4.7	Verwendung des Erfolgs	12
4.7.1	Ausschüttungen aus Ertrag	12
4.7.2	Thesaurierungen aus Ertrag	12
4.8	Wertpapierbestand	12
4.8.1	Inventar und Bestandesveränderungen	12
4.8.2	Bewertungskategorien KKV-FINMA Art. 84 Absatz 2	18
<b>5</b>	<b>In Pools gehaltene Wertschriften</b>	<b>19</b>
5.1	SYZ ARI CHF Principal Pool	19
5.1.1	Inventar und Bestandesveränderungen	19
5.1.2	Bewertungskategorien KKV-FINMA Art. 84 Absatz 2	21
5.1.3	Während der Berichtsperiode getätigte Devisentermingeschäfte	21
5.2	SYZ ARI CHF Equity Pool	22
5.2.1	Inventar und Bestandesveränderungen	22
5.2.2	Bewertungskategorien KKV-FINMA Art. 84 Absatz 2	22
5.3	SIP Liquidity Mgmt CHF Syz AM Pool	23
5.3.1	Inventar und Bestandesveränderungen	23
5.3.2	Bewertungskategorien KKV-FINMA Art. 84 Absatz 2	27

# 1 Organisation und Management

## 1.1 Fondsleitung

Bis 31.12.2024:

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

Per 01.01.2025:

Came Global Fund Managers (Schweiz) AG  
Gartenstrasse 25  
8002 Zürich

## 1.2 Depotbank / Hauptzahlstelle

Bis 19.01.2025:

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

Per 20.01.2025

State Street Bank International GmbH, München, Zweigniederlassung Zürich  
Kalandplatz 5  
8045 Zürich

## 1.3 Prüfgesellschaft

Ernst & Young AG  
Maagplatz 1  
8005 Zürich

## 1.4 Delegation der Anlageentscheide

---

Teilvermögen	Delegation Anlageentscheide	Bemerkungen
SYZ – Absolute Return CHF	Banque SYZ SA, Quai des Bergues 1, 1201 Genf	

---

## 1.5 Delegation weiterer Teilaufgaben

Der State Street Bank International GmbH, München, Zweigniederlassung Zürich, wurden Teilaufgaben im Bereich der Fondsadministration delegiert.

## 2 Bericht der Prüfgesellschaft

SYZ

Basel, 28. Januar 2025

### Kurzbericht der kollektivanlagengesetzlichen Prüfgesellschaft

An den Verwaltungsrat der Fondsleitung zur Jahresrechnung des

SYZ, Zürich

### Bericht zur Prüfung der Jahresrechnung



#### Prüfungsurteil

Wir haben die Jahresrechnung des Anlagefonds

SYZ,

mit dem Teilvermögen

- ▶ SYZ – Absolute Return CHF

bestehend aus der Vermögensrechnung zum 30. September 2024, der Erfolgsrechnung für das dann endende Jahr, den Angaben über die Verwendung des Erfolges und die Offenlegung der Kosten sowie den weiteren Angaben gemäss Art. 89 Abs. 1 Bst. b-h des schweizerischen Kollektivanlagengesetzes (KAG), geprüft.

Nach unserer Beurteilung entspricht die (Seiten 3, 10 bis 27) Jahresrechnung dem schweizerischen Kollektivanlagengesetz, den dazugehörigen Verordnungen sowie dem Fondsvertrag und dem Prospekt.



#### Grundlage für das Prüfungsurteil

Wir haben unsere Abschlussprüfung in Übereinstimmung mit dem schweizerischen Gesetz und den Schweizer Standards zur Abschlussprüfung (SA-CH) durchgeführt. Unsere Verantwortlichkeiten nach diesen Vorschriften und Standards sind im Abschnitt „Verantwortlichkeiten der kollektivanlagengesetzlichen Prüfgesellschaft für die Prüfung der Jahresrechnung“ unseres Berichts weitergehend beschrieben. Wir sind vom Anlagefonds sowie der Fondsleitung unabhängig in Übereinstimmung mit den schweizerischen gesetzlichen Vorschriften und den Anforderungen des Berufsstands, und wir haben unsere sonstigen beruflichen Verhaltenspflichten in Übereinstimmung mit diesen Anforderungen erfüllt.

Wir sind der Auffassung, dass die von uns erlangten Prüfungsnachweise ausreichend und geeignet sind, um als eine Grundlage für unser Prüfungsurteil zu dienen.



## **Sonstiger Sachverhalt**

Die Jahresrechnung des SYZ – Absolute Return CHF für das am 30. September 2023 abgeschlossene Geschäftsjahr wurde von einer anderen Revisionsstelle geprüft, die am 18. Januar 2024 ein nicht modifiziertes Prüfungsurteil zu diesem Abschluss abgegeben hat.



## **Sonstige Informationen**

Der Verwaltungsrat der Fondsleitung ist für die sonstigen Informationen verantwortlich. Die sonstigen Informationen umfassen die in einem Jahresbericht enthaltenen Informationen, aber nicht die Jahresrechnung und unseren dazugehörigen Bericht.

Unser Prüfungsurteil zur Jahresrechnung erstreckt sich nicht auf die sonstigen Informationen, und wir bringen keinerlei Form von Prüfungsschlussfolgerung hierzu zum Ausdruck.

Im Zusammenhang mit unserer Abschlussprüfung haben wir die Verantwortlichkeit, die sonstigen Informationen zu lesen und dabei zu würdigen, ob die sonstigen Informationen wesentliche Unstimmigkeiten zur Jahresrechnung oder unseren bei der Abschlussprüfung erlangten Kenntnissen aufweisen oder anderweitig wesentlich falsch dargestellt erscheinen.

Falls wir auf Grundlage der von uns durchgeführten Arbeiten den Schluss ziehen, dass eine wesentliche falsche Darstellung dieser sonstigen Informationen vorliegt, sind wir verpflichtet, über diese Tatsache zu berichten. Wir haben in diesem Zusammenhang nichts zu berichten.



## **Verantwortlichkeiten des Verwaltungsrates der Fondsleitung für die Jahresrechnung**

Der Verwaltungsrat der Fondsleitung ist verantwortlich für die Aufstellung einer Jahresrechnung in Übereinstimmung mit dem schweizerischen Kollektivanlagengesetz, den dazugehörigen Verordnungen, dem Fondsvertrag sowie dem Prospekt und für die internen Kontrollen, die der Verwaltungsrat als notwendig feststellt, um die Aufstellung einer Jahresrechnung zu ermöglichen, die frei von wesentlichen falschen Darstellungen aufgrund von dolosen Handlungen oder Irrtümern sind.



## **Verantwortlichkeiten der kollektivanlagengesetzlichen Prüfgesellschaft für die Prüfung der Jahresrechnung**

Unsere Ziele sind, hinreichende Sicherheit darüber zu erlangen, ob die Jahresrechnung als Ganzes frei von wesentlichen falschen Darstellungen aufgrund von dolosen Handlungen oder Irrtümern sind, und einen Bericht abzugeben, der unser Prüfungsurteil beinhaltet. Hinreichende Sicherheit ist ein hohes Mass an Sicherheit, aber keine Garantie dafür, dass eine in Übereinstimmung mit dem schweizerischen Gesetz und den SA-CH durchgeführte Abschlussprüfung eine wesentliche falsche Darstellung, falls eine solche vorliegt, stets aufdeckt. Falsche Darstellungen können aus dolosen Handlungen oder Irrtümern resultieren und werden als wesentlich gewürdigt, wenn von ihnen einzeln oder insgesamt vernünftigerweise erwartet werden könnte, dass sie die auf der Grundlage dieser Jahresrechnung getroffenen wirtschaftlichen Entscheidungen von Nutzern beeinflussen.

# Bericht der Prüfungsgesellschaft

---

Als Teil einer Abschlussprüfung in Übereinstimmung mit dem schweizerischen Gesetz und den SA-CH üben wir während der gesamten Abschlussprüfung pflichtgemässes Ermessen aus und bewahren eine kritische Grundhaltung. Darüber hinaus:

- ▶ identifizieren und beurteilen wir die Risiken wesentlicher falscher Darstellungen in der Jahresrechnung aufgrund von dolosen Handlungen oder Irrtümern, planen und führen Prüfungshandlungen als Reaktion auf diese Risiken durch sowie erlangen Prüfungsnachweise, die ausreichend und geeignet sind, um als Grundlage für unser Prüfungsurteil zu dienen. Das Risiko, dass aus dolosen Handlungen resultierende wesentliche falsche Darstellungen nicht aufgedeckt werden, ist höher als ein aus Irrtümern resultierendes, da dolose Handlungen kollusives Zusammenwirken, Fälschungen, beabsichtigte Unvollständigkeiten, irreführende Darstellungen oder das Ausserkraftsetzen interner Kontrollen beinhalten können.
- ▶ gewinnen wir ein Verständnis von dem für die Abschlussprüfung relevanten Internen Kontrollsystem, um Prüfungshandlungen zu planen, die unter den gegebenen Umständen angemessen sind, jedoch nicht mit dem Ziel, ein Prüfungsurteil zur Wirksamkeit des Internen Kontrollsystems der Gesellschaft abzugeben.
- ▶ beurteilen wir die Angemessenheit der angewandten Rechnungslegungsmethoden sowie die Vertretbarkeit der dargestellten geschätzten Werte in der Rechnungslegung und damit zusammenhängenden Angaben.

Wir kommunizieren mit dem Verwaltungsrat der Fondsleitung unter anderem über den geplanten Umfang und die geplante zeitliche Einteilung der Abschlussprüfung sowie über bedeutsame Prüfungsfeststellungen, einschliesslich etwaiger bedeutsamer Mängel im Internen Kontrollsystem, die wir während unserer Abschlussprüfung identifizieren.

Ernst & Young AG

Zugelassener Revisionsexperte  
(Leitender Revisor)

Zugelassener Revisionsexperte

## 3 Erläuterungen zum Jahresbericht

### 3.1 Grundsätze für die Bewertung sowie für die Berechnung des Nettoinventarwertes

#### 3.1.1 Berechnung der Nettoinventarwerte

Auszug aus dem Fondsvertrag (§ 16):

1. Der Nettoinventarwert eines Teilvermögens und der Anteil der einzelnen Klassen (Quoten) wird zum Verkehrswert auf Ende des Rechnungsjahres und für jeden anderen im Prospekt angegebenen Zeitpunkt, sowie für jeden Tag, an dem Anteile ausgegeben oder zurückgenommen werden, in der Rechnungseinheit des jeweiligen Teilvermögens berechnet. Für Tage, an welchen die Börsen bzw. Märkte der Hauptanlageländer des jeweiligen Teilvermögens geschlossen sind (z.B. Banken- und Börsenfeiertage), findet keine Bewertung des Vermögens des entsprechenden Teilvermögens statt.
2. An einer Börse oder an einem anderen geregelten, dem Publikum offenstehenden Markt gehandelte Anlagen sind mit den am Hauptmarkt bezahlten aktuellen Kursen zu bewerten. Andere Anlagen, für die keine aktuellen Kurse verfügbar sind, sind mit dem Preis zu bewerten, der bei sorgfältigem Verkauf im Zeitpunkt der Schätzung wahrscheinlich erzielt würde. Die Fondsleitung wendet in diesem Fall zur Ermittlung des Verkehrswertes angemessene und in der Praxis anerkannte Bewertungsmodelle und -grundsätze an.
3. Der Wert von Geldmarktinstrumenten, welche nicht an einer Börse oder an einem anderen geregelten, dem Publikum offen stehenden Markt gehandelt werden, wird wie folgt bestimmt: Der Bewertungspreis solcher Anlagen wird, ausgehend vom Nettoerwerbspreis, unter Konstanthaltung der daraus berechneten Anlagerendite, sukzessiv dem Rückzahlungspreis angeglichen. Bei wesentlichen Änderungen der Marktbedingungen wird die Bewertungsgrundlage der einzelnen Anlagen der neuen Markttrendite angepasst. Dabei wird bei fehlendem aktuellem Marktpreis in der Regel auf die Bewertung von Geldmarktinstrumenten mit gleichen Merkmalen (Qualität und Sitz des Emittenten, Ausgabewährung, Laufzeit) abgestellt.
4. Bankguthaben werden mit ihrem Forderungsbetrag plus aufgelaufene Zinsen bewertet. Bei wesentlichen Änderungen der Marktbedingungen oder der Bonität wird die Bewertungsgrundlage für Bankguthaben auf Zeit den neuen Verhältnissen angepasst. Aufgelaufene Marchzinsen können auf jeden Bewertungstag hin abgegrenzt werden.
5. Offene kollektive Kapitalanlagen werden mit ihrem Rücknahmepreis bzw. Nettoinventarwert bewertet. Werden sie regelmässig an einer Börse oder an einem anderen geregelten, dem Publikum offen stehenden Markt gehandelt, so kann die Fondsleitung diese gemäss §16 Ziff. 2 bewerten.
6. Der Nettoinventarwert des Anteils einer Anteilsklasse ergibt sich aus der der betreffenden Anteilsklasse zukommenden Quote des Vermögens dieses Teilvermögens, vermindert um allfällige Schuldverpflichtungen desselben Teilvermögens, die der betroffenen Anteilsklasse zugeteilt sind, dividiert durch die Anzahl der im Umlauf befindlichen Anteile der entsprechenden Anteilsklasse. Er wird auf 2 Dezimalstellen gerundet.
7. Die Quoten am Verkehrswert des Nettovermögens eines Teilvermögens (Vermögen eines Teilvermögens abzüglich Verbindlichkeiten), welche den jeweiligen Anteilsklassen zuzurechnen sind, werden erstmals bei der Erstausgabe mehrerer Anteilsklassen (wenn diese gleichzeitig erfolgt) oder der Erstausgabe einer weiteren Anteilsklasse auf der Basis der dem Teilvermögen für jede Anteilsklasse zufließenden Beträge bestimmt. Die Quote wird bei folgenden Ereignissen jeweils neu berechnet:
  - a) bei der Ausgabe und Rücknahme von Anteilen;
  - b) auf den Stichtag von Ausschüttungen, sofern (i) solche Ausschüttungen nur auf einzelnen Anteilsklassen (Ausschüttungsklassen) anfallen oder sofern (ii) die Ausschüttungen der verschiedenen Anteilsklassen in Prozenten ihres jeweiligen Nettoinventarwertes unterschiedlich ausfallen oder sofern (iii) auf den Ausschüttungen der verschiedenen Anteilsklassen in Prozenten der Ausschüttung unterschiedliche Kommissions- oder Kostenbelastungen anfallen;
  - c) bei der Inventarwertberechnung, im Rahmen der Zuweisung von Verbindlichkeiten (einschliesslich der fälligen oder aufgelaufenen Kosten und Kommissionen) an die verschiedenen Anteilsklassen, sofern die Verbindlichkeiten der verschiedenen Anteilsklassen in Prozenten ihres jeweiligen Nettoinventarwertes unterschiedlich ausfallen, namentlich, wenn für die verschiedenen Anteilsklassen unterschiedliche Kommissionssätze zur Anwendung gelangen oder wenn klassenspezifische Kostenbelastungen erfolgen;
  - d) bei der Inventarwertberechnung, im Rahmen der Zuweisung von Erträgen oder Kapitalerträgen an die verschiedenen Anteilsklassen, sofern die Erträge oder Kapitalerträge aus Transaktionen (beispielsweise aus Währungsabsicherungsgeschäften) anfallen, die nur im Interesse einer Anteilsklasse oder im Interesse mehrerer Anteilsklassen, nicht jedoch proportional zu deren Quote am Nettovermögen des jeweiligen Teilvermögens, getätigt wurden

#### 3.1.2 Wechselkurse

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

Einheit	Lokalwährung	=	Rechnungswährung		Einheit	Lokalwährung	=	Rechnungswährung
1	AUD	=	0.585213		100	MXN	=	4.303387
1	CAD	=	0.624412		100	NOK	=	8.008906
1	CHF	=	1.000000		1	PLN	=	0.219886
1	CNY	=	0.120231		100	RUB	=	0.905826
100	DKK	=	12.628939		100	SEK	=	8.321824
1	EUR	=	0.941444		100	TRY	=	2.467440
1	GBP	=	1.131495		1	USD	=	0.843550
100	HKD	=	10.859994		100	ZAR	=	4.895111
100	JPY	=	0.589730					

## 3.2 Angelegenheiten von besonderer wirtschaftlicher oder rechtlicher Bedeutung

### 3.2.1 Änderungen des Fondsvertrages

Im Berichtszeitraum wurde die für den Wechsel der Fondsleitung erforderliche Neufassung des Fondsvertrages per 1. Februar 2024 genehmigt.

### 3.2.2 Kündigung und Auflösung von Teilvermögen

Im Berichtszeitraum gab es keine Kündigung oder Auflösung von Teilvermögen.

### 3.2.3 Wesentliche Fragen der Auslegung von Gesetz und Fondsvertrag

Im Berichtszeitraum waren keine wesentlichen Fragen der Auslegung von Gesetz und Fondsvertrag zu behandeln.

### 3.2.4 Wechsel von Fondsleitung und Depotbank

Zum 1 Februar 2024 wechselte die Fondsleitung von GAM Investment Management (Switzerland) AG, Zürich zu Carne Global Fund Managers (Switzerland) AG, Zürich .

### 3.2.5 Änderungen der geschäftsführenden Personen der Fondsleitung

Bei der Fondsleitung schied Michael Zaar am 19. August 2024 aus der Geschäftsleitung aus.

### 3.2.6 Rechtsstreitigkeiten

Im Berichtszeitraum waren bezüglich des SYZ – Absolute Return CHF keine Rechtsstreitigkeiten zu verzeichnen.

## 3.3 Übrige Angaben

### 3.3.1 Sacheinlagen SE / Sachauslagen SA

Im Berichtszeitraum waren keine Sacheinlagen beziehungsweise Sachauslagen zu verzeichnen.

### 3.3.2 Identität der Vertragspartner bei OTC – Geschäften

Während der Berichtsperiode wurden keine OTC Geschäfte vorgenommen.

### 3.3.3 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.



## 3.3.3.1 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%	0.15%
Weitere	-	-	99.85%
<b>Total Pool</b>	<b>100.00%</b>	<b>100.00%</b>	<b>100.00%</b>

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 CHF

### 4.1 Vermögensrechnung

	30.09.2024	30.09.2023
	CHF	CHF
<b>Vermögen</b>		
Bankguthaben, einschliesslich Treuhandanlagen bei Drittbanken, aufgeteilt in:		
- Sichtguthaben	2'312'657.32	2'546'613.93
Geldmarktinstrumente	521'134.99	1'118'930.41
Effekten, einschliesslich ausgeliehene Effekten, aufgeteilt in:		
- Obligationen, Wandelobligationen, Optionsanleihen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte	12'260'249.62	14'800'814.34
- Aktien und sonstige Beteiligungswertpapiere und -rechte	475'721.50	415'650.31
- Anteile anderer kollektiver Kapitalanlagen	262'838.37	84'833.52
Derivative Finanzinstrumente	60'426.26	-132'241.00
Sonstige Vermögenswerte	242'143.27	128'797.95
<b>Gesamtfondsvermögen</b>	<b>16'135'171.33</b>	<b>18'963'399.46</b>
Andere Verbindlichkeiten	64'084.72	229'586.16
<b>Nettofondsvermögen</b>	<b>16'071'086.61</b>	<b>18'733'813.30</b>

### 4.2 Erfolgsrechnung

	01.10.2023 - 30.09.2024	01.10.2022 - 30.09.2023
	CHF	CHF
<b>Ertrag</b>		
Erträge der Bankguthaben	77'362.35	63'032.52
Erträge der Geldmarktinstrumente	10'468.65	9'168.68
Erträge der Effekten, aufgeteilt in:		
- Obligationen, Wandelobligationen, Optionsanleihen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte	162'570.07	228'651.68
- Aktien und sonstige Beteiligungswertpapiere und -rechte, einschliesslich Erträge aus Gratisaktien	6'084.42	2'376.30
- Anteile anderer kollektiver Kapitalanlagen	2'292.82	1'964.59
Sonstige Erträge	389.98	849.35
Einkauf in laufende Nettoerträge bei der Ausgabe von Anteilen	252.21	-45.20
<b>Total Ertrag</b>	<b>259'420.50</b>	<b>305'997.92</b>
<b>Aufwand</b>		
Passivzinsen	2.60	3'438.40
Negativzinsen	3'227.30	10'926.01
Prüfaufwand	18'728.33	18'657.68
Reglementarische Vergütungen an:		
- die Fondsleitung	112'216.17	160'735.22
Sonstige Aufwendungen	5'298.38	19'166.96
Teilübertrag von Aufwendungen auf realisierte Kapitalgewinne und –verluste	-140.03	-28'498.98
Ausrichtung laufender Nettoerträge bei der Rücknahme von Anteilen	9'312.91	1'492.77
<b>Total Aufwand</b>	<b>148'645.66</b>	<b>185'918.06</b>
<b>Nettoertrag</b>	<b>110'774.84</b>	<b>120'079.86</b>
Realisierte Kapitalgewinne und -verluste	303'035.34	-1'696'069.35
Teilübertrag von Aufwendungen auf realisierte Kapitalgewinne und –verluste	-140.03	-28'498.98
<b>Realisierter Erfolg</b>	<b>413'670.15</b>	<b>-1'604'488.47</b>
Nicht realisierte Kapitalgewinne und -verluste	819'706.09	3'054'347.45
<b>Gesamterfolg</b>	<b>1'233'376.24</b>	<b>1'449'858.98</b>

### 4.3 Veränderung des Nettofondsvermögens

	01.10.2023 - 30.09.2024	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	-3'813'708.86	-29'413'835.61
Gesamterfolg	1'233'376.24	1'449'858.98
<b>Nettofondsvermögen am Ende der Berichtsperiode</b>	<b>16'071'086.61</b>	<b>18'733'813.30</b>

## 4.4 Anteilsscheinverkehr

	ISIN	01.10.2023 - 30.09.2024	01.10.2022 - 30.09.2023	01.10.2021 - 30.09.2022
<b>Anteile A</b>	<b>CH0226422373</b>			
Anteile zu Beginn der Berichtsperiode		3'627.200	4'247.200	5'669.200
Ausgegebene Anteile		816.000	-	225.000
Zurückgenommene Anteile		-2'128.000	-620.000	-1'647.000
Anteile am Ende der Berichtsperiode		2'315.200	3'627.200	4'247.200
Inventarwert pro Anteil		98.12	92.38	92.90
Nettofondsvermögen		227'156.61	335'064.62	394'570.03
<b>Anteile C2</b>	<b>CH0245146250</b>			
Anteile zu Beginn der Berichtsperiode		21'462.680	311'627.480	330'213.228
Ausgegebene Anteile		105.000	2'020.000	2'543.000
Zurückgenommene Anteile		-9'560.680	-292'184.800	-21'128.748
Anteile am Ende der Berichtsperiode		12'007.000	21'462.680	311'627.480
Inventarwert pro Anteil		98.07	92.80	93.05
Nettofondsvermögen		1'177'519.49	1'991'808.82	28'995'572.28
<b>Anteile I1</b>	<b>CH0182982550</b>			
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		103.42	97.33	97.87
Nettofondsvermögen		19'650.00	154'261.36	192'314.51
<b>Anteile I2</b>	<b>CH0182982568</b>			
Anteile zu Beginn der Berichtsperiode		166'025.000	174'770.000	194'816.695
Ausgegebene Anteile		30.000	-	1'395.000
Zurückgenommene Anteile		-25'195.000	-8'745.000	-21'441.695
Anteile am Ende der Berichtsperiode		140'860.000	166'025.000	174'770.000
Inventarwert pro Anteil		103.98	97.89	98.44
Nettofondsvermögen		14'646'760.51	16'252'678.50	17'204'356.86

## 4.5 Ausserbilanzgeschäfte

Commitment – Ansatz II	Basiswertäquivalent	% des	Basiswertäquivalent	% des
	30.09.2024	Nettofondsvermögens 30.09.2024	30.09.2023	Nettofondsvermögens 30.09.2023
	CHF		CHF	
Brutto-Gesamtengagement aus Derivaten	3'538'060.23	22.02%	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

	ISIN	30.09.2024	30.09.2023	30.09.2022
<b>Anteile A</b>	<b>CH0226422373</b>			
Effektive Vergütungssätze an die Fondsleitung <sup>1</sup>		0.99%	0.99%	0.99%
Total Expense Ratio (TER) <sup>2</sup>		1.13%	1.15%	1.06%
<b>Anteile C2</b>	<b>CH0245146250</b>			
Effektive Vergütungssätze an die Fondsleitung <sup>1</sup>		0.66%	0.66%	0.66%
Total Expense Ratio (TER) <sup>2</sup>		0.81%	0.81%	0.73%
<b>Anteile I1</b>	<b>CH0182982550</b>			
Effektive Vergütungssätze an die Fondsleitung <sup>1</sup>		0.89%	0.91%	0.91%
Total Expense Ratio (TER) <sup>2</sup>		1.04%	1.07%	0.98%
<b>Anteile I2</b>	<b>CH0182982568</b>			
Effektive Vergütungssätze an die Fondsleitung <sup>1</sup>		0.66%	0.66%	0.66%
Total Expense Ratio (TER) <sup>2</sup>		0.80%	0.82%	0.73%

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

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

# SYZ – Absolute Return CHF

## 4.6.2 Performancezahlen <sup>1</sup>

Klassen	Währung	YTD	1 Monat	1 Jahr	3 Jahre
Anteile A	CHF	3.74%	0.43%	6.31%	-6.84%
Anteile C2	CHF	3.99%	0.45%	6.64%	-5.93%
Anteile I1	CHF	3.86%	0.43%	6.45%	-6.57%
Anteile I2	CHF	3.99%	0.44%	6.65%	-5.93%

<sup>1</sup> 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

	30.09.2024 CHF	30.09.2023 CHF
Nettoertrag des Rechnungsjahres	110'774.84	120'079.86
Vortrag des Vorjahres	1'457.73	-
<b>Zur Verteilung verfügbarer Erfolg</b>	<b>112'232.57</b>	<b>120'079.86</b>
Ausschüttungen Anteile A	-878.82	-269.02
Wiederanlage Anteile C2	-8'160.51	-52'616.06
Ausschüttungen Anteile I1	-243.79	-271.25
Ausschüttungen Anteile I2	-102'949.45	-65'465.80
<b>Vortrag auf neue Rechnung</b>	<b>-</b>	<b>1'457.73</b>

### 4.7.1 Ausschüttungen aus Ertrag

<b>Anteile A</b>		<b>CH0226422373</b>	
Zahlbar am		19.12.2024	
Coupons Nr.		11	
<b>Bruttobetrag pro Anteil</b>	CHF	0.37958707	
Abzüglich 35% schweizerische Verrechnungssteuer <sup>1</sup>	CHF	0.13285547	
<b>Nettobetrag pro Anteil</b>	<b>CHF</b>	<b>0.24673160</b>	
<b>Anteile I1</b>		<b>CH0182982550</b>	
Zahlbar am		19.12.2024	
Coupons Nr.		13	
<b>Bruttobetrag pro Anteil</b>	CHF	1.28310526	
Abzüglich 35% schweizerische Verrechnungssteuer <sup>1</sup>	CHF	0.44908684	
<b>Nettobetrag pro Anteil</b>	<b>CHF</b>	<b>0.83401842</b>	
<b>Anteile I2</b>		<b>CH0182982568</b>	
Zahlbar am		19.12.2024	
Coupons Nr.		13	
<b>Bruttobetrag pro Anteil</b>	CHF	0.73086362	
Abzüglich 35% schweizerische Verrechnungssteuer <sup>1</sup>	CHF	0.25580227	
<b>Nettobetrag pro Anteil</b>	<b>CHF</b>	<b>0.47506135</b>	

<sup>1</sup> Findet das Meldeverfahren gemäss Kreisschreiben Nr. 24 Ziffer 2.1.6.1 ESTV in Verbindung mit Art. 38a VStV Anwendung, erfolgt die Ausschüttung brutto.

### 4.7.2 Thesaurierungen aus Ertrag

<b>Anteile C2</b>		<b>CH0245146250</b>	
Thesaurierung am		18.12.2024	
Coupons Nr.		-	
<b>Bruttobetrag pro Anteil</b>	CHF	0.67964603	
Abzüglich 35% schweizerische Verrechnungssteuer <sup>1</sup>	CHF	0.23787611	
<b>Nettobetrag pro Anteil</b>	<b>CHF</b>	<b>0.44176992</b>	

<sup>1</sup> Findet das Meldeverfahren gemäss Kreisschreiben Nr. 24 Ziffer 2.1.6.1 ESTV in Verbindung mit Art. 38a VStV Anwendung, erfolgt die Ausschüttung brutto.

## 4.8 Wertpapierbestand

### 4.8.1 Inventar und Bestandesveränderungen

Titel	Art. 84 951.312	Währung	% <sup>1</sup>	Maturität Commitment <sup>5</sup>	Nominal per 30.09.2023	Käufe <sup>2</sup>	Verkäufe <sup>3</sup>	Nominal per 30.09.2024	Marktwert CHF	% des Gesamtfonds- vermögens <sup>4</sup>
Total Effekten									13'519'946.61	83.80%

# SYZ – Absolute Return CHF

Titel	Art. 84 951.312	Währung	% <sup>1</sup>	Maturität Commitment <sup>5</sup>	Nominal per 30.09.2023	Käufe <sup>2</sup>	Verkäufe <sup>3</sup>	Nominal per 30.09.2024	Marktwert CHF	% des Gesamtfonds- vermögens <sup>4</sup>
<b>An einer Börse gehandelte Effekten</b>									<b>12'795'970.77</b>	<b>79.31%</b>
<b>Durch Pool gehaltene Aktien (Irland)</b>									<b>56'315.74</b>	<b>0.35%</b>
Linde PLC	L1	USD			140.000			140.000	56'315.74	0.35%
<b>Durch Pool gehaltene Aktien (Schweiz)</b>									<b>133'312.40</b>	<b>0.82%</b>
Nestle SA	L1	CHF			440.000			440.000	37'382.40	0.23%
Novartis AG	L1	CHF			500.000			500.000	48'575.00	0.30%
Roche Holding AG	L1	CHF			175.000			175.000	47'355.00	0.29%
<b>Durch Pool gehaltene Aktien (Vereinigte Staaten)</b>									<b>286'093.36</b>	<b>1.78%</b>
Alphabet Inc	L1	USD			400.000			400.000	55'961.11	0.35%
Amazon.com Inc	L1	USD			400.000			400.000	62'871.47	0.39%
Apple Inc	L1	USD			280.000			280.000	55'033.20	0.34%
Mastercard Inc	L1	USD			130.000			130.000	54'150.85	0.34%
Microsoft Corp	L1	USD			160.000			160.000	58'076.73	0.36%
<b>Durch Pool gehaltene Obligationen (CHF)</b>									<b>11'984'905.71</b>	<b>74.28%</b>
Aargauische Kantonalbank	L1	CHF	0.110%	21.02.24	965.000			-	-	-
Aargauische Kantonalbank	L1	CHF	0.150%	15.11.24	-			2'227.000	2'223.88	0.01%
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	149'088.00	0.92%
ADCB Finance Cayman Ltd	L1	CHF	0.500%	29.11.24	125'000.000			129'342.000	129'096.14	0.80%
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			-	-	-
Allreal Holding AG	L1	CHF	1.375%	31.03.25	-			10'488.000	10'488.00	0.07%
Amag Leasing AG	L1	CHF	0.000%	18.02.25	-			9'575.000	9'524.25	0.06%
Amag Leasing AG	L1	CHF	0.125%	12.02.24	62'110.000			-	-	-
Amag Leasing AG	L1	CHF	0.175%	16.06.25	-			18'207.000	18'030.39	0.11%
Amag Leasing AG	L1	CHF	0.210%	27.06.24	16'836.000			-	-	-
Amag Leasing AG	L1	CHF	0.250%	27.10.23	78'002.000			-	-	-
Amag Leasing AG	L1	CHF	0.875%	25.10.24	-			16'382.000	16'375.45	0.10%
Amag Leasing AG	L1	CHF	2.803%	10.09.25	-			5'790.000	5'862.38	0.04%
Apple Inc	L1	CHF	0.375%	25.11.24	200'000.000			213'657.000	213'432.61	1.32%
ASB Bank Ltd	L1	CHF	0.200%	02.08.24	16'235.000			-	-	-
AT&T Inc	L1	CHF	1.375%	04.12.24	-			66'291.000	66'304.26	0.41%
Axpo Holding AG	L1	CHF	0.250%	04.02.25	-			9'946.000	9'909.20	0.06%
Axpo Holding AG	L1	CHF	1.750%	29.05.24	50'100.000			-	-	-
Axpo Holding AG	L1	CHF	3.125%	26.02.25	-			46'643.000	46'969.50	0.29%
Baloise Holding AG	L1	CHF	1.125%	19.12.24	-			4'134.000	4'132.35	0.03%
Baloise Life Ltd	L1	CHF	2.200%	19.06.48	100'000.000			150'000.000	152'983.50	0.95%
Banca Dello Stato del Cantone Ticino	L1	CHF	0.500%	24.06.24	5'308.000			-	-	-
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA	L1	CHF	0.125%	27.08.26	200'000.000			200'000.000	196'326.00	1.22%
Banco de Chile	L1	CHF	0.250%	05.12.24	-			3'043.000	3'036.61	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	-			21'436.000	21'401.70	0.13%
Banco del Estado de Chile	L1	CHF	0.240%	06.06.25	-			3'934.000	3'908.43	0.02%
Banco del Estado de Chile	L1	CHF	0.693%	04.12.24	-			3'489.000	3'483.42	0.02%
Banco Santander Chile	L1	CHF	0.350%	30.05.25	-			1'789.000	1'777.91	0.01%
Banco Santander Chile	L1	CHF	0.384%	27.09.24	5'362.000			-	-	-
Banco Santander Chile	L1	CHF	0.441%	21.12.23	24'803.000			-	-	-
Banco Santander SA	L1	CHF	1.000%	10.12.24	-			25'734.000	25'708.27	0.16%
Banco Santander SA	L1	CHF	1.328%	10.06.25	-			1'930.000	1'934.44	0.01%
Banco Santander SA	L1	CHF	2.248%	30.01.26	200'000.000			200'000.000	203'346.00	1.26%
Bank Julius Baer & Co AG	L1	CHF	2.375%	06.09.27	150'000.000			150'000.000	155'608.50	0.96%
Bank of Montreal	L1	CHF	2.260%	01.02.29	200'000.000			200'000.000	210'216.00	1.30%
Banque Cantonale de Fribourg	L1	CHF	1.250%	03.06.24	6'434.000			-	-	-
Banque Cantonale de Geneve	L1	CHF	1.125%	28.06.27	100'000.000			200'000.000	200'348.00	1.24%
Banque Cantonale Vaudoise	L1	CHF	1.500%	28.03.24	11'367.000			-	-	-
Banque Federative du Credit Mutuel SA	L1	CHF	0.250%	10.07.25	-			1'945.000	1'935.08	0.01%
Banque Federative du Credit Mutuel SA	L1	CHF	0.320%	10.02.25	-			720.000	717.77	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			-	-	-
Banque Internationale a Luxembourg SA	L1	CHF	1.000%	10.07.25	-			1'893.000	1'882.78	0.01%
BKW AG	L1	CHF	0.000%	18.10.24	16'117.000			12'418.000	12'410.55	0.08%
BNP Paribas SA	L1	CHF	1.000%	06.06.25	-			10'392.000	10'373.29	0.06%
BNP Paribas SA	L1	CHF	1.750%	05.06.25	-			7'037.000	7'054.59	0.04%
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	-			2'368.000	2'368.00	0.01%
CA Auto Finance Suisse SA	L1	CHF	0.052%	20.12.24	-			36'697.000	36'557.55	0.23%
CA Auto Finance Suisse SA	L1	CHF	0.100%	23.10.23	180'448.000			-	-	-
Caisse de Refinancement de l'Habitat SA	L1	CHF	1.750%	26.06.25	-			1'870.000	1'879.54	0.01%
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	197'330.00	1.22%
Canadian Imperial Bank of Commerce	L1	CHF	0.100%	30.04.25	-			5'196.000	5'167.42	0.03%
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	249'735.00	1.55%
Canton of Zürich	L1	CHF	0.000%	27.06.25	250'000.000			250'000.000	248'687.50	1.54%

# SYZ – Absolute Return CHF

Titel	Art. 84 951.312	Wahrung	% <sup>1</sup>	Maturitat Commitment <sup>5</sup>	Nominal per 30.09.2023	Kaufe <sup>2</sup>	Verkaufe <sup>3</sup>	Nominal per 30.09.2024	Marktwert CHF	% des Gesamtfonds- vermogens <sup>4</sup>
CBQ Finance Ltd	L1	CHF	0.195%	22.04.24	38'433.000	-	-	-	-	-
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	-	-	184'656.000	184'454.28	1.14%
Cellnex Telecom SA	L1	CHF	0.775%	18.02.27	125'000.000	-	-	-	-	-
Cellnex Telecom SA	L1	CHF	1.118%	17.07.25	-	-	-	3'726.000	3'720.41	0.02%
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	-	-	-	-	-
Cembra Money Bank AG	L1	CHF	2.411%	08.08.29	200'000.000	-	-	200'000.000	209'516.00	1.30%
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	-	-	-	-	-
Central American Bank for Economic Integration	L1	CHF	0.405%	25.06.25	-	-	-	6'450.000	6'413.24	0.04%
Central American Bank for Economic Integration	L1	CHF	2.138%	13.12.27	200'000.000	-	-	200'000.000	207'044.00	1.28%
Chocoladefabriken Lindt & Spruengli AG	L1	CHF	1.000%	08.10.24	-	-	-	6'049.000	6'048.40	0.04%
Citigroup Inc	L1	CHF	0.500%	22.11.24	-	-	-	16'441.000	16'422.91	0.10%
City of Geneva Switzerland	L1	CHF	1.625%	12.12.24	-	-	-	12'707.000	12'717.17	0.08%
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	209'562.00	1.30%
Commerzbank AG	L1	CHF	1.100%	11.07.25	-	-	-	5'938.000	5'935.03	0.04%
Commerzbank AG	L1	CHF	3.125%	14.07.25	-	-	-	2'227.000	2'262.63	0.01%
Commerzbank AG	L1	CHF	3.263%	03.02.27	100'000.000	-	-	-	-	-
Cooperatieve Rabobank UA	L1	CHF	2.488%	25.01.29	200'000.000	-	-	200'000.000	207'554.00	1.29%
Coop-Gruppe Genossenschaft	L1	CHF	0.750%	06.06.25	-	-	-	2'212.000	2'205.59	0.01%
Corner Banca SA	L1	CHF	3.000%	14.07.25	-	-	-	4'491.000	4'547.14	0.03%
Corp Andina de Fomento	L1	CHF	0.300%	07.04.25	-	-	-	2'947.000	2'932.27	0.02%
Corp Andina de Fomento	L1	CHF	0.510%	16.09.26	300'000.000	-	-	300'000.000	296'841.00	1.84%
Corp Andina de Fomento	L1	CHF	0.700%	04.09.25	-	-	-	3'711.000	3'696.53	0.02%
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	-	-	-	-	-
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	-	-	-	-	-
Credit Agricole SA/London	L1	CHF	2.125%	29.09.25	-	-	-	4'454.000	4'489.63	0.03%
Deutsche Bahn Finance GMBH	L1	CHF	1.500%	26.08.24	1'609.000	-	-	-	-	-
Deutsche Bank AG	L1	CHF	0.800%	07.02.25	-	-	-	26'127.000	26'043.39	0.16%
Deutsche Bank AG	L1	CHF	3.645%	27.01.29	200'000.000	-	-	200'000.000	213'028.00	1.32%
Deutsche Telekom AG	L1	CHF	0.435%	06.02.32	-	-	-	150'000.000	144'265.50	0.89%
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	-	-	-	-	-
EBN BV	L1	CHF	1.625%	03.10.23	3'431.000	-	-	-	-	-
Electricite de France SA	L1	CHF	0.300%	14.10.24	-	-	-	55'053.000	55'030.98	0.34%
Electricite de France SA	L1	CHF	2.300%	14.09.27	200'000.000	-	-	-	-	-
Eli Lilly & Co	L1	CHF	0.150%	24.05.24	49'124.000	-	-	-	-	-
Enel Finance International NV	L1	CHF	0.550%	03.09.24	9'244.000	-	-	-	-	-
Energiefinanzierungs AG	L1	CHF	3.050%	04.07.25	-	-	-	19'581.000	19'833.59	0.12%
Engadiner Kraftwerke AG	L1	CHF	1.625%	25.04.24	3'850.000	-	-	-	-	-
Engie SA	L1	CHF	1.625%	09.10.24	1'019.000	-	-	15'587.000	15'587.00	0.10%
European Investment Bank	L1	CHF	1.500%	02.08.24	2'574.000	-	-	-	-	-
European Investment Bank	L1	CHF	1.625%	23.11.23	7'260.000	-	-	-	-	-
Export-Import Bank of Korea	L1	CHF	0.170%	18.07.25	-	-	-	1'485.000	1'476.09	0.01%
Export-Import Bank of Korea	L1	CHF	0.383%	11.07.24	11'581.000	-	-	-	-	-
Federation des Caisses Desjardins du Quebec	L1	CHF	1.488%	11.09.29	-	-	-	100'000.000	101'040.00	0.63%
Federation des Caisses Desjardins du Quebec	L1	CHF	1.735%	31.01.28	150'000.000	-	-	150'000.000	154'908.00	0.96%
Ferring Holding SA	L1	CHF	1.050%	09.07.25	-	-	-	46'829.000	46'697.88	0.29%
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	-	-	10'065.000	10'063.99	0.06%
Flughafen Zurich AG	L1	CHF	0.700%	22.05.24	37'607.000	-	-	-	-	-
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	212'688.00	1.32%
Geberit AG	L1	CHF	0.100%	17.10.24	-	-	-	2'509.000	2'507.75	0.02%
Geberit AG	L1	CHF	2.250%	26.09.25	-	-	-	868.000	877.03	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	-	-	-	20'523.000	20'520.95	0.13%
Goldman Sachs Group Inc/The	L1	CHF	0.500%	04.12.24	-	-	-	42'776.000	42'716.11	0.26%
Grand City Properties SA	L1	CHF	0.956%	01.09.26	125'000.000	-	-	-	-	-
Grande Dixence SA	L1	CHF	1.375%	18.02.25	-	-	-	5'441.000	5'441.54	0.03%
Graubundner Kantonalbank	L1	CHF	0.100%	07.05.31	100'000.000	-	-	-	-	-
Graubundner Kantonalbank	L1	CHF	1.375%	11.03.25	-	-	-	7'408.000	7'417.63	0.05%
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	-	-	23'990.000	9'715.95	0.06%
Heathrow Funding Ltd	L1	CHF	0.500%	17.05.24	81'187.000	-	-	-	-	-
Helvetia Schweizerische Versicherungsgesellschaft AG	L1	CHF	1.450%	25.06.26	200'000.000	-	-	200'000.000	201'828.00	1.25%
Helvetia Schweizerische Versicherungsgesellschaft AG	L1	CHF	1.500%	28.04.25	-	-	-	14'236.000	14'267.32	0.09%
Hilti AG	L1	CHF	0.050%	02.07.25	-	-	-	3'667.000	3'641.33	0.02%
Hilti AG	L1	CHF	0.200%	08.11.24	-	-	-	6'955.000	6'947.35	0.04%
Hilti AG	L1	CHF	1.875%	30.10.23	21'179.000	-	-	-	-	-
Holcim AG	L1	CHF	1.000%	11.12.24	-	-	-	56'968.000	56'933.82	0.35%
HSBC Holdings PLC	L1	CHF	1.805%	01.06.26	200'000.000	-	-	200'000.000	200'856.00	1.25%
HYPO NOE Landesbank fuer Niederosterreich und Wien AG	L1	CHF	0.100%	27.11.24	-	-	-	2'449.000	2'444.59	0.02%
Hyundai Capital Services Inc	L1	CHF	0.260%	11.02.25	-	-	-	20'226.000	20'147.12	0.13%
Hyundai Capital Services Inc	L1	CHF	0.733%	26.02.24	22'219.000	-	-	-	-	-

# SYZ – Absolute Return CHF

Titel	Art. 84 951.312	Wahrung	% <sup>1</sup>	Maturitat Commitment <sup>5</sup>	Nominal per 30.09.2023	Kaufe <sup>2</sup>	Verkaufe <sup>3</sup>	Nominal per 30.09.2024	Marktwert CHF	% des Gesamtfonds- vermogens <sup>4</sup>
Hyundai Capital Services Inc	L1	CHF	1.158%	14.06.24	12'546.000	-	-	-	-	-
Industrial Bank of Korea	L1	CHF	0.022%	16.07.25	-	-	-	32'681.000	32'399.94	0.20%
Jackson National Life Global Funding	L1	CHF	0.300%	18.12.23	35'516.000	-	-	-	-	-
Jackson National Life Global Funding	L1	CHF	0.375%	18.07.25	-	-	-	7'912.000	7'864.53	0.05%
JPMorgan Chase & Co	L1	CHF	0.500%	04.12.23	18'358.000	-	-	-	-	-
Julius Baer Group Ltd	L1	CHF	0.375%	06.12.24	-	-	-	15'075.000	15'046.36	0.09%
Kanton Basel-Stadt	L1	CHF	0.000%	22.11.24	-	-	-	668.000	667.00	0.00%
Kernkraftwerk Leibstadt AG	L1	CHF	1.500%	07.08.24	2'359.000	-	-	-	-	-
Kernkraftwerk Leibstadt AG	L1	CHF	2.000%	14.02.25	-	-	-	28'042.000	28'084.06	0.17%
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	-	-	-	-	-
Korea Gas Corp	L1	CHF	0.000%	28.11.23	56'555.000	-	-	-	-	-
Korea Land & Housing Corp	L1	CHF	0.193%	15.06.25	-	-	-	3'444.000	3'418.17	0.02%
Korea National Oil Corp	L1	CHF	0.000%	04.10.24	-	-	-	16'767.000	16'765.32	0.10%
Korea National Oil Corp	L1	CHF	0.263%	30.07.27	200'000.000	-	-	250'000.000	245'330.00	1.52%
Korea National Oil Corp	L1	CHF	0.875%	21.04.25	-	-	-	3'110.000	3'105.02	0.02%
Korea Railroad Corp	L1	CHF	0.000%	19.11.24	-	-	-	1'425.000	1'422.72	0.01%
Korea Water Resources Corp	L1	CHF	2.173%	18.09.25	-	-	-	10'392.000	10'496.96	0.07%
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	-	-	-	-	-
Kraftwerke Linth-Limmern AG	L1	CHF	2.000%	11.12.23	46'089.000	-	-	-	-	-
Kraftwerke Oberhasli AG	L1	CHF	1.875%	21.02.25	-	-	-	4'839.000	4'850.13	0.03%
Kuehne + Nagel International AG	L1	CHF	0.200%	18.06.25	-	-	-	13'049.000	12'955.05	0.08%
La Banque Postale SA	L1	CHF	2.773%	12.07.27	200'000.000	-	-	200'000.000	208'866.00	1.29%
Lloyds Banking Group PLC	L1	CHF	1.000%	04.03.25	150'000.000	-	-	220'492.000	220'260.86	1.37%
Lloyds Banking Group PLC	L1	CHF	2.745%	02.02.27	-	-	-	200'000.000	204'110.00	1.27%
Lonza Swiss Finanz AG	L1	CHF	0.700%	12.07.24	33'478.000	-	-	-	-	-
Lonza Swiss Finanz AG	L1	CHF	2.100%	12.09.29	150'000.000	-	-	130'000.000	135'274.10	0.84%
Luzerner Kantonalbank AG	L1	CHF	0.200%	11.04.25	-	-	-	4'454.000	4'433.96	0.03%
Luzerner Kantonalbank AG	L1	CHF	0.875%	14.05.31	100'000.000	-	-	-	-	-
Luzerner Kantonalbank AG	L1	CHF	3.000%	11.03.25	-	-	-	1'485.000	1'497.47	0.01%
Macquarie Bank Ltd/London	L1	CHF	0.750%	05.02.24	12'664.000	-	-	-	-	-
McDonald's Corp	L1	CHF	0.170%	04.10.24	-	-	-	24'049.000	24'046.60	0.15%
Mondelez International Inc	L1	CHF	1.125%	21.12.23	19'988.000	-	-	-	-	-
Muenchener Hypothekenbank eG	L1	CHF	0.100%	31.10.24	-	-	-	1'054.000	1'053.05	0.01%
Muenchener Hypothekenbank eG	L1	CHF	0.300%	20.12.24	-	-	-	24'969.000	24'919.06	0.15%
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	1.550%	19.08.25	-	-	-	12'915.000	12'958.91	0.08%
Nant de Drance SA	L1	CHF	1.750%	18.07.24	3'367.000	-	-	-	-	-
National Australia Bank Ltd	L1	CHF	1.500%	07.02.24	35'258.000	-	-	-	-	-
Nationwide Building Society	L1	CHF	0.000%	11.07.25	-	-	-	935.000	927.43	0.01%
Nederlandse Waterschapsbank NV	L1	CHF	1.250%	09.08.24	250'000.000	-	-	-	-	-
Nestle SA	L1	CHF	0.250%	28.06.24	2'788.000	-	-	-	-	-
Nestle SA	L1	CHF	1.875%	28.06.29	200'000.000	-	-	200'000.000	209'634.00	1.30%
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	149'610.00	0.93%
North American Development Bank	L1	CHF	0.200%	28.11.28	250'000.000	-	-	250'000.000	242'567.50	1.50%
Novartis AG	L1	CHF	0.250%	13.05.25	250'000.000	-	-	254'899.000	253'926.96	1.57%
Pargesa SA	L1	CHF	0.875%	24.04.24	11'796.000	-	-	-	-	-
Partners Group Holding AG	L1	CHF	0.150%	07.06.24	15'753.000	-	-	-	-	-
Pfandbriefbank schweizerischer Hypothekarinstitute AG	L1	CHF	0.125%	25.03.24	22'090.000	-	-	-	-	-
Pfandbriefbank schweizerischer Hypothekarinstitute AG	L1	CHF	0.500%	24.01.25	-	-	-	10'911.000	10'893.54	0.07%
Pfandbriefbank schweizerischer Hypothekarinstitute AG	L1	CHF	0.750%	23.08.24	8'579.000	-	-	-	-	-
Pfandbriefbank schweizerischer Hypothekarinstitute AG	L1	CHF	1.000%	21.05.24	21'372.000	-	-	-	-	-
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	-	-	-	26'157.000	26'164.85	0.16%
Pfandbriefbank schweizerischer Hypothekarinstitute AG	L1	CHF	1.750%	15.07.25	-	-	-	3'711.000	3'736.61	0.02%
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	-	-	-	-	-
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	-	-	-	-	-
Pfandbriefzentrale der schweizerischen Kantonalbanken AG	L1	CHF	0.125%	31.10.24	-	-	-	1'017.000	1'016.19	0.01%
Pfandbriefzentrale der schweizerischen Kantonalbanken AG	L1	CHF	0.125%	02.12.24	-	-	-	4'565.000	4'557.24	0.03%
Pfandbriefzentrale der schweizerischen Kantonalbanken AG	L1	CHF	0.125%	16.04.25	-	-	-	6'680.000	6'651.28	0.04%
Pfandbriefzentrale der schweizerischen Kantonalbanken AG	L1	CHF	1.000%	22.09.28	150'000.000	-	-	150'000.000	151'332.00	0.94%
Pfandbriefzentrale der schweizerischen Kantonalbanken AG	L1	CHF	1.375%	16.04.25	-	-	-	3'110.000	3'117.15	0.02%
Pfandbriefzentrale der schweizerischen Kantonalbanken AG	L1	CHF	1.625%	31.10.24	-	-	-	8'974.000	8'977.59	0.06%
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	152'374.50	0.94%
Raiffeisen Schweiz Genossenschaft	L1	CHF	0.300%	22.04.25	-	-	-	2'286.000	2'275.03	0.01%
Raiffeisen Schweiz Genossenschaft	L1	CHF	0.350%	16.02.24	23'291.000	-	-	-	-	-
Repower AG	L1	CHF	2.550%	09.12.24	-	-	-	24'569.000	24'618.14	0.15%
Roche Kapitalmarkt AG	L1	CHF	0.500%	25.02.27	200'000.000	-	-	300'000.000	298'677.00	1.85%
Sandoz Group AG	L1	CHF	2.125%	17.11.26	-	-	-	200'000.000	204'438.00	1.27%
Santander Consumer Finance SA	L1	CHF	0.150%	10.12.24	-	-	-	13'368.000	13'337.25	0.08%
Santander Consumer Finance SA	L1	CHF	2.733%	04.07.25	-	-	-	4'765.000	4'823.13	0.03%
Scotiabank Chile SA	L1	CHF	2.783%	23.05.25	-	-	-	9'197.000	9'284.37	0.06%
Services Industriels de Geneve SIG	L1	CHF	1.250%	30.06.25	-	-	-	14'845.000	14'846.48	0.09%

# SYZ – Absolute Return CHF

Titel	Art. 84 951.312	Wahrung	% <sup>1</sup>	Maturitat Commitment <sup>5</sup>	Nominal per 30.09.2023	Kaufe <sup>2</sup>	Verkaufe <sup>3</sup>	Nominal per 30.09.2024	Marktwert CHF	% des Gesamtfonds- vermogens <sup>4</sup>
SFS Group AG	L1	CHF	1.000%	06.06.25	-	-	-	40'482.000	40'421.28	0.25%
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	-	-	-	-	-
Sika AG	L1	CHF	1.650%	28.11.29	-	-	-	200'000.000	205'300.00	1.27%
Sika AG	L1	CHF	1.875%	14.11.23	15'227.000	-	-	-	-	-
Sika AG	L1	CHF	1.900%	28.11.25	100'000.000	-	-	-	-	-
SIX Group AG	L1	CHF	0.125%	27.11.26	200'000.000	-	-	200'000.000	196'912.00	1.22%
Slovakia Government International Bond	L1	CHF	2.125%	16.10.23	1'255.000	-	-	-	-	-
Societe Generale SA	L1	CHF	0.700%	26.02.25	-	-	-	32'065.000	32'000.87	0.20%
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	0.550%	03.10.25	-	-	-	1'618.000	1'608.13	0.01%
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	-	-	153'563.000	152'489.28	0.95%
Sulzer AG	L1	CHF	1.600%	22.10.24	-	-	-	30'084.000	30'084.00	0.19%
Swiss Confederation Government Bond	L1	CHF	0.500%	27.06.32	500'000.000	-	-	500'000.000	505'525.00	3.13%
Swiss Confederation Government Bond	L1	CHF	1.250%	28.05.26	800'000.000	-	-	600'000.000	608'424.00	3.77%
Swiss Confederation Government Bond	L1	CHF	1.500%	24.07.25	600'000.000	-	-	400'000.000	402'868.00	2.50%
Swiss Life Holding AG	L1	CHF	0.000%	06.06.25	-	-	-	965.000	958.34	0.01%
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	262'422.50	1.63%
Swiss Prime Site Finance AG	L1	CHF	1.000%	16.07.24	28'202.000	-	-	-	-	-
Swiss Prime Site Finance AG	L1	CHF	2.000%	10.12.24	-	-	-	9'419.000	9'433.13	0.06%
Swiss Reinsurance Co Ltd	L1	CHF	1.000%	17.09.24	250'000.000	-	-	-	-	-
Swisscom AG	L1	CHF	1.750%	10.07.24	17'758.000	-	-	-	-	-
Swissgrid AG	L1	CHF	1.625%	30.01.25	-	-	-	7'749.000	7'760.62	0.05%
Syngenta Finance AG	L1	CHF	0.700%	09.12.26	200'000.000	-	-	200'000.000	197'762.00	1.23%
Tecan Group AG	L1	CHF	0.050%	06.10.25	-	-	-	9'783.000	9'677.34	0.06%
Temenos AG	L1	CHF	1.750%	05.04.24	180'000.000	-	-	-	-	-
Thurgauer Kantonalbank	L1	CHF	0.375%	31.03.25	-	-	-	1'470.000	1'465.00	0.01%
Toronto-Dominion Bank/The	L1	CHF	2.203%	31.01.28	200'000.000	-	-	200'000.000	207'492.00	1.29%
Trafigura Funding SA	L1	CHF	3.250%	30.09.24	100'000.000	-	-	-	-	-
UBS AG/London	L1	CHF	2.385%	09.05.25	-	-	-	1'485.000	1'497.62	0.01%
UBS Group AG	L1	CHF	2.113%	22.05.30	-	-	-	200'000.000	206'428.00	1.28%
UBS Switzerland AG	L1	CHF	0.000%	17.12.24	-	-	-	1'588.000	1'584.03	0.01%
UBS Switzerland AG	L1	CHF	0.000%	31.07.25	-	-	-	20'130.000	19'966.95	0.12%
UBS Switzerland AG	L1	CHF	2.459%	22.11.24	-	-	-	8'157.000	8'170.05	0.05%
Valiant Bank AG	L1	CHF	0.125%	23.04.24	47'119.000	-	-	-	-	-
Vodafone Group PLC	L1	CHF	0.375%	03.12.24	-	-	-	35'717.000	35'659.85	0.22%
VP Bank AG	L1	CHF	0.875%	07.10.24	-	-	-	8'966.000	8'965.10	0.06%
Wells Fargo & Co	L1	CHF	0.500%	02.11.23	104'060.000	-	-	-	-	-
Wells Fargo & Co	L1	CHF	0.750%	27.05.25	-	-	-	2'034.000	2'029.12	0.01%
Wells Fargo & Co	L1	CHF	1.250%	03.09.24	3'646.000	-	-	-	-	-
Westpac Banking Corp	L1	CHF	0.400%	06.06.24	14'584.000	-	-	-	-	-
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	-	-	-	-	-
Zurich Insurance Co Ltd	L1	CHF	0.100%	27.08.32	200'000.000	-	-	200'000.000	186'346.00	1.16%
Zurich Insurance Co Ltd	L1	CHF	0.500%	18.12.24	-	-	-	3'147.000	3'142.59	0.02%
<b>Durch Pool gehaltene Obligationen (EUR)</b>									<b>72'505.19</b>	<b>0.45%</b>
Argentine Republic Government International Bond	L1	EUR	0.125%	09.07.30	134'858.000	-	-	129'464.000	70'059.64	0.43%
Argentine Republic Government International Bond	L1	EUR	0.500%	09.07.29	4'152.000	-	-	4'152.000	2'445.55	0.02%
<b>Durch Pool gehaltene Investmentfonds (Irland)</b>									<b>262'838.37</b>	<b>1.63%</b>
iShares MSCI Global Semiconductors UCITS ETF	L1	USD	0.350%	-	9'000.000	-	-	9'000.000	57'729.19	0.36%
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	205'109.18	1.27%
<b>Nicht Notierte Wertpapiere</b>									<b>202'839.32</b>	<b>1.27%</b>
<b>Durch Pool gehaltene Obligationen (CHF)</b>									<b>202'839.32</b>	<b>1.27%</b>
Credit Agricole next bank Suisse SA	L2	CHF	2.006%	17.01.25	-	-	-	26'721.000	26'776.85	0.17%
Credit Agricole next bank Suisse SA	L2	CHF	2.030%	20.12.24	-	-	-	59'380.000	59'474.41	0.37%
Kernkraftwerk Leibstadt AG	L2	CHF	0.250%	30.04.24	32'170.000	-	-	-	-	-
Limeco	L2	CHF	1.800%	05.12.24	-	-	-	17'072.000	17'087.19	0.11%
Schaffhauser Kantonalbank	L2	CHF	1.591%	21.03.25	-	-	-	37'113.000	37'180.55	0.23%
UBS AG/London	L2	CHF	0.440%	29.04.24	32'170.000	-	-	-	-	-
Valiant Bank AG	L2	CHF	1.000%	28.08.25	-	-	-	62'349.000	62'320.32	0.39%
Valiant Bank AG	L2	CHF	2.000%	26.08.24	90'076.000	-	-	-	-	-
Valiant Bank AG	L2	CHF	2.200%	08.07.24	42'894.000	-	-	-	-	-
<b>Durch Pool gehaltene Obligationen (USD)</b>									<b>0.00</b>	<b>0.00%</b>
Arendal S de RL de CV	L2	USD	25.000%	30.06.24	43'200.000	-	-	2'331.000	0.00	0.00%
<b>Durch Pool gehaltene Strukturierte Produkte (USD)</b>									<b>-</b>	<b>-</b>
Arendal S de RL de CV	L2	USD	-	12.06.22	216'000.000	-	-	-	-	-
<b>Geldmarktinstrumente</b>									<b>521'136.52</b>	<b>3.22%</b>
<b>Durch Pool gehaltene Certificate of Deposit (CHF)</b>									<b>-</b>	<b>-</b>



# SYZ – Absolute Return CHF

Titel	Art. 84 951.312	Wahrung	% <sup>1</sup>	Maturitat Commitment <sup>5</sup>	Nominal per 30.09.2023	Kaufe <sup>2</sup>	Verkaufe <sup>3</sup>	Nominal per 30.09.2024	Marktwert CHF	% des Gesamtfonds- vermogens <sup>4</sup>
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	-	-	-	-	-
Bank Cler AG	L2	CHF	2.045%	26.06.24	53'617.000	-	-	-	-	-
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	-	-	-	-	-
Cooperatieve Rabobank UA	L2	CHF	0.000%	03.06.24	35'387.000	-	-	-	-	-
Cooperatieve Rabobank UA	L2	CHF	0.000%	25.07.24	32'170.000	-	-	-	-	-
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	-	-	-	-	-
Swiss Prime Site Finance AG	L2	CHF	2.090%	08.12.23	53'617.000	-	-	-	-	-
<b>Durch Pool gehaltene Commercial Paper (CHF)</b>									<b>14'822.83</b>	<b>0.09%</b>
DNB Bank ASA	L2	CHF	0.000%	31.07.24	32'170.000	-	-	-	-	-
Jyske Bank A/S	L2	CHF	0.000%	31.05.24	53'617.000	-	-	-	-	-
Landesbank Baden-Wuerttemberg	L2	CHF	0.000%	23.09.24	85'787.000	-	-	-	-	-
Landesbank Baden-Wuerttemberg	L2	CHF	0.000%	06.12.24	-	-	-	14'845.000	14'822.83	0.09%
Swiss National Bank Bill	L2	CHF	0.000%	13.11.23	15'013.000	-	-	-	-	-
<b>Durch Pool gehaltene Obligationen (CHF)</b>									<b>506'313.69</b>	<b>3.13%</b>
Aargauische Kantonalbank	L2	CHF	1.000%	23.09.25	-	-	-	59'380.000	59'380.00	0.37%
Azienda Elettrica Ticinese	L2	CHF	1.640%	03.10.24	-	-	-	14'845.000	14'845.00	0.09%
Bank Cler AG	L2	CHF	0.963%	17.10.25	-	-	-	7'423.000	7'421.44	0.05%
Bank Cler AG	L2	CHF	1.423%	28.03.25	-	-	-	37'113.000	37'143.80	0.23%
Bank Cler AG	L2	CHF	1.768%	15.11.24	-	-	-	37'113.000	37'133.78	0.23%
Banque SYZ SA	L2	CHF	1.815%	12.11.24	-	-	-	1'485.000	1'485.88	0.01%
BPCE SA	L1	CHF	1.321%	01.03.25	-	-	-	59'380.000	59'370.96	0.37%
Canton of Ticino	L2	CHF	1.250%	21.10.24	-	-	-	74'225.000	74'230.20	0.46%
City of La Chaux-de-Fonds	L2	CHF	1.220%	13.03.25	-	-	-	22'268.000	22'302.96	0.14%
City of La Chaux-de-Fonds	L2	CHF	1.220%	20.03.25	-	-	-	14'845.000	14'869.35	0.09%
Galenica AG	L2	CHF	2.050%	06.11.23	53'617.000	-	-	-	-	-
Galenica AG	L2	CHF	2.080%	05.12.23	42'894.000	-	-	-	-	-
Kantonsspital Aarau AG	L2	CHF	1.880%	30.11.23	62'196.000	-	-	-	-	-
Limeco	L2	CHF	1.770%	05.12.23	24'664.000	-	-	-	-	-
QNB Finance Ltd	L1	CHF	1.550%	20.06.25	-	-	-	29'690.000	29'778.18	0.18%
Reseau Hopitalier Neuchatelois	L2	CHF	1.640%	24.01.25	-	-	-	37'113.000	37'127.85	0.23%
Schaffhauser Kantonalbank	L2	CHF	1.000%	26.08.25	-	-	-	14'845.000	14'845.00	0.09%
Schaffhauser Kantonalbank	L2	CHF	1.263%	10.07.25	-	-	-	29'690.000	29'722.36	0.18%
Stiftung Kantonsspital Graubuenden	L2	CHF	1.860%	17.05.24	10'723.000	-	-	-	-	-
Swiss National Bank Bill	L2	CHF	0.000%	16.10.23	10'723.000	-	-	-	-	-
Swiss National Bank Bill	L2	CHF	0.000%	31.03.25	-	-	-	37'113.000	36'954.16	0.23%
Swissgrid AG	L2	CHF	1.980%	30.04.24	107'234.000	-	-	-	-	-
UBS AG/London	L2	CHF	2.050%	28.04.24	75'064.000	-	-	-	-	-
Valiant Bank AG	L2	CHF	1.125%	08.07.25	-	-	-	29'690.000	29'702.77	0.18%
<b>Sichtguthaben</b>									<b>2'312'655.19</b>	<b>14.33%</b>
<b>Derivative Finanzinstrumente</b>									<b>60'426.26</b>	<b>0.37%</b>
<b>Durch Pool gehaltene Devisentermingeschafte</b>									<b>6'599.57</b>	<b>0.05%</b>
Devisentermingeschafte	L2	CHF/EUR		28.10.24		47'220	50'000		237.14	0.00%
Devisentermingeschafte	L2	CHF/EUR		28.10.24		214'392	227'000		1'087.86	0.01%
Devisentermingeschafte	L2	CHF/USD		28.10.24		152'234	180'000		844.77	0.01%
Devisentermingeschafte	L2	CHF/USD		28.10.24		795'017	940'000		4'429.80	0.03%
<b>Durch Pool gehaltene Futures auf Anleihen</b>									-	-
Euro-Bund Fut.	L1	EUR		07.12.23	17.000	-	-	-	-	-
<b>Durch Pool gehaltene Futures auf Indizes</b>									<b>53'826.69</b>	<b>0.32%</b>
EURO STOXX 50 Index Fut.	L1	EUR		15.12.23	7.000	-	-	-	-	-
EURO STOXX 50 Index Fut.	L1	EUR		20.12.24	-	-	-	5.000	7'837.52	0.05%
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		20.12.24	-	-	-	8.000	41'772.60	0.24%
Topix Index Fut.	L1	JPY		07.12.23	2.000	-	-	-	-	-
Topix Index Fut.	L1	JPY		12.12.24	-	-	-	1.000	4'216.57	0.03%
<b>Sonstige Vermogenswerte</b>									<b>242'143.27</b>	<b>1.50%</b>
<b>Gesamtfondsvermogen</b>									<b>16'135'171.33</b>	<b>100.00%</b>
<b>./. Andere Verbindlichkeiten</b>									<b>-64'084.72</b>	
<b>Total Nettofondsvermogen</b>									<b>16'071'086.61</b>	

<sup>1</sup> Bei Investmentfonds die maximale oder applizierte Gebuhr.

<sup>2</sup> Kaufe umfassen unter anderem die Transaktionen: Gratiestitel / Kaufe / Konversionen / Namensanderungen / Splits / Stock- und Wahldividenden / Titelaufteilungen / Ubertrage / Umtausch zwischen Gesellschaften / Zuteilungen aus Bezugs- und Optionsrechten / Zuteilung von Bezugsrechten aus Basistiteln / Sacheinlagen.

<sup>3</sup> Verkaufe umfassen unter anderem die Transaktionen: Auslosungen / Ausbuchungen infolge Verfall / Ausubungen von Bezugs- und Optionsrechten / Konversionen / Reverse Splits / Ruckzahlungen / Ubertrage / Umtausch zwischen Gesellschaften / Sachauslagen.

<sup>4</sup> Allfallige Abweichungen der Prozentzahlen des Gesamtfondsvermogens sind auf Rundungsdifferenzen zuruckzufuhren.

<sup>5</sup> 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	12'938'946.60	80.18%
b) Anlagen, für die keine Kurse gemäss Buchstabe a verfügbar sind: bewertet aufgrund von am Markt beobachtbaren Parametern	L2	641'426.27	3.99%
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	% <sup>1</sup>	Maturität Commitment <sup>5</sup>	Nominal per 30.09.2023	Käufe <sup>2</sup>	Verkäufe <sup>3</sup>	Nominal per 30.09.2024	Marktwert CHF	% des Gesamtpool- vermögens <sup>4</sup>
<b>Total Effekten</b>									<b>11'337'802.99</b>	<b>83.02%</b>
<b>An einer Börse gehandelte Effekten</b>									<b>11'337'802.99</b>	<b>83.02%</b>
<b>Aktien (Irland)</b>									<b>56'315.74</b>	<b>0.41%</b>
Linde PLC	L1	USD			140.000	-	-	140.000	56'315.74	0.41%
<b>Aktien (Schweiz)</b>									<b>133'312.40</b>	<b>0.98%</b>
Nestle SA	L1	CHF			440.000	-	-	440.000	37'382.40	0.27%
Novartis AG	L1	CHF			500.000	500.000	500.000	500.000	48'575.00	0.36%
Roche Holding AG	L1	CHF			175.000	-	-	175.000	47'355.00	0.35%
Sandoz Group AG	L1	CHF			-	100.000	100.000	-	-	-
<b>Aktien (Vereinigte Staaten)</b>									<b>286'093.36</b>	<b>2.10%</b>
Alphabet Inc	L1	USD			400.000	-	-	400.000	55'961.11	0.41%
Amazon.com Inc	L1	USD			400.000	-	-	400.000	62'871.47	0.46%
Apple Inc	L1	USD			280.000	-	-	280.000	55'033.20	0.40%
Mastercard Inc	L1	USD			130.000	-	-	130.000	54'150.85	0.40%
Microsoft Corp	L1	USD			160.000	-	-	160.000	58'076.73	0.43%
<b>Obligationen (CHF)</b>									<b>10'526'738.10</b>	<b>77.08%</b>
Achmea Bank NV	L1	CHF	0.500%	03.10.25	150'000.000	-	-	150'000.000	149'088.00	1.09%
ADCB Finance Cayman Ltd	L1	CHF	0.500%	29.11.24	125'000.000	-	-	125'000.000	124'765.00	0.91%
Apple Inc	L1	CHF	0.375%	25.11.24	200'000.000	-	-	200'000.000	199'792.00	1.46%
Baloise Life Ltd	L1	CHF	2.200%	19.06.48	100'000.000	50'000.000	-	150'000.000	152'983.50	1.12%
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA	L1	CHF	0.125%	27.08.26	200'000.000	-	-	200'000.000	196'326.00	1.44%
Banco Santander SA	L1	CHF	2.248%	30.01.26	200'000.000	-	-	200'000.000	203'346.00	1.49%
Bank Julius Baer & Co AG	L1	CHF	2.375%	06.09.27	150'000.000	-	-	150'000.000	155'608.50	1.14%
Bank of Montreal	L1	CHF	2.260%	01.02.29	200'000.000	-	-	200'000.000	210'216.00	1.54%
Banque Cantonale de Geneve	L1	CHF	1.125%	28.06.27	100'000.000	100'000.000	-	200'000.000	200'348.00	1.47%
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	197'330.00	1.44%
Canadian Imperial Bank of Commerce	L1	CHF	1.713%	13.12.27	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	249'735.00	1.83%
Canton of Zürich	L1	CHF	0.000%	27.06.25	250'000.000	-	-	250'000.000	248'687.50	1.82%
CBQ Finance Ltd	L1	CHF	0.735%	27.11.24	150'000.000	-	-	150'000.000	149'826.00	1.10%
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	209'516.00	1.53%
Central American Bank for Economic Integration	L1	CHF	0.314%	05.09.24	250'000.000	-	250'000.000	-	-	-
Central American Bank for Economic Integration	L1	CHF	2.138%	13.12.27	200'000.000	-	-	200'000.000	207'044.00	1.52%
Clariant AG	L1	CHF	2.750%	22.09.28	200'000.000	-	-	200'000.000	209'562.00	1.53%
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	207'554.00	1.52%
Corp Andina de Fomento	L1	CHF	0.510%	16.09.26	300'000.000	-	-	300'000.000	296'841.00	2.17%
Credit Agricole SA/London	L1	CHF	0.625%	12.07.24	150'000.000	-	150'000.000	-	-	-
Deutsche Bank AG	L1	CHF	3.645%	27.01.29	200'000.000	-	-	200'000.000	213'028.00	1.56%
Deutsche Telekom AG	L1	CHF	0.435%	06.02.32	-	150'000.000	-	150'000.000	144'265.50	1.06%
Electricite de France SA	L1	CHF	2.300%	14.09.27	200'000.000	-	200'000.000	-	-	-
Federation des Caisses Desjardins du Quebec	L1	CHF	1.488%	11.09.29	-	100'000.000	-	100'000.000	101'040.00	0.74%
Federation des Caisses Desjardins du Quebec	L1	CHF	1.735%	31.01.28	150'000.000	-	-	150'000.000	154'908.00	1.13%
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	212'688.00	1.56%
Glärner 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	201'828.00	1.48%
HSBC Holdings PLC	L1	CHF	1.805%	01.06.26	200'000.000	-	-	200'000.000	200'856.00	1.47%
Korea National Oil Corp	L1	CHF	0.263%	30.07.27	200'000.000	50'000.000	-	250'000.000	245'330.00	1.80%
La Banque Postale SA	L1	CHF	2.773%	12.07.27	200'000.000	-	-	200'000.000	208'866.00	1.53%
Lloyds Banking Group PLC	L1	CHF	1.000%	04.03.25	150'000.000	-	-	150'000.000	149'860.50	1.10%
Lloyds Banking Group PLC	L1	CHF	2.745%	02.02.27	-	200'000.000	-	200'000.000	204'110.00	1.49%
Lonza Swiss Finanz AG	L1	CHF	2.100%	12.09.29	150'000.000	-	20'000.000	130'000.000	135'274.10	0.99%
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	-	250'000.000	-	-	-
Nestle SA	L1	CHF	1.875%	28.06.29	200'000.000	-	-	200'000.000	209'634.00	1.53%
Nordea Bank Abp	L1	CHF	0.550%	23.06.25	150'000.000	-	-	150'000.000	149'610.00	1.10%
North American Development Bank	L1	CHF	0.200%	28.11.28	250'000.000	-	-	250'000.000	242'567.50	1.78%

# In Pools gehaltene Wertschriften SYZ ARI CHF Principal Pool

Titel	Art. 84 951.312	Währung	% <sup>1</sup>	Maturität Commitment <sup>5</sup>	Nominal per 30.09.2023	Käufe <sup>2</sup>	Verkäufe <sup>3</sup>	Nominal per 30.09.2024	Marktwert CHF	% des Gesamtpool- vermögens <sup>4</sup>
Novartis AG	L1	CHF	0.250%	13.05.25	250'000.000	-	-	250'000.000	249'050.00	1.82%
Pfandbriefzentrale der schweizerischen Kantonalbanken AG	L1	CHF	1.000%	22.09.28	150'000.000	-	-	150'000.000	151'332.00	1.11%
PSP Swiss Property AG	L1	CHF	2.000%	01.07.26	180'000.000	-	30'000.000	150'000.000	152'374.50	1.12%
Roche Kapitalmarkt AG	L1	CHF	0.500%	25.02.27	200'000.000	100'000.000	-	300'000.000	298'677.00	2.19%
Sandoz Group AG	L1	CHF	2.125%	17.11.26	-	200'000.000	-	200'000.000	204'438.00	1.50%
Sika AG	L1	CHF	1.650%	28.11.29	-	200'000.000	-	200'000.000	205'300.00	1.50%
Sika AG	L1	CHF	1.900%	28.11.25	100'000.000	-	100'000.000	-	-	-
SIX Group AG	L1	CHF	0.125%	27.11.26	200'000.000	-	-	200'000.000	196'912.00	1.44%
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	148'953.00	1.09%
Swiss Confederation Government Bond	L1	CHF	0.500%	27.06.32	500'000.000	-	-	500'000.000	505'525.00	3.70%
Swiss Confederation Government Bond	L1	CHF	1.250%	28.05.26	800'000.000	-	200'000.000	600'000.000	608'424.00	4.46%
Swiss Confederation Government Bond	L1	CHF	1.500%	24.07.25	600'000.000	-	200'000.000	400'000.000	402'868.00	2.95%
Swiss Life Holding AG	L1	CHF	2.259%	26.07.28	250'000.000	-	-	250'000.000	262'422.50	1.92%
Swiss Reinsurance Co Ltd	L1	CHF	1.000%	17.09.24	250'000.000	-	250'000.000	-	-	-
Syngenta Finance AG	L1	CHF	0.700%	09.12.26	200'000.000	-	-	200'000.000	197'762.00	1.45%
Temenos AG	L1	CHF	1.750%	05.04.24	180'000.000	-	180'000.000	-	-	-
Toronto-Dominion Bank/The	L1	CHF	2.203%	31.01.28	200'000.000	-	-	200'000.000	207'492.00	1.52%
Trafigura Funding SA	L1	CHF	3.250%	30.09.24	100'000.000	-	100'000.000	-	-	-
UBS Group AG	L1	CHF	2.113%	22.05.30	-	200'000.000	-	200'000.000	206'428.00	1.51%
Zürich Insurance Co Ltd	L1	CHF	0.100%	27.08.32	200'000.000	-	-	200'000.000	186'346.00	1.36%
<b>Obligationen (EUR)</b>									<b>72'505.02</b>	<b>0.53%</b>
Argentine Republic Government International Bond	L1	EUR	0.125%	09.07.30	134'858.000	-	5'394.320	129'463.680	70'059.47	0.51%
Argentine Republic Government International Bond	L1	EUR	0.500%	09.07.29	4'152.000	-	-	4'152.000	2'445.55	0.02%
<b>Investmentfonds (Irland)</b>									<b>262'838.37</b>	<b>1.92%</b>
iShares MSCI Global Semiconductors UCITS ETF	L1	USD	0.350%		9'000.000	-	-	9'000.000	57'729.19	0.42%
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	205'109.18	1.50%
<b>Nicht Notierte Wertpapiere</b>									-	-
<b>Obligationen (USD)</b>									<b>0.00</b>	<b>0.00%</b>
Arendal S de RL de CV	L2	USD	25.000%	30.06.24	43'200.000	-	40'869.000	2'331.000	0.00	0.00%
<b>Strukturierte Produkte (USD)</b>									-	-
Arendal S de RL de CV	L2	USD		12.06.22	216'000.000	-	216'000.000	-	-	-
<b>Sichtguthaben</b>									<b>2'055'249.68</b>	<b>15.05%</b>
<b>Derivative Finanzinstrumente</b>									<b>60'426.26</b>	<b>0.44%</b>
<b>Devisentermingeschäfte</b>									<b>6'599.57</b>	<b>0.04%</b>
Devisentermingeschäfte	L2	CHF/EUR		28.10.24		214'392	227'000		1'087.86	0.01%
Devisentermingeschäfte	L2	CHF/EUR		28.10.24		47'220	50'000		237.14	0.00%
Devisentermingeschäfte	L2	CHF/USD		28.10.24		795'017	940'000		4'429.80	0.02%
Devisentermingeschäfte	L2	CHF/USD		28.10.24		152'234	180'000		844.77	0.01%
<b>Futures auf Anleihen</b>									-	-
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	-	-	-
<b>Futures auf Indizes</b>									<b>53'826.69</b>	<b>0.40%</b>
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	-	-	-
EURO STOXX 50 Index Fut.	L1	EUR		20.09.24	-	5.000	5.000	-	-	-
EURO STOXX 50 Index Fut.	L1	EUR		20.12.24	-	5.000	-	5.000	7'837.52	0.06%
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	-	-	-
S+P 500 Emini Index Fut.	L1	USD		20.09.24	-	8.000	8.000	-	-	-
S+P 500 Emini Index Fut.	L1	USD		20.12.24	-	8.000	-	8.000	41'772.60	0.31%
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	-	-	-
Topix Index Fut.	L1	JPY		12.09.24	-	1.000	1.000	-	-	-
Topix Index Fut.	L1	JPY		12.12.24	-	1.000	-	1.000	4'216.57	0.03%
<b>Sonstige Vermögenswerte</b>									<b>203'551.37</b>	<b>1.49%</b>
<b>Gesamtpoolvermögen</b>									<b>13'657'030.30</b>	<b>100.00%</b>
<b>./. Andere Verbindlichkeiten</b>									<b>-0.46</b>	
<b>Total Nettopoolvermögen</b>									<b>13'657'029.84</b>	

# In Pools gehaltene Wertschriften SYZ ARI CHF Principal Pool

<sup>1</sup> Bei Investmentfonds die maximale oder applizierte Gebühr.

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

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

<sup>4</sup> Allfällige Abweichungen der Prozentzahlen des Gesamtfondsvermögens sind auf Rundungsdifferenzen zurückzuführen.

<sup>5</sup> Private Equity eingegangene Verpflichtung in Millionen.

## 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	11'391'629.68	83.42%
b) Anlagen, für die keine Kurse gemäss Buchstabe a verfügbar sind: bewertet aufgrund von am Markt beobachtbaren Parametern	L2	6'599.57	0.04%
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	750'000.00	CHF	676'398.53	06.06.2024
CHF	189'699.10	EUR	200'000.00	11.12.2023	EUR	240'000.00	CHF	232'663.20	03.07.2024
EUR	250'000.00	CHF	235'442.98	11.01.2024	USD	950'000.00	CHF	846'312.25	03.07.2024
USD	250'000.00	CHF	217'800.18	11.01.2024	EUR	240'000.00	CHF	232'074.72	02.08.2024
EUR	250'000.00	CHF	232'153.85	21.03.2024	USD	950'000.00	CHF	853'778.02	02.08.2024
USD	300'000.00	CHF	253'741.08	21.03.2024	EUR	235'000.00	CHF	223'816.75	30.08.2024
USD	200'000.00	CHF	170'941.58	21.03.2024	USD	950'000.00	CHF	834'170.40	30.08.2024
USD	284'475.76	CHF	250'000.00	21.03.2024	EUR	230'000.00	CHF	215'694.09	30.09.2024
EUR	250'000.00	CHF	240'358.75	05.04.2024	USD	950'000.00	CHF	798'525.92	30.09.2024
USD	800'000.00	CHF	708'613.68	05.04.2024	EUR	50'000.00	CHF	47'220.34	28.10.2024
EUR	240'000.00	CHF	234'157.13	08.05.2024	EUR	227'000.00	CHF	214'391.58	28.10.2024
USD	750'000.00	CHF	678'818.55	08.05.2024	USD	940'000.00	CHF	795'016.56	28.10.2024
EUR	240'000.00	CHF	233'684.06	06.06.2024	USD	180'000.00	CHF	152'233.72	28.10.2024

# 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	% <sup>1</sup>	Maturität Commitment <sup>5</sup>	Nominal per 30.09.2023	Käufe <sup>2</sup>	Verkäufe <sup>3</sup>	Nominal per 30.09.2024	Marktwert CHF	% des Gesamtpool- vermögens <sup>4</sup>
<b>Total Effekten</b>									-	-
<b>Sichtguthaben</b>									32'769.67	99.94%
<b>Sonstige Vermögenswerte</b>									20.16	0.06%
<b>Gesamtpoolvermögen</b>									32'789.83	100.00%
<b>./. Andere Verbindlichkeiten</b>									-0.15	
<b>Total Nettopoolvermögen</b>									32'789.68	

<sup>1</sup> Bei Investmentfonds die maximale oder applizierte Gebühr.

<sup>2</sup> 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.

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

<sup>4</sup> Allfällige Abweichungen der Prozentzahlen des Gesamtfondsvermögens sind auf Rundungsdifferenzen zurückzuführen.

<sup>5</sup> 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	Wahrung	% <sup>1</sup>	Maturitat Commitment <sup>5</sup>	Nominal per 30.09.2023	Kaufe <sup>2</sup>	Verkaufe <sup>3</sup>	Nominal per 30.09.2024	Marktwert CHF	% des Gesamtpool- vermogens <sup>4</sup>
<b>Total Effekten</b>									<b>1'469'944'938.10</b>	<b>93.26%</b>	
<b>An einer Borse gehandelte Effekten</b>									<b>982'257'777.50</b>	<b>62.32%</b>	
<b>Obligationen (CHF)</b>									<b>982'257'777.50</b>	<b>62.32%</b>	
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	1'497'900.00	0.10%
ABB Ltd	L1		CHF	0.300%	06.08.24	-	250'000.000	250'000.000	-	-	-
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	-	2'925'000.000	-	2'925'000.000	2'917'687.50	0.19%
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	-	-	-
Allreal Holding AG	L1		CHF	1.375%	31.03.25	-	7'065'000.000	-	7'065'000.000	7'065'000.00	0.45%
Amag Leasing AG	L1		CHF	0.000%	18.02.25	-	6'450'000.000	-	6'450'000.000	6'415'815.00	0.41%
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	0.175%	16.06.25	-	12'265'000.000	-	12'265'000.000	12'146'029.50	0.77%
Amag Leasing AG	L1		CHF	0.210%	27.06.24	7'850'000.000	3'620'000.000	11'470'000.000	-	-	-
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	-	11'035'000.000	-	11'035'000.000	11'030'586.00	0.70%
Amag Leasing AG	L1		CHF	2.803%	10.09.25	-	3'900'000.000	-	3'900'000.000	3'948'750.00	0.25%
Apple Inc	L1		CHF	0.375%	25.11.24	-	20'200'000.000	11'000'000.000	9'200'000.000	9'188'960.00	0.58%
ASB Bank Ltd	L1		CHF	0.200%	02.08.24	7'570'000.000	2'520'000.000	10'090'000.000	-	-	-
AT&T Inc	L1		CHF	1.375%	04.12.24	-	44'655'000.000	-	44'655'000.000	44'663'931.00	2.83%
Axpo Holding AG	L1		CHF	0.250%	04.02.25	-	6'700'000.000	-	6'700'000.000	6'675'210.00	0.42%
Axpo Holding AG	L1		CHF	1.750%	29.05.24	23'360'000.000	4'575'000.000	27'935'000.000	-	-	-
Axpo Holding AG	L1		CHF	3.125%	26.02.25	-	31'420'000.000	-	31'420'000.000	31'639'940.00	2.01%
Baloise Holding AG	L1		CHF	1.125%	19.12.24	-	2'785'000.000	-	2'785'000.000	2'783'886.00	0.18%
Banca Dello Stato del Cantone Ticino	L1		CHF	0.500%	24.06.24	2'475'000.000	635'000.000	3'110'000.000	-	-	-
Banco de Chile	L1		CHF	0.250%	05.12.24	-	2'050'000.000	-	2'050'000.000	2'045'695.00	0.13%
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	14'416'896.00	0.91%
Banco del Estado de Chile	L1		CHF	0.240%	06.06.25	-	2'650'000.000	-	2'650'000.000	2'632'775.00	0.17%
Banco del Estado de Chile	L1		CHF	0.693%	04.12.24	-	2'350'000.000	-	2'350'000.000	2'346'240.00	0.15%
Banco Santander Chile	L1		CHF	0.350%	30.05.25	-	1'205'000.000	-	1'205'000.000	1'197'529.00	0.08%
Banco Santander Chile	L1		CHF	0.384%	27.09.24	2'500'000.000	100'000.000	2'600'000.000	-	-	-
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	-	17'335'000.000	-	17'335'000.000	17'317'665.00	1.10%
Banco Santander SA	L1		CHF	1.328%	10.06.25	-	1'300'000.000	-	1'300'000.000	1'302'990.00	0.08%
Banque Cantonale de Fribourg	L1		CHF	1.250%	03.06.24	3'000'000.000	1'460'000.000	4'460'000.000	-	-	-
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	0.250%	10.07.25	-	1'310'000.000	-	1'310'000.000	1'303'319.00	0.08%
Banque Federative du Credit Mutuel SA	L1		CHF	0.320%	10.02.25	-	485'000.000	-	485'000.000	483'496.50	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	795'000.000	1'805'000.000	-	-	-
Banque Internationale a Luxembourg SA	L1		CHF	1.000%	10.07.25	-	1'275'000.000	-	1'275'000.000	1'268'115.00	0.08%
BKW AG	L1		CHF	0.000%	18.10.24	7'515'000.000	850'000.000	8'365'000.000	-	-	0.53%
BMW International Investment BV	L1		CHF	0.300%	05.09.24	-	2'335'000.000	2'335'000.000	-	-	-
BNP Paribas SA	L1		CHF	1.000%	06.06.25	-	7'000'000.000	-	7'000'000.000	6'987'400.00	0.44%
BNP Paribas SA	L1		CHF	1.750%	05.06.25	-	4'740'000.000	-	4'740'000.000	4'751'850.00	0.30%
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	-	1'595'000.000	-	1'595'000.000	1'595'000.00	0.10%
CA Auto Finance Suisse SA	L1		CHF	0.052%	20.12.24	-	24'720'000.000	-	24'720'000.000	24'626'064.00	1.56%
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	1.750%	26.06.25	-	1'260'000.000	-	1'260'000.000	1'266'426.00	0.08%
Caisse de Refinancement de l'Habitat SA	L1		CHF	2.375%	05.03.24	2'950'000.000	-	2'950'000.000	-	-	-
Canadian Imperial Bank of Commerce	L1		CHF	0.100%	30.04.25	-	3'500'000.000	-	3'500'000.000	3'480'750.00	0.22%
CBQ Finance Ltd	L1		CHF	0.195%	22.04.24	17'920'000.000	10'320'000.000	28'240'000.000	-	-	-
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	-	23'345'000.000	-	23'345'000.000	23'326'324.00	1.48%
Cellnex Telecom SA	L1		CHF	1.118%	17.07.25	-	2'510'000.000	-	2'510'000.000	2'506'235.00	0.16%
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	-	-	-
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	-	3'820'000.000	-	3'820'000.000	-	-
Central American Bank for Economic Integration	L1		CHF	0.405%	25.06.25	-	4'345'000.000	-	4'345'000.000	4'320'233.50	0.27%
Chocoladefabriken Lindt & Spruengli AG	L1		CHF	1.000%	08.10.24	-	4'075'000.000	-	4'075'000.000	4'074'592.50	0.26%
Citigroup Inc	L1		CHF	0.500%	22.11.24	-	11'075'000.000	-	11'075'000.000	11'062'817.50	0.70%
City of Geneva Switzerland	L1		CHF	1.625%	12.12.24	-	8'560'000.000	-	8'560'000.000	8'566'848.00	0.54%
City of Lausanne Switzerland	L1		CHF	1.375%	27.11.23	-	10'000'000.000	10'000'000.000	-	-	-
City of Zurich Switzerland	L1		CHF	2.375%	21.02.24	13'770'000.000	-	13'770'000.000	-	-	-
Commerzbank AG	L1		CHF	1.100%	11.07.25	-	4'000'000.000	-	4'000'000.000	3'998'000.00	0.25%
Commerzbank AG	L1		CHF	3.125%	14.07.25	-	1'500'000.000	-	1'500'000.000	1'524'000.00	0.10%

# In Pools gehaltene Wertschriften

## SIP Liquidity Mgmt CHF Syz AM Pool

	Titel	Art. 84 951.312	Wahrung	% <sup>1</sup>	Maturitat Commitment <sup>5</sup>	Nominal per 30.09.2023	Kaufe <sup>2</sup>	Verkaufe <sup>3</sup>	Nominal per 30.09.2024	Marktwert CHF	% des Gesamtpool- vermogens <sup>4</sup>
Coop-Gruppe Genossenschaft	L1	CHF	0.750%	06.06.25	-	1'490'000.000	-	-	1'490'000.000	1'485'679.00	0.09%
Coop-Gruppe Genossenschaft	L1	CHF	0.875%	31.07.24	-	14'675'000.000	14'675'000.000	-	-	-	-
Corner Banca SA	L1	CHF	3.000%	14.07.25	-	3'025'000.000	-	-	3'025'000.000	3'062'812.50	0.19%
Corp Andina de Fomento	L1	CHF	0.300%	07.04.25	-	1'985'000.000	-	-	1'985'000.000	1'975'075.00	0.13%
Corp Andina de Fomento	L1	CHF	0.700%	04.09.25	-	2'500'000.000	-	-	2'500'000.000	2'490'250.00	0.16%
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	-	-
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	1'085'000.000	4'260'000.000	-	-	-
Credit Agricole SA/London	L1	CHF	2.125%	29.09.25	-	3'000'000.000	-	-	3'000'000.000	3'024'000.00	0.19%
Credit Suisse AG/London	L1	CHF	0.550%	15.04.24	-	2'200'000.000	-	-	2'200'000.000	-	-
Deutsche Bahn Finance GMBH	L1	CHF	1.500%	26.08.24	750'000.000	115'000.000	865'000.000	-	-	-	-
Deutsche Bank AG	L1	CHF	0.800%	07.02.25	-	17'600'000.000	-	-	17'600'000.000	17'543'680.00	1.11%
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	-	50'585'000.000	-	-	37'085'000.000	37'070'166.00	2.35%
Eli Lilly & Co	L1	CHF	0.150%	24.05.24	22'905'000.000	795'000.000	23'700'000.000	-	-	-	-
Enel Finance International NV	L1	CHF	0.550%	03.09.24	4'310'000.000	5'445'000.000	9'755'000.000	-	-	-	-
Energiefinanzierungs AG	L1	CHF	3.050%	04.07.25	-	13'190'000.000	-	-	13'190'000.000	13'360'151.00	0.85%
Engadiner Kraftwerke AG	L1	CHF	1.625%	25.04.24	1'795'000.000	3'585'000.000	5'380'000.000	-	-	-	-
Engie SA	L1	CHF	1.625%	09.10.24	475'000.000	10'025'000.000	-	-	10'500'000.000	10'500'000.00	0.67%
European Investment Bank	L1	CHF	1.500%	02.08.24	1'200'000.000	560'000.000	1'760'000.000	-	-	-	-
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	0.170%	18.07.25	-	1'000'000.000	-	-	1'000'000.000	994'000.00	0.06%
Export-Import Bank of Korea	L1	CHF	0.383%	11.07.24	5'400'000.000	-	5'400'000.000	-	-	-	-
Ferring Holding SA	L1	CHF	1.050%	09.07.25	-	31'545'000.000	-	-	31'545'000.000	31'456'674.00	2.00%
Firmenich 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	4'690'000.000	-	-	6'780'000.000	6'779'322.00	0.43%
Flughafen Zurich AG	L1	CHF	0.700%	22.05.24	17'535'000.000	995'000.000	18'530'000.000	-	-	-	-
Geberit AG	L1	CHF	0.100%	17.10.24	-	1'690'000.000	-	-	1'690'000.000	1'689'155.00	0.11%
Geberit AG	L1	CHF	2.250%	26.09.25	-	585'000.000	-	-	585'000.000	591'084.00	0.04%
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	-	13'825'000.000	-	-	13'825'000.000	13'823'617.50	0.88%
Goldman Sachs Group Inc/The	L1	CHF	0.500%	04.12.24	-	28'815'000.000	-	-	28'815'000.000	28'774'659.00	1.83%
Grande Dixence SA	L1	CHF	1.125%	04.07.24	-	3'130'000.000	-	-	3'130'000.000	-	-
Grande Dixence SA	L1	CHF	1.375%	18.02.25	-	3'665'000.000	-	-	3'665'000.000	3'665'366.50	0.23%
Graubundner Kantonalbank	L1	CHF	1.375%	11.03.25	-	4'990'000.000	-	-	4'990'000.000	4'996'487.00	0.32%
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	200'000.000	-	-	16'160'000.000	6'544'800.00	0.42%
Heathrow Funding Ltd	L1	CHF	0.500%	17.05.24	37'855'000.000	8'235'000.000	46'090'000.000	-	-	-	-
Helvetia Schweizerische Versicherungsgesellschaft AG	L1	CHF	1.500%	28.04.25	-	9'590'000.000	-	-	9'590'000.000	9'611'098.00	0.61%
Hilti AG	L1	CHF	0.050%	02.07.25	-	2'470'000.000	-	-	2'470'000.000	2'452'710.00	0.16%
Hilti AG	L1	CHF	0.200%	08.11.24	-	4'685'000.000	-	-	4'685'000.000	4'679'846.50	0.30%
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	-	43'375'000.000	5'000'000.000	38'375'000.000	-	38'351'975.00	2.43%
HYPO NOE Landesbank fuer Niederoesterreich und Wien AG	L1	CHF	0.100%	27.11.24	-	1'650'000.000	-	-	1'650'000.000	1'647'030.00	0.10%
Hyundai Capital Services Inc	L1	CHF	0.260%	11.02.25	-	13'625'000.000	-	-	13'625'000.000	13'571'862.50	0.86%
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	1'560'000.000	7'410'000.000	-	-	-	-
Industrial Bank of Korea	L1	CHF	0.022%	16.07.25	-	22'015'000.000	-	-	22'015'000.000	21'825'671.00	1.39%
Intesa Sanpaolo Bank Ireland PLC	L1	CHF	0.250%	30.09.24	-	2'400'000.000	2'400'000.000	-	-	-	-
Jackson National Life Global Funding	L1	CHF	0.300%	18.12.23	16'560'000.000	-	16'560'000.000	-	-	-	-
Jackson National Life Global Funding	L1	CHF	0.375%	18.07.25	-	5'330'000.000	-	-	5'330'000.000	5'298'020.00	0.34%
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	-	10'155'000.000	-	-	10'155'000.000	10'135'705.50	0.64%
Kanton Basel-Stadt	L1	CHF	0.000%	22.11.24	-	450'000.000	-	-	450'000.000	449'325.00	0.03%
Kernkraftwerk Leibstadt AG	L1	CHF	1.500%	07.08.24	1'100'000.000	17'945'000.000	19'045'000.000	-	-	-	-
Kernkraftwerk Leibstadt AG	L1	CHF	2.000%	14.02.25	-	18'890'000.000	-	-	18'890'000.000	18'918'335.00	1.20%
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	1'020'000.000	20'980'000.000	-	-	-	-
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	-	-	-	-
Korea Land & Housing Corp	L1	CHF	0.193%	15.06.25	-	2'320'000.000	-	-	2'320'000.000	2'302'600.00	0.15%
Korea National Oil Corp	L1	CHF	0.000%	04.10.24	-	11'295'000.000	-	-	11'295'000.000	11'293'870.50	0.72%
Korea National Oil Corp	L1	CHF	0.875%	21.04.25	-	2'095'000.000	-	-	2'095'000.000	2'091'648.00	0.13%
Korea Railroad Corp	L1	CHF	0.000%	19.11.24	-	960'000.000	-	-	960'000.000	958'464.00	0.06%
Korea Water Resources Corp	L1	CHF	2.173%	18.09.25	-	7'000'000.000	-	-	7'000'000.000	7'070'700.00	0.45%
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	14'050'000.000	17'745'000.000	-	-	-	-
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	-	3'260'000.000	-	-	3'260'000.000	3'267'498.00	0.21%
Kuehne + Nagel International AG	L1	CHF	0.200%	18.06.25	-	8'790'000.000	-	-	8'790'000.000	8'726'712.00	0.55%
Kuntarahoitus Oyj	L1	CHF	0.750%	17.09.24	-	2'000'000.000	2'000'000.000	-	-	-	-
Lloyds Banking Group PLC	L1	CHF	1.000%	04.03.25	-	47'485'000.000	-	-	47'485'000.000	47'423'269.50	3.01%
Lonza Swiss Finanz AG	L1	CHF	0.700%	12.07.24	15'610'000.000	890'000.000	16'500'000.000	-	-	-	-
Luzerner Kantonalbank AG	L1	CHF	0.200%	11.04.25	-	3'000'000.000	-	-	3'000'000.000	2'986'500.00	0.19%
Luzerner Kantonalbank AG	L1	CHF	3.000%	11.03.25	-	1'000'000.000	-	-	1'000'000.000	1'008'400.00	0.06%
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	-	16'750'000.000	550'000.000	16'200'000.000	-	16'198'380.00	1.03%



# In Pools gehaltene Wertschriften

## SIP Liquidity Mgmt CHF Syz AM Pool

Titel	Art. 84 951.312	Währung	% <sup>1</sup>	Maturität Commitment <sup>5</sup>	Nominal per 30.09.2023	Käufe <sup>2</sup>	Verkäufe <sup>3</sup>	Nominal per 30.09.2024	Marktwert CHF	% des Gesamtpool- vermögens <sup>4</sup>
Mondelez International Inc	L1	CHF	0.617%	30.09.24	-	2'890'000.000	2'890'000.000	-	-	-
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	0.100%	31.10.24	-	710'000.000	-	710'000.000	709'361.00	0.05%
Muenchener Hypothekenbank eG	L1	CHF	0.300%	20.12.24	-	16'820'000.000	-	16'820'000.000	16'786'360.00	1.06%
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	1.550%	19.08.25	-	8'700'000.000	-	8'700'000.000	8'729'580.00	0.55%
Nant de Drance SA	L1	CHF	1.750%	18.07.24	1'570'000.000	11'095'000.000	12'665'000.000	-	-	-
National Australia Bank Ltd	L1	CHF	1.500%	07.02.24	16'440'000.000	200'000.000	16'640'000.000	-	-	-
Nationwide Building Society	L1	CHF	0.000%	11.07.25	-	630'000.000	-	630'000.000	624'897.00	0.04%
Nederlandse Waterschapsbank NV	L1	CHF	1.250%	09.08.24	-	600'000.000	600'000.000	-	-	-
Nestle SA	L1	CHF	0.250%	28.06.24	1'300'000.000	855'000.000	2'155'000.000	-	-	-
Nordea Bank Abp	L1	CHF	0.250%	27.11.23	875'000.000	-	875'000.000	-	-	-
Novartis AG	L1	CHF	0.250%	13.05.25	-	3'300'000.000	-	3'300'000.000	3'285'150.00	0.21%
Pargesa SA	L1	CHF	0.875%	24.04.24	5'500'000.000	910'000.000	6'410'000.000	-	-	-
Partners Group Holding AG	L1	CHF	0.150%	07.06.24	7'345'000.000	4'490'000.000	11'835'000.000	-	-	-
Pfandbriefbank schweizerischer Hypothekarinstitute AG	L1	CHF	0.000%	29.07.24	-	1'035'000.000	1'035'000.000	-	-	-
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	0.500%	24.01.25	-	7'350'000.000	-	7'350'000.000	7'338'240.00	0.47%
Pfandbriefbank schweizerischer Hypothekarinstitute AG	L1	CHF	0.750%	23.08.24	4'000'000.000	4'580'000.000	8'580'000.000	-	-	-
Pfandbriefbank schweizerischer Hypothekarinstitute AG	L1	CHF	1.000%	21.05.24	9'965'000.000	7'635'000.000	17'600'000.000	-	-	-
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	-	17'620'000.000	-	17'620'000.000	17'625'286.00	1.12%
Pfandbriefbank schweizerischer Hypothekarinstitute AG	L1	CHF	1.750%	15.07.25	-	2'500'000.000	-	2'500'000.000	2'517'250.00	0.16%
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	-	-	-
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	-	-	-
Pfandbriefzentrale der schweizerischen Kantonalbanken AG	L1	CHF	0.125%	31.10.24	-	685'000.000	-	685'000.000	684'452.00	0.04%
Pfandbriefzentrale der schweizerischen Kantonalbanken AG	L1	CHF	0.125%	02.12.24	-	3'075'000.000	-	3'075'000.000	3'069'772.50	0.20%
Pfandbriefzentrale der schweizerischen Kantonalbanken AG	L1	CHF	0.125%	16.04.25	-	4'500'000.000	-	4'500'000.000	4'480'650.00	0.28%
Pfandbriefzentrale der schweizerischen Kantonalbanken AG	L1	CHF	0.750%	15.04.24	-	610'000.000	610'000.000	-	-	-
Pfandbriefzentrale der schweizerischen Kantonalbanken AG	L1	CHF	0.750%	23.09.24	-	36'000'000.000	36'000'000.000	-	-	-
Pfandbriefzentrale der schweizerischen Kantonalbanken AG	L1	CHF	1.250%	17.07.24	-	2'680'000.000	2'680'000.000	-	-	-
Pfandbriefzentrale der schweizerischen Kantonalbanken AG	L1	CHF	1.375%	16.04.25	-	2'095'000.000	-	2'095'000.000	2'099'818.50	0.13%
Pfandbriefzentrale der schweizerischen Kantonalbanken AG	L1	CHF	1.625%	31.10.24	-	6'045'000.000	-	6'045'000.000	6'047'418.00	0.38%
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	-	4'540'000.000	3'000'000.000	1'540'000.000	1'532'608.00	0.10%
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	-	16'550'000.000	-	16'550'000.000	16'583'100.00	1.05%
Roche Kapitalmarkt AG	L1	CHF	0.100%	23.09.24	-	3'200'000.000	3'200'000.000	-	-	-
Santander Consumer Finance SA	L1	CHF	0.150%	10.12.24	-	9'005'000.000	-	9'005'000.000	8'984'288.50	0.57%
Santander Consumer Finance SA	L1	CHF	2.733%	04.07.25	-	3'210'000.000	-	3'210'000.000	3'249'162.00	0.21%
Scotiabank Chile SA	L1	CHF	2.783%	23.05.25	-	6'195'000.000	-	6'195'000.000	6'253'852.50	0.40%
Services Industriels de Geneve SIG	L1	CHF	1.250%	30.06.25	-	10'000'000.000	-	10'000'000.000	10'001'000.00	0.63%
SFS Group AG	L1	CHF	1.000%	06.06.25	-	27'270'000.000	-	27'270'000.000	27'229'095.00	1.73%
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	-	-	-
Sika AG	L1	CHF	0.625%	12.07.24	9'970'000.000	13'870'000.000	23'840'000.000	-	-	-
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	-	21'600'000.000	-	21'600'000.000	21'556'800.00	1.37%
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	0.550%	03.10.25	-	1'090'000.000	-	1'090'000.000	1'083'351.00	0.07%
Straumann Holding AG	L1	CHF	1.000%	03.10.23	16'055'000.000	-	16'055'000.000	-	-	-
Sulzer AG	L1	CHF	0.800%	23.09.25	-	2'400'000.000	-	2'400'000.000	2'382'000.00	0.15%
Sulzer AG	L1	CHF	1.600%	22.10.24	-	20'265'000.000	-	20'265'000.000	20'265'000.00	1.29%
Swiss Life Holding AG	L1	CHF	0.000%	06.06.25	-	650'000.000	-	650'000.000	645'515.00	0.04%
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	5'005'000.000	18'155'000.000	-	-	-
Swiss Prime Site Finance AG	L1	CHF	2.000%	10.12.24	-	6'345'000.000	-	6'345'000.000	6'354'517.50	0.40%
Swisscom AG	L1	CHF	1.750%	10.07.24	8'280'000.000	4'965'000.000	13'245'000.000	-	-	-
Swissgrid AG	L1	CHF	1.625%	30.01.25	-	5'220'000.000	-	5'220'000.000	5'227'830.00	0.33%
Tecan Group AG	L1	CHF	0.050%	06.10.25	-	6'590'000.000	-	6'590'000.000	6'518'828.00	0.41%
Thurgauer Kantonalbank	L1	CHF	0.375%	31.03.25	-	990'000.000	-	990'000.000	986'634.00	0.06%
Thurgauer Kantonalbank	L1	CHF	1.750%	30.09.24	-	4'380'000.000	4'380'000.000	-	-	-
TotalEnergies Capital International SA	L1	CHF	1.000%	29.08.24	-	1'610'000.000	1'610'000.000	-	-	-
UBS AG/London	L1	CHF	2.385%	09.05.25	-	1'000'000.000	-	1'000'000.000	1'008'500.00	0.06%
UBS Switzerland AG	L1	CHF	0.000%	17.12.24	-	1'070'000.000	-	1'070'000.000	1'067'325.00	0.07%
UBS Switzerland AG	L1	CHF	0.000%	31.07.25	-	13'560'000.000	-	13'560'000.000	13'450'164.00	0.85%
UBS Switzerland AG	L1	CHF	2.459%	22.11.24	-	5'495'000.000	-	5'495'000.000	5'503'792.00	0.35%
Valiant Bank AG	L1	CHF	0.125%	23.04.24	21'970'000.000	5'180'000.000	27'150'000.000	-	-	-
Vodafone Group PLC	L1	CHF	0.375%	03.12.24	-	24'060'000.000	-	24'060'000.000	24'021'504.00	1.52%
VP Bank AG	L1	CHF	0.875%	07.10.24	-	6'040'000.000	-	6'040'000.000	6'039'396.00	0.38%
Walliser Kantonalbank	L1	CHF	0.200%	19.08.24	-	3'380'000.000	3'380'000.000	-	-	-
Wells Fargo & Co	L1	CHF	0.500%	02.11.23	48'520'000.000	-	48'520'000.000	-	-	-
Wells Fargo & Co	L1	CHF	0.750%	27.05.25	-	1'370'000.000	-	1'370'000.000	1'366'712.00	0.09%
Wells Fargo & Co	L1	CHF	1.250%	03.09.24	1'700'000.000	15'215'000.000	16'915'000.000	-	-	-
Westpac Banking Corp	L1	CHF	0.400%	06.06.24	6'800'000.000	2'815'000.000	9'615'000.000	-	-	-

# In Pools gehaltene Wertschriften

## SIP Liquidity Mgmt CHF Syz AM Pool

Titel	Art. 84 951.312	Wahrung	% <sup>1</sup>	Maturitat Commitment <sup>5</sup>	Nominal per 30.09.2023	Kaufe <sup>2</sup>	Verkaufe <sup>3</sup>	Nominal per 30.09.2024	Marktwert CHF	% des Gesamtpool- vermogens <sup>4</sup>
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	-	2'120'000.000	-	2'120'000.000	2'117'032.00	0.13%
<b>Nicht Notierte Wertpapiere</b>									<b>136'637'635.00</b>	<b>8.67%</b>
<b>Obligationen (CHF)</b>									<b>136'637'635.00</b>	<b>8.67%</b>
Credit Agricole next bank Suisse SA	L2	CHF	2.006%	17.01.25	-	18'000'000.000	-	18'000'000.000	18'037'620.00	1.15%
Credit Agricole next bank Suisse SA	L2	CHF	2.030%	20.12.24	-	40'000'000.000	-	40'000'000.000	40'063'600.00	2.54%
Kernkraftwerk Leibstadt AG	L2	CHF	0.250%	30.04.24	15'000'000.000	-	15'000'000.000	-	-	-
Limeco	L2	CHF	1.800%	05.12.24	-	11'500'000.000	-	11'500'000.000	11'510'235.00	0.73%
Schaffhauser Kantonalbank	L2	CHF	1.591%	21.03.25	-	25'000'000.000	-	25'000'000.000	25'045'500.00	1.59%
UBS AG/London	L2	CHF	0.440%	29.04.24	15'000'000.000	-	15'000'000.000	-	-	-
Valiant Bank AG	L2	CHF	1.000%	28.08.25	-	42'000'000.000	-	42'000'000.000	41'980'680.00	2.66%
Valiant Bank AG	L2	CHF	2.000%	26.08.24	42'000'000.000	-	42'000'000.000	-	-	-
Valiant Bank AG	L2	CHF	2.200%	08.07.24	20'000'000.000	-	20'000'000.000	-	-	-
<b>Geldmarktinstrumente</b>									<b>351'049'525.60</b>	<b>22.27%</b>
<b>Certificate of Deposit (CHF)</b>									-	-
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	-	-	-
Bank Cler AG	L2	CHF	2.045%	26.06.24	25'000'000.000	-	25'000'000.000	-	-	-
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	-	-	-
Cooperatieve Rabobank UA	L2	CHF	0.000%	03.06.24	16'500'000.000	-	16'500'000.000	-	-	-
Cooperatieve Rabobank UA	L2	CHF	0.000%	25.07.24	15'000'000.000	-	15'000'000.000	-	-	-
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	-	-	-
Swiss Prime Site Finance AG	L2	CHF	2.090%	08.12.23	25'000'000.000	-	25'000'000.000	-	-	-
<b>Commercial Paper (CHF)</b>									<b>9'985'077.60</b>	<b>0.63%</b>
Bayerische Landesbank	L2	CHF	0.000%	13.05.24	-	30'000'000.000	30'000'000.000	-	-	-
DNB Bank ASA	L2	CHF	0.000%	31.07.24	15'000'000.000	-	15'000'000.000	-	-	-
Jyske Bank A/S	L2	CHF	0.000%	31.05.24	25'000'000.000	-	25'000'000.000	-	-	-
Landesbank Baden-Wuerttemberg	L2	CHF	0.000%	23.09.24	40'000'000.000	-	40'000'000.000	-	-	-
Landesbank Baden-Wuerttemberg	L2	CHF	0.000%	06.12.24	-	10'000'000.000	-	10'000'000.000	9'985'077.60	0.63%
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	-	-	-
<b>Obligationen (CHF)</b>									<b>341'064'448.00</b>	<b>21.64%</b>
Aargauische Kantonalbank	L2	CHF	1.000%	23.09.25	-	40'000'000.000	-	40'000'000.000	40'000'000.00	2.54%
Azienda Elettrica Ticinese	L2	CHF	1.640%	03.10.24	-	10'000'000.000	-	10'000'000.000	10'000'000.00	0.63%
Banca Dello Stato del Cantone Ticino	L2	CHF	1.420%	03.09.24	-	20'000'000.000	20'000'000.000	-	-	-
Banca Dello Stato del Cantone Ticino	L2	CHF	1.710%	19.04.24	-	50'000'000.000	50'000'000.000	-	-	-
Bank Cler AG	L2	CHF	0.963%	17.10.25	-	5'000'000.000	-	5'000'000.000	4'998'950.00	0.32%
Bank Cler AG	L2	CHF	1.423%	28.03.25	-	25'000'000.000	-	25'000'000.000	25'020'750.00	1.59%
Bank Cler AG	L2	CHF	1.768%	15.11.24	-	25'000'000.000	-	25'000'000.000	25'014'000.00	1.59%
Banque SYZ SA	L2	CHF	1.815%	12.11.24	-	1'000'000.000	-	1'000'000.000	1'000'590.00	0.06%
Banque SYZ SA	L2	CHF	1.980%	06.09.24	-	1'000'000.000	1'000'000.000	-	-	-
Banque SYZ SA	L2	CHF	2.000%	12.08.24	-	1'000'000.000	1'000'000.000	-	-	-
Banque SYZ SA	L2	CHF	2.025%	10.06.24	-	1'000'000.000	1'000'000.000	-	-	-
Banque SYZ SA	L2	CHF	2.260%	22.04.24	-	2'000'000.000	2'000'000.000	-	-	-
BPCE SA	L1	CHF	1.321%	01.03.25	-	40'000'000.000	-	40'000'000.000	39'993'908.00	2.54%
Canton of Ticino	L2	CHF	1.250%	21.10.24	-	50'000'000.000	-	50'000'000.000	50'003'500.00	3.17%
City of La Chaux-de-Fonds	L2	CHF	1.220%	13.03.25	-	15'000'000.000	-	15'000'000.000	15'023'550.00	0.95%
City of La Chaux-de-Fonds	L2	CHF	1.220%	20.03.25	-	10'000'000.000	-	10'000'000.000	10'016'400.00	0.64%
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	-	-	-
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	-	-	-
Luzerner Kantonsspital	L2	CHF	1.880%	22.03.24	-	15'000'000.000	15'000'000.000	-	-	-
QNB Finance Ltd	L1	CHF	1.550%	20.06.25	-	20'000'000.000	-	20'000'000.000	20'059'400.00	1.27%
Reseau Hospitalier Neuchatelois	L2	CHF	1.640%	24.01.25	-	25'000'000.000	-	25'000'000.000	25'010'000.00	1.59%
Schaffhauser Kantonalbank	L2	CHF	1.000%	26.08.25	-	10'000'000.000	-	10'000'000.000	10'000'000.00	0.63%
Schaffhauser Kantonalbank	L2	CHF	1.263%	10.07.25	-	20'000'000.000	-	20'000'000.000	20'021'800.00	1.27%
Stiftung Kantonsspital Graubunden	L2	CHF	1.860%	17.05.24	5'000'000.000	-	20'000'000.000	-	-	-
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	-	-	-
Swiss National Bank Bill	L2	CHF	0.000%	31.03.25	-	25'000'000.000	-	25'000'000.000	24'893'000.00	1.58%
Swissgrid AG	L2	CHF	1.980%	30.04.24	50'000'000.000	-	50'000'000.000	-	-	-
Switzerland Treasury Bill	L2	CHF	0.000%	15.02.24	-	2'300'000.000	2'300'000.000	-	-	-
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	-	-	-
Thurgauer Kantonalbank	L2	CHF	1.670%	12.04.24	-	50'000'000.000	50'000'000.000	-	-	-
UBS AG/London	L2	CHF	2.050%	28.04.24	35'000'000.000	-	35'000'000.000	-	-	-

# In Pools gehaltene Wertschriften

## SIP Liquidity Mgmt CHF Syz AM Pool

Titel	Art. 84 951.312	Währung	% <sup>1</sup>	Maturität Commitment <sup>5</sup>	Nominal per 30.09.2023	Käufe <sup>2</sup>	Verkäufe <sup>3</sup>	Nominal per 30.09.2024	Marktwert CHF	% des Gesamtpool- vermögens <sup>4</sup>
Universitaetsspital Zuerich	L2	CHF	1.680%	29.05.24	-	20'000'000.000	20'000'000.000	-	-	-
Valiant Bank AG	L2	CHF	1.125%	08.07.25	-	20'000'000.000	-	20'000'000.000	20'008'600.00	1.27%
<b>Sichtguthaben</b>									<b>80'700'393.76</b>	<b>5.12%</b>
<b>Sonstige Vermögenswerte</b>									<b>25'586'687.50</b>	<b>1.62%</b>
<b>Gesamtpoolvermögen</b>									<b>1'576'232'019.36</b>	<b>100.00%</b>
<b>./. Andere Verbindlichkeiten</b>									<b>-24'682'241.24</b>	
<b>Total Nettopoolvermögen</b>									<b>1'551'549'778.12</b>	

<sup>1</sup> Bei Investmentfonds die maximale oder applizierte Gebühr.

<sup>2</sup> 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.

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

<sup>4</sup> Allfällige Abweichungen der Prozentzahlen des Gesamtfondsvermögens sind auf Rundungsdifferenzen zurückzuführen.

<sup>5</sup> 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 geregelt, dem Publikum offen stehenden Markt gehandelt werden	L1	1'042'311'085.50	66.13%
b) Anlagen, für die keine Kurse gemäss Buchstabe a verfügbar sind: bewertet aufgrund von am Markt beobachtbaren Parametern	L2	427'633'852.60	27.13%
c) Anlagen, die aufgrund von am Markt nicht beobachtbaren Parametern mit geeigneten Bewertungsmodellen unter Berücksichtigung der aktuellen Marktgegebenheiten bewertet werden.	L3	-	-