

# Jahresbericht

## CS Fund 1

Umbrella-Fonds schweizerischen Rechts der Art  
«Übrige Fonds für traditionelle Anlagen»

**31. Dezember 2023**

**Inhaltsverzeichnis**

|   |     |
|---|-----|
| Verwaltung und Organe                                     | 3   |
| Ungeprüfte Nachhaltigkeitsberichterstattung               | 4   |
| Credit Suisse (CH) Interest & Dividend Focus Yield CHF    | 12  |
| Credit Suisse (CH) Interest & Dividend Focus Balanced CHF | 41  |
| Credit Suisse (CH) Interest & Dividend Focus Growth CHF   | 70  |
| Credit Suisse (CH) Privilege 35 CHF                       | 98  |
| Credit Suisse (CH) Privilege 45 CHF                       | 117 |
| Credit Suisse (CH) Privilege 75 CHF                       | 136 |
| Credit Suisse (CH) Privilege 20 CHF                       | 150 |
| Erläuterungen zum Jahresbericht                           | 164 |
| Bericht der Prüfungsgesellschaft                          | 169 |

## Verwaltung und Organe

### Fondsleitung

Credit Suisse Funds AG, Zürich

### Verwaltungsrat

- Andreas Binder, Präsident (ab 1. März 2023, Mitglied ab 2. November 2022 bis 28. Februar 2023)
- Luca Diener, Vizepräsident
- Patrick Tschumper, Mitglied (ab 1. März 2023, Präsident bis 28. Februar 2023)
- Jürg Roth, Mitglied  
Managing Director, Credit Suisse (Schweiz) AG
- Thomas Vonaesch, Mitglied
- Hans Peter Bär, Mitglied (ab 1. April 2023)

### Geschäftsleitung

- Thomas Schärer, CEO
- Markus Hafner, Mitglied, COO (ab 2. Oktober 2023)
- Hans Christoph Nickl, Mitglied, COO (bis 1. Oktober 2023)
- David Dubach, Mitglied, Oversight & ManCo Services
- Emil Stark, Mitglied, stellvertretender CEO und Leiter Fund Solutions AM
- Gilbert Eyb, Mitglied, Legal
- Ralph Warth, Mitglied, Fund Solutions PLF
- Christian Bieri, Mitglied, Real Estate Fund Management
- Naftali Halonbrenner, Mitglied, Fund Services
- Gabriele Wyss, Mitglied, Compliance
- Marcus Eberlein, Mitglied, Performance & Risk Management

### Depotbank

Credit Suisse (Schweiz) AG, Zürich

### Prüfgesellschaft

PricewaterhouseCoopers AG, Zürich

## Informationen über Dritte

### Übertragung der Anlageentscheide

Die Anlageentscheide aller Teilvermögen sind an die Credit Suisse Asset Management (Schweiz) AG, Zürich, als Vermögensverwalterin übertragen.

### Übertragung weiterer Teilaufgaben

Die Fondsleitung hat verschiedene Teilaufgaben der Fondsadministration an nachfolgende Gruppengesellschaften der UBS Group AG übertragen:

- Credit Suisse AG, Schweiz: Teilaufgaben in den Bereichen Rechts- und Complianceberatung, Facility Management und Management Information System MIS.
- Credit Suisse (Schweiz) AG, Schweiz: Teilaufgaben in den Bereichen Complianceberatung, Personalwesen Collateral Management, IT Dienstleistungen und First Line of Defense Support (FLDS).
- Credit Suisse Asset Management (Schweiz) AG, Schweiz: Real Estate Administration (u.a. Fonds- und Liegenschaftsbuchhaltung, Liegenschaftenverwaltung).
- Credit Suisse Services AG, Schweiz: Teilaufgaben in den Bereichen Complianceberatung, Finanzwesen der Fondsleitung und Steuerberatung.
- Credit Suisse Fund Services (Luxembourg) S.A., Luxembourg: Teilaufgaben im Bereich der Fondsbuchhaltung sowie Unterstützung bei der Überwachung der Anlagevorschriften.
- Credit Suisse (Poland) Sp.z.o.o., Polen: Teilaufgaben in den Bereichen Fondsbuchhaltung, Information Management (u.a. Produkt-Masterdaten, Preis-Publikationen, Factsheet-Produktion, Basisinformationsblatt-Produktion und Erstellen von Reportings), Legal Reporting (Erstellung des Jahresberichts) sowie weitere Supportaufgaben.

Die genaue Ausführung des Auftrages regelt ein zwischen der Fondsleitung und den genannten Gruppengesellschaften abgeschlossener Vertrag. Es besteht die Möglichkeit, den genannten Gruppengesellschaften weitere Teilaufgaben zu übertragen.

## Ungeprüfte Nachhaltigkeitsberichterstattung

Die ESG-Merkmale der Subfonds werden erfüllt durch die Anwendung der im Verkaufsprospekt der Subfonds beschriebenen Richtlinien für nachhaltiges Investieren.

| Ansatz | Beschreibung                             |
|--------|--|
| ☒      | Ausschlüsse                              |
| ☐      | Best-in-Class/ Positive-Screening-Ansatz |

Folgende drei Arten von Ausschlüssen, welche sich laufend weiterentwickeln können, werden vorgenommen:

– **Normen-basierte Ausschlüsse:** Systematischer Ausschluss von Unternehmen, die sich nicht an internationale Verträge über kontroverse Waffen halten, wie z.B. das Übereinkommen über Streumunition, das Chemiewaffenübereinkommen, das Übereinkommen über biologische Waffen und den Vertrag über die Nichtverbreitung von Kernwaffen. Ebenfalls systematisch ausgeschlossen werden Unternehmen mit Umsatz aus einer Geschäftstätigkeit im Bereich von aufgrund ihres militärischen und zivilen Schädigungspotentials kontroverser Waffen (namentlich Nuklearwaffen, biologische und chemische Waffen, Anti-Personen- und Landminen), wobei für reine Support Dienstleistungen und Lieferplattformen für Nuklearwaffen eine Umsatzschwelle von insgesamt 5% gilt.

– **Wertebasierte Ausschlüsse:** Ausschluss von Unternehmen, deren Umsätze in den folgenden Sektoren einen Schwellenwert von 5% überschreiten: konventionelle Waffen und Feuerwaffen, Tabakproduktion, Glücksspiel und Erwachsenenunterhaltung. Ferner gilt eine Umsatzschwelle von 20% für Investitionen in Kohle (Gewinnung und Produktion von Strom) und für Unternehmen, deren Umsätze den Schwellenwert von 20% aus dem Tabakverkauf sowie aus Unterstützungssystemen und Dienstleistungen für konventionelle Waffen überschreiten. Für arktisches Öl und Gas gilt eine Umsatzschwelle von 5% sowie für Ölsande ein Schwellenwert von 10%.

– **Verhaltensbasierte Ausschlüsse:** Unternehmen, die (1) systematisch gegen internationale Normen (namentlich die Grundsätze des Global Compact der Vereinten Nationen (UNGC)) verstossen, (2) bei denen die Verstöße besonders schwerwiegend sind oder (3) bei denen die Geschäftsführung nicht bereit ist, notwendige Reformen umzusetzen, werden auf eine Beobachtungsliste gesetzt und können aus dem firmenweiten Anlageuniversum ausgeschlossen werden. Ausschlüsse werden als letztes Mittel in Betracht gezogen. Der Diskurs mit Unternehmen, in welche investiert wird, ist als geeigneteres Mittel für eine mögliche Verhinderung zukünftiger Verstöße anzusehen. Bei Unternehmen, die in der Lage und willens sind, Massnahmen zu ergreifen, kann die Credit Suisse im Rahmen eines längeren Engagements mit der Geschäftsführung dieses Unternehmens Ziele und Fristen für Verbesserungen vereinbaren. Unternehmen in Geschäftsfeldern mit erhöhten Umwelt- und sozialen Risiken werden verstärkt überwacht. Kontroverses Geschäftsgebaren wird aufgrund eines systematischen Prozesses identifiziert und beurteilt, wobei die Analyse fallweise aufgrund eigener Recherche und gestützt auf von spezialisierten Anbietern wie z. B. MSCI bezogenen ESG-Daten erfolgt..

| Ansatz | Beschreibung    |
|--------|-----------------|
| ☒      | ESG Integration |

Für Beteiligungswertpapiere und -wertrechte sowie festverzinsliche Forderungswertpapiere und -wertrechte innerhalb von Multi-Asset Portfolios erfolgt die Integration von ESG-Faktoren in den Anlageprozess in folgenden Schritten:

- **Definition wesentlicher ESG-Faktoren:** Der Vermögensverwalter hat zum Vergleich von Anlagen in einem gemischten Anlageuniversum anhand von Materiality Frameworks externer Anbieter, wie z.B. MSCI ESG Research LLC, wesentliche ESG-Faktoren bestimmt. Für Direktinvestitionen stützt er sich auf ESG-Gesamtbewertungen dieser externen Anbieter, welche die für jeden Sektor bzw. Branche jeweils relevanten wesentlichen ESG-Faktoren berücksichtigen. Diese wesentlichen ESG-Faktoren können sich im Laufe der Zeit ändern. Anlagen in Anteile oder Aktien anderer kollektiver Kapitalanlagen werden einem Due-Diligence-Prozess mit Bezug auf die Berücksichtigung von ESG-Faktoren unterzogen und klassifiziert entweder als Zielfonds ohne Berücksichtigung von ESG-Faktoren oder mit Ausschlusskriterien, mit einer Integration von ESG-Faktoren in den Anlageprozess, mit einem nachhaltigen Thema oder als Impact Investment. Dabei wird ein proprietäres Klassifikations-Modell angewendet, bei dem der Grad der Umsetzung der vom Vermögensverwalter bei Direktanlagen selbst angewendeten Nachhaltigkeitsansätze im betreffenden Zielfonds gemessen wird.
- **ESG Portfolioanalyse:** Der Vermögensverwalter führt für das ganze Anlageuniversum eines ESG-Teilvermögens bei Direktanlagen hinsichtlich der jeweils anwendbaren wesentlichen ESG-Faktoren und bei Zielfondsanlagen entsprechend ihrer Klassifizierung eine Analyse durch, bei welchem er sich auf ESG-Ratings spezialisierter externer Anbieter, wie z.B. MSCI ESG Research LLC, stützt. Der Research kann auch ESG-relevante Nachrichten, ESG-Ratings und ESG-Bewertungen, ESG-Kontroversen und ESG-Trends einbeziehen.
- **Titelselektion und Portfoliokonstruktion:** Die Titelselektion und die Portfoliokonstruktion unter Berücksichtigung von ESG-Faktoren hängt von der zugrunde liegenden Anlageklasse und dem Marktsegment ab und besteht aus einer Kombination gemischter Anlagen:
  - Bei Direktanlagen in Beteiligungswertpapiere und -wertrechte und festverzinsliche Forderungswertpapiere und -wertrechte wird die Integration von ESG-Faktoren sichergestellt, indem entweder das Anlageuniversum durch einen ESG-Index eingeschränkt wird, nachhaltige Wertpapiere aufgrund eines Vergleichs hinsichtlich der wesentlichen ESG-Faktoren (Positive Screening) ausgewählt werden (z.B. grüne/soziale/nachhaltige Anleihen) oder einzelne Titel hinsichtlich ihrer ESG-Faktoren auch unter Verwendung von integriertem Research evaluiert werden. Integriertes Research ist eine Ergänzung des traditionellen Research, welches insbesondere das Geschäftsmodell, die Eigentümerstruktur, die Finanzkennzahlen und die Bewertung von Unternehmen umfasst, mit gewissen finanzrelevanten ESG-Informationen aus eigenen Datenquellen oder von externen Daten-anbietern, um Erkenntnisse zu ESG-Faktoren systematisch zu erweitern.
  - Bei Anlagen in Anteile oder Aktien anderer kollektiver Kapital-anlagen (Zielfonds) kann nur ein gemäss jeweiligem Anlageziel festgelegter Teil des Vermögens des ESG-Teilvermögens in Zielfonds mit einer Klassifizierung als Zielfonds ohne Integration von ESG-Faktoren investiert werden.
  - Bei anderen Anlageklassen und besonderen Anlagestrategien werden ESG-Faktoren nach Verfügbarkeit einbezogen.
- **Portfolioüberwachung:** Der Vermögensverwalter überwacht die ESG-Faktoren periodisch mit Hilfe seines Portfoliomanagement-Systems, um wesentliche Änderungen der ESG-Faktoren einzelner Titel im Portfolio zu erkennen, und das Portfolio im Hinblick auf eine Erhöhung oder Reduktion von Positionen regelmässig neu zu bewerten.

| Ansatz                              | Beschreibung   |
|-------------------------------------|--|
| <input type="checkbox"/>            | Thematische Anlagen  |
| <input type="checkbox"/>            | Impact Investing   |
| <input checked="" type="checkbox"/> | Stewardship (Active ownership)   |
|                                     | <p><b>Stimmrechtsausübung (Voting):</b> Der Vermögensverwalter betrachtet die Vertretung bei Gesellschafterversammlungen und Ausübung von Stimmrechten (Proxy Voting) als zentrales Element seiner Stewardship Verantwortung für ESG-Teilvermögen. Die Stimmrechtsausübung dient zur Eskalation von Problemen, zur Äusserung von Bedenken und zur Geltendmachung eigener Ansichten zu ESG. Um fundierte Entscheidungen in Abstimmungen zu ermöglichen, stützt sich der Vermögensverwalter jeweils auf mehrere Informationsquellen. Um Stimmrechte bei möglichst vielen Unternehmen, in welche investiert wird, wahrnehmen zu können, kann der Vermögensverwalter auch die Dienste von externen Stimmrechtsberatern in Anspruch nehmen. Stimmempfehlungen von solchen Stimmrechtsberatern können auch internes Research des Vermögensverwalters im Entscheidungsprozess zu einzelnen Abstimmungsthemen ergänzen. Für eine wirkungsvolle und effiziente Stimmrechtsausübung kann der Vermögensverwalter diese auch auf gemäss interner Weisung («Proxy voting - Approach and policy summary») als wesentlich eingestufte Investitionen fokussieren.</p> <p><b>Engagement:</b> Beobachtung der Unternehmen, in welche investiert wird, mit Blick auf die Möglichkeiten mit diesen proaktiv einen konstruktiven Dialog über ESG-Probleme aufzubauen und zu pflegen (z.B. mit dem Verwaltungsrat, Mitgliedern der Geschäftsführung oder Investor Relations). Themen, welche im Rahmen dieses Engagements berücksichtigt werden können, sind z.B. die Geschäftsstrategie und deren Umsetzung, das Risikomanagement, ökologische und soziale Belange, Aspekte der Corporate Governance (u.a. Zusammensetzung des Kontrollorgans, Wahl unabhängiger Verwaltungsräte oder Vergütungspolitik für Führungskräften), die Compliance, Kultur und Ethik sowie die Performance und Kapitalstruktur der Unternehmen. Weiter kann der Vermögensverwalter seine Positionen in den einzelnen Unternehmen, in welche investiert wird, auch anlässlich regelmässig stattfindender Investment-Meetings überprüfen;</p> |
| <input type="checkbox"/>            | Klima-Ausrichtung  |
| <input type="checkbox"/>            | Sonstiges  |

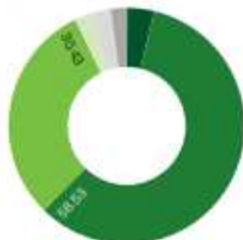
Bis maximal 20% der Teilvermögen können in Anlagen investiert werden, welche den Nachhaltigkeitsvorgaben gemäss den vorgenannten Nachhaltigkeitsansätzen nicht entsprechen.

### ESG-Ergebnisse (quantitative und qualitative Beschreibungen)

- Die **Ausschlüsse** wurden dadurch erfüllt, dass keine Investitionen in Wertschriften erfolgt sind, welche die Ausschlusskriterien oder Umsatzschwellen wie im Prospekt festgelegt verletzt haben.
- Die untenstehende Aufschlüsselung der proprietären Nachhaltigkeitsklassifizierung der Credit Suisse ist eine Momentaufnahme der im Portfolio der Subfonds enthalten Anlagen per 31.12.2023. Sie stellt keinen Durchschnitt für den Berichtszeitraum dar und ist für keinen anderen Tag des Geschäftsjahres repräsentativ für das Rating des Portfolios. Sie stellt eine Komponente der ESG-Wertpapieranalyse dar, die vom Anlageverwalter zum Zweck des Portfolioaufbaus angewendet wird. Daher vermittelt die nachstehende Bewertung kein vollständiges Bild davon, wie die CS-Politik für nachhaltiges Investieren für diesen spezifischen Subfonds konkret umgesetzt wird. Nachstehende Ergebnisse sind auf einer Lookthrough Basis und beinhalten sowohl die Direktanlagen wie die Wertschriften, die in Kollektivanlagen gehalten werden.

### Credit Suisse (CH) Interest & Dividend Focus Yield CHF

**Vermögensstruktur**  
Nach Anlageklasse in % des ökonomischen Exposures



- Liquide Anlagen: 3.76
- Obligationen: 58.53
- Aktien: 30.43
- Hedge Funds: 2.33
- MLPs: 2.66
- Immobilienanlagen: 2.27

### Aufschlüsselung der Vermögenswerte nach firmeneigenen ESG-Signalen für festverzinsliche Wertpapiere

Gemäss der firmeneigenen Methodik von CSAM in Prozent des gesamten wirtschaftlichen Exposures des Fonds aus festverzinslichen Anlagen.

| ESG-Signal    | in %  | Portfolio                          |
|---------------|-------|------------------------------------|
| Positiv       | 11.77 | <div style="width: 11.77%;"></div> |
| Neutral       | 39.15 | <div style="width: 39.15%;"></div> |
| Negativ       | 0.24  | <div style="width: 0.24%;"></div>  |
| Nicht gerated | 8.51  | <div style="width: 8.51%;"></div>  |

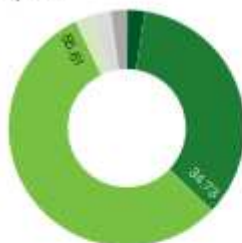
### Vermögensstruktur nach ESG Rating

In Prozent des wirtschaftlichen Gesamtexposure des Fonds aus Aktienanlagen. Quelle: MSCI-ESG-Rating

| ESG-Rating           | in %  | Portfolio                          |
|----------------------|-------|------------------------------------|
| AAA                  | 6.66  | <div style="width: 6.66%;"></div>  |
| AA                   | 11.37 | <div style="width: 11.37%;"></div> |
| A                    | 9.01  | <div style="width: 9.01%;"></div>  |
| BBB                  | 1.53  | <div style="width: 1.53%;"></div>  |
| BB                   | 1.48  | <div style="width: 1.48%;"></div>  |
| B                    | 0.14  | <div style="width: 0.14%;"></div>  |
| CCC                  | 0.04  | <div style="width: 0.04%;"></div>  |
| Nicht bewertbar      | -     |                                    |
| Keine Datenabdeckung | 0.09  | <div style="width: 0.09%;"></div>  |

### Credit Suisse (CH) Interest & Dividend Focus Balanced CHF

**Vermögensstruktur**  
Nach Anlageklasse in % des ökonomischen Exposures



- Liquide Anlagen: 3.44
- Obligationen: 34.73
- Aktien: 55.61
- Hedge Funds: 2.32
- MLPs: 2.66
- Immobilienanlagen: 2.24

### Aufschlüsselung der Vermögenswerte nach firmeneigenen ESG-Signalen für festverzinsliche Wertpapiere

Gemäss der firmeneigenen Methodik von CSAM in Prozent des gesamten wirtschaftlichen Exposures des Fonds aus festverzinslichen Anlagen.

| ESG-Signal    | in %  | Portfolio                          |
|---------------|-------|------------------------------------|
| Positiv       | 7.20  | <div style="width: 7.20%;"></div>  |
| Neutral       | 22.97 | <div style="width: 22.97%;"></div> |
| Negativ       | 0.14  | <div style="width: 0.14%;"></div>  |
| Nicht gerated | 5.57  | <div style="width: 5.57%;"></div>  |

### Vermögensstruktur nach ESG Rating

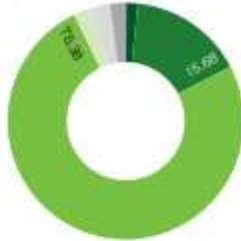
In Prozent des wirtschaftlichen Gesamtexposure des Fonds aus Aktienanlagen. Quelle: MSCI-ESG-Rating

| ESG-Rating           | in %  | Portfolio                          |
|----------------------|-------|------------------------------------|
| AAA                  | 12.31 | <div style="width: 12.31%;"></div> |
| AA                   | 21.12 | <div style="width: 21.12%;"></div> |
| A                    | 16.21 | <div style="width: 16.21%;"></div> |
| BBB                  | 2.82  | <div style="width: 2.82%;"></div>  |
| BB                   | 2.53  | <div style="width: 2.53%;"></div>  |
| B                    | 0.23  | <div style="width: 0.23%;"></div>  |
| CCC                  | 0.07  | <div style="width: 0.07%;"></div>  |
| Nicht bewertbar      | -     |                                    |
| Keine Datenabdeckung | 0.15  | <div style="width: 0.15%;"></div>  |

**Credit Suisse (CH) Interest & Dividend Focus Growth CHF**

**Vermögensstruktur**

Nach Anlageklasse in % des ökonomischen Exposures



- Liquide Anlagen: 1.67
- Obligationen: 15.68
- Aktien: 75.38
- Hedge Fonds: 2.32
- MLPs: 2.73
- Immobilienanlagen: 2.23

**Aufschlüsselung der Vermögenswerte nach firmeneigenen ESG-Signalen für festverzinsliche Wertpapiere**

**Wertpapiere**

Gemäss der firmeneigenen Methodik von CSAM in Prozent des gesamten wirtschaftlichen Exposures des Fonds aus festverzinslichen Anlagen.

| ESG-Signal    | in %  | Portfolio |
|---------------|-------|-----------|
| Positiv       | 3.64  | [Bar]     |
| Neutral       | 10.24 | [Bar]     |
| Negativ       | 0.05  | [Bar]     |
| Nicht gerated | 2.73  | [Bar]     |

**Vermögensstruktur nach ESG Rating**

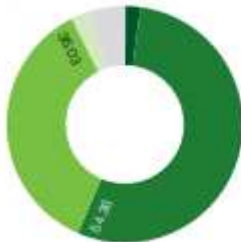
In Prozent des wirtschaftlichen Gesamtexposure des Fonds aus Aktienanlagen. Quelle: MSCI-ESG-Rating

| ESG Rating           | in %  | Portfolio |
|----------------------|-------|-----------|
| AAA                  | 16.65 | [Bar]     |
| AA                   | 26.24 | [Bar]     |
| A                    | 22.24 | [Bar]     |
| BBB                  | 4.10  | [Bar]     |
| BB                   | 3.33  | [Bar]     |
| B                    | 0.30  | [Bar]     |
| CCC                  | 0.09  | [Bar]     |
| Nicht bewertbar      | -     | [Bar]     |
| Keine Datenabdeckung | 0.19  | [Bar]     |

**Credit Suisse (CH) Privilege 35 CHF**

**Vermögensstruktur**

Nach Anlageklasse in % des ökonomischen Exposures



- Liquide Anlagen: 2.11
- Obligationen: 54.36
- Aktien: 36.03
- Hedge Fonds: 2.37
- Immobilienanlagen: 5.14

**Aufschlüsselung der Vermögenswerte nach firmeneigenen ESG-Signalen für festverzinsliche Wertpapiere**

**Wertpapiere**

Gemäss der firmeneigenen Methodik von CSAM in Prozent des gesamten wirtschaftlichen Exposures des Fonds aus festverzinslichen Anlagen.

| ESG-Signal    | in %  | Portfolio |
|---------------|-------|-----------|
| Positiv       | 33.96 | [Bar]     |
| Neutral       | 21.36 | [Bar]     |
| Negativ       | -     | [Bar]     |
| Nicht gerated | 0.28  | [Bar]     |

**Vermögensstruktur nach ESG Rating**

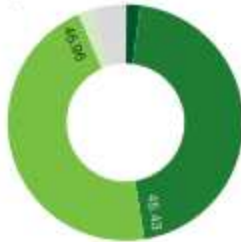
In Prozent des wirtschaftlichen Gesamtexposure des Fonds aus Aktienanlagen. Quelle: MSCI-ESG-Rating

| ESG Rating           | in %  | Portfolio |
|----------------------|-------|-----------|
| AAA                  | 9.31  | [Bar]     |
| AA                   | 13.06 | [Bar]     |
| A                    | 11.18 | [Bar]     |
| BBB                  | 1.48  | [Bar]     |
| BB                   | 0.46  | [Bar]     |
| B                    | 0.02  | [Bar]     |
| CCC                  | 0.01  | [Bar]     |
| Nicht bewertbar      | -     | [Bar]     |
| Keine Datenabdeckung | 0.01  | [Bar]     |



Credit Suisse (CH) Privilege 45 CHF

**Vermögensstruktur**  
Nach Anlageklasse in % des ökonomischen Exposures



- Liquide Anlagen: 1.57
- Obligationen: 45.43
- Aktien: 45.96
- Hedge Funds: 1.84
- Immobilienanlagen: 4.80

**Aufschlüsselung der Vermögenswerte nach firmeneigenen ESG-Signalen für festverzinsliche Wertpapiere**

Gemäss der firmeneigenen Methodik von CSAM in Prozent des gesamten wirtschaftlichen Exposures des Fonds aus festverzinslichen Anlagen.

|               | in %  | Portfolio                          |
|---------------|-------|------------------------------------|
| Positiv       | 22.49 | <div style="width: 22.49%;"></div> |
| Neutral       | 23.49 | <div style="width: 23.49%;"></div> |
| Negativ       | 0.11  | <div style="width: 0.11%;"></div>  |
| Nicht gerated | 0.30  | <div style="width: 0.30%;"></div>  |

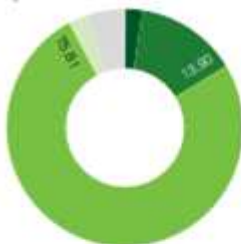
**Vermögensstruktur nach ESG Rating**

In Prozent des wirtschaftlichen Gesamtexposures des Fonds aus Aktienanlagen. Quelle: MSCI-ESG-Rating

|                      | in %  | Portfolio                          |
|----------------------|-------|------------------------------------|
| AAA                  | 11.90 | <div style="width: 11.90%;"></div> |
| AA                   | 16.80 | <div style="width: 16.80%;"></div> |
| A                    | 14.10 | <div style="width: 14.10%;"></div> |
| BBB                  | 1.85  | <div style="width: 1.85%;"></div>  |
| BB                   | 0.59  | <div style="width: 0.59%;"></div>  |
| B                    | 0.02  | <div style="width: 0.02%;"></div>  |
| CCC                  | 0.01  | <div style="width: 0.01%;"></div>  |
| Nicht bewertbar      | -     |                                    |
| Keine Datenabdeckung | 0.01  | <div style="width: 0.01%;"></div>  |

Credit Suisse (CH) Privilege 75 CHF

**Vermögensstruktur**  
Nach Anlageklasse in % des ökonomischen Exposures



- Liquide Anlagen: 2.38
- Obligationen: 13.30
- Aktien: 75.81
- Hedge Funds: 2.02
- Immobilienanlagen: 5.29

**Aufschlüsselung der Vermögenswerte nach firmeneigenen ESG-Signalen für festverzinsliche Wertpapiere**

Gemäss der firmeneigenen Methodik von CSAM in Prozent des gesamten wirtschaftlichen Exposures des Fonds aus festverzinslichen Anlagen.

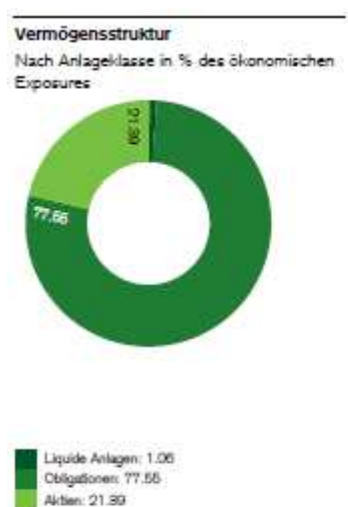
|               | in % | Portfolio                         |
|---------------|------|-----------------------------------|
| Positiv       | 6.86 | <div style="width: 6.86%;"></div> |
| Neutral       | 8.16 | <div style="width: 8.16%;"></div> |
| Negativ       | 0.05 | <div style="width: 0.05%;"></div> |
| Nicht gerated | 0.20 | <div style="width: 0.20%;"></div> |

**Vermögensstruktur nach ESG Rating**

In Prozent des wirtschaftlichen Gesamtexposures des Fonds aus Aktienanlagen. Quelle: MSCI-ESG-Rating

|                      | in %  | Portfolio                          |
|----------------------|-------|------------------------------------|
| AAA                  | 19.68 | <div style="width: 19.68%;"></div> |
| AA                   | 27.69 | <div style="width: 27.69%;"></div> |
| A                    | 23.15 | <div style="width: 23.15%;"></div> |
| BBB                  | 3.06  | <div style="width: 3.06%;"></div>  |
| BB                   | 1.04  | <div style="width: 1.04%;"></div>  |
| B                    | 0.04  | <div style="width: 0.04%;"></div>  |
| CCC                  | 0.01  | <div style="width: 0.01%;"></div>  |
| Nicht bewertbar      | -     |                                    |
| Keine Datenabdeckung | 0.01  | <div style="width: 0.01%;"></div>  |

## Credit Suisse (CH) Privilege 20 CHF



### Aufschlüsselung der Vermögenswerte nach firmeneigenen ESG-Signalen für festverzinsliche Wertpapiere

Gemäss der firmeneigenen Methodik von CSAM in Prozent des gesamten wirtschaftlichen Exposures des Fonds aus festverzinslichen Anlagen.

|               | in %  | Portfolio |
|---------------|-------|-----------|
| Positiv       | 42.02 |           |
| Neutral       | 34.53 |           |
| Negativ       | 0.54  |           |
| Nicht gerated | 0.46  |           |

### Vermögensstruktur nach ESG Rating

In Prozent des wirtschaftlichen Gesamtexposures des Fonds aus Aktienanlagen. Quelle: MSCI-ESG-Rating

|                 | in % | Portfolio |
|-----------------|------|-----------|
| AAA             | 5.25 |           |
| AA              | 7.92 |           |
| A               | 7.69 |           |
| BBB             | 0.40 |           |
| BB              | 0.13 |           |
| B               | -    |           |
| CCC             | -    |           |
| Nicht bewertbar | -    |           |

Die **firmeneigenen ESG-Signale** werden gemäss Fondsvertrag im ESG-Integrationsansatz des Asset Managers für festverzinsliche Wertpapiere verwendet. Zum Zwecke des Risikomanagements integriert der Anlageverwalter ESG-Faktoren in die Wertpapieranalyse, um eine firmeneigene Kaskade zu entwickeln, die ESG-Ratings mehrerer Datenanbieter kombiniert. Als externe Datenquellen werden MSCI, Sustainalytics, Inrate, Clarity AI und Refinitiv herangezogen. Das Rating kann ein «positives», «neutrales» oder «negatives» ESG-Signal liefern. Wenn die externen Anbieter die erforderlichen Daten zum Emittenten nicht zur Verfügung stellen, kann das ESG-Signal nicht ermittelt werden. Diese Anlagen fallen dann unter die Kategorie «ohne Rating». Die vom Anlageverwalter angewandte firmeneigene Methodik unterliegt keiner Zusicherung seitens Dritter.

Die von **MSCI ESG bereitgestellten Unternehmens- und Länder-ESG-Ratings** werden anhand einer Skala von AAA (höchstes Rating) bis CCC (niedrigstes Rating) gemessen. Unternehmens-ESG-Ratings basieren auf dem Exposure des Emittenten gegenüber branchenspezifischen ESG-Risiken und seiner Fähigkeit, diese Risiken im Vergleich zu den Mitbewerbern zu mindern. Weitere Informationen zur MSCI-Methodik finden Sie unter [www.msci.com/our-solutions/esg-investing/](http://www.msci.com/our-solutions/esg-investing/).

Weitere Informationen über die vorliegenden ESG-Offenlegungen finden Sie in den ESG-Erläuterungen weiter unten.

- Die **Stimmrechtsausübung** erfolgt für alle berechtigten Fonds, die durch den Vermögensverwalter gemanaged werden, nach einer Proxy Voting Policy. Eine Zusammenfassung in Form des Active Ownership Reports ist auf dem Internet verfügbar (Link siehe unten). Das **Engagement** erfolgt übergreifend für alle berechtigten Fonds, die durch den Vermögensverwalter gemanaged werden. Nach Analyse des Asset Managers werden Firmen, bei denen ein Engagement Impact generiert, ausgewählt. Ein direkten Wirkungszusammenhang zu einem spezifischen Fonds gibt es nicht, da die Auswahl der Firmen nicht auf spezifischen Portfolios beruht. Über die Engagement-aktivitäten wird in einem jährlichen Report berichtet, der auf dem Internet verfügbar ist. Die jeweils aktuellen Berichte finden Sie auf: [Active Ownership | Credit Suisse Asset Management \(credit-suisse.com\)](https://www.credit-suisse.com/active-ownership).

Zu ergänzen ist, dass im Fall von Investitionen in Zielfonds die Stimmrechtsausübung und das Engagement nur dann möglich sind, wenn der Zielfonds ebenfalls durch den Vermögensverwalter gemanaged wird.

## ESG-Erläuterungen

Die in diesem Abschnitt enthaltenen Zahlen sind nicht geprüft. Bei Informationen, Aussagen und Wertungen in Bezug auf Umwelt, Soziales und Unternehmensführung ("ESG") in diesem Bericht kann sich CS teilweise oder vollständig auf öffentlich zugängliche Informationen, intern entwickelte Daten und/oder aus externen Quellen bezogene Informationen stützen, die CS für zuverlässig hält. Die Fähigkeit von CS, solche Ziele zu überprüfen, kann durch die Zuverlässigkeit der verfügbaren Daten über die zugrunde liegenden Vermögenswerte und den Status der Bestimmungen bezüglich des Verfolgens und Bereitstellens solcher Daten begrenzt sein. CS hat die aus diesen öffentlich zugänglichen Quellen oder von Dritten bezogenen Informationen nicht unabhängig überprüft und kann keine Zusicherungen oder Garantien bezüglich ihrer Richtigkeit, Vollständigkeit und Zuverlässigkeit abgeben. Es besteht die Möglichkeit, dass Daten von ESG-Datenanbietern nicht korrekt, nicht verfügbar oder nicht vollständig aktuell sind. Dies gilt insbesondere, wenn CS nur begrenzten Zugang zu Daten von externen Parteien bezüglich der einer Anlage zugrunde liegenden Elemente hat, beispielsweise aufgrund des Mangels an Look-through-Daten. Eine solche Datenlücke könnte zu einer falschen Bewertung einer Nachhaltigkeitspraxis und/oder damit verbundener Nachhaltigkeitsrisiken und -chancen führen. CS kann keine Garantien zum Inhalt oder zur Vollständigkeit solcher ESG-Offenlegungen geben, die sich ändern können und nicht als verlässliche Quelle herangezogen werden können. CS haftet insbesondere nicht für Fehler oder Auslassungen im Zusammenhang mit hierin enthaltenen ESG-Daten oder für irgendwelche direkten oder indirekten Schäden, Folge- oder Sonderschäden, Schadenersatzforderungen mit Strafcharakter oder sonstige Schäden (einschliesslich entgangenen Gewinns).

Nachhaltigkeitsbezogene Praktiken unterscheiden sich zudem nach Region, Branche und ESG-Themen und entwickeln sich ständig weiter. Folglich können sich nachhaltigkeitsbezogene Praktiken im Laufe der Zeit ändern. Ebenso können neue lokale Nachhaltigkeitsanforderungen zu zusätzlichen Compliance-Kosten, Offenlegungspflichten oder sonstigen Einschränkungen für den Subfonds führen. Auch die Einschätzung der geeigneten Klassifikation durch CS kann sich im Laufe der Zeit ändern, unter anderem in Reaktion auf aufsichtsrechtliche Vorgaben oder die Änderung des branchenspezifischen Ansatzes der Klassifikation. Eine Änderung an der massgebenden Klassifikation kann weitere Massnahmen erforderlich machen, z. B. weitere Offenlegungen oder neue Prozesse für die Erfassung von Daten, was zu zusätzlichen Kosten führen kann.

Keine der ESG-Parteien haftet in irgendeiner Weise für Fehler oder Auslassungen im Zusammenhang mit hierin enthaltenen Daten oder für irgendwelche direkten oder indirekten Schäden, Folge- oder Sonderschäden, Schadenersatzforderungen mit Strafcharakter oder sonstige Schäden (einschliesslich entgangenen Gewinns), auch wenn sie auf die Möglichkeit solcher Schäden hingewiesen wurden.

## Kurze Übersicht

| Kennzahlen                            | Währung | 31.12.2023 | 31.12.2022 | 31.12.2021 |
|---------------------------------------|---------|------------|------------|------------|
| <b>Konsolidierung</b>                 |         |            |            |            |
| Nettofondsvermögen in Mio.            | CHF     | 518.87     | 630.30     | 809.07     |
| <b>Anteilklasse A</b>                 |         |            |            |            |
| Nettofondsvermögen in Mio.            | CHF     | 77.97      | 95.33      | 123.70     |
| Inventarwert pro Anteil               | CHF     | -          | -          | 826.96     |
| Inventarwert pro Anteil (Swung NAV)   | CHF     | 710.73     | 716.82     | -          |
| Inventarwert pro Anteil (Unswung NAV) | CHF     | 711.70     | 718.61     | -          |
| <b>Anteilklasse AH EUR</b>            |         |            |            |            |
| Nettofondsvermögen in Mio.            | CHF     | 13.60      | 16.81      | 21.59      |
| Inventarwert pro Anteil               | EUR     | -          | -          | 108.49     |
| Inventarwert pro Anteil (Swung NAV)   | EUR     | 95.48      | 94.45      | -          |
| Inventarwert pro Anteil (Unswung NAV) | EUR     | 95.61      | 94.68      | -          |
| <b>Anteilklasse B</b>                 |         |            |            |            |
| Nettofondsvermögen in Mio.            | CHF     | 12.54      | 15.50      | 18.31      |
| Inventarwert pro Anteil               | CHF     | -          | -          | 113.15     |
| Inventarwert pro Anteil (Swung NAV)   | CHF     | 101.77     | 100.52     | -          |
| Inventarwert pro Anteil (Unswung NAV) | CHF     | 101.91     | 100.77     | -          |
| <b>Anteilklasse BH EUR</b>            |         |            |            |            |
| Nettofondsvermögen in Mio.            | CHF     | 0.99       | 1.25       | 2.15       |
| Inventarwert pro Anteil               | EUR     | -          | -          | 111.92     |
| Inventarwert pro Anteil (Swung NAV)   | EUR     | 102.97     | 99.72      | -          |
| Inventarwert pro Anteil (Unswung NAV) | EUR     | 103.11     | 99.97      | -          |
| <b>Anteilklasse IA</b>                |         |            |            |            |
| Nettofondsvermögen in Mio.            | CHF     | -          | 9.13       | 10.47      |
| Inventarwert pro Anteil               | CHF     | -          | -          | 968.49     |
| Inventarwert pro Anteil (Swung NAV)   | CHF     | -          | 843.12     | -          |
| Inventarwert pro Anteil (Unswung NAV) | CHF     | -          | 845.23     | -          |
| <b>Anteilklasse UA</b>                |         |            |            |            |
| Nettofondsvermögen in Mio.            | CHF     | 349.96     | 414.33     | 532.17     |
| Inventarwert pro Anteil               | CHF     | -          | -          | 98.31      |
| Inventarwert pro Anteil (Swung NAV)   | CHF     | 84.47      | 85.23      | -          |
| Inventarwert pro Anteil (Unswung NAV) | CHF     | 84.59      | 85.44      | -          |
| <b>Anteilklasse UAH EUR</b>           |         |            |            |            |
| Nettofondsvermögen in Mio.            | CHF     | 14.31      | 18.14      | 23.56      |
| Inventarwert pro Anteil               | EUR     | -          | -          | 109.19     |
| Inventarwert pro Anteil (Swung NAV)   | EUR     | 96.33      | 95.29      | -          |
| Inventarwert pro Anteil (Unswung NAV) | EUR     | 96.46      | 95.53      | -          |
| <b>Anteilklasse UB</b>                |         |            |            |            |
| Nettofondsvermögen in Mio.            | CHF     | 47.00      | 56.13      | 72.10      |
| Inventarwert pro Anteil               | CHF     | -          | -          | 108.82     |
| Inventarwert pro Anteil (Swung NAV)   | CHF     | 98.20      | 96.83      | -          |
| Inventarwert pro Anteil (Unswung NAV) | CHF     | 98.33      | 97.08      | -          |
| <b>Anteilklasse UBH EUR</b>           |         |            |            |            |
| Nettofondsvermögen in Mio.            | CHF     | 2.50       | 3.69       | 5.03       |
| Inventarwert pro Anteil               | EUR     | -          | -          | 112.72     |
| Inventarwert pro Anteil (Swung NAV)   | EUR     | 104.03     | 100.59     | -          |
| Inventarwert pro Anteil (Unswung NAV) | EUR     | 104.17     | 100.84     | -          |

## Verwendung des Erfolges

### Ausschüttung pro Anteil

#### 1. Für in der Schweiz domizilierte Anteilinhaber

Für im Ausland domizilierte Anteilinhaber, ohne Bankenerklärung

| Ausschüttung 2023                         |            | Anteilklasse A |            | Anteilklasse AH EUR |
|---|------------|----------------|------------|---------------------|
| Bruttoausschüttung aus Ertrag             | CHF        | 24.060         | EUR        | 3.260               |
| ./. 35% Eidgenössische Verrechnungssteuer | CHF        | 8.421          | EUR        | 1.141               |
| <b>Nettoausschüttung aus Ertrag</b>       | <b>CHF</b> | <b>15.639</b>  | <b>EUR</b> | <b>2.119</b>        |

#### 2. Für im Ausland domizilierte Anteilinhaber, mit Bankenerklärung

| Ausschüttung 2023                   |            | Anteilklasse A |            | Anteilklasse AH EUR |
|-------------------------------------|------------|----------------|------------|---------------------|
| Bruttoausschüttung aus Ertrag       | CHF        | 24.060         | EUR        | 3.260               |
| <b>Nettoausschüttung aus Ertrag</b> | <b>CHF</b> | <b>24.060</b>  | <b>EUR</b> | <b>3.260</b>        |
| <b>Coupon Nr. Ertrag</b>            |            | <b>30</b>      |            | <b>11</b>           |

#### 3. Für in der Schweiz und im Ausland domizilierte Anteilinhaber (verrechnungssteuerbefreite Erträge aus direktem Immobilienbesitz)

| Ausschüttung 2023                   |            | Anteilklasse A |            | Anteilklasse AH EUR |
|-------------------------------------|------------|----------------|------------|---------------------|
| Bruttoausschüttung aus Ertrag       | CHF        | 0.070          | EUR        | 0.010               |
| <b>Nettoausschüttung aus Ertrag</b> | <b>CHF</b> | <b>0.070</b>   | <b>EUR</b> | <b>0.010</b>        |
| <b>Coupon Nr. Ertrag</b>            |            | <b>31</b>      |            | <b>12</b>           |

#### 4. Für in der Schweiz und im Ausland domizilierte Anteilinhaber

| Ausschüttung 2023                    |            | Anteilklasse A |            | Anteilklasse AH EUR |
|--------------------------------------|------------|----------------|------------|---------------------|
| <b>Kapitalrückzahlung</b>            | <b>CHF</b> | <b>0.750</b>   | <b>EUR</b> | <b>0.080</b>        |
| <b>Coupon Nr. Kapitalrückzahlung</b> |            | <b>32</b>      |            | <b>13</b>           |

Zahlbar ab 15.02.2024 bei der CREDIT SUISSE (SCHWEIZ) AG und deren sämtlichen Geschäftsstellen in der Schweiz.

#### 1. Für in der Schweiz domizilierte Anteilinhaber

Für im Ausland domizilierte Anteilinhaber, ohne Bankenerklärung

| Ausschüttung 2023                         |            | Anteilklasse UA |            | Anteilklasse UAH EUR |
|---|------------|-----------------|------------|----------------------|
| Bruttoausschüttung aus Ertrag             | CHF        | 2.960           | EUR        | 3.380                |
| ./. 35% Eidgenössische Verrechnungssteuer | CHF        | 1.036           | EUR        | 1.183                |
| <b>Nettoausschüttung aus Ertrag</b>       | <b>CHF</b> | <b>1.924</b>    | <b>EUR</b> | <b>2.197</b>         |

#### 2. Für im Ausland domizilierte Anteilinhaber, mit Bankenerklärung

| Ausschüttung 2023                   |            | Anteilklasse UA |            | Anteilklasse UAH EUR |
|-------------------------------------|------------|-----------------|------------|----------------------|
| Bruttoausschüttung aus Ertrag       | CHF        | 2.960           | EUR        | 3.380                |
| <b>Nettoausschüttung aus Ertrag</b> | <b>CHF</b> | <b>2.960</b>    | <b>EUR</b> | <b>3.380</b>         |
| <b>Coupon Nr. Ertrag</b>            |            | <b>20</b>       |            | <b>10</b>            |

#### 3. Für in der Schweiz und im Ausland domizilierte Anteilinhaber (verrechnungssteuerbefreite Erträge aus direktem Immobilienbesitz)

| Ausschüttung 2023                   |            | Anteilklasse UA |            | Anteilklasse UAH EUR |
|-------------------------------------|------------|-----------------|------------|----------------------|
| Bruttoausschüttung aus Ertrag       | CHF        | 0.010           | EUR        | 0.010                |
| <b>Nettoausschüttung aus Ertrag</b> | <b>CHF</b> | <b>0.010</b>    | <b>EUR</b> | <b>0.010</b>         |
| <b>Coupon Nr. Ertrag</b>            |            | <b>21</b>       |            | <b>11</b>            |

Zahlbar ab 15.02.2024 bei der CREDIT SUISSE (SCHWEIZ) AG und deren sämtlichen Geschäftsstellen in der Schweiz.

**Thesaurierung pro Anteil****1. Für in der Schweiz domizillierte Anteilinhaber**

Für im Ausland domizillierte Anteilinhaber, ohne Bankenerklärung

| Thesaurierung 2023                               | Anteilklasse B |              | Anteilklasse BH EUR |              | Anteilklasse UB |              |
|--|----------------|--------------|---------------------|--------------|-----------------|--------------|
| Zur Thesaurierung verfügbarer Erfolg             | CHF            | 3.440        | EUR                 | 3.514        | CHF             | 3.556        |
| ./.. 35% Eidgenössische Verrechnungssteuer       | CHF            | 1.204        | EUR                 | 1.230        | CHF             | 1.245        |
| <b>Zur Thesaurierung zurückbehaltener Erfolg</b> | <b>CHF</b>     | <b>2.236</b> | <b>EUR</b>          | <b>2.284</b> | <b>CHF</b>      | <b>2.312</b> |

**2. Für im Ausland domizillierte Anteilinhaber, mit Bankenerklärung**

| Thesaurierung 2023                               | Anteilklasse B |              | Anteilklasse BH EUR |              | Anteilklasse UB |              |
|--|----------------|--------------|---------------------|--------------|-----------------|--------------|
| Zur Thesaurierung verfügbarer Erfolg             | CHF            | 3.440        | EUR                 | 3.514        | CHF             | 3.556        |
| ./.. 35% Eidgenössische Verrechnungssteuer 1)    | CHF            | 1.204        | EUR                 | 1.230        | CHF             | 1.245        |
| <b>Zur Thesaurierung zurückbehaltener Erfolg</b> | <b>CHF</b>     | <b>2.236</b> | <b>EUR</b>          | <b>2.284</b> | <b>CHF</b>      | <b>2.312</b> |
| <b>Coupon Nr. Ertrag</b>                         |                | <b>19</b>    |                     | <b>9</b>     |                 | <b>16</b>    |

1) Anleger mit ausländischem Domizil erhalten die Eidgenössische Verrechnungssteuer durch ihre Depotbank gutgeschrieben.

**3. Für in der Schweiz und im Ausland domizillierte Anteilinhaber**

(verrechnungssteuerbefreite Erträge aus direktem Immobilienbesitz)

| Thesaurierung 2023                               | Anteilklasse B |              | Anteilklasse BH EUR |              | Anteilklasse UB |              |
|--|----------------|--------------|---------------------|--------------|-----------------|--------------|
| Zur Thesaurierung verfügbarer Erfolg             | CHF            | 0.009        | EUR                 | 0.009        | CHF             | 0.009        |
| <b>Zur Thesaurierung zurückbehaltener Erfolg</b> | <b>CHF</b>     | <b>0.009</b> | <b>EUR</b>          | <b>0.009</b> | <b>CHF</b>      | <b>0.009</b> |
| <b>Coupon Nr. Ertrag</b>                         |                | <b>20</b>    |                     | <b>10</b>    |                 | <b>17</b>    |

**1. Für in der Schweiz domizillierte Anteilinhaber**

Für im Ausland domizillierte Anteilinhaber, ohne Bankenerklärung

| Thesaurierung 2023                               | Anteilklasse UBH EUR |              |
|--|----------------------|--------------|
| Zur Thesaurierung verfügbarer Erfolg             | EUR                  | 3.810        |
| ./.. 35% Eidgenössische Verrechnungssteuer       | EUR                  | 1.334        |
| <b>Zur Thesaurierung zurückbehaltener Erfolg</b> | <b>EUR</b>           | <b>2.477</b> |

**2. Für im Ausland domizillierte Anteilinhaber, mit Bankenerklärung**

| Thesaurierung 2023                               | Anteilklasse UBH EUR |              |
|--|----------------------|--------------|
| Zur Thesaurierung verfügbarer Erfolg             | EUR                  | 3.810        |
| ./.. 35% Eidgenössische Verrechnungssteuer 1)    | EUR                  | 1.334        |
| <b>Zur Thesaurierung zurückbehaltener Erfolg</b> | <b>EUR</b>           | <b>2.477</b> |
| <b>Coupon Nr. Ertrag</b>                         |                      | <b>9</b>     |

1) Anleger mit ausländischem Domizil erhalten die Eidgenössische Verrechnungssteuer durch ihre Depotbank gutgeschrieben.

**3. Für in der Schweiz und im Ausland domizillierte Anteilinhaber**

(verrechnungssteuerbefreite Erträge aus direktem Immobilienbesitz)

| Thesaurierung 2023                               | Anteilklasse UBH EUR |              |
|--|----------------------|--------------|
| Zur Thesaurierung verfügbarer Erfolg             | EUR                  | 0.010        |
| <b>Zur Thesaurierung zurückbehaltener Erfolg</b> | <b>EUR</b>           | <b>0.010</b> |
| <b>Coupon Nr. Ertrag</b>                         |                      | <b>10</b>    |

## Wechselkurse

| Wechselkurse per       | 31.12.2023 |
|------------------------|------------|
| AUSTRALISCHER DOLLAR   | 0.574279   |
| DAENISCHE KRONE        | 0.124716   |
| ENGLISCHES PFUND       | 1.072875   |
| EURO                   | 0.929700   |
| HONGKONG-DOLLAR        | 0.107782   |
| JAPANISCHER YEN        | 0.005970   |
| KANADISCHER DOLLAR     | 0.638267   |
| MEXIKANISCHER PESO     | 0.049699   |
| NEUER POLNISCHER ZŁOTY | 0.214032   |
| NORWEGISCHE KRONE      | 0.082872   |
| SCHWEDISCHE KRONE      | 0.083512   |
| SCHWEIZER FRANKEN      | 1.000000   |
| US DOLLAR              | 0.841624   |

## Vermögensrechnung per 31. Dezember 2023

|  | Konsolidierung        |                       |
|--|-----------------------|-----------------------|
|  | 31.12.2023            | 31.12.2022            |
|  | CHF                   | CHF                   |
| <b>Vermögenswerte</b>  |                       |                       |
| Bankguthaben, einschliesslich Treuhandanlagen bei Drittbanken, aufgeteilt in:                      |                       |                       |
| - Sichtguthaben  | 5'010'986.15          | 6'129'930.07          |
| Effekten, einschliesslich ausgeliehene und pensionierte Effekten, aufgeteilt in:                   |                       |                       |
| - Obligationen, Wandelobligationen, Optionsanleihen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte | 188'566'310.47        | 220'931'339.71        |
| - Strukturierte Produkte   | 0.00                  | 16'181'483.26         |
| - Aktien und sonstige Beteiligungswertpapiere und -rechte  | 124'008'054.24        | 157'114'212.28        |
| - Anteile anderer kollektiver Kapitalanlagen   | 184'593'997.40        | 207'557'847.99        |
| Derivative Finanzinstrumente   | 14'148'834.04         | 17'785'247.40         |
| Sonstige Vermögenswerte  | 3'061'947.11          | 5'256'884.39          |
| <b>Gesamtfondsvermögen abzüglich:</b>  | <b>519'390'129.41</b> | <b>630'956'945.10</b> |
| Andere Verbindlichkeiten   | 518'608.55            | 654'306.03            |
| <b>Nettofondsvermögen</b>  | <b>518'871'520.86</b> | <b>630'302'639.07</b> |
| <b>Veränderung des Nettofondsvermögens</b>   |                       |                       |
|  | 01.01.2023 -          | 01.01.2022 -          |
|  | 31.12.2023            | 31.12.2022            |
|  | CHF                   | CHF                   |
| Nettofondsvermögen zu Beginn der Berichtsperiode   | 630'302'639.07        | 809'066'804.68        |
| Ausschüttungen   | -19'013'628.11        | -24'284'725.00        |
| Ablieferung Verrechnungssteuer   | -896'049.63           | -928'013.50           |
| Ausgaben von Anteilen  | 12'482'558.14         | 25'469'050.49         |
| Rücknahmen von Anteilen  | -116'835'727.40       | -101'217'635.73       |
| Sonstiges aus Anteilverkehr  | 1'547'042.79          | -5'662'895.23         |
| Gesamterfolg   | 11'284'686.00         | -72'139'946.64        |
| <b>Nettofondsvermögen am Ende der Berichtsperiode</b>  | <b>518'871'520.86</b> | <b>630'302'639.07</b> |
| <b>Entwicklung der Anteile im Umlauf</b>   |                       |                       |
| Bestand zu Beginn der Berichtsperiode  | 6'146'504.293         | 6'859'610.663         |
| Ausgegebene Anteile  | 140'296.294           | 265'857.155           |
| Zurückgenommene Anteile  | -1'090'223.952        | -978'963.525          |
| <b>Bestand am Ende der Berichtsperiode</b>   | <b>5'196'576.635</b>  | <b>6'146'504.293</b>  |
| <b>Währung Anteilklasse</b>  |                       |                       |
| <b>Inventarwert pro Anteil (Swung NAV)</b>   |                       |                       |
| <b>Inventarwert pro Anteil (Unswung NAV)</b>   |                       |                       |



| Anteilklasse A             |                            | Anteilklasse AH EUR        |                            | Anteilklasse B             |                            | Anteilklasse BH EUR        |                            |
|----------------------------|----------------------------|----------------------------|----------------------------|----------------------------|----------------------------|----------------------------|----------------------------|
| 01.01.2023 -<br>31.12.2023 | 01.01.2022 -<br>31.12.2022 | 01.01.2023 -<br>31.12.2023 | 01.01.2022 -<br>31.12.2022 | 01.01.2023 -<br>31.12.2023 | 01.01.2022 -<br>31.12.2022 | 01.01.2023 -<br>31.12.2023 | 01.01.2022 -<br>31.12.2022 |
| CHF                        | CHF                        | CHF                        | CHF                        | CHF                        | CHF                        | CHF                        | CHF                        |
| 95'325'764.57              | 123'700'381.75             | 16'811'487.86              | 21'586'903.19              | 15'497'667.46              | 18'306'410.40              | 1'252'534.94               | 2'145'610.25               |
| -3'030'664.12              | -3'981'449.59              | -537'396.89                | -664'521.52                | 0.00                       | 0.00                       | 0.00                       | 0.00                       |
| 0.00                       | 0.00                       | 0.00                       | 0.00                       | -171'586.81                | -161'195.97                | -13'878.35                 | -19'070.12                 |
| 394'949.46                 | 622'329.46                 | 186'231.55                 | 1'422'658.49               | 372'913.32                 | 901'767.16                 | 63'591.71                  | 143'499.79                 |
| -16'642'424.09             | -13'377'989.73             | -2'641'592.27              | -2'746'140.93              | -3'464'811.02              | -1'726'296.62              | -299'601.13                | -741'814.46                |
| 174'022.91                 | -818'033.81                | 31'115.20                  | -22'907.82                 | 27'918.20                  | -70'014.75                 | 3'768.55                   | -69'672.76                 |
| 1'751'803.82               | -10'819'473.51             | -246'362.79                | -2'764'503.55              | 274'406.11                 | -1'753'002.76              | -18'496.50                 | -206'017.76                |
| <b>77'973'452.55</b>       | <b>95'325'764.57</b>       | <b>13'603'482.66</b>       | <b>16'811'487.86</b>       | <b>12'536'507.26</b>       | <b>15'497'667.46</b>       | <b>987'919.22</b>          | <b>1'252'534.94</b>        |
| 132'652.358                | 149'584.768                | 179'821.957                | 192'037.923                | 153'788.514                | 161'785.484                | 12'688.253                 | 18'501.530                 |
| 559.552                    | 810.872                    | 2'056.246                  | 15'090.000                 | 3'715.520                  | 8'460.376                  | 646.712                    | 1'453.627                  |
| -23'651.870                | -17'743.282                | -28'846.960                | -27'305.966                | -34'489.126                | -16'457.346                | -3'029.101                 | -7'266.904                 |
| <b>109'560.040</b>         | <b>132'652.358</b>         | <b>153'031.243</b>         | <b>179'821.957</b>         | <b>123'014.908</b>         | <b>153'788.514</b>         | <b>10'305.864</b>          | <b>12'688.253</b>          |
| (CHF)                      | (CHF)                      | (EUR)                      | (EUR)                      | (CHF)                      | (CHF)                      | (EUR)                      | (EUR)                      |
| <b>710.73</b>              | <b>716.82</b>              | <b>95.48</b>               | <b>94.45</b>               | <b>101.77</b>              | <b>100.52</b>              | <b>102.97</b>              | <b>99.72</b>               |
| <b>711.70</b>              | <b>718.61</b>              | <b>95.61</b>               | <b>94.68</b>               | <b>101.91</b>              | <b>100.77</b>              | <b>103.11</b>              | <b>99.97</b>               |

|   | Anteilklasse IA            |                            |
|---|----------------------------|----------------------------|
|   | 01.01.2023 -<br>31.12.2023 | 01.01.2022 -<br>31.12.2022 |
|   | CHF                        | CHF                        |
| <b>Veränderung des Nettofondsvermögens</b>            |                            |                            |
| Nettofondsvermögen zu Beginn der Berichtsperiode      | 9'133'579.66               | 10'465'527.51              |
| Ausschüttungen  | -331'096.30                | -368'377.05                |
| Ablieferung Verrechnungssteuer                        | 0.00                       | 0.00                       |
| Ausgaben von Anteilen                                 | 32.25                      | 0.00                       |
| Rücknahmen von Anteilen                               | -9'063'112.84              | 0.00                       |
| Sonstiges aus Anteilverkehr                           | 350'830.13                 | 2'007.11                   |
| Gesamterfolg  | -90'232.90                 | -965'577.91                |
| <b>Nettofondsvermögen am Ende der Berichtsperiode</b> | <b>0.00</b>                | <b>9'133'579.66</b>        |
| <b>Entwicklung der Anteile im Umlauf</b>              |                            |                            |
| Bestand zu Beginn der Berichtsperiode                 | 10'806.015                 | 10'806.015                 |
| Ausgegebene Anteile                                   | 0.000                      | 0.000                      |
| Zurückgenommene Anteile                               | -10'806.015                | 0.000                      |
| <b>Bestand am Ende der Berichtsperiode</b>            | <b>0.000</b>               | <b>10'806.015</b>          |
| <b>Währung Anteilklasse</b>                           | <b>(CHF)</b>               | <b>(CHF)</b>               |
| <b>Inventarwert pro Anteil (Swung NAV)</b>            | <b>0.00</b>                | <b>843.12</b>              |
| <b>Inventarwert pro Anteil (Unswung NAV)</b>          | <b>0.00</b>                | <b>845.23</b>              |

| Anteilklasse UA            |                            | Anteilklasse UAH EUR       |                            | Anteilklasse UB            |                            | Anteilklasse UBH EUR       |                            |
|----------------------------|----------------------------|----------------------------|----------------------------|----------------------------|----------------------------|----------------------------|----------------------------|
| 01.01.2023 -<br>31.12.2023 | 01.01.2022 -<br>31.12.2022 | 01.01.2023 -<br>31.12.2023 | 01.01.2022 -<br>31.12.2022 | 01.01.2023 -<br>31.12.2023 | 01.01.2022 -<br>31.12.2022 | 01.01.2023 -<br>31.12.2023 | 01.01.2022 -<br>31.12.2022 |
| CHF                        | CHF                        | CHF                        | CHF                        | CHF                        | CHF                        | CHF                        | CHF                        |
| 414'326'590.17             | 532'169'744.75             | 18'137'471.57              | 23'561'663.43              | 56'130'773.68              | 72'100'327.71              | 3'686'769.25               | 5'030'235.77               |
| -14'498'501.91             | -18'525'862.71             | -615'968.89                | -744'514.13                | 0.00                       | 0.00                       | 0.00                       | 0.00                       |
| 0.00                       | 0.00                       | 0.00                       | 0.00                       | -666'808.92                | -698'517.15                | -43'775.55                 | -49'230.26                 |
| 10'224'981.32              | 18'558'131.95              | 120'675.17                 | 603'670.46                 | 1'119'183.36               | 3'106'486.47               | 0.00                       | 110'506.71                 |
| -69'620'956.29             | -68'200'094.90             | -3'153'057.27              | -2'153'757.46              | -10'835'419.96             | -11'532'194.89             | -1'114'752.53              | -739'346.74                |
| 791'880.33                 | -3'767'963.02              | 49'235.17                  | -195'362.61                | 106'338.73                 | -651'235.55                | 11'933.55                  | -69'712.01                 |
| 8'739'312.61               | -45'907'965.90             | -229'790.11                | -2'934'228.12              | 1'144'430.64               | -6'194'092.91              | -40'384.88                 | -595'684.22                |
| <b>349'963'306.23</b>      | <b>414'326'590.17</b>      | <b>14'308'565.64</b>       | <b>18'137'471.57</b>       | <b>46'998'497.53</b>       | <b>56'130'773.68</b>       | <b>2'499'789.84</b>        | <b>3'686'769.25</b>        |
| 4'849'219.819              | 5'413'027.406              | 192'282.820                | 208'253.042                | 578'219.008                | 662'543.405                | 37'025.549                 | 43'071.090                 |
| 120'455.581                | 202'914.071                | 1'332.256                  | 5'892.510                  | 11'530.427                 | 30'166.996                 | 0.000                      | 1'068.703                  |
| -832'342.879               | -766'721.658               | -34'057.648                | -21'862.732                | -111'786.028               | -114'491.393               | -11'214.325                | -7'114.244                 |
| <b>4'137'332.521</b>       | <b>4'849'219.819</b>       | <b>159'557.428</b>         | <b>192'282.820</b>         | <b>477'963.407</b>         | <b>578'219.008</b>         | <b>25'811.224</b>          | <b>37'025.549</b>          |
| (CHF)                      | (CHF)                      | (EUR)                      | (EUR)                      | (CHF)                      | (CHF)                      | (EUR)                      | (EUR)                      |
| <b>84.47</b>               | <b>85.23</b>               | <b>96.33</b>               | <b>95.29</b>               | <b>98.20</b>               | <b>96.83</b>               | <b>104.03</b>              | <b>100.59</b>              |
| <b>84.59</b>               | <b>85.44</b>               | <b>96.46</b>               | <b>95.53</b>               | <b>98.33</b>               | <b>97.08</b>               | <b>104.17</b>              | <b>100.84</b>              |

## Erfolgsrechnung für die Zeit vom 1. Januar 2023 bis zum 31. Dezember 2023

|  | Konsolidierung             |                            |
|--|----------------------------|----------------------------|
|  | 01.01.2023 -<br>31.12.2023 | 01.01.2022 -<br>31.12.2022 |
|  | CHF                        | CHF                        |
| <b>Ertrag</b>  |                            |                            |
| Erträge der Bankguthaben   | 212'422.58                 | 49'866.21                  |
| Negativzinsen  | -12'378.95                 | -27'673.36                 |
| Erträge der Effektleihen   | 91'820.70                  | 208'507.90                 |
| Erträge der Ausgleichszahlungen  | 1'216'229.27               | 2'176'359.63               |
| Erträge der Geldmarktinstrumenten  | 0.00                       | 453'796.30                 |
| Erträge der Effekten, aufgeteilt in:   |                            |                            |
| - Obligationen, Wandelobligationen, Optionsanleihen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte     | 10'027'172.72              | 10'127'751.76              |
| - Strukturierte Produkte   | 145'574.46                 | 1'217'353.73               |
| - Aktien und sonstige Beteiligungswertpapiere und -rechte, einschliesslich Gratisaktien                | 5'011'500.63               | 6'063'338.40               |
| - Anteile anderer kollektiver Kapitalanlagen   | 10'041'930.51              | 10'706'108.81              |
| Erträge der Rückvergütungen  | 0.00                       | 6'065.76                   |
| Erträge aus kollektiven Kapitalanlagen mit Immobilien im Direktbesitz                                  | 69'398.50                  | 34'855.24                  |
| Sonstige Erträge   | 32'081.65                  | 32'216.17                  |
| Einkauf in laufende Nettoerträge bei der Ausgabe von Anteilen  | 179'744.99                 | 363'368.16                 |
| <b>Total Erträge</b>   | <b>27'015'497.06</b>       | <b>31'411'914.71</b>       |
| <b>Aufwendungen</b>  |                            |                            |
| Passivzinsen   | 8'123.14                   | 1'393.63                   |
| Prüfaufwand  | 14'494.70                  | 14'512.48                  |
| Reglementarische Vergütung an:   |                            |                            |
| - die Fondsleitung   | 6'290'626.86               | 7'858'456.73               |
| - die Depotbank  | 236'507.07                 | 296'985.22                 |
| Teilübertrag von Aufwendungen auf kollektiven Kapitalanlagen mit Immobilien im Direktbesitz            | -17'041.69                 | -9'217.25                  |
| Aufwände aus kollektiven Kapitalanlagen mit Immobilien im Direktbesitz                                 | 17'041.69                  | 9'217.25                   |
| Sonstige Aufwendungen  | 28'923.30                  | 17'650.38                  |
| Ausrichtung laufender Nettoerträge bei Rücknahme von Anteilen  | 1'947'001.23               | 1'828'690.14               |
| <b>Total Aufwendungen</b>  | <b>8'525'676.30</b>        | <b>10'017'688.58</b>       |
| <b>Nettoertrag</b>   | <b>18'489'820.76</b>       | <b>21'394'226.13</b>       |
| Realisierte Kapitalgewinne und -verluste   | -25'479'474.65             | -34'280'104.36             |
| <b>Realisierter Erfolg</b>   | <b>-6'989'653.89</b>       | <b>-12'885'878.23</b>      |
| Nicht realisierte Kapitalgewinne und -verluste   | 18'274'339.89              | -59'254'068.41             |
| <b>Gesamterfolg</b>  | <b>11'284'686.00</b>       | <b>-72'139'946.64</b>      |
| <b>Verwendung des Erfolgs</b>  |                            |                            |
| Nettoertrag des Rechnungsjahres  | 18'489'820.76              | 21'394'226.13              |
| Vortrag des Vorjahres aus kollektiven Kapitalanlagen mit Immobilien im Direktbesitz                    | 45'907.72                  | 27'894.00                  |
| Vortrag des Vorjahres  | 170'730.77                 | 515'891.03                 |
| <b>Zur Verteilung verfügbarer Erfolg</b>   | <b>18'706'459.25</b>       | <b>21'938'011.16</b>       |
| Zur Ausschüttung an die Anlegerinnen und Anleger vorgesehener Erfolg                                   | 15'847'720.31              | 19'125'413.27              |
| Zur Ausschüttung bestimmter Erfolg aus Kapitalanlagen mit Immobilien im Direktbesitz                   | 51'948.66                  | 3'085.29                   |
| Ablieferung/Ausschüttung der Verrechnungssteuer (35%)  | 786'828.06                 | 906'491.42                 |
| Zur Wiederanlage zurückbehaltener Ertrag (65%)   | 1'461'253.52               | 1'683'485.50               |
| Zur Wiederanlage zurückbehaltener Ertrag aus kollektiven Kapitalanlagen mit Immobilien im Direktbesitz | 5'906.91                   | 2'897.19                   |
| Vortrag Nettoerträge aus kollektiven Kapitalanlagen mit Immobilien im Direktbesitz                     | 36'125.03                  | 45'907.72                  |
| Vortrag auf neue Rechnung  | 516'676.75                 | 170'730.77                 |

| Anteilklasse A             |                            | Anteilklasse AH EUR        |                            | Anteilklasse B             |                            | Anteilklasse BH EUR        |                            |
|----------------------------|----------------------------|----------------------------|----------------------------|----------------------------|----------------------------|----------------------------|----------------------------|
| 01.01.2023 -<br>31.12.2023 | 01.01.2022 -<br>31.12.2022 | 01.01.2023 -<br>31.12.2023 | 01.01.2022 -<br>31.12.2022 | 01.01.2023 -<br>31.12.2023 | 01.01.2022 -<br>31.12.2022 | 01.01.2023 -<br>31.12.2023 | 01.01.2022 -<br>31.12.2022 |
| CHF                        | CHF                        | CHF                        | CHF                        | CHF                        | CHF                        | CHF                        | CHF                        |
| 32'156.80                  | 7'513.96                   | 5'664.72                   | 1'239.38                   | 5'280.99                   | 1'217.76                   | 413.38                     | 115.96                     |
| -1'869.28                  | -4'177.22                  | -329.88                    | -688.54                    | -305.02                    | -660.17                    | -24.42                     | -68.44                     |
| 13'917.71                  | 31'464.60                  | 2'443.90                   | 5'274.48                   | 2'289.15                   | 4'973.03                   | 180.40                     | 507.01                     |
| 184'162.74                 | 328'601.12                 | 32'485.11                  | 54'781.89                  | 30'247.66                  | 51'916.36                  | 2'389.57                   | 5'321.18                   |
| 0.00                       | 68'387.61                  | 0.00                       | 11'620.93                  | 0.00                       | 10'858.00                  | 0.00                       | 1'113.12                   |
| 1'519'303.06               | 1'530'131.16               | 267'315.15                 | 256'398.73                 | 249'750.97                 | 241'336.46                 | 19'669.72                  | 24'736.61                  |
| 22'140.78                  | 183'906.29                 | 3'907.56                   | 30'982.47                  | 3'641.01                   | 29'134.63                  | 303.84                     | 2'908.71                   |
| 761'370.61                 | 916'428.73                 | 133'105.85                 | 154'130.32                 | 125'509.36                 | 143'323.19                 | 9'929.25                   | 15'075.98                  |
| 1'521'359.17               | 1'616'923.26               | 267'461.43                 | 271'886.25                 | 250'386.00                 | 254'571.39                 | 19'631.87                  | 26'423.15                  |
| 0.00                       | 913.36                     | 0.00                       | 156.80                     | 0.00                       | 144.01                     | 0.00                       | 14.75                      |
| 10'567.12                  | 5'279.32                   | 1'820.58                   | 904.42                     | 1'730.23                   | 824.93                     | 141.18                     | 80.48                      |
| 4'841.62                   | 4'875.59                   | 853.42                     | 856.77                     | 783.25                     | 789.76                     | 60.68                      | 63.69                      |
| 3'342.10                   | 7'605.04                   | 2'879.28                   | 44'101.80                  | 7'518.83                   | 12'559.63                  | 935.58                     | 3'324.18                   |
| <b>4'071'292.43</b>        | <b>4'697'852.82</b>        | <b>717'607.12</b>          | <b>831'645.70</b>          | <b>676'832.43</b>          | <b>750'988.98</b>          | <b>53'631.05</b>           | <b>79'616.38</b>           |
| 1'231.08                   | 210.31                     | 217.48                     | 34.72                      | 201.53                     | 33.37                      | 15.51                      | 3.39                       |
| 2'195.78                   | 2'191.68                   | 386.38                     | 366.93                     | 361.04                     | 346.32                     | 28.26                      | 35.45                      |
| 1'117'023.93               | 1'398'943.77               | 208'523.09                 | 249'046.19                 | 183'577.72                 | 220'239.99                 | 15'353.56                  | 24'086.95                  |
| 35'830.56                  | 44'872.78                  | 6'307.79                   | 7'533.45                   | 5'888.19                   | 7'063.91                   | 464.40                     | 728.52                     |
| -3'018.42                  | -1'634.06                  | -551.31                    | -296.28                    | -493.64                    | -255.33                    | -42.69                     | -26.32                     |
| 3'018.42                   | 1'634.06                   | 551.31                     | 296.28                     | 493.64                     | 255.33                     | 42.69                      | 26.32                      |
| 4'364.40                   | 2'628.19                   | 770.87                     | 548.69                     | 710.24                     | 416.10                     | 56.70                      | 51.17                      |
| 267'743.95                 | 208'782.60                 | 36'036.43                  | 42'413.76                  | 61'785.18                  | 28'779.71                  | 3'950.41                   | 15'093.09                  |
| <b>1'428'389.70</b>        | <b>1'657'629.33</b>        | <b>252'242.04</b>          | <b>299'943.74</b>          | <b>252'523.90</b>          | <b>256'879.40</b>          | <b>19'868.84</b>           | <b>39'998.57</b>           |
| <b>2'642'902.73</b>        | <b>3'040'223.49</b>        | <b>465'365.08</b>          | <b>531'701.96</b>          | <b>424'308.53</b>          | <b>494'109.58</b>          | <b>33'762.21</b>           | <b>39'617.81</b>           |
| -3'708'272.33              | -4'739'822.80              | -1'000'088.78              | -2'090'291.12              | -591'610.51                | -769'087.31                | -72'509.78                 | -155'269.88                |
| <b>-1'065'369.60</b>       | <b>-1'699'599.31</b>       | <b>-534'723.70</b>         | <b>-1'558'589.16</b>       | <b>-167'301.98</b>         | <b>-274'977.73</b>         | <b>-38'747.57</b>          | <b>-115'652.07</b>         |
| 2'817'173.42               | -9'119'874.20              | 288'360.91                 | -1'205'914.39              | 441'708.09                 | -1'478'025.03              | 20'251.07                  | -90'365.69                 |
| <b>1'751'803.82</b>        | <b>-10'819'473.51</b>      | <b>-246'362.79</b>         | <b>-2'764'503.55</b>       | <b>274'406.11</b>          | <b>-1'753'002.76</b>       | <b>-18'496.50</b>          | <b>-206'017.76</b>         |
| 2'642'902.73               | 3'040'223.49               | 465'365.08                 | 531'701.96                 | 424'308.53                 | 494'109.58                 | 33'762.21                  | 39'617.81                  |
| 1'277.93                   | 511.96                     | 924.01                     | 313.93                     | 0.00                       | 0.00                       | 0.00                       | 0.00                       |
| 355.08                     | 33'126.17                  | 824.33                     | 13'081.94                  | 0.00                       | 0.00                       | 0.00                       | 0.00                       |
| <b>2'644'535.74</b>        | <b>3'073'861.62</b>        | <b>467'113.42</b>          | <b>545'097.83</b>          | <b>424'308.53</b>          | <b>494'109.58</b>          | <b>33'762.21</b>           | <b>39'617.81</b>           |
| 2'636'014.56               | 3'069'575.56               | 463'810.46                 | 543'349.49                 | 0.00                       | 0.00                       | 0.00                       | 0.00                       |
| 7'669.20                   | 2'653.05                   | 1'422.73                   | 0.00                       | 0.00                       | 0.00                       | 0.00                       | 0.00                       |
| 0.00                       | 0.00                       | 0.00                       | 0.00                       | 148'124.24                 | 172'745.22                 | 11'785.13                  | 13'851.62                  |
| 0.00                       | 0.00                       | 0.00                       | 0.00                       | 275'087.98                 | 320'812.87                 | 21'886.68                  | 25'724.44                  |
| 0.00                       | 0.00                       | 0.00                       | 0.00                       | 1'096.31                   | 551.49                     | 90.40                      | 41.75                      |
| 470.92                     | 1'277.93                   | 686.13                     | 924.01                     | 0.00                       | 0.00                       | 0.00                       | 0.00                       |
| 381.06                     | 355.08                     | 1'194.10                   | 824.33                     | 0.00                       | 0.00                       | 0.00                       | 0.00                       |

|  | Anteilklasse IA            |                            |
|--|----------------------------|----------------------------|
|  | 01.01.2023 -<br>31.12.2023 | 01.01.2022 -<br>31.12.2022 |
|  | CHF                        | CHF                        |
| <b>Ertrag</b>  |                            |                            |
| Erträge der Bankguthaben   | 234.35                     | 699.64                     |
| Negativzinsen  | -177.98                    | -376.70                    |
| Erträge der Effektenleihen   | 155.30                     | 2'835.60                   |
| Erträge der Ausgleichszahlungen  | 2'036.22                   | 29'600.16                  |
| Erträge der Geldmarktinstrumenten  | 0.00                       | 6'127.95                   |
| Erträge der Effekten, aufgeteilt in:   |                            |                            |
| - Obligationen, Wandelobligationen, Optionsanleihen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte     | 17'454.80                  | 137'900.75                 |
| - Strukturierte Produkte   | 0.00                       | 16'694.25                  |
| - Aktien und sonstige Beteiligungswertpapiere und -rechte, einschliesslich Gratisaktien                | 1'359.47                   | 81'283.24                  |
| - Anteile anderer kollektiver Kapitalanlagen   | 15'720.04                  | 145'084.24                 |
| Erträge der Rückvergütungen  | 0.00                       | 81.47                      |
| Erträge aus kollektiven Kapitalanlagen mit Immobilien im Direktbesitz                                  | 0.00                       | 474.92                     |
| Sonstige Erträge   | 0.00                       | 465.42                     |
| Einkauf in laufende Nettoerträge bei der Ausgabe von Anteilen  | 0.00                       | 0.00                       |
| <b>Total Erträge</b>   | <b>36'782.20</b>           | <b>420'870.94</b>          |
| <b>Aufwendungen</b>  |                            |                            |
| Passivzinsen   | 9.21                       | 19.12                      |
| Prüfaufwand  | 22.35                      | 197.96                     |
| Reglementarische Vergütung an:   |                            |                            |
| - die Fondsleitung   | 6'403.50                   | 59'322.93                  |
| - die Depotbank  | 435.43                     | 4'033.91                   |
| Teilübertrag von Aufwendungen auf kollektiven Kapitalanlagen mit Immobilien im Direktbesitz            | 0.00                       | -72.37                     |
| Aufwände aus kollektiven Kapitalanlagen mit Immobilien im Direktbesitz                                 | 0.00                       | 72.37                      |
| Sonstige Aufwendungen  | 27.11                      | 238.57                     |
| Ausrichtung laufender Nettoerträge bei Rücknahme von Anteilen  | 120'117.50                 | 0.00                       |
| <b>Total Aufwendungen</b>  | <b>127'015.10</b>          | <b>63'812.49</b>           |
| <b>Nettoertrag</b>   | <b>-90'232.90</b>          | <b>357'058.45</b>          |
| Realisierte Kapitalgewinne und -verluste   | 0.00                       | -452'794.23                |
| <b>Realisierter Erfolg</b>   | <b>-90'232.90</b>          | <b>-95'735.78</b>          |
| Nicht realisierte Kapitalgewinne und -verluste   | 0.00                       | -869'842.13                |
| <b>Gesamterfolg</b>  | <b>-90'232.90</b>          | <b>-965'577.91</b>         |
| <b>Verwendung des Erfolgs</b>  |                            |                            |
| Nettoertrag des Rechnungsjahres  | -90'232.90                 | 357'058.45                 |
| Vortrag des Vorjahres aus kollektiven Kapitalanlagen mit Immobilien im Direktbesitz                    | 19.11                      | 48.80                      |
| Vortrag des Vorjahres  | 90'213.79                  | 64'221.95                  |
| <b>Zur Verteilung verfügbarer Erfolg</b>   | <b>0.00</b>                | <b>421'329.20</b>          |
| Zur Ausschüttung an die Anlegerinnen und Anleger vorgesehener Erfolg                                   | 0.00                       | 330'664.06                 |
| Zur Ausschüttung bestimmter Erfolg aus Kapitalanlagen mit Immobilien im Direktbesitz                   | 0.00                       | 432.24                     |
| Ablieferung/Ausschüttung der Verrechnungssteuer (35%)  | 0.00                       | 0.00                       |
| Zur Wiederanlage zurückbehaltener Ertrag (65%)   | 0.00                       | 0.00                       |
| Zur Wiederanlage zurückbehaltener Ertrag aus kollektiven Kapitalanlagen mit Immobilien im Direktbesitz | 0.00                       | 0.00                       |
| Vortrag Nettoerträge aus kollektiven Kapitalanlagen mit Immobilien im Direktbesitz                     | 0.00                       | 19.11                      |
| Vortrag auf neue Rechnung  | 0.00                       | 90'213.79                  |

| Anteilklasse UA            |                            | Anteilklasse UAH EUR       |                            | Anteilklasse UB            |                            | Anteilklasse UBH EUR       |                            |
|----------------------------|----------------------------|----------------------------|----------------------------|----------------------------|----------------------------|----------------------------|----------------------------|
| 01.01.2023 -<br>31.12.2023 | 01.01.2022 -<br>31.12.2022 | 01.01.2023 -<br>31.12.2023 | 01.01.2022 -<br>31.12.2022 | 01.01.2023 -<br>31.12.2023 | 01.01.2022 -<br>31.12.2022 | 01.01.2023 -<br>31.12.2023 | 01.01.2022 -<br>31.12.2022 |
| CHF                        | CHF                        | CHF                        | CHF                        | CHF                        | CHF                        | CHF                        | CHF                        |
| 142'522.03                 | 32'874.50                  | 5'969.71                   | 1'416.68                   | 19'037.83                  | 4'495.30                   | 1'142.77                   | 293.03                     |
| -8'141.43                  | -18'226.41                 | -355.90                    | -794.05                    | -1'103.14                  | -2'511.83                  | -71.90                     | -170.00                    |
| 61'483.03                  | 137'313.66                 | 2'595.23                   | 6'004.46                   | 8'252.39                   | 18'870.56                  | 503.59                     | 1'264.50                   |
| 814'782.92                 | 1'433'225.67               | 34'364.95                  | 62'621.88                  | 109'147.99                 | 197'061.89                 | 6'612.11                   | 13'229.48                  |
| 0.00                       | 298'630.12                 | 0.00                       | 13'350.20                  | 0.00                       | 40'942.12                  | 0.00                       | 2'766.25                   |
| 6'716'666.71               | 6'668'412.13               | 282'525.83                 | 291'569.19                 | 899'946.62                 | 915'741.75                 | 54'539.86                  | 61'524.98                  |
| 97'523.04                  | 801'166.10                 | 4'185.35                   | 35'049.48                  | 13'040.13                  | 110'085.58                 | 832.75                     | 7'426.22                   |
| 3'359'539.04               | 3'989'278.30               | 141'890.44                 | 175'205.42                 | 451'463.56                 | 551'056.28                 | 27'333.05                  | 37'556.94                  |
| 6'728'149.81               | 7'046'591.63               | 282'951.12                 | 309'579.70                 | 901'608.35                 | 969'463.79                 | 54'662.72                  | 65'585.40                  |
| 0.00                       | 3'990.82                   | 0.00                       | 178.92                     | 0.00                       | 548.35                     | 0.00                       | 37.28                      |
| 46'464.55                  | 22'926.76                  | 1'951.39                   | 1'002.82                   | 6'345.70                   | 3'148.07                   | 377.75                     | 213.52                     |
| 21'617.51                  | 21'171.51                  | 888.53                     | 921.50                     | 2'874.92                   | 2'884.11                   | 161.72                     | 187.82                     |
| 134'845.15                 | 239'531.57                 | 4'220.19                   | 11'992.20                  | 26'003.86                  | 42'158.20                  | 0.00                       | 2'095.54                   |
| <b>18'115'452.36</b>       | <b>20'676'886.36</b>       | <b>761'186.84</b>          | <b>908'098.40</b>          | <b>2'436'618.21</b>        | <b>2'853'944.17</b>        | <b>146'094.42</b>          | <b>192'010.96</b>          |
| 5'452.88                   | 918.16                     | 227.48                     | 39.98                      | 724.71                     | 126.14                     | 43.26                      | 8.44                       |
| 9'713.26                   | 9'556.22                   | 408.61                     | 417.73                     | 1'300.45                   | 1'312.26                   | 78.57                      | 87.93                      |
| 4'006'570.50               | 4'945'620.93               | 181'297.83                 | 232'762.87                 | 536'872.27                 | 679'264.79                 | 35'004.46                  | 49'168.31                  |
| 158'397.70                 | 195'525.67                 | 6'670.73                   | 8'564.79                   | 21'224.35                  | 26'853.08                  | 1'287.92                   | 1'809.11                   |
| -10'868.41                 | -5'807.23                  | -488.99                    | -271.91                    | -1'483.54                  | -796.04                    | -94.69                     | -57.71                     |
| 10'868.41                  | 5'807.23                   | 488.99                     | 271.91                     | 1'483.54                   | 796.04                     | 94.69                      | 57.71                      |
| 19'427.80                  | 11'451.86                  | 813.81                     | 614.69                     | 2'601.15                   | 1'571.42                   | 151.22                     | 129.69                     |
| 1'214'640.18               | 1'257'798.11               | 55'221.06                  | 49'345.63                  | 169'653.37                 | 211'858.50                 | 17'853.15                  | 14'618.74                  |
| <b>5'414'202.32</b>        | <b>6'420'870.95</b>        | <b>244'639.52</b>          | <b>291'745.69</b>          | <b>732'376.30</b>          | <b>920'986.19</b>          | <b>54'418.58</b>           | <b>65'822.22</b>           |
| <b>12'701'250.04</b>       | <b>14'256'015.41</b>       | <b>516'547.32</b>          | <b>616'352.71</b>          | <b>1'704'241.91</b>        | <b>1'932'957.98</b>        | <b>91'675.84</b>           | <b>126'188.74</b>          |
| -16'654'372.42             | -20'581'746.59             | -1'051'324.39              | -2'252'066.24              | -2'217'875.01              | -2'782'576.20              | -183'421.43                | -456'449.99                |
| <b>-3'953'122.38</b>       | <b>-6'325'731.18</b>       | <b>-534'777.07</b>         | <b>-1'635'713.53</b>       | <b>-513'633.10</b>         | <b>-849'618.22</b>         | <b>-91'745.59</b>          | <b>-330'261.25</b>         |
| 12'692'434.99              | -39'581'634.72             | 304'986.96                 | -1'298'514.59              | 1'658'063.74               | -5'344'474.69              | 51'360.71                  | -265'422.97                |
| <b>8'739'312.61</b>        | <b>-45'907'365.90</b>      | <b>-229'790.11</b>         | <b>-2'934'228.12</b>       | <b>1'144'430.64</b>        | <b>-6'194'092.91</b>       | <b>-40'384.88</b>          | <b>-595'684.22</b>         |
| 12'701'250.04              | 14'256'015.41              | 516'547.32                 | 616'352.71                 | 1'704'241.91               | 1'932'957.98               | 91'675.84                  | 126'188.74                 |
| 41'910.66                  | 25'932.44                  | 1'776.01                   | 1'086.86                   | 0.00                       | 0.00                       | 0.00                       | 0.00                       |
| 28'354.24                  | 335'976.51                 | 50'983.33                  | 69'484.47                  | 0.00                       | 0.00                       | 0.00                       | 0.00                       |
| <b>12'771'514.94</b>       | <b>14'617'924.36</b>       | <b>569'306.66</b>          | <b>686'924.04</b>          | <b>1'704'241.91</b>        | <b>1'932'957.98</b>        | <b>91'675.84</b>           | <b>126'188.74</b>          |
| 12'246'504.26              | 14'547'659.46              | 501'391.03                 | 634'164.70                 | 0.00                       | 0.00                       | 0.00                       | 0.00                       |
| 41'373.33                  | 0.00                       | 1'483.41                   | 0.00                       | 0.00                       | 0.00                       | 0.00                       | 0.00                       |
| 0.00                       | 0.00                       | 0.00                       | 0.00                       | 594'915.08                 | 675'778.14                 | 32'003.61                  | 44'116.44                  |
| 0.00                       | 0.00                       | 0.00                       | 0.00                       | 1'104'843.53               | 1'255'017.64               | 59'435.33                  | 81'930.55                  |
| 0.00                       | 0.00                       | 0.00                       | 0.00                       | 4'483.30                   | 2'162.20                   | 236.90                     | 141.75                     |
| 33'344.39                  | 41'910.66                  | 1'623.59                   | 1'776.01                   | 0.00                       | 0.00                       | 0.00                       | 0.00                       |
| 450'292.96                 | 28'354.24                  | 64'808.63                  | 50'983.33                  | 0.00                       | 0.00                       | 0.00                       | 0.00                       |

## Zusammensetzung des Portefolles und Bestandesveränderungen

| Titelbezeichnung   | Währung | 31.12.2022<br>Anzahl/<br>Nominal | Käufe (1) | Verkäufe (1) | 31.12.2023<br>Anzahl/<br>Nominal | Kurswert CHF         | in % des<br>Gesamtfonds-<br>vermögens |
|--|---------|----------------------------------|-----------|--------------|----------------------------------|----------------------|---------------------------------------|
| <b>Börsennotierte / an einem geregelten Markt gehandelte Wertpapiere; bewertet zu den Kursen, die am Hauptmarkt bezahlt werden</b> |         |                                  |           |              |                                  |                      |                                       |
| <b>Aktien (und aktienähnliche Wertpapiere)</b>   |         |                                  |           |              |                                  |                      |                                       |
| <b>AUSTRALISCHER DOLLAR</b>  |         |                                  |           |              |                                  |                      |                                       |
| AMPOL LTD  | AUD     | 28'000                           | 30'700    | 23'700       | 35'000                           | 726'606.29           | 0.14                                  |
| ANZ GROUP HOLDINGS LTD   | AUD     | 8'770                            |           | 8'770        |                                  |                      |                                       |
| APA GROUP (stapled security)   | AUD     | 32'800                           | 2'000     | 21'700       | 13'100                           | 64'246.87            | 0.01                                  |
| AURIZON HOLDINGS   | AUD     | 78'240                           | 85'100    | 92'340       | 71'000                           | 154'940.43           | 0.03                                  |
| AUSTRALIA & NEW ZEALAND BANKING GROUP  | AUD     |                                  | 21'370    | 4'070        | 17'300                           | 257'515.82           | 0.05                                  |
| BHP BILLITON   | AUD     | 17'350                           | 2'250     | 6'500        | 13'100                           | 379'237.09           | 0.07                                  |
| COLES GROUP LTD  | AUD     | 17'500                           | 3'100     | 5'600        | 15'000                           | 138'774.48           | 0.03                                  |
| COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA   | AUD     |                                  | 10'000    |              | 10'000                           | 642'043.73           | 0.12                                  |
| COMPUTERSHARE  | AUD     | 22'000                           | 2'700     | 24'700       |                                  |                      |                                       |
| FORTESCUE METALS GROUP   | AUD     | 115'770                          | 15'400    | 69'170       | 62'000                           | 1'033'265.44         | 0.20                                  |
| HARVEY NORMAN HOLDINGS   | AUD     | 185'900                          | 23'100    | 190'200      | 18'800                           | 45'345.06            | 0.01                                  |
| IPH  | AUD     | 20'000                           | 2'500     | 22'500       |                                  |                      |                                       |
| JB HI-FI   | AUD     | 17'060                           | 2'100     | 17'860       | 1'300                            | 39'590.21            | 0.01                                  |
| MAGELLAN   | AUD     | 12'690                           | 58'900    | 10'090       | 61'500                           | 327'752.41           | 0.06                                  |
| METCASH  | AUD     | 204'290                          | 129'500   | 101'290      | 232'500                          | 465'984.20           | 0.09                                  |
| NINE ENTERTAINMENT COMPANY HOLDINGS  | AUD     | 356'000                          | 503'000   | 559'000      | 300'000                          | 348'012.97           | 0.07                                  |
| NRW HOLDINGS   | AUD     | 95'940                           | 28'600    | 29'540       | 95'000                           | 162'578.34           | 0.03                                  |
| PENDAL GROUP LTD   | AUD     | 38'380                           |           | 38'380       |                                  |                      |                                       |
| PERPETUAL  | AUD     |                                  | 10'782    | 1'282        | 9'500                            | 139'009.93           | 0.03                                  |
| PLATINUM ASSET MANAGEMENT  | AUD     | 98'620                           | 420'000   | 68'620       | 450'000                          | 343'705.88           | 0.07                                  |
| RIO TINTO  | AUD     | 18'160                           | 3'400     | 5'060        | 16'500                           | 1'285'459.99         | 0.25                                  |
| SMARTGROUP CORP LTD  | AUD     | 35'550                           | 4'400     | 39'950       |                                  |                      |                                       |
| SONIC HEALTHCARE   | AUD     |                                  | 7'000     | 7'000        |                                  |                      |                                       |
| SOUTH32  | AUD     | 413'800                          | 93'700    | 307'500      | 200'000                          | 382'469.70           | 0.07                                  |
| SUNCORP GROUP LTD  | AUD     | 51'170                           | 6'200     | 19'870       | 37'500                           | 298'266.07           | 0.06                                  |
| TELSTRA GROUP LIMITED  | AUD     |                                  | 150'000   | 34'000       | 116'000                          | 263'800.72           | 0.05                                  |
| TRANSURBAN GROUP (stapled security)  | AUD     | 19'190                           |           | 19'190       |                                  |                      |                                       |
| WESFARMERS   | AUD     | 54'700                           | 11'400    | 29'100       | 37'000                           | 1'212'003.99         | 0.23                                  |
| WOODSIDE ENERGY GROUP LTD  | AUD     | 33'050                           | 21'400    | 11'450       | 43'000                           | 766'995.32           | 0.15                                  |
| WORLEYPARSONS  | AUD     | 53'240                           | 6'300     | 59'540       |                                  |                      |                                       |
|  |         |                                  |           |              |                                  | <b>9'477'604.94</b>  | <b>1.82</b>                           |
| <b>ENGLISCHES PFUND</b>  |         |                                  |           |              |                                  |                      |                                       |
| ABRDN PLC  | GBP     | 32'400                           |           | 8'700        | 23'700                           | 45'425.59            | 0.01                                  |
| ADMIRAL GROUP  | GBP     |                                  | 40'000    | 40'000       |                                  |                      |                                       |
| ANGLO AMERICAN   | GBP     | 54'250                           | 21'000    | 16'750       | 58'500                           | 1'236'811.60         | 0.24                                  |
| ANTOFAGASTA  | GBP     | 78'600                           |           | 78'600       |                                  |                      |                                       |
| ASTRAZENECA  | GBP     | 6'900                            |           | 5'650        | 1'250                            | 142'155.96           | 0.03                                  |
| BARRATT DEVELOPMENTS   | GBP     | 64'000                           | 98'200    | 27'200       | 135'000                          | 814'859.44           | 0.16                                  |
| BHP GROUP LTD  | GBP     | 25'200                           |           | 6'800        | 18'400                           | 530'931.60           | 0.10                                  |
| BP   | GBP     | 51'500                           | 16'800    | 43'500       | 24'800                           | 124'029.95           | 0.02                                  |
| DIRECT LINE INSURANCE GROUP  | GBP     | 30'300                           |           | 30'300       |                                  |                      |                                       |
| FERGUSON   | GBP     | 1'350                            |           | 1'350        |                                  |                      |                                       |
| GLENORE  | GBP     | 90'000                           |           | 25'000       | 65'000                           | 329'227.85           | 0.06                                  |
| GSK PLC  | GBP     | 59'200                           | 7'800     | 54'400       | 12'600                           | 196'041.33           | 0.04                                  |
| HSBC HOLDINGS  | GBP     | 12'700                           | 126'800   | 16'200       | 123'300                          | 840'674.43           | 0.16                                  |
| IG GROUP HOLDINGS  | GBP     | 7'900                            | 44'600    | 6'500        | 46'000                           | 377'791.54           | 0.07                                  |
| J. SAINSBURY   | GBP     | 259'000                          |           | 70'200       | 188'800                          | 612'943.04           | 0.12                                  |
| KELLER GROUP   | GBP     | 17'200                           |           | 8'200        | 9'000                            | 84'971.72            | 0.02                                  |
| KINGFISHER   | GBP     | 529'400                          |           | 143'300      | 386'100                          | 1'007'838.90         | 0.19                                  |
| LEGAL & GENERAL GROUP  | GBP     | 25'400                           | 229'400   | 29'800       | 225'000                          | 606'147.66           | 0.12                                  |
| M&G PLC  | GBP     | 33'400                           | 189'000   | 28'000       | 194'400                          | 463'852.87           | 0.09                                  |
| NEXT   | GBP     | 22'100                           |           | 22'100       |                                  |                      |                                       |
| PERSIMMON  | GBP     | 29'900                           |           | 8'100        | 21'800                           | 324'868.75           | 0.06                                  |
| RENEWABLES INFRASTRUCTURE GROU   | GBP     | 445'000                          | 105'000   |              | 550'000                          | 671'512.58           | 0.13                                  |
| RIO TINTO  | GBP     | 23'000                           | 29'404    | 27'604       | 24'800                           | 1'554'398.75         | 0.30                                  |
| SHELL PLC  | GBP     | 10'700                           | 4'300     | 10'500       | 4'500                            | 124'150.44           | 0.02                                  |
| SSE  | GBP     |                                  | 40'000    | 4'000        | 36'000                           | 716'852.29           | 0.14                                  |
| TESCO PLC  | GBP     | 249'900                          |           | 132'900      | 117'000                          | 364'654.19           | 0.07                                  |
| UNILEVER   | GBP     | 14'000                           |           | 7'400        | 6'600                            | 269'077.10           | 0.05                                  |
| VESUVIUS   | GBP     | 33'300                           |           | 10'800       | 22'500                           | 116'160.20           | 0.02                                  |
| VODAFONE GROUP   | GBP     | 209'900                          |           | 56'900       | 153'000                          | 112'541.17           | 0.02                                  |
| WOODSIDE ENERGY GROUP LTD  | GBP     | 13'100                           |           | 13'100       |                                  |                      |                                       |
|  |         |                                  |           |              |                                  | <b>11'667'918.95</b> | <b>2.25</b>                           |
| <b>EURO</b>  |         |                                  |           |              |                                  |                      |                                       |
| ACTIVIDADES DE CONSTRUCCION Y SERVICIOS  | EUR     | 9'736                            | 2'100     | 3'536        | 8'300                            | 309'895.04           | 0.06                                  |
| ALLIANZ SE (reg. shares) ((restricted))  | EUR     | 5'530                            | 2'900     | 6'630        | 1'800                            | 404'893.65           | 0.08                                  |



| Titelbezeichnung                             | Währung | 31.12.2022<br>Anzahl/<br>Nominal | Käufe (1) | Verkäufe (1) | 31.12.2023<br>Anzahl/<br>Nominal | Kurswert CHF         | in % des<br>Gesamtfonds-<br>vermögens |
|--|---------|----------------------------------|-----------|--------------|----------------------------------|----------------------|---------------------------------------|
| ASR NEDERLAND                                | EUR     | 20'000                           | 4'100     | 7'500        | 16'600                           | 658'989.95           | 0.13                                  |
| AXA  | EUR     | 19'370                           | 4'100     | 7'970        | 15'500                           | 424'961.22           | 0.08                                  |
| BASF (reg. shares)                           | EUR     | 25'280                           | 4'700     | 10'980       | 19'000                           | 861'664.55           | 0.17                                  |
| BILFINGER                                    | EUR     | 10'000                           |           | 10'000       |                                  |                      |                                       |
| BMW  | EUR     | 15'000                           | 2'900     | 6'900        | 11'000                           | 1'030'646.83         | 0.20                                  |
| BNP PARIBAS -A-                              | EUR     |                                  | 6'000     | 1'300        | 4'700                            | 273'492.64           | 0.05                                  |
| BOUYGUES                                     | EUR     | 6'000                            | 1'200     | 2'300        | 4'900                            | 155'434.68           | 0.03                                  |
| CIE GENERALE DES ETABLISSEMENTS MICHELIN SA  | EUR     |                                  | 15'500    | 3'300        | 12'200                           | 368'172.36           | 0.07                                  |
| COVIVIO FONCIERE DES REGIONS                 | EUR     | 5'100                            |           | 5'100        |                                  |                      |                                       |
| CREDIT AGRICOLE                              | EUR     | 20'000                           | 4'200     | 7'500        | 16'700                           | 199'540.02           | 0.04                                  |
| CRH PLC                                      | EUR     | 10'000                           |           | 10'000       |                                  |                      |                                       |
| DANONE                                       | EUR     | 2'575                            | 10'200    | 2'975        | 9'800                            | 534'637.00           | 0.10                                  |
| E.ON (reg. shares)                           | EUR     | 9'000                            | 1'600     | 3'500        | 7'100                            | 80'200.57            | 0.02                                  |
| EBRO FOODS                                   | EUR     | 36'000                           |           | 36'000       |                                  |                      |                                       |
| EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL (reg. shares)       | EUR     | 21'500                           | 4'300     | 9'800        | 16'000                           | 67'756.54            | 0.01                                  |
| ENDESA                                       | EUR     | 30'000                           | 6'300     | 11'200       | 25'100                           | 430'772.78           | 0.08                                  |
| ENEL   | EUR     | 150'000                          | 64'000    | 158'000      | 56'000                           | 350'385.34           | 0.07                                  |
| ENI  | EUR     | 16'000                           | 3'400     | 5'900        | 13'500                           | 192'631.98           | 0.04                                  |
| EVONIK INDUSTRIES (reg. shares)              | EUR     | 10'000                           | 2'100     | 3'700        | 8'400                            | 144'475.38           | 0.03                                  |
| GALP ENERGIA -B-                             | EUR     | 28'700                           |           | 28'700       |                                  |                      |                                       |
| HEIDELBERGCEMENT                             | EUR     | 3'000                            | 600       | 1'200        | 2'400                            | 180'599.80           | 0.03                                  |
| KESKO -B-                                    | EUR     | 11'480                           | 53'600    | 14'580       | 50'500                           | 841'576.06           | 0.16                                  |
| KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE                   | EUR     | 27'000                           | 8'000     | 27'000       | 8'000                            | 193'489.16           | 0.04                                  |
| MANDATUM HOLDING OY                          | EUR     |                                  | 2'000     |              | 2'000                            | 7'567.76             | 0.00                                  |
| MAPFRE (reg. shares)                         | EUR     | 80'000                           | 16'700    | 32'700       | 64'000                           | 115'610.05           | 0.02                                  |
| MERCEDES-BENZ GROUP AG                       | EUR     |                                  | 18'100    | 2'600        | 15'500                           | 901'367.39           | 0.17                                  |
| NATURGY ENERGY GROUP                         | EUR     | 15'000                           | 3'100     | 7'100        | 11'000                           | 276'120.90           | 0.05                                  |
| OESTERREICH POST                             | EUR     | 4'700                            | 1'000     | 1'700        | 4'000                            | 121'604.76           | 0.02                                  |
| ORANGE                                       | EUR     | 55'000                           | 33'500    | 31'500       | 57'000                           | 546'038.84           | 0.11                                  |
| ORION CORPORATION (new) -B-                  | EUR     |                                  | 13'300    |              | 13'300                           | 485'573.94           | 0.09                                  |
| POSTNL                                       | EUR     | 60'000                           | 12'500    | 22'400       | 50'100                           | 65'814.67            | 0.01                                  |
| PROXIMUS                                     | EUR     | 9'300                            | 36'600    | 3'400        | 42'500                           | 336'249.25           | 0.06                                  |
| RANDSTAD HOLDING                             | EUR     | 5'500                            | 1'000     | 2'500        | 4'000                            | 210'930.34           | 0.04                                  |
| RED ELECTRICA CORPORACION                    | EUR     | 27'000                           | 5'500     | 10'000       | 22'500                           | 311'891.11           | 0.06                                  |
| SAMPO -A-                                    | EUR     | 2'300                            | 500       | 2'800        |                                  |                      |                                       |
| SAMPO PLC -A-                                | EUR     |                                  | 2'000     |              | 2'000                            | 73'650.83            | 0.01                                  |
| SANOFI                                       | EUR     | 9'000                            | 1'600     | 3'500        | 7'100                            | 592'494.09           | 0.11                                  |
| SNAM   | EUR     | 130'000                          | 146'200   | 76'200       | 200'000                          | 865'550.70           | 0.17                                  |
| SOLVAY                                       | EUR     | 1'800                            |           | 1'800        |                                  |                      |                                       |
| STELLANTIS NV                                | EUR     |                                  | 42'500    | 2'500        | 40'000                           | 786'526.20           | 0.15                                  |
| TELEFONICA                                   | EUR     | 30'000                           | 6'300     | 11'200       | 25'100                           | 82'467.55            | 0.02                                  |
| TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDING (reg. shares) | EUR     | 100'000                          | 22'900    | 122'900      |                                  |                      |                                       |
| TERNA  | EUR     | 50'000                           |           | 50'000       |                                  |                      |                                       |
| TOTAL ENERGIES                               | EUR     | 17'000                           | 17'750    | 16'250       | 18'500                           | 1'059'486.12         | 0.20                                  |
| UPM-KYMMENE                                  | EUR     | 10'000                           | 2'100     | 4'100        | 8'000                            | 253'324.66           | 0.05                                  |
|  |         |                                  |           |              |                                  | <b>14'796'484.71</b> | <b>2.85</b>                           |
| <b>HONGKONG-DOLLAR</b>                       |         |                                  |           |              |                                  |                      |                                       |
| CHINA CONSTRUCTION BANK -H-                  | HKD     | 785'000                          |           | 785'000      |                                  |                      |                                       |
| CHINA MOLYBDENUM -H-                         | HKD     | 1'608'000                        |           | 1'359'000    | 249'000                          | 114'596.98           | 0.02                                  |
|  |         |                                  |           |              |                                  | <b>114'596.98</b>    | <b>0.02</b>                           |
| <b>KANADISCHER DOLLAR</b>                    |         |                                  |           |              |                                  |                      |                                       |
| ALGONQUIN POWER & UTILITIES                  | CAD     | 55'000                           | 50'000    | 30'000       | 75'000                           | 400'193.53           | 0.08                                  |
| ALTAGAS                                      | CAD     | 19'800                           |           | 9'800        | 10'000                           | 177'565.93           | 0.03                                  |
| BANK OF MONTREAL                             | CAD     | 3'300                            |           | 300          | 3'000                            | 251'049.64           | 0.05                                  |
| BANK OF NOVA SCOTIA                          | CAD     | 12'000                           | 12'000    | 11'000       | 13'000                           | 535'187.05           | 0.10                                  |
| BCE  | CAD     | 13'610                           | 6'000     | 7'610        | 12'000                           | 399'580.80           | 0.08                                  |
| CANADIAN IMPERIAL BANK OF COMMERCE           | CAD     | 7'420                            |           | 920          | 6'500                            | 264'689.41           | 0.05                                  |
| CANADIAN TIRE (nv) -A-                       | CAD     | 4'900                            |           | 2'400        | 2'500                            | 224'542.40           | 0.04                                  |
| CANADIAN UTILITIES (nv)                      | CAD     | 16'200                           |           | 1'200        | 15'000                           | 305'315.11           | 0.06                                  |
| EMERA  | CAD     | 10'000                           |           |              | 10'000                           | 321'048.40           | 0.06                                  |
| ENBRIDGE                                     | CAD     | 7'560                            | 16'440    | 4'000        | 20'000                           | 608'906.91           | 0.12                                  |
| FORTIS                                       | CAD     | 6'460                            |           | 460          | 6'000                            | 208'751.67           | 0.04                                  |
| GREAT WEST LIFECO                            | CAD     | 23'570                           | 12'000    | 23'570       | 12'000                           | 335'932.79           | 0.06                                  |
| HYDRO ONE                                    | CAD     | 8'500                            |           | 8'500        |                                  |                      |                                       |
| IGM FINANCIAL                                | CAD     | 9'000                            |           |              | 9'000                            | 201'111.61           | 0.04                                  |
| KEYERA                                       | CAD     | 11'340                           | 26'660    | 5'000        | 33'000                           | 674'642.05           | 0.13                                  |
| LUNDIN MINING                                | CAD     | 89'600                           |           | 59'600       | 30'000                           | 207'564.49           | 0.04                                  |
| MANULIFE FINANCIAL                           | CAD     | 19'000                           | 38'000    | 2'000        | 55'000                           | 1'027'865.50         | 0.20                                  |
| PEMBINA PIPELINE                             | CAD     |                                  | 23'000    |              | 23'000                           | 669'708.24           | 0.13                                  |
| POWER CORP OF CANADA                         | CAD     | 13'200                           |           | 200          | 13'000                           | 314'391.27           | 0.06                                  |

Jahresbericht per 31. Dezember 2023

| Titelbezeichnung                                       | Währung | 31.12.2022<br>Anzahl/<br>Nominal | Käufe (1) | Verkäufe (1) | 31.12.2023<br>Anzahl/<br>Nominal | Kurswert CHF         | in % des<br>Gesamtfonds-<br>vermögens |
|--|---------|----------------------------------|-----------|--------------|----------------------------------|----------------------|---------------------------------------|
| QUEBECOR (v) -B-                                       | CAD     | 19'800                           | 10'000    | 9'800        | 20'000                           | 402'363.64           | 0.08                                  |
| RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL                        | CAD     | 8'080                            |           | 8'080        |                                  |                      |                                       |
| ROGERS COMMUNICATIONS (nv) -B-                         | CAD     | 13'200                           |           | 13'200       |                                  |                      |                                       |
| ROYAL BANK OF CANADA                                   | CAD     | 5'770                            | 4'730     | 5'500        | 5'000                            | 427'639.02           | 0.08                                  |
| SHAW COMMUNICATIONS (nv) -B-                           | CAD     | 15'000                           |           | 15'000       |                                  |                      |                                       |
| SUN LIFE FINANCIAL                                     | CAD     | 10'560                           | 2'440     |              | 13'000                           | 570'202.38           | 0.11                                  |
| TELUS NON-CANADIAN                                     | CAD     | 30'000                           |           | 12'500       | 17'500                           | 263'380.96           | 0.05                                  |
| TORONTO DOMINION BANK                                  | CAD     | 6'000                            | 3'000     | 1'000        | 8'000                            | 437'187.50           | 0.08                                  |
|  |         |                                  |           |              |                                  | <b>9'228'820.30</b>  | <b>1.78</b>                           |
| <b>MEXIKANISCHER PESO</b>                              |         |                                  |           |              |                                  |                      |                                       |
| GRUPO FINANCIERO BANORTE                               | MXN     |                                  | 30'000    |              | 30'000                           | 254'596.86           | 0.05                                  |
| KIMBERLY CLARK DE MEXICO -A-                           | MXN     | 439'400                          |           | 439'400      |                                  |                      |                                       |
|  |         |                                  |           |              |                                  | <b>254'596.86</b>    | <b>0.05</b>                           |
| <b>NORWEGISCHE KRONE</b>                               |         |                                  |           |              |                                  |                      |                                       |
| AKER BP ASA  | NOK     | 6'000                            | 1'000     | 2'800        | 4'200                            | 102'852.49           | 0.02                                  |
| SPAREBANK 1 OESTLANDET                                 | NOK     | 17'000                           | 3'500     | 6'300        | 14'200                           | 156'041.42           | 0.03                                  |
|  |         |                                  |           |              |                                  | <b>258'893.91</b>    | <b>0.05</b>                           |
| <b>SCHWEDISCHE KRONE</b>                               |         |                                  |           |              |                                  |                      |                                       |
| ELECTROLUX AB -B-                                      | SEK     | 20'000                           |           | 20'000       |                                  |                      |                                       |
| HENNES & MAURITZ STOCKHOLM -B-                         | SEK     | 27'000                           |           | 27'000       |                                  |                      |                                       |
|  |         |                                  |           |              |                                  | <b>0.00</b>          | <b>0.00</b>                           |
| <b>SCHWEIZER FRANKEN</b>                               |         |                                  |           |              |                                  |                      |                                       |
| ABB (reg. shares)                                      | CHF     | 90'000                           | 5'000     | 18'000       | 77'000                           | 2'872'100.00         | 0.55                                  |
| ADECCO (reg. shares)                                   | CHF     | 18'000                           | 1'000     | 8'000        | 11'000                           | 453'970.00           | 0.09                                  |
| ALCON INC  | CHF     | 24'000                           |           | 5'000        | 19'000                           | 1'247'160.00         | 0.24                                  |
| APG SGA (reg. shares)                                  | CHF     | 147                              |           |              | 147                              | 26'901.00            | 0.01                                  |
| BANQUE CANTONALE VAUDOISE                              | CHF     | 3'300                            |           | 1'900        | 1'400                            | 151'900.00           | 0.03                                  |
| CEMBRA MONEY (reg. shares)                             | CHF     | 11'000                           |           | 1'500        | 9'500                            | 623'200.00           | 0.12                                  |
| CIE FINANCIERE RICHEMONT (reg. shares)                 | CHF     | 17'100                           | 2'500     | 5'600        | 14'000                           | 1'620'500.00         | 0.31                                  |
| CLARIANT (reg. shares)                                 | CHF     | 101'830                          |           | 101'830      |                                  |                      |                                       |
| CS GROUP (reg. shares)                                 | CHF     | 297'142                          |           | 297'142      |                                  |                      |                                       |
| EFG INTERNATIONAL                                      | CHF     | 45'500                           | 6'000     | 6'500        | 45'000                           | 486'000.00           | 0.09                                  |
| GALENICA AG  | CHF     | 15'510                           |           | 15'510       |                                  |                      |                                       |
| GEBERIT  | CHF     | 1'900                            |           | 950          | 950                              | 512'050.00           | 0.10                                  |
| HELVETIA HOLDING LTD                                   | CHF     |                                  | 1'700     | 925          | 775                              | 89'822.50            | 0.02                                  |
| JULIUS BAER GRUPPE                                     | CHF     | 12'000                           | 1'700     | 1'700        | 12'000                           | 565'800.00           | 0.11                                  |
| KUEHNE & NAGEL INTERNATIONAL                           | CHF     | 2'250                            |           | 350          | 1'900                            | 550'620.00           | 0.11                                  |
| LAFARGEHOLCIM (reg. shares)                            | CHF     | 65'000                           | 21'500    | 15'300       | 71'200                           | 4'700'624.00         | 0.91                                  |
| LANDIS+GYR GROUP AG                                    | CHF     | 7'500                            |           | 1'100        | 6'400                            | 486'400.00           | 0.09                                  |
| LONZA GROUP (reg. shares)                              | CHF     | 3'600                            | 700       | 800          | 3'500                            | 1'237'950.00         | 0.24                                  |
| MOBILEZONE HOLDING (reg. shares)                       | CHF     | 24'000                           |           | 3'400        | 20'600                           | 282'632.00           | 0.05                                  |
| NESTLE (reg. shares)                                   | CHF     | 144'590                          | 98'600    | 129'690      | 113'500                          | 11'067'385.00        | 2.13                                  |
| NOVARTIS (reg. shares)                                 | CHF     | 114'960                          | 99'800    | 127'760      | 87'000                           | 7'383'690.00         | 1.42                                  |
| PARTNERS GROUP   | CHF     | 450                              |           | 60           | 390                              | 473'070.00           | 0.09                                  |
| ROCHE HOLDINGS (cert. shares)                          | CHF     | 37'000                           | 49'500    | 56'500       | 30'000                           | 7'335'000.00         | 1.41                                  |
| SANDOZ GROUP LTD                                       | CHF     |                                  | 20'500    |              | 20'500                           | 554'730.00           | 0.11                                  |
| SGS LTD  | CHF     |                                  | 10'000    | 1'000        | 9'000                            | 652'860.00           | 0.13                                  |
| SIKA LTD   | CHF     | 2'600                            |           | 400          | 2'200                            | 602'140.00           | 0.12                                  |
| SOCIETE GENERALE DE SURVEILLANCE HOLDING (reg. shares) | CHF     | 450                              |           | 450          |                                  |                      |                                       |
| SONOVA HOLDING (reg. shares)                           | CHF     | 3'100                            | 1'800     | 3'100        | 1'800                            | 493'920.00           | 0.10                                  |
| STRAUMANN HOLDING LTD                                  | CHF     | 6'300                            |           | 1'300        | 5'000                            | 678'000.00           | 0.13                                  |
| SWISS LIFE HOLDING (reg. shares)                       | CHF     | 1'800                            |           | 230          | 1'570                            | 916'880.00           | 0.18                                  |
| SWISS REINSURANCE                                      | CHF     | 18'150                           | 18'350    | 21'500       | 15'000                           | 1'418'400.00         | 0.27                                  |
| SWISSCOM (reg. shares)                                 | CHF     | 1'600                            |           | 300          | 1'300                            | 657'800.00           | 0.13                                  |
| THE SWATCH GROUP (reg. shares)                         | CHF     | 23'890                           |           | 6'390        | 17'500                           | 770'875.00           | 0.15                                  |
| UBS GROUP  | CHF     | 169'490                          | 10'779    | 45'269       | 135'000                          | 3'523'500.00         | 0.68                                  |
| VAT GROUP  | CHF     | 1'350                            |           | 210          | 1'140                            | 480'510.00           | 0.09                                  |
| ZURICH INSURANCE GROUP (reg. shares)                   | CHF     | 7'290                            |           | 1'390        | 5'900                            | 2'593'640.00         | 0.50                                  |
|  |         |                                  |           |              |                                  | <b>55'510'029.50</b> | <b>10.69</b>                          |
| <b>US DOLLAR</b>                                       |         |                                  |           |              |                                  |                      |                                       |
| 3M   | USD     | 16'510                           | 12'000    | 11'510       | 17'000                           | 1'564'107.79         | 0.30                                  |
| ABBVIE   | USD     | 12'900                           | 3'900     | 8'300        | 8'500                            | 1'108'625.06         | 0.21                                  |
| ADVANCED MICRO DEVICES                                 | USD     | 3'000                            | 600       | 2'000        | 1'600                            | 198'502.08           | 0.04                                  |
| ALPHABET -A-   | USD     | 2'000                            | 1'300     | 2'900        | 400                              | 47'026.59            | 0.01                                  |
| ALPHABET -C-   | USD     | 2'000                            | 1'300     | 2'900        | 400                              | 47'444.03            | 0.01                                  |
| AMAZON.COM   | USD     | 1'500                            | 200       | 900          | 800                              | 102'301.09           | 0.02                                  |
| AMGEN  | USD     | 300                              | 50        | 200          | 150                              | 36'360.68            | 0.01                                  |
| APPLE  | USD     | 2'200                            | 800       | 2'600        | 400                              | 64'815.15            | 0.01                                  |
| ASE TECHNOLOGY HOLDING CO LTD ADR                      | USD     | 49'700                           | 50'300    |              | 100'000                          | 791'968.23           | 0.15                                  |

| Titelbezeichnung   | Währung | 31.12.2022<br>Anzahl/<br>Nominal | Käufe (1) | Verkäufe (1) | 31.12.2023<br>Anzahl/<br>Nominal | Kurswert CHF          | in % des<br>Gesamtfonds-<br>vermögens |
|--|---------|----------------------------------|-----------|--------------|----------------------------------|-----------------------|---------------------------------------|
| AT&T   | USD     | 70'000                           | 8'000     | 58'000       | 20'000                           | 282'449.03            | 0.05                                  |
| BANCO DE CHILE ADR   | USD     |                                  | 10'000    |              | 10'000                           | 194'246.83            | 0.04                                  |
| BANCO DO BRASIL ADR  | USD     | 53'689                           | 51'311    |              | 105'000                          | 1'009'633.24          | 0.19                                  |
| BEST BUY   | USD     | 8'800                            | 1'500     | 5'800        | 4'500                            | 296'470.49            | 0.06                                  |
| BRISTOL MYERS SQUIBB   | USD     |                                  | 9'500     |              | 9'500                            | 410'245.43            | 0.08                                  |
| BROADCOM INC   | USD     | 130                              |           | 130          |                                  |                       |                                       |
| C.H. ROBINSON WORLDWIDE  | USD     | 2'430                            |           | 2'430        |                                  |                       |                                       |
| CAMPBELL SOUP  | USD     | 11'440                           | 2'500     | 6'940        | 7'000                            | 254'683.85            | 0.05                                  |
| CITIZENS FINANCIAL GROUP   | USD     | 13'000                           |           | 13'000       |                                  |                       |                                       |
| COCA-COLA  | USD     | 11'100                           | 11'100    | 10'700       | 11'500                           | 570'364.41            | 0.11                                  |
| CONAGRA BRANDS   | USD     | 27'000                           | 6'800     | 17'800       | 16'000                           | 385'935.12            | 0.07                                  |
| CSX  | USD     | 3'400                            |           | 3'400        |                                  |                       |                                       |
| CUMMINS  | USD     | 2'750                            |           | 2'750        |                                  |                       |                                       |
| DEVON ENERGY   | USD     |                                  | 15'600    | 2'800        | 12'800                           | 488'007.29            | 0.09                                  |
| DOW INC  | USD     | 11'000                           | 1'100     | 12'100       |                                  |                       |                                       |
| DUKE ENERGY  | USD     | 7'470                            | 1'600     | 4'470        | 4'600                            | 375'687.51            | 0.07                                  |
| EDISON INTERNATIONAL   | USD     | 12'330                           | 3'400     | 7'730        | 8'000                            | 481'341.62            | 0.09                                  |
| FRANKLIN RESOURCES   | USD     | 4'920                            | 1'000     | 3'220        | 2'700                            | 67'694.35             | 0.01                                  |
| GERDAU ADR   | USD     | 122'000                          | 5'000     | 77'000       | 50'000                           | 204'093.83            | 0.04                                  |
| GILEAD SCIENCES  | USD     | 2'500                            | 650       | 1'650        | 1'500                            | 102'269.95            | 0.02                                  |
| HASBRO   | USD     | 4'300                            | 1'100     | 2'800        | 2'600                            | 111'730.64            | 0.02                                  |
| HUNTINGTON BANCSHARES  | USD     | 29'240                           | 6'000     | 12'240       | 23'000                           | 246'225.53            | 0.05                                  |
| IBM  | USD     | 14'260                           | 7'200     | 12'060       | 9'400                            | 1'293'887.56          | 0.25                                  |
| INTERNATIONAL PAPER  | USD     |                                  | 11'500    |              | 11'500                           | 349'884.16            | 0.07                                  |
| KBF FINANCIAL GROUP ADR  | USD     |                                  | 15'000    |              | 15'000                           | 522'269.80            | 0.10                                  |
| KELLOGG  | USD     | 20'000                           | 4'500     | 13'200       | 11'300                           | 531'723.76            | 0.10                                  |
| KEYCORP  | USD     | 17'250                           | 4'000     | 11'250       | 10'000                           | 121'193.86            | 0.02                                  |
| KIMBERLY-CLARK   | USD     | 8'000                            | 1'450     | 4'850        | 4'600                            | 470'422.39            | 0.09                                  |
| KINDER MORGAN  | USD     | 19'790                           | 58'300    | 25'090       | 53'000                           | 786'851.15            | 0.15                                  |
| KLA-TENCOR   | USD     | 600                              | 50        | 400          | 250                              | 122'309.01            | 0.02                                  |
| LAM RESEARCH   | USD     | 500                              | 80        | 330          | 250                              | 164'802.61            | 0.03                                  |
| LEGGETT & PLATT  | USD     | 10'700                           | 3'950     | 7'150        | 7'500                            | 165'189.76            | 0.03                                  |
| LINCOLN NATIONAL   | USD     |                                  | 22'000    | 11'500       | 10'500                           | 238'335.30            | 0.05                                  |
| LYONDELLBASELL INDUSTRIES -A-                                    | USD     | 3'200                            | 750       | 2'100        | 1'850                            | 148'039.99            | 0.03                                  |
| MEDTRONIC  | USD     | 1'500                            | 300       | 1'000        | 800                              | 55'466.39             | 0.01                                  |
| MERCK & CO   | USD     | 33'630                           | 8'300     | 34'930       | 7'000                            | 642'276.97            | 0.12                                  |
| MICRON TECHNOLOGY  | USD     | 4'000                            | 700       | 2'700        | 2'000                            | 143'648.39            | 0.03                                  |
| MICROSOFT  | USD     | 2'580                            | 300       | 1'980        | 900                              | 284'835.87            | 0.05                                  |
| MODERNA INC  | USD     | 270                              | 20        | 185          | 105                              | 8'788.45              | 0.00                                  |
| NEW YORK COMMUNITY BANCORP                                       | USD     | 35'000                           |           | 35'000       |                                  |                       |                                       |
| NEWELL BRANDS  | USD     | 40'000                           |           | 40'000       |                                  |                       |                                       |
| NVIDIA   | USD     | 1'400                            | 550       | 1'700        | 250                              | 104'197.26            | 0.02                                  |
| ONEOK (new)  | USD     |                                  | 14'300    | 4'300        | 10'000                           | 590'988.40            | 0.11                                  |
| PAYPAL HOLDINGS  | USD     | 520                              | 40        | 350          | 210                              | 10'853.67             | 0.00                                  |
| PEPSICO  | USD     | 1'170                            | 1'240     | 1'110        | 1'300                            | 185'823.86            | 0.04                                  |
| PIONEER NATURAL RESOURCES  | USD     |                                  | 4'400     | 1'100        | 3'300                            | 624'572.57            | 0.12                                  |
| PROCTER & GAMBLE   | USD     | 5'100                            | 4'600     | 5'300        | 4'400                            | 542'658.98            | 0.10                                  |
| PRUDENTIAL FINANCIAL   | USD     | 4'100                            | 1'000     | 2'700        | 2'400                            | 209'483.59            | 0.04                                  |
| REGIONS FINANCIAL  | USD     | 18'240                           | 4'800     | 12'540       | 10'500                           | 171'262.08            | 0.03                                  |
| RENAISSANCE HOLDINGS L.S. -F- 5.75%/PREFERRED STOCK              | USD     | 50'000                           |           | 20'000       | 30'000                           | 603'191.95            | 0.12                                  |
| SANLAM LTD ADR   | USD     | 18'500                           |           |              | 18'500                           | 123'171.51            | 0.02                                  |
| SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS PL                                   | USD     | 4'710                            | 900       | 2'910        | 2'700                            | 193'993.50            | 0.04                                  |
| SNAP-ON  | USD     | 2'000                            |           | 2'000        |                                  |                       |                                       |
| TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFACTURING ADR                           | USD     |                                  | 2'500     |              | 2'500                            | 218'822.25            | 0.04                                  |
| TESLA MOTORS   | USD     | 930                              | 260       | 590          | 600                              | 125'476.05            | 0.02                                  |
| THE WENDY'S  | USD     |                                  | 15'000    |              | 15'000                           | 245'922.55            | 0.05                                  |
| TRUIST FINANCIAL CORP  | USD     | 23'280                           | 4'800     | 15'080       | 13'000                           | 403'945.88            | 0.08                                  |
| UNITED MICROELECTRONICS ADR                                      | USD     |                                  | 80'000    |              | 80'000                           | 569'611.15            | 0.11                                  |
| UNITED PARCEL SERVICE -B-  | USD     | 4'300                            | 13'900    | 6'200        | 12'000                           | 1'587'942.58          | 0.31                                  |
| VERIZON COMMUNICATIONS   | USD     | 8'500                            | 1'400     | 5'400        | 4'500                            | 142'781.52            | 0.03                                  |
| WALGREENS BOOTS ALLIANCE   | USD     |                                  | 10'000    |              | 10'000                           | 219'748.04            | 0.04                                  |
| WESTERN UNION  | USD     | 10'020                           | 8'600     | 6'620        | 12'000                           | 120'385.90            | 0.02                                  |
| WHIRLPOOL  | USD     | 2'600                            | 950       | 1'750        | 1'800                            | 184'472.21            | 0.04                                  |
| WK KELLOGG CO  | USD     |                                  | 2'500     |              | 2'500                            | 27'647.35             | 0.01                                  |
| <b>Total Aktien (und aktienähnliche Wertpapiere)</b>             |         |                                  |           |              |                                  | <b>22'699'108.09</b>  | <b>4.37</b>                           |
| <b>Anleihen</b>  |         |                                  |           |              |                                  | <b>124'008'054.24</b> | <b>23.88</b>                          |
| <b>US DOLLAR</b>   |         |                                  |           |              |                                  |                       |                                       |
| - AT&T INC 0%/18-01.08.2067                                      | USD     | 35'000                           |           | 5'000        | 30'000                           | 626'168.29            | 0.12                                  |
| 4.875 BROOKFIELD BRP HOLDINGS (subordinated) 4.875%/21-PERPETUAL | USD     | 30'000                           |           |              | 30'000                           | 409'029.29            | 0.08                                  |

Jahresbericht per 31. Dezember 2023

| Titelbezeichnung   | Währung | 31.12.2022<br>Anzahl/<br>Nominal | Käufe (1) | Verkäufe (1) | 31.12.2023<br>Anzahl/<br>Nominal | Kurswert CHF          | in % des<br>Gesamtfonds-<br>vermögens |
|--|---------|----------------------------------|-----------|--------------|----------------------------------|-----------------------|---------------------------------------|
| 6.625 BRUNSWICK CORP 6.625%/18-15.01.2049  | USD     | 25'000                           |           |              | 25'000                           | 516'757.16            | 0.10                                  |
| 5.750 SEMPRO ENERGY (subordinated) 5.75%/19-01.07.2079   | USD     | 35'000                           |           | 5'000        | 30'000                           | 630'713.06            | 0.12                                  |
|  |         |                                  |           |              |                                  | <b>2'182'667.80</b>   | <b>0.42</b>                           |
| <b>Total Anleihen</b>  |         |                                  |           |              |                                  | <b>2'182'667.80</b>   | <b>0.42</b>                           |
| <b>Kollektive Kapitalanlagen</b>   |         |                                  |           |              |                                  |                       |                                       |
| <b>ENGLISCHES PFUND</b>  |         |                                  |           |              |                                  |                       |                                       |
| BLUEFIELD SOLAR INCOME FUND LT   | GBP     | 435'000                          | 65'000    |              | 500'000                          | 636'214.99            | 0.12                                  |
| FORESIGHT SOLAR FUND LTD   | GBP     | 510'000                          | 90'000    |              | 600'000                          | 657'887.07            | 0.13                                  |
| GREENCOAT UK WIND PLC/FUNDS  | GBP     | 400'000                          | 70'000    | 70'000       | 400'000                          | 650'162.37            | 0.13                                  |
| JLEN ENVIRONMENTAL ASSETS GROU   | GBP     | 500'000                          | 50'000    |              | 550'000                          | 599'522.66            | 0.12                                  |
| NEXTENERGY SOLAR FUND LTD  | GBP     | 525'000                          | 125'000   |              | 650'000                          | 644'368.84            | 0.12                                  |
|  |         |                                  |           |              |                                  | <b>3'188'155.93</b>   | <b>0.61</b>                           |
| <b>EURO</b>  |         |                                  |           |              |                                  |                       |                                       |
| AMUNDI INDEX EURO AGG SRI UCIT -EUR D- EUR   | EUR     |                                  | 50'000    | 27'000       | 23'000                           | 964'035.68            | 0.19                                  |
| ISHARES EUR CORP BOND ESG UCIT -EUR DIST- EUR  | EUR     | 160'000                          |           | 160'000      |                                  |                       |                                       |
| ISHARES EUR HIGH YIELD CORP BO -EUR DIST- EUR  | EUR     | 1'200'000                        |           | 1'025'000    | 175'000                          | 736'564.12            | 0.14                                  |
| UBS ETF SICAV - UBS ETF - MSCI EMU SOCIALLY RESPONSIBLE UCITS ETF - A- EUR   | EUR     | 42'000                           | 7'000     | 25'000       | 24'000                           | 2'443'697.86          | 0.47                                  |
|  |         |                                  |           |              |                                  | <b>4'144'297.66</b>   | <b>0.80</b>                           |
| <b>SCHWEIZER FRANKEN</b>   |         |                                  |           |              |                                  |                       |                                       |
| CREDIT SUISSE REAL ESTATE FUND GREEN PROPERTY  | CHF     | 4'000                            |           |              | 4'000                            | 484'000.00            | 0.09                                  |
| CREDIT SUISSE REAL ESTATE FUND HOSPITALITY   | CHF     | 8'000                            |           | 1'000        | 7'000                            | 498'400.00            | 0.10                                  |
| CREDIT SUISSE REAL ESTATE FUND INTERSWISS  | CHF     | 4'000                            |           |              | 4'000                            | 652'000.00            | 0.13                                  |
| CREDIT SUISSE REAL ESTATE FUND LIVINGPLUS  | CHF     | 5'500                            |           | 500          | 5'000                            | 717'500.00            | 0.14                                  |
| CREDIT SUISSE REAL ESTATE FUND LOGISTICS PLUS  | CHF     | 4'571                            |           |              | 4'571                            | 432'416.60            | 0.08                                  |
| CREDIT SUISSE REAL ESTATE SIAT   | CHF     | 6'000                            |           | 1'000        | 5'000                            | 1'060'000.00          | 0.20                                  |
| SCHRODER IMMOPLUS  | CHF     | 4'000                            |           |              | 4'000                            | 604'000.00            | 0.12                                  |
| UBS ETF CH - MSCI SWITZERLAND -CHF A-DIS- CHF  | CHF     | 105'880                          | 32'000    | 20'880       | 117'000                          | 1'919'502.00          | 0.37                                  |
| UBS PROPERTY FUND - SWISS MIXED SIMA   | CHF     | 22'000                           |           | 5'000        | 17'000                           | 2'286'500.00          | 0.44                                  |
| UBS PROPERTY SWISS COMMERCIAL SWISSREAL  | CHF     | 10'769                           |           | 1'769        | 9'000                            | 556'200.00            | 0.11                                  |
| UBS PROPERTY SWISS RESIDENTIAL ANFOS   | CHF     | 11'500                           |           | 2'500        | 9'000                            | 734'400.00            | 0.14                                  |
|  |         |                                  |           |              |                                  | <b>9'944'918.60</b>   | <b>1.91</b>                           |
| <b>US DOLLAR</b>   |         |                                  |           |              |                                  |                       |                                       |
| ABERDEEN ASIA-PACIFIC INCOME F   | USD     | 220'000                          | 230'000   | 450'000      |                                  |                       |                                       |
| CREDIT SUISSE INDEX FUND (IE) ETF ICAV - CSIF (IE) MSCI WORLD ESG LEADERS BLUE UCITS ETF -B- USD   | USD     |                                  | 6'000     | 6'000        |                                  |                       |                                       |
| CSIF IE FTSE EPRA NAREIT DEVEL -B USD- EUR   | USD     | 30'000                           |           | 10'000       | 20'000                           | 1'916'546.27          | 0.37                                  |
| CSIF IE MSCI USA SMALL CAP ESG -B USD- EUR   | USD     |                                  | 22'500    | 22'500       |                                  |                       |                                       |
| EATON VANCE LTD DURATION INCOM   | USD     | 100'000                          |           |              | 100'000                          |                       |                                       |
| INVESCO PREFERRED SHARES UCITS ETF -A- USD   | USD     | 100'000                          | 5'000     | 20'000       | 85'000                           | 1'104'189.70          | 0.21                                  |
| INVESCO US HIGH YIELD FALLEN ANGELS  | USD     | 100'000                          | 75'000    | 175'000      |                                  |                       |                                       |
| ISHARES CHINA CNY BOND UCITS E -USD DIST- USD  | USD     | 1'000'000                        |           | 1'000'000    |                                  |                       |                                       |
| ISHARES EM DIVIDEND UCITS ETF -USD DIST- USD   | USD     | 100'400                          | 249'600   | 50'000       | 300'000                          | 3'747'490.96          | 0.72                                  |
| ISHARES II PLC - ISHARES JP MORGAN USD EMERGING MARKETS BOND UCITS ETF   | USD     | 130'000                          |           | 80'000       | 50'000                           | 3'677'993.86          | 0.71                                  |
| ISHARES MSCI EM SRI UCITS ETF -USD DIST- USD   | USD     |                                  | 320'000   | 320'000      |                                  |                       |                                       |
| ISHARES MSCI EMERGING MARKETS LOCAL GOVERNMENT BOND UCITS  | USD     | 60'000                           |           |              | 60'000                           | 2'344'333.67          | 0.45                                  |
| ISHARES MSCI USA SRI UCITS ETF -USD DIST- USD  | USD     | 550'000                          | 187'500   | 422'500      | 315'000                          | 2'547'006.42          | 0.49                                  |
| ISHARES USD HIGH YIELD CORP BO -USD DIST- USD  | USD     | 2'750'000                        | 375'000   | 400'000      | 2'725'000                        | 10'423'618.99         | 2.01                                  |
| L&G ESG EMERGING MARKETS CORPO -USD DISTRIBUTING- USD  | USD     | 1'100'000                        |           |              | 1'100'000                        | 8'031'197.44          | 1.55                                  |
| NUVEEN CREDIT STRATEGIES INCOM   | USD     | 125'000                          |           | 125'000      |                                  |                       |                                       |
| PGIM GLOBAL HIGH YIELD FUND IN   | USD     | 85'000                           |           | 85'000       |                                  |                       |                                       |
| PIMCO FIXED INCOME SOURCE ETF - EMERGING MARKETS ADVANTAGE LOCAL USD BOND INDEX SOURCE ETF   | USD     | 40'000                           | 45'000    |              | 85'000                           | 4'779'099.01          | 0.92                                  |
| SOURCE MORNINGSTAR US ENERGY INFRASTRUCTURE MLP UCITS ETF - B- USD   | USD     | 200'000                          | 60'000    | 15'000       | 245'000                          | 9'394'375.90          | 1.81                                  |
| UBS ETF SICAV - UBS ETF - MSCI EMERGING MARKETS SOCIALLY RESPONSIBLE UCITS ETF -A- USD   | USD     | 365'900                          | 126'600   | 242'500      | 250'000                          | 2'673'839.59          | 0.51                                  |
| VIRTUS ALLIANZGI CONVERTIBLE &   | USD     | 140'000                          |           | 140'000      |                                  |                       |                                       |
|  |         |                                  |           |              |                                  | <b>50'639'691.81</b>  | <b>9.75</b>                           |
| <b>Total Kollektive Kapitalanlagen</b>   |         |                                  |           |              |                                  | <b>67'917'064.00</b>  | <b>13.08</b>                          |
| <b>Total Börsennotierte / an einem geregelten Markt gehandelte Wertpapiere; bewertet zu den Kursen, die am Hauptmarkt bezahlt werden</b> |         |                                  |           |              |                                  | <b>194'107'786.04</b> | <b>37.37</b>                          |
| <b>Wertpapiere bewertet aufgrund von am Markt beobachtbaren Parametern</b>   |         |                                  |           |              |                                  |                       |                                       |
| <b>Aktien (und aktienähnliche Wertpapiere)</b>   |         |                                  |           |              |                                  |                       |                                       |
| <b>EURO</b>  |         |                                  |           |              |                                  |                       |                                       |
| ACS ACTIVIDADES DE CONSTRUCCIO (rights) 03.02.2023   | EUR     |                                  | 9'736     | 9'736        |                                  |                       |                                       |

| Titelbezeichnung                                     | Währung   | 31.12.2022<br>Anzahl/<br>Nominal | Käufe (1) | Verkäufe (1) | 31.12.2023<br>Anzahl/<br>Nominal | Kurswert CHF         | in % des<br>Gesamtfonds-<br>vermögens |      |
|--|---|----------------------------------|-----------|--------------|----------------------------------|----------------------|---------------------------------------|------|
| ACS ACTIVIDADES DE CONSTRUCCIO (rights) 17.07.2023   | EUR   |                                  | 8'400     | 8'400        |                                  | 0.00                 | 0.00                                  |      |
| <b>Total Aktien (und aktienähnliche Wertpapiere)</b> |   |                                  |           |              |                                  | <b>0.00</b>          | <b>0.00</b>                           |      |
| <b>Anleihen</b>                                      |   |                                  |           |              |                                  |                      |                                       |      |
| <b>AUSTRALISCHER DOLLAR</b>                          |   |                                  |           |              |                                  |                      |                                       |      |
| 4.600  | AT&T INC 4.6%/18-19.09.2028   | AUD                              | 5'000'000 |              | 3'500'000                        | 1'978'258.49         | 0.38                                  |      |
| 4.760  | ATHENE GLOBAL FUNDING 4.76%/22-21.04.2027   | AUD                              | 2'500'000 |              | 2'500'000                        | 1'346'755.64         | 0.26                                  |      |
| 6.134  | AUSNET SERVICES HOLDINGS 6.134%/23-31.05.2033   | AUD                              |           | 1'500'000    | 1'500'000                        | 888'647.68           | 0.17                                  |      |
| 4.750  | AUSTRALIA S. 136 4.75%/11-21.04.2027  | AUD                              | 2'000'000 |              | 2'000'000                        | 1'189'159.18         | 0.23                                  |      |
| 4.500  | AUSTRALIA S. 140 4.5%/13-21.04.2033   | AUD                              | 500'000   |              | 500'000                          | 299'518.00           | 0.06                                  |      |
| 3.147  | COMPUTERSHARE US INC 3.147%/21-30.11.2027   | AUD                              | 1'000'000 |              | 1'000'000                        |                      |                                       |      |
| 4.100  | FBG FINANCE PTY LTD 4.1%/17-06.09.2027  | AUD                              | 1'200'000 |              | 1'200'000                        |                      |                                       |      |
| 3.700  | LENDLEASE FINANCE LTD 3.7%/21-31.03.2031  | AUD                              | 1'200'000 | 200'000      | 1'000'000                        | 466'279.95           | 0.09                                  |      |
| -  | NATIONAL AUSTRALIA BANK (subordinated) FIX-TO-FRN FRN/22-03.08.2032                     | AUD                              | 1'000'000 |              | 1'000'000                        | 591'047.77           | 0.11                                  |      |
| 4.000  | NEW SOUTH WALES TREASURY 4%/13-20.04.2023   | AUD                              | 3'000'000 | 3'000'000    |                                  |                      |                                       |      |
| 5.400  | PACIFIC NATIONAL FINANCE 5.4%/17-12.05.2027   | AUD                              | 4'000'000 |              | 4'000'000                        | 2'229'442.31         | 0.43                                  |      |
| 5.250  | QANTAS AIRWAYS LTD 5.25%/20-09.09.2030  | AUD                              | 500'000   |              | 500'000                          | 278'709.00           | 0.05                                  |      |
| 5.000  | SOCIETE GENERALE (subordinated) 5%/17-19.05.2027  | AUD                              | 1'500'000 |              | 1'500'000                        | 830'079.85           | 0.16                                  |      |
| 4.000  | TELSTRA CORP LTD 4%/17-19.04.2027   | AUD                              | 4'000'000 | 2'000'000    | 2'000'000                        | 1'132'466.37         | 0.22                                  |      |
| 5.500  | TREASURY CORP OF VICTORIA 5.5%/11-17.11.2026  | AUD                              | 5'000'000 | 1'000'000    | 4'000'000                        | 2'392'422.64         | 0.46                                  |      |
| 4.500  | VERIZON COMMUNICATIONS 4.5%/17-17.08.2027   | AUD                              | 2'000'000 |              | 2'000'000                        | 1'139'231.37         | 0.22                                  |      |
| 4.200  | VODAFONE GROUP PLC 4.2%/17-13.12.2027   | AUD                              | 2'000'000 |              | 2'000'000                        | 1'117'270.95         | 0.22                                  |      |
| 5.300  | WESTPAC BANKING CORP 5.3%/22-11.11.2027   | AUD                              |           | 500'000      | 500'000                          | 294'539.00           | 0.06                                  |      |
| 2.800  | WOOLWORTHS GROUP LTD 2.8%/20-20.05.2030   | AUD                              | 1'000'000 |              | 1'000'000                        | 501'460.28           | 0.10                                  |      |
|  |   |                                  |           |              |                                  | <b>16'675'288.48</b> | <b>3.21</b>                           |      |
| <b>DAENISCHE KRONE</b>                               |   |                                  |           |              |                                  |                      |                                       |      |
| 7.000  | KINGDOM OF DENMARK 7%/94-10.11.2024   | DKK                              |           | 7'500'000    | 7'500'000                        | 967'919.15           | 0.19                                  |      |
|  |   |                                  |           |              |                                  | <b>967'919.15</b>    | <b>0.19</b>                           |      |
| <b>ENGLISCHES PFUND</b>                              |   |                                  |           |              |                                  |                      |                                       |      |
| 6.625  | AEGON s 46 6.625%/09-16.12.2039   | GBP                              | 1'000'000 |              | 1'000'000                        | 1'224'697.76         | 0.24                                  |      |
| 9.750  | AHHEUSER-BUSCH INBEV 9.75%/09-30.07.2024  | GBP                              | 1'000'000 |              | 1'000'000                        | 1'096'060.03         | 0.21                                  |      |
| 4.000  | AMGEN (reg. -S-) 4%/12-13.09.2029   | GBP                              | 700'000   | 700'000      |                                  |                      |                                       |      |
| 4.500  | ANGLIAN WATER SERVICES FINANCING 4.5%/13-22.02.2026                                     | GBP                              | 1'000'000 | 1'000'000    |                                  |                      |                                       |      |
| 5.750  | ASTRAZENECA PLC S. -3- 5.75%/07-13.11.2031  | GBP                              | 500'000   |              | 500'000                          | 603'095.33           | 0.12                                  |      |
| 5.750  | BT GROUP (reg. -S-) 5.75%/99-07.12.2028   | GBP                              | 1'000'000 |              | 1'000'000                        | 1'130'724.63         | 0.22                                  |      |
| -  | CENTRICA (reg.-S) (subordinated) FIX-TO-FLOATER 5.25%/15-10.04.2075                     | GBP                              | 1'800'000 | 800'000      | 1'000'000                        | 1'056'953.73         | 0.20                                  |      |
| 6.800  | CITIGROUP INC 6.8%/08-25.06.2038  | GBP                              |           | 400'000      | 400'000                          | 512'950.21           | 0.10                                  |      |
| 7.375  | CREDIT AGRICOLE s283 7.375%/08-18.12.2023   | GBP                              | 500'000   | 500'000      |                                  |                      |                                       |      |
| 6.000  | EIB 6%/98-07.12.2028  | GBP                              | 1'000'000 | 1'000'000    | 2'000'000                        | 2'367'320.57         | 0.46                                  |      |
| 8.125  | FRANCE TELECOM (reg. -S-) S. 103 T.1 8.125%/08-20.11.2028                               | GBP                              | 1'300'000 |              | 1'300'000                        | 1'635'218.44         | 0.31                                  |      |
| 7.250  | HAMMERSON PLC 7.25%/98-21.04.2028   | GBP                              | 850'000   |              | 850'000                          | 946'761.93           | 0.18                                  |      |
| 6.750  | HEATHROW FUNDING LIMITED (reg. -S-) A-10 S. 2 6.75%/09-03.12.2028                       | GBP                              |           | 700'000      | 700'000                          | 789'554.60           | 0.15                                  |      |
| 7.125  | HEATHROW FUNDING LIMITED (subordinated) (reg. -S-) S. -11- C. -B2- 7.125%/12-14.02.2024 | GBP                              | 500'000   |              | 500'000                          |                      |                                       |      |
| 5.750  | HSBC HOLDINGS 5.75%/02-20.12.2027   | GBP                              |           | 300'000      | 300'000                          | 334'402.32           | 0.06                                  |      |
| 7.375  | IBERDROLA FINANZAS SAU 7.375%/09-29.01.2024   | GBP                              | 500'000   |              | 500'000                          | 536'974.04           | 0.10                                  |      |
| 6.000  | ITALY 6%/98-04.08.2028  | GBP                              | 500'000   |              | 500'000                          | 563'157.55           | 0.11                                  |      |
| 5.500  | JOHNSON & JOHNSON 5.5%/07-06.11.2024  | GBP                              | 2'700'000 |              | 2'700'000                        |                      |                                       |      |
| 5.375  | NEDERLANDSE WATERSCHAPSBANK 5.375%/01-07.06.2032  | GBP                              |           | 700'000      | 700'000                          | 828'111.59           | 0.16                                  |      |
| -  | NGG FINANCE ff 13-18.06.2073  | GBP                              | 1'600'000 | 600'000      | 1'000'000                        | 1'056'932.27         | 0.20                                  |      |
| 5.625  | RECKITT BENCKISER TSY 5.625%/23-14.12.2038  | GBP                              |           | 600'000      | 600'000                          | 723'218.73           | 0.14                                  |      |
| 8.375  | SSE (reg. -S-) S. 3 8.375%/08-20.11.2028  | GBP                              | 1'000'000 |              | 1'000'000                        | 1'257'216.61         | 0.24                                  |      |
| 2.250  | UNITED KINGDOM 2.25%/13-07.09.2023  | GBP                              | 2'000'000 |              | 2'000'000                        |                      |                                       |      |
| 2.750  | UNITED KINGDOM 2.75%/14-07.09.2024  | GBP                              | 1'500'000 |              | 1'500'000                        |                      |                                       |      |
| 6.000  | UNITED KINGDOM 6%/98-07.12.2028   | GBP                              |           | 2'500'000    | 2'500'000                        | 3'001'851.15         | 0.58                                  |      |
|  |   |                                  |           |              |                                  | <b>19'665'201.49</b> | <b>3.79</b>                           |      |
| <b>EURO</b>  |   |                                  |           |              |                                  |                      |                                       |      |
| 4.875  | ALD SA S. -0- 4.875%/23-06.10.2028  | EUR                              |           | 1'000'000    | 1'000'000                        | 984'310.58           | 0.19                                  |      |
| -  | BANK OF AMERICA CORP FIX-TO-FRN FRN/20-31.03.2029                                       | EUR                              | 2'000'000 |              | 2'000'000                        |                      |                                       |      |
| 4.250  | BAYER AG 4.25%/23-26.08.2029  | EUR                              |           | 400'000      | 400'000                          | 385'182.15           | 0.07                                  |      |
| -  | BAYER FIX-TO-FRN 3.75%/14-01.07.2074  | EUR                              | 500'000   |              | 500'000                          |                      |                                       |      |
| 4.000  | BELGIUM KINGDOM S. 66 4%/12-28.03.2032  | EUR                              |           | 1'000'000    | 1'000'000                        | 1'033'593.98         | 0.20                                  |      |
| 3.750  | CAISSE NATIONALE DES AUTOROUTES 3.75%/05-15.07.2025                                     | EUR                              | 500'000   |              | 500'000                          |                      |                                       |      |
| 4.875  | CEZ (reg. -S-) S. 15 4.875%/10-16.04.2025   | EUR                              | 1'000'000 |              | 300'000                          | 700'000              | 659'399.95                            | 0.13 |
| 4.250  | CYPRUS (reg. -S-) 4.25%/15-04.11.2025   | EUR                              |           | 1'400'000    | 1'400'000                        | 1'340'796.61         | 0.26                                  |      |
| 3.500  | DEUTSCHE LUFTHANSA AG 3.5%/21-14.07.2029  | EUR                              | 1'000'000 |              | 1'000'000                        |                      |                                       |      |

Jahresbericht per 31. Dezember 2023

| Titelbezeichnung   | Währung | 31.12.2022<br>Anzahl/<br>Nominal | Käufe (1) | Verkäufe (1) | 31.12.2023<br>Anzahl/<br>Nominal | Kurswert CHF         | in % des<br>Gesamtfonds-<br>vermögens |
|--|---------|----------------------------------|-----------|--------------|----------------------------------|----------------------|---------------------------------------|
| - ENERGIAS DE PORTUGAL SA (subordinated) FIX-TO-FRN FRN/19-30.04.2079              | EUR     | 1'500'000                        |           |              | 1'500'000                        | 1'393'657.49         | 0.27                                  |
| 4.500 FIAT CHRYSLER AUTOMOBILE 4.5%/20-07.07.2028                                  | EUR     | 1'000'000                        |           |              | 1'000'000                        | 978'974.10           | 0.19                                  |
| 5.750 FRANCE 5.75%/01-25.10.2032   | EUR     |                                  | 800'000   |              | 800'000                          | 934'891.44           | 0.18                                  |
| 6.000 FRANCE 6%/94-25.10.2025  | EUR     | 500'000                          | 1'500'000 | 300'000      | 1'700'000                        | 1'677'168.57         | 0.32                                  |
| 4.000 FRESENIUS FINANCE (reg. -S-) 4%/14-01.02.2024                                | EUR     | 500'000                          |           | 500'000      |                                  |                      |                                       |
| 4.250 GERMANY 4.25%/07-04.07.2039  | EUR     |                                  | 800'000   |              | 800'000                          | 936'408.72           | 0.18                                  |
| 6.500 GERMANY 6.5%/97-04.07.2027   | EUR     | 500'000                          |           | 500'000      |                                  |                      |                                       |
| 6.250 GERMANY S. 00 6.25%/00-04.01.2030  | EUR     |                                  | 800'000   |              | 800'000                          | 923'482.17           | 0.18                                  |
| 6.000 GROUPAMA ASSURANCES MUTUELLES SA (subordinated) 6%/17-23.01.2027             | EUR     | 600'000                          |           |              | 600'000                          | 599'293.92           | 0.12                                  |
| 3.875 HARLEY-DAVIDSON FINL SER 3.875%/20-19.05.2023                                | EUR     | 1'500'000                        |           | 1'500'000    |                                  |                      |                                       |
| 5.400 IRELAND 5.4%/09-13.03.2025   | EUR     | 500'000                          |           |              | 500'000                          | 477'810.02           | 0.09                                  |
| 3.750 ITALY BTP 3.75%/14-01.09.2024  | EUR     | 1'100'000                        |           | 1'100'000    |                                  |                      |                                       |
| 6.500 ITALY BTP 6.5%/97-01.11.2027   | EUR     | 800'000                          |           | 100'000      | 700'000                          | 736'577.14           | 0.14                                  |
| 4.000 NYKREDIT REALKREDIT AS S. -5- 4%/23-17.07.2028                               | EUR     |                                  | 1'000'000 | 1'000'000    |                                  |                      |                                       |
| - OMV FIX-TO-FRN 6.25%/15-PERPETUAL  | EUR     | 1'500'000                        |           |              | 1'500'000                        | 1'443'177.96         | 0.28                                  |
| 5.250 POLAND (reg -S-) S. 24 5.25%/10-20.01.2025                                   | EUR     | 600'000                          |           |              | 600'000                          | 568'457.63           | 0.11                                  |
| 4.125 PORTUGAL (OBRIGACOES DO TESOURO) 4.125%/17-14.04.2027                        | EUR     | 600'000                          |           |              | 600'000                          | 590'625.39           | 0.11                                  |
| 4.875 PROCTER & GAMBLE CO (reg. -S-) 4.875%/07-11.05.2027                          | EUR     | 500'000                          |           |              | 500'000                          | 495'014.12           | 0.10                                  |
| 4.000 REPUBLIC OF ESTONIA 4%/22-12.10.2032   | EUR     |                                  | 750'000   |              | 750'000                          | 750'902.42           | 0.14                                  |
| 4.250 SNCF RESEAU (reg. -S-) S. -84- 4.25%/11-07.10.2026                           | EUR     | 500'000                          |           |              | 500'000                          | 484'057.60           | 0.09                                  |
| 3.800 SPAIN 3.8%/14-30.04.2024   | EUR     | 1'100'000                        |           | 1'100'000    |                                  |                      |                                       |
| 5.750 SPAIN 5.75%/01-30.07.2032  | EUR     |                                  | 1'000'000 |              | 1'000'000                        | 1'135'070.73         | 0.22                                  |
| 5.500 SUEZ ENVIRONNEMENT COMPANY 5.5%/09-22.07.2024                                | EUR     | 600'000                          |           | 600'000      |                                  |                      |                                       |
| - TELEFONICA EUROPE BV (subordinated) FIX-TO-FRN FRN/19-PERPETUAL                  | EUR     | 1'500'000                        |           |              | 1'500'000                        | 1'385'820.12         | 0.27                                  |
| 3.875 TELIASONERA (reg. -S-) S. -69- 3.875%/10-01.10.2025                          | EUR     | 1'500'000                        |           | 1'500'000    |                                  |                      |                                       |
| 4.875 WAL-MART STORES 4.875%/09-21.09.2029   | EUR     | 1'500'000                        |           |              | 1'500'000                        | 1'551'687.89         | 0.30                                  |
|  |         |                                  |           |              |                                  | <b>21'466'360.70</b> | <b>4.13</b>                           |
| <b>KANADISCHER DOLLAR</b>  |         |                                  |           |              |                                  |                      |                                       |
| 5.500 BANK OF NOVA SCOTIA 5.5%/23-29.12.2025                                       | CAD     |                                  | 1'000'000 |              | 1'000'000                        | 648'109.28           | 0.12                                  |
| 7.850 BELL CANADA S. -M-11- 7.85%/01-02.04.2031                                    | CAD     | 1'000'000                        |           |              | 1'000'000                        | 753'921.21           | 0.15                                  |
| 5.400 BRITISH COLUMBIA PROV OF S. -BCCD-7- 5.4%/04-18.06.2035                      | CAD     |                                  | 1'000'000 |              | 1'000'000                        | 728'703.28           | 0.14                                  |
| 6.150 BRITISH COLUMBIA PROV OF S. -BCCD-W- 6.15%/97-19.11.2027                     | CAD     |                                  | 2'500'000 |              | 2'500'000                        | 1'741'735.44         | 0.34                                  |
| 3.500 CANADIAN GOVERNMENT 3.5%/22-01.03.2028                                       | CAD     |                                  | 3'500'000 | 1'500'000    | 2'000'000                        | 1'290'308.20         | 0.25                                  |
| 6.100 ENBRIDGE INC 6.1%/22-09.11.2032  | CAD     |                                  | 2'000'000 |              | 2'000'000                        | 1'388'805.60         | 0.27                                  |
| 7.050 GREATER TORONTO AIRPORT S. 2000-1 7.05%/00-12.06.2030                        | CAD     | 1'000'000                        |           |              | 1'000'000                        | 735'079.57           | 0.14                                  |
| 4.400 IADB 4.4%/06-26.01.2026  | CAD     | 500'000                          |           |              | 500'000                          | 321'153.71           | 0.06                                  |
| 4.488 LOBLAW COS LTD S. -2028- 4.488%/18-11.12.2028                                | CAD     | 4'500'000                        |           |              | 4'500'000                        | 2'909'598.46         | 0.56                                  |
| 5.219 NATIONAL BANK OF CANADA 5.219%/23-14.06.2028                                 | CAD     |                                  | 1'000'000 |              | 1'000'000                        | 657'555.63           | 0.13                                  |
| 4.400 ROGERS COMMUNICATIONS INC 4.4%/18-02.11.2028                                 | CAD     |                                  | 5'000'000 |              | 5'000'000                        | 3'180'804.58         | 0.61                                  |
| 4.400 SHAW COMMUNICATIONS INC 4.4%/18-02.11.2028                                   | CAD     | 5'000'000                        |           | 5'000'000    |                                  |                      |                                       |
| 3.750 TELUS S. -CV- 3.75%/15-10.03.2026  | CAD     | 3'500'000                        |           | 1'500'000    | 2'000'000                        | 1'257'692.75         | 0.24                                  |
| 3.057 WALT DISNEY COMPANY/THE 3.057%/20-30.03.2027                                 | CAD     | 3'000'000                        |           | 3'000'000    |                                  |                      |                                       |
| 3.460 WELLS FARGO CANADA 3.46%/13-24.01.2023                                       | CAD     | 2'500'000                        |           | 2'500'000    |                                  |                      |                                       |
|  |         |                                  |           |              |                                  | <b>15'613'467.71</b> | <b>3.01</b>                           |
| <b>US DOLLAR</b>   |         |                                  |           |              |                                  |                      |                                       |
| 6.150 ABBOTT LABORATORIES 6.15%/07-30.11.2037                                      | USD     | 1'000'000                        |           |              | 1'000'000                        | 968'153.80           | 0.19                                  |
| 4.625 AERCAP IRELAND CAP/GLOBA 4.625%/20-15.10.2027                                | USD     | 1'000'000                        |           | 500'000      | 500'000                          | 413'435.19           | 0.08                                  |
| 6.500 AERCAP IRELAND CAPITAL DAC / AERCAP GLOBAL AVIATION TRUST 6.5%/20-15.07.2025 | USD     | 1'000'000                        |           |              | 1'000'000                        | 854'147.41           | 0.16                                  |
| 4.250 AIRCASTLE LTD 4.25%/19-15.06.2026  | USD     | 1'500'000                        |           |              | 1'500'000                        | 1'221'381.64         | 0.24                                  |
| 5.050 ALBEMARLE CORP 5.05%/22-01.06.2032   | USD     |                                  | 1'500'000 |              | 1'500'000                        | 1'232'693.07         | 0.24                                  |
| 3.800 AMAZON.COM 3.8%/14-05.12.2024  | USD     | 1'500'000                        |           | 1'500'000    |                                  |                      |                                       |
| 3.500 ANHEUSER-BUSCH INBEV WOR 3.5%/20-01.06.2030                                  | USD     | 1'000'000                        |           | 1'000'000    |                                  |                      |                                       |
| 3.350 ANTHEM INC 3.35%/17-01.12.2024   | USD     | 2'500'000                        |           | 2'500'000    |                                  |                      |                                       |
| 3.000 APPLE INC 3%/17-20.06.2027   | USD     | 2'400'000                        |           | 600'000      | 1'800'000                        | 1'456'750.23         | 0.28                                  |
| 4.000 ASHTEAD CAPITAL INC 4%/19-01.05.2028   | USD     | 1'200'000                        |           |              | 1'200'000                        | 949'432.72           | 0.18                                  |
| 5.820 ASIAN DEVELOPMENT BANK 5.82%/98-16.06.2028                                   | USD     | 1'000'000                        |           |              | 1'000'000                        | 899'409.95           | 0.17                                  |
| 3.800 AVANGRID INC 3.8%/19-01.06.2029  | USD     | 1'500'000                        |           | 1'500'000    |                                  |                      |                                       |
| 3.500 BANC CREDITO INVERSIONES 3.5%/17-12.10.2027                                  | USD     | 1'000'000                        |           | 1'000'000    |                                  |                      |                                       |
| 5.500 BARRY CALLEBAUT SERVICES (reg. -S-) 5.5%/13-15.06.2023                       | USD     | 2'500'000                        |           | 2'500'000    |                                  |                      |                                       |
| 3.750 BECLE SA DE CV S. -14- 3.75%/15-13.05.2025                                   | USD     | 1'200'000                        |           | 1'200'000    |                                  |                      |                                       |
| 3.700 BECTON DICKINSON AND CO 3.7%/17-06.06.2027                                   | USD     | 1'000'000                        |           |              | 1'000'000                        | 815'651.53           | 0.16                                  |
| 4.150 BMW US CAPITAL LLC 4.15%/20-09.04.2030                                       | USD     | 1'200'000                        |           | 1'200'000    |                                  |                      |                                       |
| 5.700 BPCE 5.7%/13-23.10.2023  | USD     | 2'000'000                        |           | 2'000'000    |                                  |                      |                                       |
| - BRITISH TELECOMMUNICATIONS STEP UP 00-15.12.2030                                 | USD     |                                  | 2'000'000 |              | 2'000'000                        | 2'083'457.15         | 0.40                                  |
| 4.200 CELULOSA ARAUCO CONSTITU 4.2%/19-29.01.2030                                  | USD     | 1'000'000                        |           | 1'000'000    |                                  |                      |                                       |
| 4.125 CERRO DEL AGUILA SA 4.125%/17-16.08.2027                                     | USD     | 3'000'000                        |           | 3'000'000    |                                  |                      |                                       |
| 5.500 CISCO SYSTEMS 5.5%/09-15.01.2040   | USD     | 1'000'000                        | 200'000   |              | 1'200'000                        | 1'076'080.30         | 0.21                                  |

| Titelbezeichnung   | Wahrung | 31.12.2022<br>Anzahl/<br>Nominal | Kaufe (1) | Verkaufe (1) | 31.12.2023<br>Anzahl/<br>Nominal | Kurswert CHF | in % des<br>Gesamtfonds-<br>vermogens |
|--|----------|----------------------------------|------------|---------------|----------------------------------|--------------|--|
| 4.450 CITIGROUP INC 4.45%/15-29.09.2027                                  | USD      | 1'000'000                        |            | 1'000'000     |                                  |              |  |
| 6.500 COMCAST 6.5%/05-15.11.2035   | USD      |                                  | 1'500'000  |               | 1'500'000                        | 1'441'853.48 | 0.28                                   |
| 3.700 COMCAST CORP 3.7%/18-15.04.2024                                    | USD      | 3'000'000                        |            | 3'000'000     |                                  |              |  |
| 8.500 DAIMLERCHRYSLER NORTH AMERICA 8.5%/01-18.01.2031                   | USD      | 800'000                          |            |               | 800'000                          | 844'162.38   | 0.16                                   |
| 6.020 DELL INT LLC / EMC CORP 6.02%/21-15.06.2026                        | USD      | 2'500'000                        |            |               | 2'500'000                        | 2'153'189.91 | 0.41                                   |
| 9.250 DEUTSCHE TELECOM INTERNATIONAL FINANCE 9.25%/02-01.06.2032         | USD      |                                  | 1'500'000  |               | 1'500'000                        | 1'638'844.00 | 0.32                                   |
| 8.750 DEUTSCHE TELEKOM INTERNATIONAL FINANCE STEP UP 8.75%/00-15.06.2030 | USD      |                                  | 1'500'000  |               | 1'500'000                        | 1'521'854.05 | 0.29                                   |
| 6.700 DISCOVER FINANCIAL SVS 6.7%/22-29.11.2032                          | USD      |                                  | 1'500'000  |               | 1'500'000                        | 1'321'101.47 | 0.25                                   |
| 7.375 DOW CHEMICAL 7.375%/99-01.11.2029                                  | USD      | 1'000'000                        | 500'000    |               | 1'500'000                        | 1'425'441.81 | 0.27                                   |
| 4.493 DOWDUPONT INC 4.493%/18-15.11.2025                                 | USD      | 1'000'000                        |            |               | 1'000'000                        | 836'347.06   | 0.16                                   |
| 3.625 EDF (reg. -S-) 3.625%/15-13.10.2025                                | USD      | 1'200'000                        |            | 1'200'000     |                                  |              |  |
| 5.750 EDISON INTERNATIONAL 5.75%/19-15.06.2027                           | USD      | 1'500'000                        |            |               | 1'500'000                        | 1'290'563.14 | 0.25                                   |
| 3.500 ENEL FINANCE INTL NV 3.5%/17-06.04.2028                            | USD      | 1'200'000                        |            | 1'200'000     |                                  |              |  |
| 4.375 EXPORT DEVELOPMNT CANADA 4.375%/23-29.06.2026                      | USD      |                                  | 700'000    |               | 700'000                          | 591'646.55   | 0.11                                   |
| 6.625 FANNIE MAE 6.625%/00-15.11.2030                                    | USD      | 1'000'000                        |            |               | 1'000'000                        | 968'305.29   | 0.19                                   |
| 4.250 FEDEX CORP 4.25%/20-15.05.2030                                     | USD      | 1'000'000                        |            |               | 1'000'000                        | 824'252.92   | 0.16                                   |
| 4.400 GC TREASURY CENTRE CO 4.4%/22-30.03.2032                           | USD      | 1'000'000                        |            | 1'000'000     |                                  |              |  |
| 3.100 GECC T. 881 3.1%/13-09.01.2023                                     | USD      | 3'000'000                        |            | 3'000'000     |                                  |              |  |
| 5.800 GENERAL MOTORS FINL CO 5.8%/23-23.06.2028                          | USD      |                                  | 800'000    |               | 800'000                          | 692'165.08   | 0.13                                   |
| 6.250 GLOBELEQ MESOAMERICA 6.25%/21-26.04.2029                           | USD      | 300'000                          |            |               | 300'000                          | 237'234.46   | 0.05                                   |
| 5.625 HCA INC 5.625%/18-01.09.2028                                       | USD      | 1'000'000                        |            |               | 1'000'000                        | 861'318.05   | 0.17                                   |
| 4.950 HEXCEL 4.95%/15-15.08.2025   | USD      | 800'000                          |            |               | 800'000                          | 667'609.86   | 0.13                                   |
| 5.500 HP INC 5.5%/22-15.01.2033  | USD      | 1'000'000                        | 500'000    |               | 1'500'000                        | 1'295'360.40 | 0.25                                   |
| 5.875 IBM 5.875%/02-29.11.2032   | USD      | 1'200'000                        |            |               | 1'200'000                        | 1'105'389.02 | 0.21                                   |
| 8.500 INDONESIA (reg. -S-) 8.5%/05-12.10.2035                            | USD      |                                  | 800'000    |               | 800'000                          | 897'379.95   | 0.17                                   |
| 6.250 JEFFERIES GROUP 6.25%/06-15.01.2036                                | USD      |                                  | 1'000'000  |               | 1'000'000                        | 884'976.10   | 0.17                                   |
| 8.375 KONINKLUKE KPN -144A- 8.375%/00-01.10.2030                         | USD      | 1'800'000                        |            |               | 1'800'000                        | 1'784'079.70 | 0.34                                   |
| 4.625 KRAFT HEINZ FOODS CO 4.625%/18-30.01.2029                          | USD      | 1'000'000                        |            |               | 1'000'000                        | 847'885.73   | 0.16                                   |
| 3.700 KROGER CO 3.7%/17-01.08.2027                                       | USD      | 1'000'000                        |            | 1'000'000     |                                  |              |  |
| 4.750 LENNAR CORP 4.75%/18-29.11.2027                                    | USD      | 2'000'000                        |            |               | 2'000'000                        | 1'683'399.58 | 0.32                                   |
| 4.750 MCKESSON CORP 4.75%/18-30.05.2029                                  | USD      | 1'500'000                        |            |               | 1'500'000                        | 1'265'251.30 | 0.24                                   |
| 5.000 MEGLOBAL CANADA INC 5%/20-18.05.2025                               | USD      | 1'500'000                        |            | 1'500'000     |                                  |              |  |
| - MERCK & CO STEP UP 03-01.12.2033                                       | USD      | 800'000                          |            |               | 800'000                          | 791'328.59   | 0.15                                   |
| 6.375 METLIFE INC 6.375%/04-15.06.2034                                   | USD      |                                  | 1'400'000  |               | 1'400'000                        | 1'322'836.06 | 0.25                                   |
| 4.185 MICRON TECHNOLOGY INC 4.185%/19-15.02.2027                         | USD      | 2'000'000                        |            | 2'000'000     |                                  |              |  |
| 6.250 MORGAN STANLEY 6.25%/06-09.08.2026                                 | USD      | 2'500'000                        |            | 1'000'000     | 1'500'000                        | 1'301'622.08 | 0.25                                   |
| 5.602 NATIONAL GRID PLC 5.602%/23-12.06.2028                             | USD      |                                  | 1'000'000  |               | 1'000'000                        | 867'714.39   | 0.17                                   |
| 4.950 NESTLE HOLDINGS INC 4.95%/23-14.03.2030                            | USD      |                                  | 1'000'000  |               | 1'000'000                        | 868'303.53   | 0.17                                   |
| 4.450 NEWELL RUBBERMAID 4.45%/16-01.04.2026                              | USD      | 800'000                          |            |               | 800'000                          | 662'964.09   | 0.13                                   |
| 6.950 OCCIDENTAL PETROLEUM COR 6.95%/19-01.07.2024                       | USD      | 389'000                          |            |               | 389'000                          | 329'189.13   | 0.06                                   |
| 7.950 OCCIDENTAL PETROLEUM COR 7.95%/19-15.06.2039                       | USD      |                                  | 1'000'000  |               | 1'000'000                        | 981'485.13   | 0.19                                   |
| 6.250 ORACLE CORP 6.25%/22-09.11.2032                                    | USD      |                                  | 1'500'000  |               | 1'500'000                        | 1'372'810.85 | 0.26                                   |
| 8.750 PERU 8.75%/03-21.11.2033   | USD      |                                  | 2'300'000  |               | 2'300'000                        | 2'430'644.75 | 0.47                                   |
| 6.500 PFIZER 6.5%/03-01.02.2034  | USD      | 1'000'000                        |            |               | 1'000'000                        | 949'848.48   | 0.18                                   |
| 4.650 PFIZER INVESTMENT ENTER 4.65%/23-19.05.2030                        | USD      |                                  | 1'500'000  |               | 1'500'000                        | 1'271'247.87 | 0.24                                   |
| 10.625 PHILIPPINES 10.625%/00-16.03.2025                                 | USD      | 1'000'000                        |            |               | 1'000'000                        | 896'363.27   | 0.17                                   |
| - PRUDENTIAL FINANCIAL INC (subordinated) FIX-TO-FRN FRN/18-15.09.2048   | USD      | 2'100'000                        |            | 1'100'000     | 1'000'000                        | 818'588.79   | 0.16                                   |
| 5.500 PULTEGROUP INC 5.5%/16-01.03.2026                                  | USD      | 2'000'000                        |            |               | 2'000'000                        | 1'705'584.79 | 0.33                                   |
| 3.250 ROCHE HOLDINGS INC 3.25%/18-17.09.2023                             | USD      | 2'000'000                        |            | 2'000'000     |                                  |              |  |
| 6.000 ROMANIA 6%/22-25.05.2034   | USD      |                                  | 2'500'000  |               | 2'500'000                        | 2'115'863.89 | 0.41                                   |
| 4.000 SCHLUMBERGER HOLDINGS (reg. -S-) 4%/15-21.12.2025                  | USD      | 1'200'000                        |            |               | 1'200'000                        | 993'961.36   | 0.19                                   |
| 6.450 SOUTHWESTERN ENERGY 6.45%/15-23.01.2025                            | USD      | 800'000                          |            |               | 800'000                          | 670'801.29   | 0.13                                   |
| 4.050 STANDARD CHARTERED (reg. -S-) 4.05%/16-12.04.2026                  | USD      | 1'500'000                        |            | 1'500'000     |                                  |              |  |
| 4.000 STATE OF QATAR 4%/19-14.03.2029                                    | USD      | 1'000'000                        |            | 1'000'000     |                                  |              |  |
| 7.250 STATOIL ASA 7.25%/00-23.09.2027                                    | USD      | 2'000'000                        |            |               | 2'000'000                        | 1'846'590.48 | 0.36                                   |
| 5.950 SYSCO CORPORATION 5.95%/20-01.04.2030                              | USD      |                                  | 1'200'000  |               | 1'200'000                        | 1'074'918.86 | 0.21                                   |
| 4.450 TOYOTA MOTOR CREDIT CORP S. -B- 4.45%/22-29.06.2029                | USD      |                                  | 1'000'000  |               | 1'000'000                        | 845'781.67   | 0.16                                   |
| 6.750 TRAVELERS COS INC 6.75%/06-20.06.2036                              | USD      |                                  | 1'500'000  |               | 1'500'000                        | 1'487'768.28 | 0.29                                   |
| 7.125 TYCO ELECTRONICS GROUP S 7.125%/08-01.10.2037                      | USD      | 1'000'000                        |            |               | 1'000'000                        | 991'020.73   | 0.19                                   |
| - UBS GROUP AG FIX-TO-FRN FRN/23-22.12.2027                              | USD      |                                  | 1'500'000  |               | 1'500'000                        | 1'301'016.11 | 0.25                                   |
| 6.338 UNITED MEXICAN STATES 6.338%/23-04.05.2053                         | USD      |                                  | 1'000'000  |               | 1'000'000                        | 858'363.95   | 0.17                                   |
| 4.500 UNITED STATES OF AMERICA 4.5%/06-15.02.2036                        | USD      | 1'200'000                        |            | 1'200'000     |                                  |              |  |
| 4.625 UNITED STATES OF AMERICA 4.625%/10-15.02.2040                      | USD      |                                  | 5'000'000  |               | 5'000'000                        | 4'510'250.12 | 0.87                                   |
| 6.250 UNITED STATES OF AMERICA 6.25%/00-15.05.2030                       | USD      | 3'000'000                        | 6'000'000  | 1'000'000     | 8'000'000                        | 7'614'593.54 | 1.47                                   |
| 6.500 UNITED STATES OF AMERICA 6.5%/96-15.11.2026                        | USD      | 10'000'000                       |            | 2'000'000     | 8'000'000                        | 7'168'532.79 | 1.38                                   |
| 2.500 UNITED STATES OF AMERICA E-2023 2.5%/13-15.08.2023                 | USD      | 5'000'000                        |            | 5'000'000     |                                  |              |  |
| 2.250 UNITED STATES OF AMERICA F 2024 2.25%/14-15.11.2024                | USD      | 4'500'000                        |            | 4'500'000     |                                  |              |  |
| 2.250 UNITED STATES OF AMERICA -F-2025- 2.25%/15-15.11.2025              | USD      | 5'000'000                        |            | 5'000'000     |                                  |              |  |



Jahresbericht per 31. Dezember 2023

| Titelbezeichnung   | Währung | 31.12.2022<br>Anzahl/<br>Nominal | Käufe (1)  | Verkäufe (1) | 31.12.2023<br>Anzahl/<br>Nominal | Kurswert CHF          | in % des<br>Gesamtfonds-<br>vermögens |
|--|---------|----------------------------------|------------|--------------|----------------------------------|-----------------------|---------------------------------------|
| 2.500 UNITED STATES OF AMERICA S. -U-2024- 2.5%/19-31.01.2024  | USD     |                                  | 600'000    | 600'000      |                                  |                       |                                       |
| 4.625 UNITEDHEALTH GROUP 4.625%/15-15.07.2035  | USD     |                                  | 1'200'000  | 1'200'000    |                                  |                       |                                       |
| 7.875 URUGUAY 7.875%/03-15.01.2033   | USD     |                                  | 800'000    |              | 800'000                          | 821'862.71            | 0.16                                  |
| 5.000 US 5%/07-15.05.2037  | USD     |                                  | 2'000'000  |              | 2'000'000                        | 1'884'448.84          | 0.36                                  |
| 6.250 US 6.25%/93-15.08.2023   | USD     | 5'000'000                        | 3'000'000  | 8'000'000    |                                  |                       |                                       |
| 6.375 US 6.375%/97-15.08.2027  | USD     | 8'000'000                        |            |              | 8'000'000                        | 7'274'524.84          | 1.40                                  |
| 6.875 US 6.875%/95-15.08.2025  | USD     | 10'000'000                       |            | 2'000'000    | 8'000'000                        | 6'988'635.65          | 1.35                                  |
| 7.500 US 7.5%/94-15.11.2024  | USD     | 4'600'000                        |            |              | 4'600'000                        | 3'969'467.20          | 0.76                                  |
| 2.625 US TREASURY N/B S. -AA-2023- 2.625%/18-30.06.2023  | USD     |                                  | 7'400'000  | 7'400'000    |                                  |                       |                                       |
| 2.750 US TREASURY N/B S. -Y-2023- 2.75%/18-30.04.2023  | USD     |                                  | 11'000'000 | 11'000'000   |                                  |                       |                                       |
| 7.750 VERIZON GLOBAL FUNDING 7.75%/01-01.12.2030   | USD     |                                  | 500'000    |              | 500'000                          | 493'229.56            | 0.09                                  |
| 6.875 VIACOM 6.875%/06-30.04.2036  | USD     |                                  | 1'500'000  |              | 1'500'000                        | 1'281'738.71          | 0.25                                  |
| 6.000 VIRGINIA ELEC & POWER CO 6%/06-15.01.2036  | USD     |                                  | 1'000'000  |              | 1'000'000                        | 902'843.78            | 0.17                                  |
| - VODAFONE GROUP PLC (subordinated) FIX-TO-FRN FRN/19-04.04.2079   | USD     | 1'000'000                        |            | 200'000      | 800'000                          | 695'733.57            | 0.13                                  |
| 4.950 WABTEC 4.95%/18-15.09.2028   | USD     | 700'000                          |            |              | 700'000                          | 582'721.13            | 0.11                                  |
| 4.000 WELLTOWER 4%/15-01.06.2025   | USD     | 1'500'000                        |            | 1'500'000    |                                  |                       |                                       |
|  |         |                                  |            |              |                                  | <b>111'995'405.14</b> | <b>21.56</b>                          |
| <b>Total Anleihen</b>  |         |                                  |            |              |                                  | <b>186'383'642.67</b> | <b>35.89</b>                          |
| <b>Kollektive Kapitalanlagen</b>   |         |                                  |            |              |                                  |                       |                                       |
| <b>EURO</b>  |         |                                  |            |              |                                  |                       |                                       |
| CREDIT SUISSE INDEX FUND (LUX) SICAV - CSIF (LUX) EQUITY EMU ESG BLUE -OAX- EUR  | EUR     | 4'500                            | 800        | 2'000        | 3'300                            | 3'781'046.20          | 0.73                                  |
| CS INVESTMENT FUNDS 1 SICAV - CREDIT SUISSE (LUX) FINANCIAL BOND FUND -EA- EUR   | EUR     | 2'250                            |            | 2'250        |                                  |                       |                                       |
| INVESCO ZODIAC FUNDS FCP-SIF - INVESCO EUROPEAN SENIOR LOAN ESG FUND -GX EUR MD- EUR                                     | EUR     | 48'500                           |            |              | 48'500                           | 4'011'246.43          | 0.77                                  |
|  |         |                                  |            |              |                                  | <b>7'792'292.63</b>   | <b>1.50</b>                           |
| <b>JAPANISCHER YEN</b>   |         |                                  |            |              |                                  |                       |                                       |
| CREDIT SUISSE INDEX FUND (LUX) SICAV - CSIF (LUX) EQUITY JAPAN ESG BLUE -OAX- JPY  | JPY     | 1'000                            |            |              | 1'000                            | 7'17'368.42           | 0.14                                  |
|  |         |                                  |            |              |                                  | <b>7'17'368.42</b>    | <b>0.14</b>                           |
| <b>NORWEGISCHE KRONE</b>   |         |                                  |            |              |                                  |                       |                                       |
| STORM FUND II SICAV - STORM BOND FUND -IC DIST NOK- NOK  | NOK     | 800'000                          |            |              | 800'000                          | 7'202'574.89          | 1.39                                  |
|  |         |                                  |            |              |                                  | <b>7'202'574.89</b>   | <b>1.39</b>                           |
| <b>US DOLLAR</b>   |         |                                  |            |              |                                  |                       |                                       |
| BLACKROCK STRATEGIC FUNDS SICAV - BLACKROCK GLOBAL REAL ASSET SECURITIES FUND -D3 USD- USD                               | USD     | 45'000                           |            | 25'000       | 20'000                           | 1'213'116.90          | 0.23                                  |
| BNP PARIBAS EASY SICAV - JPM ESG EMBI GLOBAL DIVERSIFIED COMPOSITE - TRACK PRIVILEGE USD DIST- USD                       | USD     | 280'000                          |            | 215'000      | 65'000                           | 4'234'352.80          | 0.82                                  |
| BNP PARIBAS INSTICASH SICAV - BNP PARIBAS INSTICASH USD 1D LVNAV -I PLUS DIS USD INC- USD                                | USD     |                                  | 1'500'000  | 1'500'000    |                                  |                       |                                       |
| CIM INVESTMENT FUND ICAV - CIM DIVIDEND INCOME FUND -H ORDINARY- USD   | USD     |                                  | 450'000    |              | 450'000                          | 3'616'875.54          | 0.70                                  |
| CREDIT SUISSE (LUX) EMERGING MARKET CORPORATE BOND FUND -EA- USD   | USD     | 13'500                           |            | 13'500       |                                  |                       |                                       |
| CREDIT SUISSE FUND (LUX) ASIA PACIFIC INCOME EQUITY FUND -DA- USD  | USD     | 3'400                            | 600        | 4'000        |                                  |                       |                                       |
| CREDIT SUISSE INDEX FUND (LUX) SICAV - CSIF (LUX) BOND GOVERNMENT EMERGING MARKETS USD -OAX- USD                         | USD     |                                  | 13'700     |              | 13'700                           | 9'058'279.23          | 1.74                                  |
| CREDIT SUISSE INDEX FUND (LUX) SICAV - CSIF (LUX) EQUITY CHINA TOTAL MARKET BLUE -OB- USD                                | USD     |                                  | 4'250      | 3'000        | 1'250                            | 921'904.46            | 0.18                                  |
| CREDIT SUISSE INDEX FUND (LUX) SICAV - CSIF (LUX) EQUITY EMERGING MARKETS ESG BLUE -QA USD INC- USD                      | USD     | 4'300                            | 3'700      | 3'000        | 5'000                            | 3'715'517.67          | 0.72                                  |
| CREDIT SUISSE NOVA (LUX) GLOBAL SENIOR LOAN FUND -EA- USD  | USD     | 9'700                            |            | 3'700        | 6'000                            | 5'179'522.69          | 1.00                                  |
| CS INVESTMENT FUNDS 1 SICAV - CREDIT SUISSE(LUX)LATIN AMERICA CORPORATE BOND FUND -IA USD- USD                           | USD     | 6'500                            |            | 6'500        |                                  |                       |                                       |
| CS INVESTMENT FUNDS 4 SICAV - CREDIT SUISSE (LUX) ALTERNATIVE OPPORTUNITIES FUND -EA- USD                                | USD     |                                  | 15'000     | 250          | 14'750                           | 12'127'316.43         | 2.33                                  |
| DIVAS GLOBAL BARRIER COUPON FUND -F USD DIST- USD  | USD     | 50'000                           | 15'000     |              | 65'000                           | 4'970'000.38          | 0.96                                  |
| DWS INVEST SICAV - DWS INVEST ESG ASIAN BONDS -USD IDQ- USD  | USD     |                                  | 90'000     |              | 90'000                           | 7'788'978.04          | 1.50                                  |
| INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC - BLACKROCK ICS US DOLLAR LIQUIDITY FUND -PREMIER (ACC TO)- USD                            | USD     |                                  | 1'432      | 1'432        |                                  |                       |                                       |
| INVESCO ZODIAC FUNDS FCP-SIF - INVESCO US SENIORLOAN ESG FUND -GX USD MD- USD  | USD     | 195'000                          |            | 5'000        | 190'000                          | 14'962'644.74         | 2.88                                  |
| LEGAL & GENERAL ICAV - L&G ESG EMERGING MARKETS GOVERNMENT BOND (LOCAL CURRENCY) INDEX FUND -C DIS UNHEDGED USD INC- USD | USD     | 16'952'598                       |            | 4'952'598    | 12'000'000                       | 9'585'424.56          | 1.85                                  |
| LEGAL & GENERAL ICAV - L&G ESG GLOBAL HIGH YIELDBOND INDEX FUND -C USD INC UNHEDGED- USD                                 | USD     |                                  | 7'000'000  |              | 7'000'000                        | 6'296'105.31          | 1.21                                  |
| PRINCIPAL GLOBAL INVESTORS FUNDS - FINISTERRE UNCONSTRAINED EMERGING MARKETS FIXED INCOME FUND -I3 INCOME USD- USD       | USD     | 900'000                          | 900'000    | 100'000      | 1'700'000                        | 12'753'087.05         | 2.46                                  |
| PRINCIPAL GLOBAL INVESTORS FUNDS - PREFERRED SECURITIES FUND -I CLASS INCOME- USD  | USD     | 400'000                          | 100'000    |              | 500'000                          | 3'884'094.96          | 0.75                                  |
| SIMAG INVESTMENT FUNDS SICAV - SIMAG SYSTEMATIC USA ESG EQUITY FUND -SA- USD   | USD     | 29'000                           |            | 29'000       |                                  |                       |                                       |



| Titelbezeichnung   | Währung | 31.12.2022<br>Anzahl/<br>Nominal | Käufe (1) | Verkäufe (1) | 31.12.2023<br>Anzahl/<br>Nominal | Kurswert CHF   | in % des<br>Gesamtfonds-<br>vermögens |
|--|---------|----------------------------------|-----------|--------------|----------------------------------|----------------|---------------------------------------|
|  |         |                                  |           |              |                                  | 100'307'220.76 | 19.31                                 |
| <b>Total Kollektive Kapitalanlagen</b>   |         |                                  |           |              |                                  | 116'019'456.70 | 22.34                                 |
| <b>Strukturierte Produkte</b>  |         |                                  |           |              |                                  |                |                                       |
| <b>EURO</b>  |         |                                  |           |              |                                  |                |                                       |
| CREDIT SUISSE AG NASSAU BRANCH 6%/20-PERPETUAL   | EUR     | 7'000                            |           | 7'000        |                                  |                |                                       |
| J.P.MORGAN STRUCTURED PRODUCTS B.V./20-26.05.2025  | EUR     | 20'000                           |           | 20'000       |                                  |                |                                       |
| UBS AG/20-18.05.2027   | EUR     | 2'000                            |           | 2'000        |                                  |                |                                       |
|  |         |                                  |           |              |                                  | 0.00           | 0.00                                  |
| <b>SCHWEIZER FRANKEN</b>   |         |                                  |           |              |                                  |                |                                       |
| CREDIT SUISSE AG NASSAU BRANCH 6%/20-PERPETUAL   | CHF     | 7'500                            |           | 7'500        |                                  |                |                                       |
| J.P.MORGAN STRUCTURED PRODUCTS B.V./20-26.05.2025  | CHF     | 22'500                           |           | 22'500       |                                  |                |                                       |
| UBS AG/20-18.05.2027   | CHF     | 2'250                            |           | 2'250        |                                  |                |                                       |
|  |         |                                  |           |              |                                  | 0.00           | 0.00                                  |
| <b>US DOLLAR</b>   |         |                                  |           |              |                                  |                |                                       |
| CREDIT SUISSE AG NASSAU BRANCH 6%/20-PERPETUAL   | USD     | 12'500                           |           | 12'500       |                                  |                |                                       |
| J.P.MORGAN STRUCTURED PRODUCTS B.V./20-26.05.2025  | USD     | 30'000                           |           | 30'000       |                                  |                |                                       |
| UBS AG/20-18.05.2027   | USD     | 2'000                            |           | 2'000        |                                  |                |                                       |
|  |         |                                  |           |              |                                  | 0.00           | 0.00                                  |
| <b>Total Strukturierte Produkte</b>  |         |                                  |           |              |                                  | 0.00           | 0.00                                  |
| <b>Total Wertpapiere bewertet aufgrund von am Markt beobachtbaren Parametern</b>   |         |                                  |           |              |                                  | 302'403'099.37 | 58.22                                 |
| <b>Wertpapiere bewertet aufgrund geeigneten Bewertungsmodellen unter Berücksichtigung der aktuellen Marktgegebenheiten</b>         |         |                                  |           |              |                                  |                |                                       |
| <b>Kollektive Kapitalanlagen</b>   |         |                                  |           |              |                                  |                |                                       |
| <b>US DOLLAR</b>   |         |                                  |           |              |                                  |                |                                       |
| THOMASLOYD ENERGY IMPACT TRUS  | USD     | 1'550'000                        |           |              | 1'550'000                        | 657'476.70     | 0.13                                  |
|  |         |                                  |           |              |                                  | 657'476.70     | 0.13                                  |
| <b>Total Kollektive Kapitalanlagen</b>   |         |                                  |           |              |                                  | 657'476.70     | 0.13                                  |
| <b>Total Wertpapiere bewertet aufgrund geeigneten Bewertungsmodellen unter Berücksichtigung der aktuellen Marktgegebenheiten</b>   |         |                                  |           |              |                                  | 657'476.70     | 0.13                                  |
| <b>Derivative Finanzinstrumente</b>  |         |                                  |           |              |                                  |                |                                       |
| <b>Börsennotierte / an einem geregelten Markt gehandelte Wertpapiere; bewertet zu den Kursen, die am Hauptmarkt bezahlt werden</b> |         |                                  |           |              |                                  |                |                                       |
| <b>Financial Futures</b>   |         |                                  |           |              |                                  |                |                                       |
| <b>ENGLISCHES PFUND</b>  |         |                                  |           |              |                                  |                |                                       |
| FTSE 100 Index -10- 03/23  | GBP     | -20                              | 42        | 22           |                                  |                |                                       |
| FTSE 100 Index -10- 06/23  | GBP     |                                  | 22        | 22           |                                  |                |                                       |
| FTSE 100 Index -10- 09/23  | GBP     |                                  | 20        | 20           |                                  |                |                                       |
| FTSE 100 Index -10- 12/23  | GBP     |                                  | 20        | 20           |                                  |                |                                       |
| FTSE 100 Index -10- 03/24  | GBP     |                                  | 20        | 20           |                                  |                |                                       |
|  |         |                                  |           |              |                                  | 0.00           | 0.00                                  |
| <b>EURO</b>  |         |                                  |           |              |                                  |                |                                       |
| EURO STOXX 50 Index -10- 03/23   | EUR     | -190                             | 200       | 10           |                                  |                |                                       |
| EURO STOXX 50 Index -10- 06/23   | EUR     |                                  | 125       | 125          |                                  |                |                                       |
| EURO STOXX 50 Index -10- 09/23   | EUR     |                                  | 140       | 140          |                                  |                |                                       |
|  |         |                                  |           |              |                                  | 0.00           | 0.00                                  |
| <b>SCHWEIZER FRANKEN</b>   |         |                                  |           |              |                                  |                |                                       |
| SMI Index -10- 03/23   | CHF     | -35                              | 66        | 31           |                                  |                |                                       |
| SMI Index -10- 06/23   | CHF     |                                  | 25        | 25           |                                  |                |                                       |
| SMI Index -10- 09/23   | CHF     |                                  | 30        | 30           |                                  |                |                                       |
|  |         |                                  |           |              |                                  | 0.00           | 0.00                                  |
| <b>US DOLLAR</b>   |         |                                  |           |              |                                  |                |                                       |
| S&P E-MINI 500 Index -50- 03/23  | USD     | -95                              | 105       | 10           |                                  |                |                                       |
| S&P E-MINI 500 Index -50- 06/23  | USD     |                                  | 22        | 22           |                                  |                |                                       |
| S&P E-MINI 500 Index -50- 09/23  | USD     |                                  | 22        | 22           |                                  |                |                                       |
|  |         |                                  |           |              |                                  | 0.00           | 0.00                                  |
| <b>Total Financial Futures</b>   |         |                                  |           |              |                                  | 0.00           | 0.00                                  |
| <b>Options</b>   |         |                                  |           |              |                                  |                |                                       |
| <b>ENGLISCHES PFUND</b>  |         |                                  |           |              |                                  |                |                                       |
| RIO TINTO (call) -61- 20.01.23   | GBP     | -22                              | 22        |              |                                  |                |                                       |
|  |         |                                  |           |              |                                  | 0.00           | 0.00                                  |
| <b>EURO</b>  |         |                                  |           |              |                                  |                |                                       |
| ENDESA (put) -19- 16.06.23   | EUR     | -50                              | 50        |              |                                  |                |                                       |
|  |         |                                  |           |              |                                  | 0.00           | 0.00                                  |
| <b>KANADISCHER DOLLAR</b>  |         |                                  |           |              |                                  |                |                                       |
| GREAT WEST LIFECO (call) -36- 17.02.23   | CAD     |                                  | 120       | 120          |                                  |                |                                       |

Jahresbericht per 31. Dezember 2023

| Titelbezeichnung  | Währung | 31.12.2022<br>Anzahl/<br>Nominal | Käufe (1) | Verkäufe (1) | 31.12.2023<br>Anzahl/<br>Nominal | Kurswert CHF | in % des<br>Gesamtfonds-<br>vermögens |
|---|---------|----------------------------------|-----------|--------------|----------------------------------|--------------|---------------------------------------|
| POWER CORP OF CANADA (call) -37- 17.02.23               | CAD     |                                  | 65        | 65           |                                  | 0.00         | 0.00                                  |
| <b>SCHWEIZER FRANKEN</b>                                |         |                                  |           |              |                                  |              |                                       |
| EUREX FRANKFURT AKTIENGESELLSCHAFT (call) -94- 20.10.23 | CHF     |                                  | 300       | 300          |                                  |              |                                       |
| EUREX FRANKFURT AKTIENGESELLSCHAFT (put) -86- 20.10.23  | CHF     |                                  | 300       | 300          |                                  |              |                                       |
| NESTLE reg (call) -102- 17.11.23                        | CHF     |                                  | 260       | 260          |                                  |              |                                       |
| NESTLE reg (call) -102- 19.01.24                        | CHF     |                                  |           | 270          | -270                             | -2'970.00    | 0.00                                  |
| NESTLE reg (call) -103- 15.12.23                        | CHF     |                                  | 260       | 260          |                                  |              |                                       |
| NESTLE reg (call) -108- 25.08.23                        | CHF     |                                  | 260       | 260          |                                  |              |                                       |
| NESTLE reg (call) -112- 20.01.23                        | CHF     | -300                             | 300       |              |                                  |              |                                       |
| NESTLE reg (call) -112- 20.10.23                        | CHF     |                                  | 250       | 250          |                                  |              |                                       |
| NESTLE reg (call) -112- 21.07.23                        | CHF     |                                  | 260       | 260          |                                  |              |                                       |
| NESTLE reg (call) -114- 21.04.23                        | CHF     |                                  | 280       | 280          |                                  |              |                                       |
| NESTLE reg (call) -116- 17.03.23                        | CHF     |                                  | 300       | 300          |                                  |              |                                       |
| NESTLE reg (call) -122- 16.06.23                        | CHF     |                                  | 250       | 250          |                                  |              |                                       |
| NESTLE reg (put) -102- 20.10.23                         | CHF     |                                  | 250       | 250          |                                  |              |                                       |
| NESTLE reg (put) -102- 25.08.23                         | CHF     |                                  | 260       | 260          |                                  |              |                                       |
| NESTLE reg (put) -104- 20.01.23                         | CHF     | -300                             | 300       |              |                                  |              |                                       |
| NESTLE reg (put) -104- 21.04.23                         | CHF     |                                  | 280       | 280          |                                  |              |                                       |
| NESTLE reg (put) -104- 21.07.23                         | CHF     |                                  | 260       | 260          |                                  |              |                                       |
| NESTLE reg (put) -105- 17.03.23                         | CHF     |                                  | 300       | 300          |                                  |              |                                       |
| NESTLE reg (put) -108- 16.06.23                         | CHF     |                                  | 250       | 250          |                                  |              |                                       |
| NESTLE reg (put) -92- 19.01.24                          | CHF     |                                  |           | 270          | -270                             | -4'050.00    | 0.00                                  |
| NESTLE reg (put) -94- 17.11.23                          | CHF     |                                  | 260       | 260          |                                  |              |                                       |
| NESTLE reg (put) -97- 15.12.23                          | CHF     |                                  | 260       | 260          |                                  |              |                                       |
| NOVARTIS reg (call) -78- 21.04.23                       | CHF     |                                  | 400       | 400          |                                  |              |                                       |
| NOVARTIS reg (call) -87- 17.03.23                       | CHF     |                                  | 400       | 400          |                                  |              |                                       |
| NOVARTIS reg (call) -88- 19.01.24                       | CHF     |                                  |           | 310          | -310                             | -6'510.00    | 0.00                                  |
| NOVARTIS reg (call) -88- 20.01.23                       | CHF     | -380                             | 380       |              |                                  |              |                                       |
| NOVARTIS reg (call) -89- 15.12.23                       | CHF     |                                  | 300       | 300          |                                  |              |                                       |
| NOVARTIS reg (call) -89- 17.11.23                       | CHF     |                                  | 300       | 300          |                                  |              |                                       |
| NOVARTIS reg (call) -93- 21.07.23                       | CHF     |                                  | 310       | 310          |                                  |              |                                       |
| NOVARTIS reg (call) -93- 25.08.23                       | CHF     |                                  | 310       | 310          |                                  |              |                                       |
| NOVARTIS reg (call) -97- 16.06.23                       | CHF     |                                  | 310       | 310          |                                  |              |                                       |
| NOVARTIS reg (put) -72- 21.04.23                        | CHF     |                                  | 400       | 400          |                                  |              |                                       |
| NOVARTIS reg (put) -79- 17.03.23                        | CHF     |                                  | 400       | 400          |                                  |              |                                       |
| NOVARTIS reg (put) -80- 19.01.24                        | CHF     |                                  |           | 310          | -310                             | -3'720.00    | 0.00                                  |
| NOVARTIS reg (put) -81- 20.01.23                        | CHF     | -380                             | 380       |              |                                  |              |                                       |
| NOVARTIS reg (put) -82- 17.11.23                        | CHF     |                                  | 300       | 300          |                                  |              |                                       |
| NOVARTIS reg (put) -83- 15.12.23                        | CHF     |                                  | 300       | 300          |                                  |              |                                       |
| NOVARTIS reg (put) -87- 16.06.23                        | CHF     |                                  | 310       | 310          |                                  |              |                                       |
| NOVARTIS reg (put) -87- 21.07.23                        | CHF     |                                  | 310       | 310          |                                  |              |                                       |
| NOVARTIS reg (put) -87- 25.08.23                        | CHF     |                                  | 310       | 310          |                                  |              |                                       |
| ROCHE HOLDING cert (call) -245- 15.12.23                | CHF     |                                  | 110       | 110          |                                  |              |                                       |
| ROCHE HOLDING cert (call) -245- 17.11.23                | CHF     |                                  | 110       | 110          |                                  |              |                                       |
| ROCHE HOLDING cert (call) -255- 19.01.24                | CHF     |                                  |           | 110          | -110                             | -7'260.00    | 0.00                                  |
| ROCHE HOLDING cert (call) -270- 20.10.23                | CHF     |                                  | 110       | 110          |                                  |              |                                       |
| ROCHE HOLDING cert (call) -270- 21.04.23                | CHF     |                                  | 120       | 120          |                                  |              |                                       |
| ROCHE HOLDING cert (call) -285- 21.07.23                | CHF     |                                  | 110       | 110          |                                  |              |                                       |
| ROCHE HOLDING cert (call) -285- 25.08.23                | CHF     |                                  | 110       | 110          |                                  |              |                                       |
| ROCHE HOLDING cert (call) -295- 16.06.23                | CHF     |                                  | 110       | 110          |                                  |              |                                       |
| ROCHE HOLDING cert (call) -305- 17.03.23                | CHF     |                                  | 120       | 120          |                                  |              |                                       |
| ROCHE HOLDING cert (call) -315- 20.01.23                | CHF     | -110                             | 110       |              |                                  |              |                                       |
| ROCHE HOLDING cert (put) -225- 17.11.23                 | CHF     |                                  | 110       | 110          |                                  |              |                                       |
| ROCHE HOLDING cert (put) -230- 15.12.23                 | CHF     |                                  | 110       | 110          |                                  |              |                                       |
| ROCHE HOLDING cert (put) -230- 19.01.24                 | CHF     |                                  |           | 110          | -110                             | -3'520.00    | 0.00                                  |
| ROCHE HOLDING cert (put) -250- 20.10.23                 | CHF     |                                  | 110       | 110          |                                  |              |                                       |
| ROCHE HOLDING cert (put) -250- 21.04.23                 | CHF     |                                  | 120       | 120          |                                  |              |                                       |
| ROCHE HOLDING cert (put) -260- 25.08.23                 | CHF     |                                  | 110       | 110          |                                  |              |                                       |
| ROCHE HOLDING cert (put) -265- 16.06.23                 | CHF     |                                  | 110       | 110          |                                  |              |                                       |
| ROCHE HOLDING cert (put) -265- 21.07.23                 | CHF     |                                  | 110       | 110          |                                  |              |                                       |
| ROCHE HOLDING cert (put) -275- 17.03.23                 | CHF     |                                  | 120       | 120          |                                  |              |                                       |
| ROCHE HOLDING cert (put) -290- 20.01.23                 | CHF     | -110                             | 110       |              |                                  |              |                                       |
| SWISS LIFE HOLDING reg (call) -570- 17.02.23            | CHF     |                                  | 10        | 10           |                                  |              |                                       |
| SWISS REINSURANCE reg (call) -92- 20.01.23              | CHF     | -181                             | 181       |              |                                  |              |                                       |

| Titelbezeichnung   | Währung | 31.12.2022<br>Anzahl/<br>Nominal | Käufe (1) | Verkäufe (1) | 31.12.2023<br>Anzahl/<br>Nominal | Kurswert CHF          | in % des<br>Gesamtfonds-<br>vermögens |
|--|---------|----------------------------------|-----------|--------------|----------------------------------|-----------------------|---------------------------------------|
|  |         |                                  |           |              |                                  | -28'030.00            | -0.01                                 |
| <b>US DOLLAR</b>   |         |                                  |           |              |                                  |                       |                                       |
| NVIDIA (call) -210- 17.02.23   | USD     |                                  | 5         | 5            |                                  | 0.00                  | 0.00                                  |
| <b>Total Options</b>   |         |                                  |           |              |                                  | -28'030.00            | -0.01                                 |
| <b>Total Börsennotierte / an einem geregelten Markt gehandelte Wertpapiere; bewertet zu den Kursen, die am Hauptmarkt bezahlt werden</b> |         |                                  |           |              |                                  | -28'030.00            | -0.01                                 |
| <b>Wertpapiere bewertet aufgrund von am Markt beobachtbaren Parametern</b>   |         |                                  |           |              |                                  |                       |                                       |
| <b>Devisentermingeschäfte</b>  |         |                                  |           |              |                                  |                       |                                       |
| Devisentermingeschäfte (siehe Liste)   |         |                                  |           |              |                                  | 14'176'864.04         | 2.73                                  |
| <b>Total Devisentermingeschäfte</b>  |         |                                  |           |              |                                  | <b>14'176'864.04</b>  | <b>2.73</b>                           |
| <b>Total Wertpapiere bewertet aufgrund von am Markt beobachtbaren Parametern</b>   |         |                                  |           |              |                                  | <b>14'176'864.04</b>  | <b>2.73</b>                           |
| <b>Total Derivative Finanzinstrumente</b>  |         |                                  |           |              |                                  | <b>14'148'834.04</b>  | <b>2.72</b>                           |
| <b>Total Anlagen</b>   |         |                                  |           |              |                                  | <b>511'317'196.15</b> | <b>98.45</b>                          |
| Bankguthaben auf Sicht   |         |                                  |           |              |                                  | 5'010'986.15          | 0.96                                  |
| Bankguthaben auf Zeit  |         |                                  |           |              |                                  | 0.00                  | 0.00                                  |
| Sonstige Vermögenswerte  |         |                                  |           |              |                                  | 3'061'947.11          | 0.59                                  |
| <b>Gesamtfondsvermögen (GFV)</b>   |         |                                  |           |              |                                  | <b>519'390'129.41</b> | <b>100.00</b>                         |
| ./. Bankverbindlichkeiten  |         |                                  |           |              |                                  | 0.00                  | 0.00                                  |
| ./. Andere Verbindlichkeiten   |         |                                  |           |              |                                  | 518'608.55            | 0.10                                  |
| ./. Andere Kredite   |         |                                  |           |              |                                  | 0.00                  | 0.00                                  |
| <b>Nettobondsvermögen</b>  |         |                                  |           |              |                                  | <b>518'871'520.86</b> | <b>99.90</b>                          |

(1) Umfassen auch Corporate Actions

**Summarische Gliederung des Portefeuilles gemäss KKV FINMA Art. 84 Absatz 2**

| Anlagekategorien   | Kurswert CHF          | in % des<br>Gesamtfonds-<br>vermögens |
|--|-----------------------|---------------------------------------|
| <b>Börsennotierte / an einem geregelten Markt gehandelte Wertpapiere; bewertet zu den Kursen, die am Hauptmarkt bezahlt werden</b> | <b>194'079'756.04</b> | <b>37.37</b>                          |
| <b>Wertpapiere bewertet aufgrund von am Markt beobachtbaren Parametern</b>   | <b>316'579'963.41</b> | <b>60.95</b>                          |
| <b>Wertpapiere bewertet aufgrund geeigneten Bewertungsmodellen unter Berücksichtigung der aktuellen Marktgegebenheiten</b>         | <b>657'476.70</b>     | <b>0.13</b>                           |

**Aufstellung der Devisentermingeschäfte für die Zeit vom 1. Januar 2023 bis zum 31. Dezember 2023**

| Fälligkeit | Transaktion | Währung | Betrag     | Gegen | Gegenwert  | Devisengewinn/-verlust<br>Mandatswährung | in % des GFV |
|------------|-------------|---------|------------|-------|------------|--|--------------|
| 10.01.2023 | Bought      | CHF     | 22'530     | EUR   | 22'800     | 0.00                                     | 0.00         |
| 10.01.2023 | Bought      | CHF     | 985        | EUR   | 1'000      | 0.00                                     | 0.00         |
| 10.01.2023 | Bought      | CHF     | 4'047      | EUR   | 4'100      | 0.00                                     | 0.00         |
| 10.01.2023 | Bought      | CHF     | 4'454      | EUR   | 4'500      | 0.00                                     | 0.00         |
| 10.01.2023 | Bought      | CHF     | 6'792      | EUR   | 6'900      | 0.00                                     | 0.00         |
| 10.01.2023 | Bought      | EUR     | 19'842'600 | CHF   | 19'563'474 | 0.00                                     | 0.00         |
| 10.01.2023 | Bought      | EUR     | 600'800    | CHF   | 591'575    | 0.00                                     | 0.00         |
| 10.01.2023 | Bought      | EUR     | 69'400     | CHF   | 68'339     | 0.00                                     | 0.00         |
| 10.01.2023 | Bought      | EUR     | 2'400      | CHF   | 2'367      | 0.00                                     | 0.00         |
| 25.01.2023 | Bought      | CHF     | 71'931     | EUR   | 72'900     | 0.00                                     | 0.00         |
| 25.01.2023 | Bought      | CHF     | 23'219     | EUR   | 23'200     | 0.00                                     | 0.00         |
| 25.01.2023 | Bought      | CHF     | 41'109     | EUR   | 41'000     | 0.00                                     | 0.00         |
| 25.01.2023 | Bought      | CHF     | 260'765    | EUR   | 263'300    | 0.00                                     | 0.00         |
| 25.01.2023 | Bought      | CHF     | 173'126    | EUR   | 174'500    | 0.00                                     | 0.00         |
| 25.01.2023 | Bought      | EUR     | 20'443'400 | CHF   | 20'118'554 | 0.00                                     | 0.00         |
| 25.01.2023 | Bought      | EUR     | 16'200     | CHF   | 15'999     | 0.00                                     | 0.00         |
| 09.02.2023 | Bought      | AUD     | 1'750'000  | CHF   | 1'134'900  | 0.00                                     | 0.00         |
| 09.02.2023 | Bought      | AUD     | 850'000    | CHF   | 556'939    | 0.00                                     | 0.00         |
| 09.02.2023 | Bought      | AUD     | 2'100'000  | CHF   | 1'325'417  | 0.00                                     | 0.00         |
| 09.02.2023 | Bought      | CAD     | 1'100'000  | CHF   | 761'694    | 0.00                                     | 0.00         |
| 09.02.2023 | Bought      | CAD     | 1'000'000  | CHF   | 680'513    | 0.00                                     | 0.00         |
| 09.02.2023 | Bought      | CAD     | 2'000'000  | CHF   | 1'356'716  | 0.00                                     | 0.00         |
| 09.02.2023 | Bought      | CAD     | 750'000    | CHF   | 513'800    | 0.00                                     | 0.00         |
| 09.02.2023 | Bought      | CAD     | 950'000    | CHF   | 645'704    | 0.00                                     | 0.00         |
| 09.02.2023 | Bought      | CAD     | 900'000    | CHF   | 611'521    | 0.00                                     | 0.00         |
| 09.02.2023 | Bought      | CHF     | 23'430'006 | AUD   | 36'875'000 | 0.00                                     | 0.00         |
| 09.02.2023 | Bought      | CHF     | 1'574'775  | AUD   | 2'500'000  | 0.00                                     | 0.00         |
| 09.02.2023 | Bought      | CHF     | 22'642'243 | CAD   | 31'220'000 | 0.00                                     | 0.00         |
| 09.02.2023 | Bought      | CHF     | 42'800'944 | EUR   | 43'450'000 | 0.00                                     | 0.00         |

## Aufstellung der Devisentermingeschäfte für die Zeit vom 1. Januar 2023 bis zum 31. Dezember 2023

| Fälligkeit | Transaktion | Währung | Betrag      | Gegen | Gegenwert   | Devisengewinn/-verlust<br>Mandatswährung | in % des GFV |
|------------|-------------|---------|-------------|-------|-------------|--|--------------|
| 09.02.2023 | Bought      | CHF     | 2'969'105   | EUR   | 3'000'000   | 0.00                                     | 0.00         |
| 09.02.2023 | Bought      | CHF     | 9'812       | EUR   | 9'800       | 0.00                                     | 0.00         |
| 09.02.2023 | Bought      | CHF     | 8'522       | EUR   | 8'500       | 0.00                                     | 0.00         |
| 09.02.2023 | Bought      | CHF     | 20'377      | EUR   | 20'300      | 0.00                                     | 0.00         |
| 09.02.2023 | Bought      | CHF     | 14'765      | EUR   | 14'800      | 0.00                                     | 0.00         |
| 09.02.2023 | Bought      | CHF     | 18'766      | EUR   | 18'800      | 0.00                                     | 0.00         |
| 09.02.2023 | Bought      | CHF     | 24'599'407  | GBP   | 21'850'000  | 0.00                                     | 0.00         |
| 09.02.2023 | Bought      | CHF     | 1'276'130   | GBP   | 1'150'000   | 0.00                                     | 0.00         |
| 09.02.2023 | Bought      | CHF     | 2'058'659   | GBP   | 1'850'000   | 0.00                                     | 0.00         |
| 09.02.2023 | Bought      | CHF     | 1'138'500   | GBP   | 1'000'000   | 0.00                                     | 0.00         |
| 09.02.2023 | Bought      | CHF     | 3'814'225   | NOK   | 40'000'000  | 0.00                                     | 0.00         |
| 09.02.2023 | Bought      | CHF     | 270'462'610 | USD   | 276'300'000 | 0.00                                     | 0.00         |
| 09.02.2023 | Bought      | CHF     | 3'166'304   | USD   | 3'400'000   | 0.00                                     | 0.00         |
| 09.02.2023 | Bought      | CHF     | 9'612'822   | USD   | 10'500'000  | 0.00                                     | 0.00         |
| 09.02.2023 | Bought      | EUR     | 20'459'700  | CHF   | 20'188'097  | 0.00                                     | 0.00         |
| 09.02.2023 | Bought      | EUR     | 851'500     | CHF   | 854'543     | 0.00                                     | 0.00         |
| 09.02.2023 | Bought      | EUR     | 2'200'000   | CHF   | 2'193'948   | 0.00                                     | 0.00         |
| 09.02.2023 | Bought      | USD     | 1'000'000   | CHF   | 943'228     | 0.00                                     | 0.00         |
| 09.02.2023 | Bought      | USD     | 650'000     | CHF   | 603'753     | 0.00                                     | 0.00         |
| 09.02.2023 | Bought      | USD     | 2'000'000   | CHF   | 1'847'166   | 0.00                                     | 0.00         |
| 09.02.2023 | Bought      | USD     | 700'000     | CHF   | 659'828     | 0.00                                     | 0.00         |
| 09.02.2023 | Bought      | USD     | 8'000'000   | CHF   | 7'777'902   | 0.00                                     | 0.00         |
| 09.02.2023 | Bought      | USD     | 4'000'000   | CHF   | 3'692'068   | 0.00                                     | 0.00         |
| 24.02.2023 | Bought      | CHF     | 116'475     | EUR   | 118'000     | 0.00                                     | 0.00         |
| 24.02.2023 | Bought      | CHF     | 1'331'005   | EUR   | 1'348'700   | 0.00                                     | 0.00         |
| 24.02.2023 | Bought      | CHF     | 39'722      | EUR   | 40'200      | 0.00                                     | 0.00         |
| 24.02.2023 | Bought      | CHF     | 17'382      | EUR   | 17'600      | 0.00                                     | 0.00         |
| 24.02.2023 | Bought      | CHF     | 33'578      | EUR   | 34'000      | 0.00                                     | 0.00         |
| 24.02.2023 | Bought      | EUR     | 28'600      | CHF   | 28'224      | 0.00                                     | 0.00         |
| 24.02.2023 | Bought      | EUR     | 19'819'600  | CHF   | 19'832'621  | 0.00                                     | 0.00         |
| 24.02.2023 | Bought      | EUR     | 661'500     | CHF   | 655'582     | 0.00                                     | 0.00         |
| 09.03.2023 | Bought      | CHF     | 10'161      | EUR   | 10'300      | 0.00                                     | 0.00         |
| 09.03.2023 | Bought      | CHF     | 14'333      | EUR   | 14'500      | 0.00                                     | 0.00         |
| 09.03.2023 | Bought      | CHF     | 264'770     | EUR   | 267'000     | 0.00                                     | 0.00         |
| 09.03.2023 | Bought      | CHF     | 17'407      | EUR   | 17'500      | 0.00                                     | 0.00         |
| 09.03.2023 | Bought      | CHF     | 24'359      | EUR   | 24'400      | 0.00                                     | 0.00         |
| 09.03.2023 | Bought      | EUR     | 20'481'100  | CHF   | 20'286'161  | 0.00                                     | 0.00         |
| 09.03.2023 | Bought      | EUR     | 1'200       | CHF   | 1'199       | 0.00                                     | 0.00         |
| 23.03.2023 | Bought      | CHF     | 26'987      | EUR   | 27'100      | 0.00                                     | 0.00         |
| 23.03.2023 | Bought      | CHF     | 18'888      | EUR   | 19'000      | 0.00                                     | 0.00         |
| 23.03.2023 | Bought      | CHF     | 943'909     | EUR   | 948'900     | 0.00                                     | 0.00         |
| 23.03.2023 | Bought      | CHF     | 114'301     | EUR   | 115'400     | 0.00                                     | 0.00         |
| 23.03.2023 | Bought      | CHF     | 59'867      | EUR   | 61'000      | 0.00                                     | 0.00         |
| 23.03.2023 | Bought      | CHF     | 245'264     | EUR   | 250'000     | 0.00                                     | 0.00         |
| 23.03.2023 | Bought      | CHF     | 52'984      | EUR   | 54'400      | 0.00                                     | 0.00         |
| 23.03.2023 | Bought      | CHF     | 35'633      | EUR   | 36'100      | 0.00                                     | 0.00         |
| 23.03.2023 | Bought      | EUR     | 18'951'200  | CHF   | 18'679'572  | 0.00                                     | 0.00         |
| 23.03.2023 | Bought      | EUR     | 621'800     | CHF   | 617'239     | 0.00                                     | 0.00         |
| 12.04.2023 | Bought      | EUR     | 16'290      | CHF   | 16'079      | 0.00                                     | 0.00         |
| 13.04.2023 | Bought      | CHF     | 233'333     | EUR   | 234'700     | 0.00                                     | 0.00         |
| 13.04.2023 | Bought      | CHF     | 22'305      | EUR   | 22'400      | 0.00                                     | 0.00         |
| 13.04.2023 | Bought      | CHF     | 8'289       | EUR   | 8'400       | 0.00                                     | 0.00         |
| 13.04.2023 | Bought      | CHF     | 182'006     | EUR   | 184'400     | 0.00                                     | 0.00         |
| 13.04.2023 | Bought      | CHF     | 55'018      | EUR   | 55'300      | 0.00                                     | 0.00         |
| 13.04.2023 | Bought      | CHF     | 79'543      | EUR   | 79'800      | 0.00                                     | 0.00         |
| 13.04.2023 | Bought      | CHF     | 141'453     | EUR   | 142'200     | 0.00                                     | 0.00         |
| 13.04.2023 | Bought      | CHF     | 110'744     | EUR   | 111'300     | 0.00                                     | 0.00         |
| 13.04.2023 | Bought      | CHF     | 15'891      | EUR   | 16'100      | 0.00                                     | 0.00         |
| 13.04.2023 | Bought      | EUR     | 2'400       | CHF   | 2'386       | 0.00                                     | 0.00         |
| 13.04.2023 | Bought      | EUR     | 19'526'900  | CHF   | 19'365'237  | 0.00                                     | 0.00         |
| 26.04.2023 | Bought      | EUR     | 18'027'200  | CHF   | 17'905'174  | 0.00                                     | 0.00         |
| 26.04.2023 | Bought      | EUR     | 323'800     | CHF   | 319'371     | 0.00                                     | 0.00         |
| 10.05.2023 | Bought      | CHF     | 27'811      | EUR   | 28'400      | 0.00                                     | 0.00         |
| 10.05.2023 | Bought      | CHF     | 70'398      | EUR   | 71'700      | 0.00                                     | 0.00         |
| 10.05.2023 | Bought      | CHF     | 28'969      | EUR   | 29'500      | 0.00                                     | 0.00         |
| 10.05.2023 | Bought      | CHF     | 4'998       | EUR   | 5'100       | 0.00                                     | 0.00         |
| 10.05.2023 | Bought      | CHF     | 4'896       | EUR   | 5'000       | 0.00                                     | 0.00         |
| 10.05.2023 | Bought      | CHF     | 80'809      | EUR   | 82'600      | 0.00                                     | 0.00         |
| 10.05.2023 | Bought      | CHF     | 173'980     | EUR   | 177'100     | 0.00                                     | 0.00         |

## Aufstellung der Devisentermingeschäfte für die Zeit vom 1. Januar 2023 bis zum 31. Dezember 2023

| Fälligkeit | Transaktion | Währung | Betrag      | Gegen | Gegenwert   | Devisengewinn/-verlust<br>Mandatswährung | in % des GFV |
|------------|-------------|---------|-------------|-------|-------------|--|--------------|
| 10.05.2023 | Bought      | CHF     | 65'611      | EUR   | 66'700      | 0.00                                     | 0.00         |
| 10.05.2023 | Bought      | CHF     | 19'124      | EUR   | 19'500      | 0.00                                     | 0.00         |
| 10.05.2023 | Bought      | EUR     | 18'351'000  | CHF   | 18'086'507  | 0.00                                     | 0.00         |
| 10.05.2023 | Bought      | EUR     | 277'700     | CHF   | 273'509     | 0.00                                     | 0.00         |
| 12.05.2023 | Bought      | AUD     | 1'000'000   | CHF   | 602'988     | 0.00                                     | 0.00         |
| 12.05.2023 | Bought      | AUD     | 200'000     | CHF   | 121'492     | 0.00                                     | 0.00         |
| 12.05.2023 | Bought      | CHF     | 22'138'150  | AUD   | 34'675'000  | 0.00                                     | 0.00         |
| 12.05.2023 | Bought      | CHF     | 16'771'557  | CAD   | 24'520'000  | 0.00                                     | 0.00         |
| 12.05.2023 | Bought      | CHF     | 1'189'645   | CAD   | 1'750'000   | 0.00                                     | 0.00         |
| 12.05.2023 | Bought      | CHF     | 43'722'274  | EUR   | 44'250'000  | 0.00                                     | 0.00         |
| 12.05.2023 | Bought      | CHF     | 28'542'252  | GBP   | 25'850'000  | 0.00                                     | 0.00         |
| 12.05.2023 | Bought      | CHF     | 3'566'653   | NOK   | 40'000'000  | 0.00                                     | 0.00         |
| 12.05.2023 | Bought      | CHF     | 251'033'640 | USD   | 273'850'000 | 0.00                                     | 0.00         |
| 12.05.2023 | Bought      | EUR     | 1'000'000   | CHF   | 987'505     | 0.00                                     | 0.00         |
| 12.05.2023 | Bought      | EUR     | 1'000'000   | CHF   | 985'092     | 0.00                                     | 0.00         |
| 12.05.2023 | Bought      | EUR     | 1'500'000   | CHF   | 1'475'721   | 0.00                                     | 0.00         |
| 12.05.2023 | Bought      | EUR     | 900'000     | CHF   | 873'617     | 0.00                                     | 0.00         |
| 12.05.2023 | Bought      | EUR     | 1'400'000   | CHF   | 1'369'991   | 0.00                                     | 0.00         |
| 12.05.2023 | Bought      | EUR     | 1'250'000   | CHF   | 1'228'080   | 0.00                                     | 0.00         |
| 12.05.2023 | Bought      | GBP     | 800'000     | CHF   | 904'226     | 0.00                                     | 0.00         |
| 12.05.2023 | Bought      | GBP     | 1'000'000   | CHF   | 1'130'557   | 0.00                                     | 0.00         |
| 12.05.2023 | Bought      | GBP     | 400'000     | CHF   | 451'538     | 0.00                                     | 0.00         |
| 12.05.2023 | Bought      | GBP     | 200'000     | CHF   | 222'103     | 0.00                                     | 0.00         |
| 12.05.2023 | Bought      | GBP     | 165'000     | CHF   | 185'183     | 0.00                                     | 0.00         |
| 12.05.2023 | Bought      | GBP     | 465'000     | CHF   | 521'391     | 0.00                                     | 0.00         |
| 12.05.2023 | Bought      | GBP     | 110'000     | CHF   | 121'907     | 0.00                                     | 0.00         |
| 12.05.2023 | Bought      | USD     | 1'000'000   | CHF   | 917'302     | 0.00                                     | 0.00         |
| 12.05.2023 | Bought      | USD     | 1'000'000   | CHF   | 918'615     | 0.00                                     | 0.00         |
| 12.05.2023 | Bought      | USD     | 1'000'000   | CHF   | 890'754     | 0.00                                     | 0.00         |
| 12.05.2023 | Bought      | USD     | 500'000     | CHF   | 464'204     | 0.00                                     | 0.00         |
| 12.05.2023 | Bought      | USD     | 500'000     | CHF   | 444'788     | 0.00                                     | 0.00         |
| 12.05.2023 | Bought      | USD     | 2'000'000   | CHF   | 1'807'687   | 0.00                                     | 0.00         |
| 12.05.2023 | Bought      | USD     | 8'000'000   | CHF   | 7'323'896   | 0.00                                     | 0.00         |
| 12.05.2023 | Bought      | USD     | 2'200'000   | CHF   | 2'019'228   | 0.00                                     | 0.00         |
| 12.05.2023 | Bought      | USD     | 4'200'000   | CHF   | 3'863'000   | 0.00                                     | 0.00         |
| 12.05.2023 | Bought      | USD     | 2'500'000   | CHF   | 2'243'492   | 0.00                                     | 0.00         |
| 24.05.2023 | Bought      | CHF     | 6'750       | EUR   | 6'900       | 0.00                                     | 0.00         |
| 24.05.2023 | Bought      | CHF     | 106'181     | EUR   | 108'800     | 0.00                                     | 0.00         |
| 24.05.2023 | Bought      | CHF     | 145'774     | EUR   | 149'400     | 0.00                                     | 0.00         |
| 24.05.2023 | Bought      | CHF     | 62'039      | EUR   | 63'700      | 0.00                                     | 0.00         |
| 24.05.2023 | Bought      | CHF     | 260'029     | EUR   | 267'200     | 0.00                                     | 0.00         |
| 24.05.2023 | Bought      | EUR     | 18'351'000  | CHF   | 17'926'303  | 0.00                                     | 0.00         |
| 24.05.2023 | Bought      | EUR     | 43'300      | CHF   | 42'411      | 0.00                                     | 0.00         |
| 09.06.2023 | Bought      | CHF     | 130'310     | EUR   | 134'400     | 0.00                                     | 0.00         |
| 09.06.2023 | Bought      | CHF     | 37'513      | EUR   | 38'700      | 0.00                                     | 0.00         |
| 09.06.2023 | Bought      | CHF     | 27'920      | EUR   | 28'700      | 0.00                                     | 0.00         |
| 09.06.2023 | Bought      | CHF     | 50'852      | EUR   | 52'200      | 0.00                                     | 0.00         |
| 09.06.2023 | Bought      | CHF     | 33'728      | EUR   | 34'600      | 0.00                                     | 0.00         |
| 09.06.2023 | Bought      | EUR     | 18'143'100  | CHF   | 17'758'085  | 0.00                                     | 0.00         |
| 09.06.2023 | Bought      | EUR     | 23'700      | CHF   | 23'064      | 0.00                                     | 0.00         |
| 09.06.2023 | Bought      | EUR     | 2'500       | CHF   | 2'423       | 0.00                                     | 0.00         |
| 09.06.2023 | Bought      | EUR     | 2'300       | CHF   | 2'235       | 0.00                                     | 0.00         |
| 26.06.2023 | Bought      | CHF     | 1'748       | EUR   | 1'800       | 0.00                                     | 0.00         |
| 26.06.2023 | Bought      | CHF     | 40'513      | EUR   | 41'800      | 0.00                                     | 0.00         |
| 26.06.2023 | Bought      | CHF     | 74'511      | EUR   | 76'200      | 0.00                                     | 0.00         |
| 26.06.2023 | Bought      | CHF     | 151'752     | EUR   | 155'700     | 0.00                                     | 0.00         |
| 26.06.2023 | Bought      | CHF     | 16'898      | EUR   | 17'300      | 0.00                                     | 0.00         |
| 26.06.2023 | Bought      | EUR     | 17'798'300  | CHF   | 17'215'904  | 0.00                                     | 0.00         |
| 26.06.2023 | Bought      | EUR     | 42'900      | CHF   | 41'576      | 0.00                                     | 0.00         |
| 11.07.2023 | Bought      | CHF     | 292         | EUR   | 300         | 0.00                                     | 0.00         |
| 11.07.2023 | Bought      | CHF     | 145'680     | EUR   | 148'700     | 0.00                                     | 0.00         |
| 11.07.2023 | Bought      | CHF     | 177'914     | EUR   | 182'000     | 0.00                                     | 0.00         |
| 11.07.2023 | Bought      | CHF     | 94'574      | EUR   | 96'800      | 0.00                                     | 0.00         |
| 11.07.2023 | Bought      | CHF     | 78'728      | EUR   | 80'400      | 0.00                                     | 0.00         |
| 11.07.2023 | Bought      | CHF     | 15'552      | EUR   | 15'900      | 0.00                                     | 0.00         |
| 11.07.2023 | Bought      | EUR     | 17'841'300  | CHF   | 17'274'946  | 0.00                                     | 0.00         |
| 11.07.2023 | Bought      | EUR     | 9'400       | CHF   | 9'174       | 0.00                                     | 0.00         |
| 25.07.2023 | Bought      | CHF     | 464'326     | EUR   | 476'800     | 0.00                                     | 0.00         |
| 25.07.2023 | Bought      | CHF     | 5'166       | EUR   | 5'300       | 0.00                                     | 0.00         |

## Aufstellung der Devisentermingeschäfte für die Zeit vom 1. Januar 2023 bis zum 31. Dezember 2023

| Fälligkeit | Transaktion | Währung | Betrag      | Gegen | Gegenwert   | Devisengewinn/-verlust<br>Mandatswährung | in % des GFV |
|------------|-------------|---------|-------------|-------|-------------|--|--------------|
| 25.07.2023 | Bought      | CHF     | 30'597      | EUR   | 31'600      | 0.00                                     | 0.00         |
| 25.07.2023 | Bought      | CHF     | 8'210       | EUR   | 8'500       | 0.00                                     | 0.00         |
| 25.07.2023 | Bought      | CHF     | 86'266      | EUR   | 89'300      | 0.00                                     | 0.00         |
| 25.07.2023 | Bought      | CHF     | 153'516     | EUR   | 159'200     | 0.00                                     | 0.00         |
| 25.07.2023 | Bought      | CHF     | 26'355      | EUR   | 27'400      | 0.00                                     | 0.00         |
| 25.07.2023 | Bought      | EUR     | 17'540'200  | CHF   | 17'212'146  | 0.00                                     | 0.00         |
| 10.08.2023 | Bought      | AUD     | 1'000'000   | CHF   | 584'378     | 0.00                                     | 0.00         |
| 10.08.2023 | Bought      | CAD     | 500'000     | CHF   | 338'148     | 0.00                                     | 0.00         |
| 10.08.2023 | Bought      | CHF     | 19'997'262  | AUD   | 33'475'000  | 0.00                                     | 0.00         |
| 10.08.2023 | Bought      | CHF     | 586'933     | AUD   | 1'000'000   | 0.00                                     | 0.00         |
| 10.08.2023 | Bought      | CHF     | 17'325'984  | CAD   | 26'270'000  | 0.00                                     | 0.00         |
| 10.08.2023 | Bought      | CHF     | 541'799     | CAD   | 800'000     | 0.00                                     | 0.00         |
| 10.08.2023 | Bought      | CHF     | 36'122'688  | EUR   | 37'200'000  | 0.00                                     | 0.00         |
| 10.08.2023 | Bought      | CHF     | 2'422'935   | EUR   | 2'500'000   | 0.00                                     | 0.00         |
| 10.08.2023 | Bought      | CHF     | 1'933'156   | EUR   | 2'000'000   | 0.00                                     | 0.00         |
| 10.08.2023 | Bought      | CHF     | 1'078'748   | EUR   | 1'100'000   | 0.00                                     | 0.00         |
| 10.08.2023 | Bought      | CHF     | 4'718       | EUR   | 4'900       | 0.00                                     | 0.00         |
| 10.08.2023 | Bought      | CHF     | 4'794       | EUR   | 5'000       | 0.00                                     | 0.00         |
| 10.08.2023 | Bought      | CHF     | 21'442      | EUR   | 22'300      | 0.00                                     | 0.00         |
| 10.08.2023 | Bought      | CHF     | 21'334      | EUR   | 22'200      | 0.00                                     | 0.00         |
| 10.08.2023 | Bought      | CHF     | 25'326'896  | GBP   | 22'710'000  | 0.00                                     | 0.00         |
| 10.08.2023 | Bought      | CHF     | 3'354'529   | NOK   | 40'000'000  | 0.00                                     | 0.00         |
| 10.08.2023 | Bought      | CHF     | 220'381'665 | USD   | 249'950'000 | 0.00                                     | 0.00         |
| 10.08.2023 | Bought      | CHF     | 1'070'212   | USD   | 1'200'000   | 0.00                                     | 0.00         |
| 10.08.2023 | Bought      | CHF     | 2'672'154   | USD   | 3'000'000   | 0.00                                     | 0.00         |
| 10.08.2023 | Bought      | CHF     | 1'889'076   | USD   | 2'200'000   | 0.00                                     | 0.00         |
| 10.08.2023 | Bought      | CHF     | 2'528'359   | USD   | 2'950'000   | 0.00                                     | 0.00         |
| 10.08.2023 | Bought      | CHF     | 3'366'059   | USD   | 3'900'000   | 0.00                                     | 0.00         |
| 10.08.2023 | Bought      | EUR     | 300'000     | CHF   | 287'518     | 0.00                                     | 0.00         |
| 10.08.2023 | Bought      | EUR     | 900'000     | CHF   | 869'051     | 0.00                                     | 0.00         |
| 10.08.2023 | Bought      | EUR     | 17'326'600  | CHF   | 16'858'193  | 0.00                                     | 0.00         |
| 10.08.2023 | Bought      | EUR     | 2'600'000   | CHF   | 2'507'605   | 0.00                                     | 0.00         |
| 10.08.2023 | Bought      | EUR     | 3'900'000   | CHF   | 3'738'846   | 0.00                                     | 0.00         |
| 10.08.2023 | Bought      | EUR     | 524'100     | CHF   | 501'576     | 0.00                                     | 0.00         |
| 10.08.2023 | Bought      | EUR     | 1'500       | CHF   | 1'436       | 0.00                                     | 0.00         |
| 10.08.2023 | Bought      | USD     | 1'000'000   | CHF   | 887'905     | 0.00                                     | 0.00         |
| 10.08.2023 | Bought      | USD     | 2'500'000   | CHF   | 2'239'355   | 0.00                                     | 0.00         |
| 24.08.2023 | Bought      | CHF     | 214'262     | EUR   | 223'700     | 0.00                                     | 0.00         |
| 24.08.2023 | Bought      | CHF     | 4'809       | EUR   | 5'000       | 0.00                                     | 0.00         |
| 24.08.2023 | Bought      | EUR     | 16'742'100  | CHF   | 16'106'068  | 0.00                                     | 0.00         |
| 24.08.2023 | Bought      | EUR     | 527'800     | CHF   | 506'376     | 0.00                                     | 0.00         |
| 11.09.2023 | Bought      | CHF     | 13'278      | EUR   | 13'900      | 0.00                                     | 0.00         |
| 11.09.2023 | Bought      | CHF     | 41'964      | EUR   | 43'900      | 0.00                                     | 0.00         |
| 11.09.2023 | Bought      | CHF     | 32'490      | EUR   | 34'000      | 0.00                                     | 0.00         |
| 11.09.2023 | Bought      | CHF     | 110'290     | EUR   | 115'400     | 0.00                                     | 0.00         |
| 11.09.2023 | Bought      | CHF     | 31'644      | EUR   | 33'100      | 0.00                                     | 0.00         |
| 11.09.2023 | Bought      | CHF     | 105'840     | EUR   | 110'500     | 0.00                                     | 0.00         |
| 11.09.2023 | Bought      | CHF     | 62'086      | EUR   | 64'900      | 0.00                                     | 0.00         |
| 11.09.2023 | Bought      | CHF     | 83'387      | EUR   | 87'400      | 0.00                                     | 0.00         |
| 11.09.2023 | Bought      | EUR     | 1'200       | CHF   | 1'143       | 0.00                                     | 0.00         |
| 11.09.2023 | Bought      | EUR     | 17'270'000  | CHF   | 16'551'499  | 0.00                                     | 0.00         |
| 25.09.2023 | Bought      | CHF     | 159'631     | EUR   | 167'200     | 0.00                                     | 0.00         |
| 25.09.2023 | Bought      | CHF     | 2'003       | EUR   | 2'100       | 0.00                                     | 0.00         |
| 25.09.2023 | Bought      | CHF     | 12'511      | EUR   | 13'100      | 0.00                                     | 0.00         |
| 25.09.2023 | Bought      | CHF     | 56'553      | EUR   | 59'000      | 0.00                                     | 0.00         |
| 25.09.2023 | Bought      | EUR     | 17'041'200  | CHF   | 16'286'173  | 0.00                                     | 0.00         |
| 10.10.2023 | Bought      | CHF     | 62'056      | EUR   | 64'400      | 0.00                                     | 0.00         |
| 10.10.2023 | Bought      | CHF     | 7'732       | EUR   | 8'000       | 0.00                                     | 0.00         |
| 10.10.2023 | Bought      | CHF     | 69'111      | EUR   | 71'700      | 0.00                                     | 0.00         |
| 10.10.2023 | Bought      | EUR     | 1'200       | CHF   | 1'159       | 0.00                                     | 0.00         |
| 10.10.2023 | Bought      | EUR     | 16'757'500  | CHF   | 15'974'506  | 0.00                                     | 0.00         |
| 10.10.2023 | Bought      | EUR     | 21'100      | CHF   | 20'362      | 0.00                                     | 0.00         |
| 24.10.2023 | Bought      | CHF     | 100'961     | EUR   | 104'900     | 0.00                                     | 0.00         |
| 24.10.2023 | Bought      | CHF     | 467'837     | EUR   | 486'100     | 0.00                                     | 0.00         |
| 24.10.2023 | Bought      | CHF     | 30'256      | EUR   | 31'600      | 0.00                                     | 0.00         |
| 24.10.2023 | Bought      | CHF     | 4'497       | EUR   | 4'700       | 0.00                                     | 0.00         |
| 24.10.2023 | Bought      | CHF     | 95          | EUR   | 100         | 0.00                                     | 0.00         |
| 24.10.2023 | Bought      | EUR     | 16'778'700  | CHF   | 16'177'251  | 0.00                                     | 0.00         |
| 24.10.2023 | Bought      | EUR     | 5'000       | CHF   | 4'796       | 0.00                                     | 0.00         |

## Aufstellung der Devisentermingeschäfte für die Zeit vom 1. Januar 2023 bis zum 31. Dezember 2023

| Fälligkeit                          | Transaktion | Währung | Betrag      | Gegen | Gegenwert   | Devisengewinn/-verlust<br>Mandatswährung | in % des GFV |
|-------------------------------------|-------------|---------|-------------|-------|-------------|--|--------------|
| 09.11.2023                          | Bought      | AUD     | 500'000     | CHF   | 281'616     | 0.00                                     | 0.00         |
| 09.11.2023                          | Bought      | AUD     | 300'000     | CHF   | 174'996     | 0.00                                     | 0.00         |
| 09.11.2023                          | Bought      | CAD     | 1'000'000   | CHF   | 664'423     | 0.00                                     | 0.00         |
| 09.11.2023                          | Bought      | CAD     | 1'300'000   | CHF   | 863'396     | 0.00                                     | 0.00         |
| 09.11.2023                          | Bought      | CHF     | 18'957'796  | AUD   | 33'475'000  | 0.00                                     | 0.00         |
| 09.11.2023                          | Bought      | CHF     | 17'145'807  | CAD   | 26'570'000  | 0.00                                     | 0.00         |
| 09.11.2023                          | Bought      | CHF     | 33'510'812  | EUR   | 35'100'000  | 0.00                                     | 0.00         |
| 09.11.2023                          | Bought      | CHF     | 6'528       | EUR   | 6'900       | 0.00                                     | 0.00         |
| 09.11.2023                          | Bought      | CHF     | 2'933       | EUR   | 3'100       | 0.00                                     | 0.00         |
| 09.11.2023                          | Bought      | CHF     | 50'596      | EUR   | 52'700      | 0.00                                     | 0.00         |
| 09.11.2023                          | Bought      | CHF     | 388'410     | GBP   | 350'000     | 0.00                                     | 0.00         |
| 09.11.2023                          | Bought      | CHF     | 25'073'362  | GBP   | 22'710'000  | 0.00                                     | 0.00         |
| 09.11.2023                          | Bought      | CHF     | 3'389'990   | NOK   | 40'000'000  | 0.00                                     | 0.00         |
| 09.11.2023                          | Bought      | CHF     | 224'848'520 | USD   | 259'700'000 | 0.00                                     | 0.00         |
| 09.11.2023                          | Bought      | EUR     | 1'000'000   | CHF   | 952'115     | 0.00                                     | 0.00         |
| 09.11.2023                          | Bought      | EUR     | 1'500'000   | CHF   | 1'425'888   | 0.00                                     | 0.00         |
| 09.11.2023                          | Bought      | EUR     | 480'000     | CHF   | 463'420     | 0.00                                     | 0.00         |
| 09.11.2023                          | Bought      | EUR     | 1'300'000   | CHF   | 1'253'194   | 0.00                                     | 0.00         |
| 09.11.2023                          | Bought      | EUR     | 16'635'700  | CHF   | 15'990'434  | 0.00                                     | 0.00         |
| 09.11.2023                          | Bought      | EUR     | 900         | CHF   | 853         | 0.00                                     | 0.00         |
| 09.11.2023                          | Bought      | EUR     | 5'200       | CHF   | 4'987       | 0.00                                     | 0.00         |
| 09.11.2023                          | Bought      | GBP     | 1'100'000   | CHF   | 1'223'389   | 0.00                                     | 0.00         |
| 09.11.2023                          | Bought      | GBP     | 400'000     | CHF   | 442'154     | 0.00                                     | 0.00         |
| 09.11.2023                          | Bought      | USD     | 4'500'000   | CHF   | 3'950'694   | 0.00                                     | 0.00         |
| 09.11.2023                          | Bought      | USD     | 1'000'000   | CHF   | 871'319     | 0.00                                     | 0.00         |
| 09.11.2023                          | Bought      | USD     | 1'500'000   | CHF   | 1'362'390   | 0.00                                     | 0.00         |
| 09.11.2023                          | Bought      | USD     | 4'000'000   | CHF   | 3'603'380   | 0.00                                     | 0.00         |
| 09.11.2023                          | Bought      | USD     | 2'500'000   | CHF   | 2'216'100   | 0.00                                     | 0.00         |
| 09.11.2023                          | Bought      | USD     | 1'700'000   | CHF   | 1'554'932   | 0.00                                     | 0.00         |
| 09.11.2023                          | Bought      | USD     | 600'000     | CHF   | 543'563     | 0.00                                     | 0.00         |
| 09.11.2023                          | Bought      | USD     | 1'214'036   | GBP   | 1'000'000   | 0.00                                     | 0.00         |
| 24.11.2023                          | Bought      | CHF     | 10          | EUR   | 10          | 0.00                                     | 0.00         |
| 24.11.2023                          | Bought      | CHF     | 28'803      | EUR   | 29'900      | 0.00                                     | 0.00         |
| 24.11.2023                          | Bought      | CHF     | 10'299      | EUR   | 10'700      | 0.00                                     | 0.00         |
| 24.11.2023                          | Bought      | CHF     | 35'500      | EUR   | 36'700      | 0.00                                     | 0.00         |
| 24.11.2023                          | Bought      | EUR     | 16'156'300  | CHF   | 15'214'501  | 0.00                                     | 0.00         |
| 24.11.2023                          | Bought      | EUR     | 226'400     | CHF   | 217'565     | 0.00                                     | 0.00         |
| 24.11.2023                          | Bought      | EUR     | 334'700     | CHF   | 321'733     | 0.00                                     | 0.00         |
| 08.12.2023                          | Bought      | CHF     | 55'640      | EUR   | 57'800      | 0.00                                     | 0.00         |
| 08.12.2023                          | Bought      | CHF     | 24'293      | EUR   | 25'200      | 0.00                                     | 0.00         |
| 08.12.2023                          | Bought      | CHF     | 190'123     | EUR   | 200'300     | 0.00                                     | 0.00         |
| 08.12.2023                          | Bought      | EUR     | 2'900       | CHF   | 2'742       | 0.00                                     | 0.00         |
| 08.12.2023                          | Bought      | EUR     | 16'352'800  | CHF   | 15'700'209  | 0.00                                     | 0.00         |
| 08.12.2023                          | Bought      | EUR     | 143'600     | CHF   | 138'264     | 0.00                                     | 0.00         |
| 22.12.2023                          | Bought      | CHF     | 1'889       | EUR   | 2'000       | 0.00                                     | 0.00         |
| 22.12.2023                          | Bought      | CHF     | 124'039     | EUR   | 130'900     | 0.00                                     | 0.00         |
| 22.12.2023                          | Bought      | EUR     | 16'496'400  | CHF   | 15'868'794  | 0.00                                     | 0.00         |
| 22.12.2023                          | Bought      | EUR     | 675'800     | CHF   | 636'569     | 0.00                                     | 0.00         |
| 10.01.2024                          | Bought      | CHF     | 945         | EUR   | 1'000       | 15.91                                    | 0.00         |
| 10.01.2024                          | Bought      | EUR     | 16'152'900  | CHF   | 15'204'902  | -199'116.80                              | -0.04        |
| 10.01.2024                          | Bought      | EUR     | 443'200     | CHF   | 418'006     | -6'280.14                                | 0.00         |
| 10.01.2024                          | Bought      | EUR     | 71'500      | CHF   | 67'409      | -986.34                                  | 0.00         |
| 24.01.2024                          | Bought      | EUR     | 16'596'100  | CHF   | 15'638'588  | -234'635.66                              | -0.05        |
| 07.02.2024                          | Bought      | AUD     | 1'000'000   | CHF   | 577'867     | -5'279.51                                | 0.00         |
| 07.02.2024                          | Bought      | AUD     | 500'000     | CHF   | 288'425     | -2'131.26                                | 0.00         |
| 07.02.2024                          | Bought      | AUD     | 2'000'000   | CHF   | 1'155'501   | -10'326.42                               | 0.00         |
| 07.02.2024                          | Bought      | AUD     | 1'400'000   | CHF   | 805'187     | -3'564.14                                | 0.00         |
| 07.02.2024                          | Bought      | CHF     | 18'742'119  | AUD   | 32'675'000  | 32'919.37                                | 0.01         |
| 07.02.2024                          | Bought      | CHF     | 15'740'891  | CAD   | 24'270'000  | 307'795.58                               | 0.06         |
| 07.02.2024                          | Bought      | CHF     | 704'986     | CAD   | 1'100'000   | 5'473.84                                 | 0.00         |
| 07.02.2024                          | Bought      | CHF     | 27'261'013  | EUR   | 28'520'000  | 814'786.09                               | 0.16         |
| 07.02.2024                          | Bought      | CHF     | 24'727'317  | GBP   | 22'560'000  | 620'786.04                               | 0.12         |
| 07.02.2024                          | Bought      | CHF     | 764'817     | GBP   | 700'000     | 16'821.36                                | 0.00         |
| 07.02.2024                          | Bought      | CHF     | 3'199'113   | NOK   | 40'000'000  | -105'574.90                              | -0.02        |
| 07.02.2024                          | Bought      | CHF     | 216'152'622 | USD   | 242'685'964 | 12'801'327.86                            | 2.46         |
| 07.02.2024                          | Bought      | CHF     | 2'606'329   | USD   | 3'000'000   | 92'297.63                                | 0.02         |
| 07.02.2024                          | Bought      | CHF     | 4'267'704   | USD   | 5'000'000   | 77'334.53                                | 0.01         |
| 07.02.2024                          | Bought      | GBP     | 1'000'000   | CHF   | 1'093'459   | -24'799.00                               | 0.00         |
| <b>Total Devisentermingeschäfte</b> |             |         |             |       |             | <b>14'176'864.04</b>                     | <b>2.73</b>  |

**Ausgeliehene Wertpapierbestände (Lending and Borrowing)**

| Titelbezeichnung                        | Agent                      | Lending / Borrowing | 31.12.2023<br>Anzahl/ Nominal |
|---|----------------------------|---------------------|-------------------------------|
| ALGONQUIN POWER & UTILITIES             | Credit Suisse (Schweiz) AG | Lending             | 67'500                        |
| BANK OF NOVA SCOTIA                     | Credit Suisse (Schweiz) AG | Lending             | 11'700                        |
| BAYER AG 4.2500 26/08/29                | Credit Suisse (Schweiz) AG | Lending             | 300'000                       |
| CAISSE NAT REASSURANCE 6.0000 23/01/27  | Credit Suisse (Schweiz) AG | Lending             | 300'000                       |
| CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE             | Credit Suisse (Schweiz) AG | Lending             | 999                           |
| CEZ AS 4.8750 16/04/25                  | Credit Suisse (Schweiz) AG | Lending             | 200'000                       |
| CS REAL ESTATE LIVINGPLUS               | Credit Suisse (Schweiz) AG | Lending             | 1'598                         |
| HAMMERSON PLC 7.2500 21/04/28           | Credit Suisse (Schweiz) AG | Lending             | 801'000                       |
| IBM CORP 5.8750 29/11/32                | Credit Suisse (Schweiz) AG | Lending             | 500'000                       |
| MERCEDES-BENZ FIN NA 8.5000 18/01/31    | Credit Suisse (Schweiz) AG | Lending             | 800'000                       |
| NATURGY ENERGY GROUP SA                 | Credit Suisse (Schweiz) AG | Lending             | 9'900                         |
| OESTERREICHISCHE POST AG                | Credit Suisse (Schweiz) AG | Lending             | 3'900                         |
| POWER CORP OF CANADA                    | Credit Suisse (Schweiz) AG | Lending             | 10'000                        |
| REDEIA CORP SA                          | Credit Suisse (Schweiz) AG | Lending             | 18'834                        |
| ROMANIA 6.0000 25/05/34                 | Credit Suisse (Schweiz) AG | Lending             | 398'000                       |
| SCHLUMBERGER HLDGS CORP 4.0000 21/12/25 | Credit Suisse (Schweiz) AG | Lending             | 1'200'000                     |
| STELLANTIS NV 4.5000 07/07/28           | Credit Suisse (Schweiz) AG | Lending             | 1'000'000                     |
| TELEFONICA SA                           | Credit Suisse (Schweiz) AG | Lending             | 22'590                        |
| TOTALENERGIES SE                        | Credit Suisse (Schweiz) AG | Lending             | 14'348                        |
| UBS PRPRTY FD SW RESIDTL ANF            | Credit Suisse (Schweiz) AG | Lending             | 2'823                         |
| UNITED MEXICAN STATES 6.3380 04/05/53   | Credit Suisse (Schweiz) AG | Lending             | 200'000                       |
| UNITED MICROELECTRON-SP ADR             | Credit Suisse (Schweiz) AG | Lending             | 75'000                        |
| US TREASURY N/B 5.0000 15/05/37         | Credit Suisse (Schweiz) AG | Lending             | 2'000'000                     |
| WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC            | Credit Suisse (Schweiz) AG | Lending             | 8'600                         |

**Ausserbilanzgeschäfte**

|  | 31.12.2023                             |                 | 31.12.2022                             |                 |
|--|--|-----------------|--|-----------------|
|  | Basiswertäquivalent in<br>Fondswährung | in %<br>des NFV | Basiswertäquivalent in<br>Fondswährung | in %<br>des NFV |
| - Marktrisiko (Aktienkursänderungsrisiko)    | 15'906'480.00                          | 3.07%           | 51'694'972.47                          | 8.20%           |
| - Währungsrisiko                             | 335'538'768.66                         | 64.67%          | 434'769'746.45                         | 68.98%          |
| <b>Brutto-Gesamtengagement aus Derivaten</b> | <b>351'445'248.66</b>                  | <b>67.73%</b>   | <b>486'464'718.92</b>                  | <b>77.18%</b>   |
| - Marktrisiko (Aktienkursänderungsrisiko)    | 15'906'480.00                          | 3.07%           | 51'694'972.47                          | 8.20%           |
| - Währungsrisiko                             | 335'538'768.66                         | 64.67%          | 434'769'746.45                         | 68.98%          |
| <b>Netto-Gesamtengagement aus Derivaten</b>  | <b>351'445'248.66</b>                  | <b>67.73%</b>   | <b>486'464'718.92</b>                  | <b>77.18%</b>   |

**Volumen der verliehenen Wertpapiere und Provisionserträge aus Wertpapieren**

|                                      |               |       |               |       |
|--------------------------------------|---------------|-------|---------------|-------|
| - Volumen der verliehenen Positionen | 11'326'029.24 | 2.18% | 22'077'760.13 | 3.50% |
| - Kommission Einkommen               | 91'820.70     | 0.02% | 208'507.90    | 0.03% |



## Kurze Übersicht

| Kennzahlen                            | Währung | 31.12.2023 | 31.12.2022 | 31.12.2021 |
|---------------------------------------|---------|------------|------------|------------|
| <b>Konsolidierung</b>                 |         |            |            |            |
| Nettofondsvermögen in Mio.            | CHF     | 653.87     | 761.94     | 914.52     |
| <b>Anteilklasse A</b>                 |         |            |            |            |
| Nettofondsvermögen in Mio.            | CHF     | 83.80      | 97.61      | 124.18     |
| Inventarwert pro Anteil               | CHF     | -          | -          | 1'028.63   |
| Inventarwert pro Anteil (Swung NAV)   | CHF     | 875.90     | 884.80     | -          |
| Inventarwert pro Anteil (Unswung NAV) | CHF     | 877.20     | 887.02     | -          |
| <b>Anteilklasse AH EUR</b>            |         |            |            |            |
| Nettofondsvermögen in Mio.            | CHF     | 10.68      | 13.43      | 18.56      |
| Inventarwert pro Anteil               | EUR     | -          | -          | 117.26     |
| Inventarwert pro Anteil (Swung NAV)   | EUR     | 102.38     | 101.17     | -          |
| Inventarwert pro Anteil (Unswung NAV) | EUR     | 102.53     | 101.42     | -          |
| <b>Anteilklasse B</b>                 |         |            |            |            |
| Nettofondsvermögen in Mio.            | CHF     | 16.90      | 19.23      | 21.27      |
| Inventarwert pro Anteil               | CHF     | -          | -          | 131.93     |
| Inventarwert pro Anteil (Swung NAV)   | CHF     | 118.61     | 116.82     | -          |
| Inventarwert pro Anteil (Unswung NAV) | CHF     | 118.78     | 117.12     | -          |
| <b>Anteilklasse BH EUR</b>            |         |            |            |            |
| Nettofondsvermögen in Mio.            | CHF     | 1.97       | 2.13       | 2.89       |
| Inventarwert pro Anteil               | EUR     | -          | -          | 120.45     |
| Inventarwert pro Anteil (Swung NAV)   | EUR     | 110.48     | 106.76     | -          |
| Inventarwert pro Anteil (Unswung NAV) | EUR     | 110.64     | 107.02     | -          |
| <b>Anteilklasse UA</b>                |         |            |            |            |
| Nettofondsvermögen in Mio.            | CHF     | 443.40     | 510.80     | 605.36     |
| Inventarwert pro Anteil               | CHF     | -          | -          | 108.26     |
| Inventarwert pro Anteil (Swung NAV)   | CHF     | 92.62      | 93.35      | -          |
| Inventarwert pro Anteil (Unswung NAV) | CHF     | 92.75      | 93.58      | -          |
| <b>Anteilklasse UAH EUR</b>           |         |            |            |            |
| Nettofondsvermögen in Mio.            | CHF     | 12.79      | 15.28      | 21.48      |
| Inventarwert pro Anteil               | EUR     | -          | -          | 118.14     |
| Inventarwert pro Anteil (Swung NAV)   | EUR     | 103.44     | 102.20     | -          |
| Inventarwert pro Anteil (Unswung NAV) | EUR     | 103.60     | 102.46     | -          |
| <b>Anteilklasse UB</b>                |         |            |            |            |
| Nettofondsvermögen in Mio.            | CHF     | 80.07      | 98.30      | 113.90     |
| Inventarwert pro Anteil               | CHF     | -          | -          | 121.94     |
| Inventarwert pro Anteil (Swung NAV)   | CHF     | 110.04     | 108.19     | -          |
| Inventarwert pro Anteil (Unswung NAV) | CHF     | 110.21     | 108.46     | -          |
| <b>Anteilklasse UBH EUR</b>           |         |            |            |            |
| Nettofondsvermögen in Mio.            | CHF     | 4.26       | 5.16       | 6.90       |
| Inventarwert pro Anteil               | EUR     | -          | -          | 121.32     |
| Inventarwert pro Anteil (Swung NAV)   | EUR     | 111.77     | 107.77     | -          |
| Inventarwert pro Anteil (Unswung NAV) | EUR     | 111.93     | 108.05     | -          |

## Verwendung des Erfolges

### Ausschüttung pro Anteil

#### 1. Für in der Schweiz und im Ausland domizilierte Anteilinhaber

| Ausschüttung 2023                         | Anteilklasse A    | Anteilklasse AH EUR | Anteilklasse UAH EUR |
|---|-------------------|---------------------|----------------------|
| Bruttoausschüttung aus Ertrag             | CHF 26.840        | EUR 3.080           | EUR 3.240            |
| ./. 35% Eidgenössische Verrechnungssteuer | CHF 9.394         | EUR 1.078           | EUR 1.134            |
| <b>Nettoausschüttung aus Ertrag</b>       | <b>CHF 17.446</b> | <b>EUR 2.002</b>    | <b>EUR 2.106</b>     |
| <b>Coupon Nr. Ertrag</b>                  | <b>30</b>         | <b>12</b>           | <b>13</b>            |
| und                                       |                   |                     |                      |
| <b>Kapitalrückzahlung</b>                 | <b>CHF 4.620</b>  | <b>EUR 0.500</b>    | <b>EUR 0.360</b>     |
| <b>Coupon Nr. Kapitalrückzahlung</b>      | <b>32</b>         | <b>14</b>           | <b>15</b>            |

#### 2. Für in der Schweiz und im Ausland domizilierte Anteilinhaber (verrechnungssteuerbefreite Erträge aus direktem Immobilienbesitz)

| Ausschüttung 2023                   | Anteilklasse A   | Anteilklasse AH EUR | Anteilklasse UAH EUR |
|-------------------------------------|------------------|---------------------|----------------------|
| Bruttoausschüttung aus Ertrag       | CHF 0.070        | EUR 0.010           | EUR 0.010            |
| <b>Nettoausschüttung aus Ertrag</b> | <b>CHF 0.070</b> | <b>EUR 0.010</b>    | <b>EUR 0.010</b>     |
| <b>Coupon Nr. Ertrag</b>            | <b>31</b>        | <b>13</b>           | <b>14</b>            |

Zahlbar ab 15.02.2024 bei der CREDIT SUISSE (SCHWEIZ) AG und deren sämtlichen Geschäftsstellen in der Schweiz.

#### 1. Für in der Schweiz und im Ausland domizilierte Anteilinhaber

| Ausschüttung 2023                         | Anteilklasse UA  |
|---|------------------|
| Bruttoausschüttung aus Ertrag             | CHF 3.260        |
| ./. 35% Eidgenössische Verrechnungssteuer | CHF 1.141        |
| <b>Nettoausschüttung aus Ertrag</b>       | <b>CHF 2.119</b> |
| <b>Coupon Nr. Ertrag</b>                  | <b>20</b>        |

#### 2. Für in der Schweiz und im Ausland domizilierte Anteilinhaber (verrechnungssteuerbefreite Erträge aus direktem Immobilienbesitz)

| Ausschüttung 2023                   | Anteilklasse UA  |
|-------------------------------------|------------------|
| Bruttoausschüttung aus Ertrag       | CHF 0.010        |
| <b>Nettoausschüttung aus Ertrag</b> | <b>CHF 0.010</b> |
| <b>Coupon Nr. Ertrag</b>            | <b>21</b>        |

Zahlbar ab 15.02.2024 bei der CREDIT SUISSE (SCHWEIZ) AG und deren sämtlichen Geschäftsstellen in der Schweiz.

**Thesaurierung pro Anteil**

**1. Für in der Schweiz und im Ausland domizilierte Anteilinhaber**

| <b>Thesaurierung 2023</b>                        | <b>Anteilklasse B</b> |              | <b>Anteilklasse BH EUR</b> |              | <b>Anteilklasse UB</b> |              |
|--|-----------------------|--------------|----------------------------|--------------|------------------------|--------------|
| Zur Thesaurierung verfügbarer Erfolg             | CHF                   | 3.456        | EUR                        | 3.331        | CHF                    | 3.401        |
| ./.. 35% Eidgenössische Verrechnungssteuer       | CHF                   | 1.210        | EUR                        | 1.166        | CHF                    | 1.190        |
| <b>Zur Thesaurierung zurückbehaltener Erfolg</b> | <b>CHF</b>            | <b>2.246</b> | <b>EUR</b>                 | <b>2.165</b> | <b>CHF</b>             | <b>2.210</b> |
| <b>Coupon Nr. Ertrag</b>                         |                       | <b>19</b>    |                            | <b>9</b>     |                        | <b>16</b>    |

**2. Für in der Schweiz und im Ausland domizilierte Anteilinhaber  
 (verrechnungssteuerbefreite Erträge aus direktem Immobilienbesitz)**

| <b>Thesaurierung 2023</b>                        | <b>Anteilklasse B</b> |              | <b>Anteilklasse BH EUR</b> |              | <b>Anteilklasse UB</b> |              |
|--|-----------------------|--------------|----------------------------|--------------|------------------------|--------------|
| Zur Thesaurierung verfügbarer Erfolg             | CHF                   | 0.009        | EUR                        | 0.009        | CHF                    | 0.009        |
| <b>Zur Thesaurierung zurückbehaltener Erfolg</b> | <b>CHF</b>            | <b>0.009</b> | <b>EUR</b>                 | <b>0.009</b> | <b>CHF</b>             | <b>0.009</b> |
| <b>Coupon Nr. Ertrag</b>                         |                       | <b>20</b>    |                            | <b>10</b>    |                        | <b>17</b>    |

**1. Für in der Schweiz und im Ausland domizilierte Anteilinhaber**

| <b>Thesaurierung 2023</b>                        | <b>Anteilklasse UBH EUR</b> |              |
|--|-----------------------------|--------------|
| Zur Thesaurierung verfügbarer Erfolg             | EUR                         | 3.482        |
| ./.. 35% Eidgenössische Verrechnungssteuer       | EUR                         | 1.219        |
| <b>Zur Thesaurierung zurückbehaltener Erfolg</b> | <b>EUR</b>                  | <b>2.263</b> |
| <b>Coupon Nr. Ertrag</b>                         |                             | <b>9</b>     |

**2. Für in der Schweiz und im Ausland domizilierte Anteilinhaber  
 (verrechnungssteuerbefreite Erträge aus direktem Immobilienbesitz)**

| <b>Thesaurierung 2023</b>                        | <b>Anteilklasse UBH EUR</b> |              |
|--|-----------------------------|--------------|
| Zur Thesaurierung verfügbarer Erfolg             | EUR                         | 0.009        |
| <b>Zur Thesaurierung zurückbehaltener Erfolg</b> | <b>EUR</b>                  | <b>0.009</b> |
| <b>Coupon Nr. Ertrag</b>                         |                             | <b>10</b>    |

## Wechselkurse

| <b>Wechselkurse per</b> | <b>31.12.2023</b> |
|-------------------------|-------------------|
| AUSTRALISCHER DOLLAR    | 0.574279          |
| DAENISCHE KRONE         | 0.124716          |
| ENGLISCHES PFUND        | 1.072875          |
| EURO                    | 0.929700          |
| HONGKONG-DOLLAR         | 0.107782          |
| JAPANISCHER YEN         | 0.005970          |
| KANADISCHER DOLLAR      | 0.638267          |
| MEXIKANISCHER PESO      | 0.049699          |
| NEUER POLNISCHER ZŁOTY  | 0.214032          |
| NORWEGISCHE KRONE       | 0.082872          |
| SCHWEDISCHE KRONE       | 0.083512          |
| SCHWEIZER FRANKEN       | 1.000000          |
| US DOLLAR               | 0.841624          |

## Vermögensrechnung per 31. Dezember 2023

|  | Konsolidierung        |                       |
|--|-----------------------|-----------------------|
|  | 31.12.2023            | 31.12.2022            |
|  | CHF                   | CHF                   |
| <b>Vermögenswerte</b>  |                       |                       |
| Bankguthaben, einschliesslich Treuhandanlagen bei Drittbanken, aufgeteilt in:                      |                       |                       |
| - Sichtguthaben  | 4'087'355.90          | 6'846'922.81          |
| Effekten, einschliesslich ausgeliehene und pensionierte Effekten, aufgeteilt in:                   |                       |                       |
| - Obligationen, Wandelobligationen, Optionsanleihen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte | 140'679'570.31        | 156'357'201.54        |
| - Strukturierte Produkte   | 0.00                  | 31'411'746.38         |
| - Aktien und sonstige Beteiligungswertpapiere und -rechte  | 289'932'663.49        | 331'252'404.39        |
| - Anteile anderer kollektiver Kapitalanlagen   | 205'644'699.24        | 219'411'904.39        |
| Derivative Finanzinstrumente   | 10'842'357.57         | 12'536'985.05         |
| Sonstige Vermögenswerte  | 3'448'540.73          | 5'136'122.14          |
| <b>Gesamtfondsvermögen abzüglich:</b>  | <b>654'635'187.24</b> | <b>762'953'286.70</b> |
| Andere Verbindlichkeiten   | 767'584.89            | 1'015'965.29          |
| <b>Nettofondsvermögen</b>  | <b>653'867'602.35</b> | <b>761'937'321.41</b> |
| <b>Veränderung des Nettofondsvermögens</b>   |                       |                       |
|  | 01.01.2023 -          | 01.01.2022 -          |
|  | 31.12.2023            | 31.12.2022            |
|  | CHF                   | CHF                   |
| Nettofondsvermögen zu Beginn der Berichtsperiode   | 761'937'321.41        | 914'520'931.64        |
| Ausschüttungen   | -22'894'113.72        | -17'466'739.46        |
| Ablieferung Verrechnungssteuer   | -1'314'744.80         | -1'213'658.35         |
| Kapitalausschüttung  | 0.00                  | -10'195'750.97        |
| Ausgaben von Anteilen  | 25'266'788.64         | 61'579'207.42         |
| Rücknahmen von Anteilen  | -127'338'087.20       | -91'730'537.97        |
| Sonstiges aus Anteilverkehr  | 2'211'078.21          | -3'227'048.37         |
| Gesamterfolg   | 15'999'359.81         | -90'329'082.53        |
| <b>Nettofondsvermögen am Ende der Berichtsperiode</b>  | <b>653'867'602.35</b> | <b>761'937'321.41</b> |
| <b>Entwicklung der Anteile im Umlauf</b>   |                       |                       |
| Bestand zu Beginn der Berichtsperiode  | 6'992'690.511         | 7'214'098.019         |
| Ausgegebene Anteile  | 248'714.149           | 582'210.090           |
| Zurückgenommene Anteile  | -1'191'715.480        | -803'617.598          |
| <b>Bestand am Ende der Berichtsperiode</b>   | <b>6'049'689.180</b>  | <b>6'992'690.511</b>  |
| <b>Währung Anteilklasse</b>  |                       |                       |
| <b>Inventarwert pro Anteil (Swung NAV)</b>   |                       |                       |
| <b>Inventarwert pro Anteil (Unswung NAV)</b>   |                       |                       |

| Anteilklasse A             |                            | Anteilklasse AH EUR        |                            | Anteilklasse B             |                            | Anteilklasse BH EUR        |                            |
|----------------------------|----------------------------|----------------------------|----------------------------|----------------------------|----------------------------|----------------------------|----------------------------|
| 01.01.2023 -<br>31.12.2023 | 01.01.2022 -<br>31.12.2022 | 01.01.2023 -<br>31.12.2023 | 01.01.2022 -<br>31.12.2022 | 01.01.2023 -<br>31.12.2023 | 01.01.2022 -<br>31.12.2022 | 01.01.2023 -<br>31.12.2023 | 01.01.2022 -<br>31.12.2022 |
| CHF                        | CHF                        | CHF                        | CHF                        | CHF                        | CHF                        | CHF                        | CHF                        |
| 97'605'430.50              | 124'175'224.46             | 13'425'062.93              | 18'555'731.90              | 19'233'200.04              | 21'265'976.46              | 2'127'115.90               | 2'894'090.27               |
| -3'470'768.15              | -2'723'879.38              | -442'571.90                | -491'348.07                | 0.00                       | 0.00                       | 0.00                       | 0.00                       |
| 0.00                       | 0.00                       | 0.00                       | 0.00                       | -198'312.92                | -168'187.04                | -22'210.14                 | -23'008.01                 |
| 0.00                       | -1'701'826.22              | 0.00                       | -142'746.38                | 0.00                       | 0.00                       | 0.00                       | 0.00                       |
| 1'731'728.68               | 1'643'594.40               | 153'061.80                 | 214'256.89                 | 1'479'572.00               | 2'934'868.02               | 210'658.84                 | 73'171.98                  |
| -14'364'657.73             | -11'561'563.97             | -2'317'530.23              | -2'210'102.40              | -4'057'360.35              | -2'525'639.85              | -319'735.88                | -411'926.32                |
| 229'791.90                 | -618'715.28                | 33'168.07                  | -197'746.96                | 43'977.97                  | -8'252.59                  | 3'407.86                   | -41'002.69                 |
| 2'068'624.34               | -11'607'403.51             | -170'422.71                | -2'302'982.05              | 403'897.78                 | -2'265'564.96              | -33'193.23                 | -364'209.33                |
| <b>83'800'149.54</b>       | <b>97'605'430.50</b>       | <b>10'680'767.96</b>       | <b>13'425'062.93</b>       | <b>16'904'974.52</b>       | <b>19'233'200.04</b>       | <b>1'966'043.35</b>        | <b>2'127'115.90</b>        |
| 110'037.959                | 120'719.413                | 134'048.712                | 152'727.299                | 164'222.211                | 161'195.644                | 20'127.366                 | 23'190.290                 |
| 1'979.441                  | 1'715.812                  | 1'521.250                  | 1'903.980                  | 12'441.912                 | 23'665.292                 | 1'985.847                  | 656.078                    |
| -16'485.776                | -12'397.266                | -23'514.994                | -20'582.567                | -34'346.003                | -20'638.725                | -2'999.224                 | -3'719.002                 |
| <b>95'531.624</b>          | <b>110'037.959</b>         | <b>112'054.968</b>         | <b>134'048.712</b>         | <b>142'318.120</b>         | <b>164'222.211</b>         | <b>19'113.989</b>          | <b>20'127.366</b>          |
| (CHF)                      | (CHF)                      | (EUR)                      | (EUR)                      | (CHF)                      | (CHF)                      | (EUR)                      | (EUR)                      |
| <b>875.90</b>              | <b>884.80</b>              | <b>102.38</b>              | <b>101.17</b>              | <b>118.61</b>              | <b>116.82</b>              | <b>110.48</b>              | <b>106.76</b>              |
| <b>877.20</b>              | <b>887.02</b>              | <b>102.53</b>              | <b>101.42</b>              | <b>118.78</b>              | <b>117.12</b>              | <b>110.64</b>              | <b>107.02</b>              |

|   | Anteilklasse UA            |                            |
|---|----------------------------|----------------------------|
|   | 01.01.2023 -<br>31.12.2023 | 01.01.2022 -<br>31.12.2022 |
|   | CHF                        | CHF                        |
| <b>Veränderung des Nettofondsvermögens</b>            |                            |                            |
| Nettofondsvermögen zu Beginn der Berichtsperiode      | 510'803'277.95             | 605'356'002.82             |
| Ausschüttungen  | -18'437'651.14             | -13'688'963.82             |
| Ablieferung Verrechnungssteuer                        | 0.00                       | 0.00                       |
| Kapitalausschüttung                                   | 0.00                       | -8'190'937.37              |
| Ausgaben von Anteilen                                 | 19'136'657.91              | 47'968'379.81              |
| Rücknahmen von Anteilen                               | -81'428'749.50             | -59'968'262.86             |
| Sonstiges aus Anteilverkehr                           | 1'479'006.56               | -1'639'525.20              |
| Gesamterfolg  | 11'851'764.22              | -59'033'415.43             |
| <b>Nettofondsvermögen am Ende der Berichtsperiode</b> | <b>443'404'306.00</b>      | <b>510'803'277.95</b>      |
| <b>Entwicklung der Anteile im Umlauf</b>              |                            |                            |
| Bestand zu Beginn der Berichtsperiode                 | 5'458'482.586              | 5'591'874.492              |
| Ausgegebene Anteile                                   | 207'345.291                | 477'083.268                |
| Zurückgenommene Anteile                               | -885'337.246               | -610'475.174               |
| <b>Bestand am Ende der Berichtsperiode</b>            | <b>4'780'490.631</b>       | <b>5'458'482.586</b>       |
| <b>Währung Anteilklasse</b>                           | <b>(CHF)</b>               | <b>(CHF)</b>               |
| <b>Inventarwert pro Anteil (Swung NAV)</b>            | <b>92.62</b>               | <b>93.35</b>               |
| <b>Inventarwert pro Anteil (Unswung NAV)</b>          | <b>92.75</b>               | <b>93.58</b>               |

| Anteilklasse UAH EUR       |                            | Anteilklasse UB            |                            | Anteilklasse UBH EUR       |                            |
|----------------------------|----------------------------|----------------------------|----------------------------|----------------------------|----------------------------|
| 01.01.2023 -<br>31.12.2023 | 01.01.2022 -<br>31.12.2022 | 01.01.2023 -<br>31.12.2023 | 01.01.2022 -<br>31.12.2022 | 01.01.2023 -<br>31.12.2023 | 01.01.2022 -<br>31.12.2022 |
| CHF                        | CHF                        | CHF                        | CHF                        | CHF                        | CHF                        |
| 15'277'970.56              | 21'478'026.18              | 98'302'793.36              | 113'897'116.35             | 5'162'470.27               | 6'898'763.32               |
| -543'122.53                | -562'548.19                | 0.00                       | 0.00                       | 0.00                       | 0.00                       |
| 0.00                       | 0.00                       | -1'039'342.14              | -963'456.41                | -54'879.60                 | -59'006.89                 |
| 0.00                       | -160'241.00                | 0.00                       | 0.00                       | 0.00                       | 0.00                       |
| 164'363.24                 | 212'601.10                 | 2'227'500.44               | 8'402'781.50               | 163'245.73                 | 129'553.72                 |
| -1'967'977.19              | -2'818'335.76              | -21'903'931.72             | -11'389'717.20             | -978'144.60                | -844'989.61                |
| 28'287.80                  | -291'108.32                | 370'120.21                 | -337'698.50                | 23'317.85                  | -92'998.85                 |
| -170'410.69                | -2'580'423.45              | 2'110'086.92               | -11'306'232.38             | -60'986.82                 | -868'851.42                |
| <b>12'789'111.19</b>       | <b>15'277'970.56</b>       | <b>80'067'227.07</b>       | <b>98'302'793.36</b>       | <b>4'255'022.83</b>        | <b>5'162'470.27</b>        |
| 151'015.865                | 175'459.299                | 906'366.639                | 934'051.661                | 48'389.173                 | 54'879.921                 |
| 1'645.518                  | 1'851.809                  | 20'259.227                 | 74'211.920                 | 1'535.663                  | 1'121.931                  |
| -19'879.715                | -26'295.243                | -200'117.141               | -101'896.942               | -9'035.381                 | -7'612.679                 |
| <b>132'781.668</b>         | <b>151'015.865</b>         | <b>726'508.725</b>         | <b>906'366.639</b>         | <b>40'889.455</b>          | <b>48'389.173</b>          |
| (EUR)                      | (EUR)                      | (CHF)                      | (CHF)                      | (EUR)                      | (EUR)                      |
| <b>103.44</b>              | <b>102.20</b>              | <b>110.04</b>              | <b>108.19</b>              | <b>111.77</b>              | <b>107.77</b>              |
| <b>103.60</b>              | <b>102.46</b>              | <b>110.21</b>              | <b>108.46</b>              | <b>111.93</b>              | <b>108.05</b>              |



## Erfolgsrechnung für die Zeit vom 1. Januar 2023 bis zum 31. Dezember 2023

|  | Konsolidierung             |                            |
|--|----------------------------|----------------------------|
|  | 01.01.2023 -<br>31.12.2023 | 01.01.2022 -<br>31.12.2022 |
|  | CHF                        | CHF                        |
| <b>Ertrag</b>  |                            |                            |
| Erträge der Bankguthaben   | 289'043.86                 | 45'108.07                  |
| Negativzinsen  | -3'698.09                  | -33'556.06                 |
| Erträge der Effektenleihen   | 128'374.70                 | 213'229.35                 |
| Erträge der Ausgleichszahlungen  | 1'964'325.47               | 2'498'103.11               |
| Erträge der Geldmarktinstrumenten  | 0.00                       | 544'751.60                 |
| Erträge der Effekten, aufgeteilt in:   |                            |                            |
| - Obligationen, Wandelobligationen, Optionsanleihen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte     | 7'332'844.48               | 7'166'165.96               |
| - Strukturierte Produkte   | 284'714.04                 | 2'320'735.13               |
| - Aktien und sonstige Beteiligungswertpapiere und -rechte, einschliesslich Gratisaktien                | 11'041'849.19              | 11'719'098.67              |
| - Anteile anderer kollektiver Kapitalanlagen   | 10'110'542.17              | 10'798'843.67              |
| Erträge der Rückvergütungen  | 0.00                       | 3'732.23                   |
| Erträge aus kollektiven Kapitalanlagen mit Immobilien im Direktbesitz                                  | 80'661.50                  | 68'255.09                  |
| Sonstige Erträge   | -4'819.94                  | -4'089.29                  |
| Einkauf in laufende Nettoerträge bei der Ausgabe von Anteilen  | 456'791.89                 | 1'171'923.28               |
| <b>Total Erträge</b>   | <b>31'680'629.27</b>       | <b>36'512'300.81</b>       |
| <b>Aufwendungen</b>  |                            |                            |
| Passivzinsen   | 7'716.14                   | 1'316.27                   |
| Prüfaufwand  | 14'494.70                  | 14'512.48                  |
| Reglementarische Vergütung an:   |                            |                            |
| - die Fondsleitung   | 9'230'804.88               | 10'874'832.66              |
| - die Depotbank  | 296'709.19                 | 349'261.21                 |
| Teilübertrag von Aufwendungen auf realisierte Kapitalverluste  | -93'190.20                 | -118'647.59                |
| Teilübertrag von Aufwendungen auf kollektiven Kapitalanlagen mit Immobilien im Direktbesitz            | -24'510.57                 | -21'557.84                 |
| Aufwände aus kollektiven Kapitalanlagen mit Immobilien im Direktbesitz                                 | 24'510.57                  | 21'557.84                  |
| Sonstige Aufwendungen  | 29'115.68                  | 17'731.42                  |
| Ausrichtung laufender Nettoerträge bei Rücknahme von Anteilen  | 2'429'903.80               | 2'096'198.08               |
| <b>Total Aufwendungen</b>  | <b>11'915'554.19</b>       | <b>13'235'204.53</b>       |
| <b>Nettoertrag</b>   | <b>19'765'075.08</b>       | <b>23'277'096.28</b>       |
| Realisierte Kapitalgewinne und -verluste   | -25'384'116.59             | -18'227'938.84             |
| Teilübertrag von Aufwendungen auf realisierte Kapitalverluste  | -93'190.20                 | -118'647.59                |
| <b>Realisierter Erfolg</b>   | <b>-5'712'231.71</b>       | <b>4'930'509.85</b>        |
| Nicht realisierte Kapitalgewinne und -verluste   | 21'711'591.52              | -95'259'592.38             |
| <b>Gesamterfolg</b>  | <b>15'999'359.81</b>       | <b>-90'329'082.53</b>      |
| <b>Verwendung des Erfolgs</b>  |                            |                            |
| Nettoertrag des Rechnungsjahres  | 19'765'075.08              | 23'277'096.28              |
| Vortrag des Vorjahres aus kollektiven Kapitalanlagen mit Immobilien im Direktbesitz                    | 29'360.99                  | 54'963.12                  |
| Vortrag des Vorjahres  | 2'377'284.08               | 5'924'980.95               |
| <b>Zur Verteilung verfügbarer Erfolg</b>   | <b>22'171'720.15</b>       | <b>29'257'040.35</b>       |
| Zur Ausschüttung an die Anlegerinnen und Anleger vorgesehener Erfolg                                   | 18'869'303.62              | 22'942'695.57              |
| Zur Ausschüttung bestimmter Erfolg aus Kapitalanlagen mit Immobilien im Direktbesitz                   | 56'768.37                  | 63'069.14                  |
| Ablieferung/Ausschüttung der Verrechnungssteuer (35%)  | 1'103'865.55               | 1'343'027.20               |
| Zur Wiederanlage zurückbehaltener Ertrag (65%)   | 2'050'037.54               | 2'494'194.24               |
| Zur Wiederanlage zurückbehaltener Ertrag aus kollektiven Kapitalanlagen mit Immobilien im Direktbesitz | 8'251.63                   | 7'409.13                   |
| Vortrag Nettoerträge aus kollektiven Kapitalanlagen mit Immobilien im Direktbesitz                     | 15'393.01                  | 29'360.99                  |
| Vortrag auf neue Rechnung  | 68'100.43                  | 2'377'284.08               |

Jahresbericht per 31. Dezember 2023

| Anteilklasse A             |                            | Anteilklasse AH EUR        |                            | Anteilklasse B             |                            | Anteilklasse BH EUR        |                            |
|----------------------------|----------------------------|----------------------------|----------------------------|----------------------------|----------------------------|----------------------------|----------------------------|
| 01.01.2023 -<br>31.12.2023 | 01.01.2022 -<br>31.12.2022 | 01.01.2023 -<br>31.12.2023 | 01.01.2022 -<br>31.12.2022 | 01.01.2023 -<br>31.12.2023 | 01.01.2022 -<br>31.12.2022 | 01.01.2023 -<br>31.12.2023 | 01.01.2022 -<br>31.12.2022 |
| CHF                        | CHF                        | CHF                        | CHF                        | CHF                        | CHF                        | CHF                        | CHF                        |
| 36'964.35                  | 5'799.33                   | 4'999.68                   | 807.15                     | 7'432.90                   | 1'128.95                   | 838.53                     | 127.14                     |
| -473.77                    | -4'372.97                  | -64.72                     | -619.99                    | -93.73                     | -824.11                    | -10.13                     | -99.14                     |
| 16'428.61                  | 27'789.90                  | 2'211.44                   | 3'979.73                   | 3'307.16                   | 5'236.72                   | 376.15                     | 632.22                     |
| 251'390.32                 | 326'536.13                 | 33'831.44                  | 46'766.94                  | 50'442.35                  | 61'221.11                  | 5'730.70                   | 7'436.51                   |
| 0.00                       | 70'938.61                  | 0.00                       | 10'290.14                  | 0.00                       | 13'395.44                  | 0.00                       | 1'635.17                   |
| 938'288.53                 | 936'005.37                 | 126'755.26                 | 133'896.87                 | 188'286.57                 | 175'832.22                 | 21'234.23                  | 21'216.30                  |
| 36'186.14                  | 301'884.88                 | 5'004.23                   | 42'860.75                  | 7'404.04                   | 57'056.92                  | 835.74                     | 6'857.83                   |
| 1'409'795.26               | 1'541'019.27               | 191'532.61                 | 222'782.92                 | 285'060.21                 | 285'820.61                 | 31'913.47                  | 35'466.48                  |
| 1'293'473.24               | 1'414'203.65               | 174'662.10                 | 204'399.14                 | 259'693.93                 | 264'316.24                 | 29'364.49                  | 32'461.75                  |
| 0.00                       | 489.90                     | 0.00                       | 72.16                      | 0.00                       | 91.03                      | 0.00                       | 11.54                      |
| 10'282.73                  | 8'965.57                   | 1'383.52                   | 1'279.36                   | 2'110.11                   | 1'660.47                   | 233.58                     | 203.24                     |
| -603.55                    | -523.74                    | -62.25                     | -72.33                     | -135.56                    | -103.07                    | -17.28                     | -11.39                     |
| 28'789.22                  | 26'211.11                  | 325.87                     | 2'893.92                   | 18'534.73                  | 42'799.56                  | 3'476.47                   | 1'389.01                   |
| <b>4'020'521.08</b>        | <b>4'654'947.01</b>        | <b>540'579.18</b>          | <b>669'336.76</b>          | <b>822'042.71</b>          | <b>907'632.09</b>          | <b>93'975.95</b>           | <b>107'326.66</b>          |
| 989.66                     | 171.88                     | 132.15                     | 24.55                      | 196.72                     | 32.19                      | 22.29                      | 3.91                       |
| 1'854.92                   | 1'890.33                   | 250.32                     | 269.45                     | 372.22                     | 357.37                     | 41.87                      | 42.95                      |
| 1'362'008.06               | 1'639'020.43               | 193'709.35                 | 247'653.32                 | 273'516.25                 | 306'925.80                 | 32'497.89                  | 39'258.58                  |
| 37'958.49                  | 45'678.98                  | 5'129.20                   | 6'558.01                   | 7'622.36                   | 8'553.17                   | 860.41                     | 1'039.40                   |
| -60'293.05                 | -76'879.16                 | -17'803.19                 | -23'469.37                 | -12'107.33                 | -14'489.81                 | -2'986.63                  | -3'809.25                  |
| -3'468.72                  | -3'128.17                  | -465.97                    | -445.10                    | -710.14                    | -580.50                    | -78.80                     | -70.35                     |
| 3'468.72                   | 3'128.17                   | 465.97                     | 445.10                     | 710.14                     | 580.50                     | 78.80                      | 70.35                      |
| 3'715.68                   | 2'279.54                   | 496.09                     | 419.39                     | 751.04                     | 430.62                     | 86.74                      | 66.32                      |
| 245'580.29                 | 257'948.88                 | 36'226.12                  | 42'237.07                  | 58'525.34                  | 42'486.60                  | 4'116.26                   | 6'979.32                   |
| <b>1'591'814.05</b>        | <b>1'870'110.88</b>        | <b>218'140.04</b>          | <b>273'692.42</b>          | <b>328'876.60</b>          | <b>344'295.94</b>          | <b>34'638.83</b>           | <b>43'581.23</b>           |
| <b>2'428'707.03</b>        | <b>2'784'836.13</b>        | <b>322'439.14</b>          | <b>395'644.34</b>          | <b>493'166.11</b>          | <b>563'336.15</b>          | <b>59'337.12</b>           | <b>63'745.43</b>           |
| -3'155'407.65              | -1'991'749.12              | -680'698.60                | -1'266'622.51              | -631'546.48                | -394'346.19                | -125'603.44                | -200'105.89                |
| -60'293.05                 | -76'879.16                 | -17'803.19                 | -23'469.37                 | -12'107.33                 | -14'489.81                 | -2'986.63                  | -3'809.25                  |
| <b>-786'993.67</b>         | <b>716'207.85</b>          | <b>-376'062.65</b>         | <b>-894'447.54</b>         | <b>-150'487.70</b>         | <b>154'500.15</b>          | <b>-69'252.95</b>          | <b>-140'169.71</b>         |
| 2'855'618.01               | -12'323'611.36             | 205'639.94                 | -1'408'534.51              | 554'385.48                 | -2'420'065.11              | 36'059.72                  | -224'039.62                |
| <b>2'068'624.34</b>        | <b>-11'607'403.51</b>      | <b>-170'422.71</b>         | <b>-2'302'982.05</b>       | <b>403'897.78</b>          | <b>-2'265'564.96</b>       | <b>-33'193.23</b>          | <b>-364'209.33</b>         |
| 2'428'707.03               | 2'784'836.13               | 322'439.14                 | 395'644.34                 | 493'166.11                 | 563'336.15                 | 59'337.12                  | 63'745.43                  |
| 534.35                     | 647.29                     | 1'177.17                   | 418.37                     | 0.00                       | 0.00                       | 0.00                       | 0.00                       |
| 142'034.94                 | 868'397.14                 | 493.63                     | 53'006.52                  | 0.00                       | 0.00                       | 0.00                       | 0.00                       |
| <b>2'571'276.32</b>        | <b>3'653'880.56</b>        | <b>324'109.94</b>          | <b>449'069.23</b>          | <b>493'166.11</b>          | <b>563'336.15</b>          | <b>59'337.12</b>           | <b>63'745.43</b>           |
| 2'564'068.79               | 3'505'809.37               | 320'866.71                 | 447'398.43                 | 0.00                       | 0.00                       | 0.00                       | 0.00                       |
| 6'687.21                   | 5'501.90                   | 1'041.78                   | 0.00                       | 0.00                       | 0.00                       | 0.00                       | 0.00                       |
| 0.00                       | 0.00                       | 0.00                       | 0.00                       | 172'154.87                 | 196'789.41                 | 20'714.39                  | 22'268.12                  |
| 0.00                       | 0.00                       | 0.00                       | 0.00                       | 319'716.43                 | 365'466.17                 | 38'469.64                  | 41'355.13                  |
| 0.00                       | 0.00                       | 0.00                       | 0.00                       | 1'294.81                   | 1'080.57                   | 153.09                     | 122.18                     |
| 102.76                     | 534.35                     | 961.02                     | 1'177.17                   | 0.00                       | 0.00                       | 0.00                       | 0.00                       |
| 417.56                     | 142'034.94                 | 1'240.43                   | 493.63                     | 0.00                       | 0.00                       | 0.00                       | 0.00                       |

|  | Anteilklasse UA            |                            |
|--|----------------------------|----------------------------|
|  | 01.01.2023 -<br>31.12.2023 | 01.01.2022 -<br>31.12.2022 |
|  | CHF                        | CHF                        |
| <b>Ertrag</b>  |                            |                            |
| Erträge der Bankguthaben   | 194'614.35                 | 30'146.98                  |
| Negativzinsen  | -2'480.68                  | -22'360.47                 |
| Erträge der Effektenleihen   | 86'506.22                  | 142'157.88                 |
| Erträge der Ausgleichszahlungen  | 1'324'159.12               | 1'663'990.38               |
| Erträge der Geldmarktinstrumenten  | 0.00                       | 362'577.88                 |
| Erträge der Effekten, aufgeteilt in:   |                            |                            |
| - Obligationen, Wandelobligationen, Optionsanleihen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte     | 4'938'379.57               | 4'775'390.26               |
| - Strukturierte Produkte   | 191'182.77                 | 1'547'642.76               |
| - Aktien und sonstige Beteiligungswertpapiere und -rechte, einschliesslich Gratisaktien                | 7'427'240.46               | 7'794'368.96               |
| - Anteile anderer kollektiver Kapitalanlagen   | 6'808'011.20               | 7'188'850.36               |
| Erträge der Rückvergütungen  | 0.00                       | 2'480.04                   |
| Erträge aus kollektiven Kapitalanlagen mit Immobilien im Direktbesitz                                  | 54'227.48                  | 45'452.82                  |
| Sonstige Erträge   | -3'344.98                  | -2'739.54                  |
| Einkauf in laufende Nettoerträge bei der Ausgabe von Anteilen  | 373'298.74                 | 943'602.93                 |
| <b>Total Erträge</b>   | <b>21'391'794.25</b>       | <b>24'471'561.24</b>       |
| <b>Aufwendungen</b>  |                            |                            |
| Passivzinsen   | 5'201.53                   | 877.05                     |
| Prüfaufwand  | 9'763.95                   | 9'675.41                   |
| Reglementarische Vergütung an:   |                            |                            |
| - die Fondsleitung   | 5'994'775.23               | 6'979'709.15               |
| - die Depotbank  | 199'826.79                 | 232'659.83                 |
| Teilübertrag von Aufwendungen auf realisierte Kapitalverluste  | 0.00                       | 0.00                       |
| Teilübertrag von Aufwendungen auf kollektiven Kapitalanlagen mit Immobilien im Direktbesitz            | -16'075.83                 | -14'006.10                 |
| Aufwände aus kollektiven Kapitalanlagen mit Immobilien im Direktbesitz                                 | 16'075.83                  | 14'006.10                  |
| Sonstige Aufwendungen  | 19'658.13                  | 11'652.46                  |
| Ausrichtung laufender Nettoerträge bei Rücknahme von Anteilen  | 1'709'808.38               | 1'446'138.30               |
| <b>Total Aufwendungen</b>  | <b>7'939'034.01</b>        | <b>8'680'712.20</b>        |
| <b>Nettoertrag</b>   | <b>13'452'760.24</b>       | <b>15'790'849.04</b>       |
| Realisierte Kapitalgewinne und -verluste   | -16'708'763.37             | -10'434'056.29             |
| Teilübertrag von Aufwendungen auf realisierte Kapitalverluste  | 0.00                       | 0.00                       |
| <b>Realisierter Erfolg</b>   | <b>-3'256'003.13</b>       | <b>5'356'792.75</b>        |
| Nicht realisierte Kapitalgewinne und -verluste   | 15'107'767.35              | -64'390'208.18             |
| <b>Gesamterfolg</b>  | <b>11'851'764.22</b>       | <b>-59'033'415.43</b>      |
| <b>Verwendung des Erfolgs</b>  |                            |                            |
| Nettoertrag des Rechnungsjahres  | 13'452'760.24              | 15'790'849.04              |
| Vortrag des Vorjahres aus kollektiven Kapitalanlagen mit Immobilien im Direktbesitz                    | 27'288.86                  | 51'396.88                  |
| Vortrag des Vorjahres  | 2'232'261.55               | 4'921'560.46               |
| <b>Zur Verteilung verfügbarer Erfolg</b>   | <b>15'712'310.65</b>       | <b>20'763'806.38</b>       |
| Zur Ausschüttung an die Anlegerinnen und Anleger vorgesehener Erfolg                                   | 15'584'399.46              | 18'449'671.14              |
| Zur Ausschüttung bestimmter Erfolg aus Kapitalanlagen mit Immobilien im Direktbesitz                   | 47'804.91                  | 54'584.83                  |
| Ablieferung/Ausschüttung der Verrechnungssteuer (35%)  | 0.00                       | 0.00                       |
| Zur Wiederanlage zurückbehaltener Ertrag (65%)   | 0.00                       | 0.00                       |
| Zur Wiederanlage zurückbehaltener Ertrag aus kollektiven Kapitalanlagen mit Immobilien im Direktbesitz | 0.00                       | 0.00                       |
| Vortrag Nettoerträge aus kollektiven Kapitalanlagen mit Immobilien im Direktbesitz                     | 14'187.83                  | 27'288.86                  |
| Vortrag auf neue Rechnung  | 65'918.45                  | 2'232'261.55               |

Jahresbericht per 31. Dezember 2023

| Anteilklasse UAH EUR       |                            | Anteilklasse UB            |                            | Anteilklasse UBH EUR       |                            |
|----------------------------|----------------------------|----------------------------|----------------------------|----------------------------|----------------------------|
| 01.01.2023 -<br>31.12.2023 | 01.01.2022 -<br>31.12.2022 | 01.01.2023 -<br>31.12.2023 | 01.01.2022 -<br>31.12.2022 | 01.01.2023 -<br>31.12.2023 | 01.01.2022 -<br>31.12.2022 |
| CHF                        | CHF                        | CHF                        | CHF                        | CHF                        | CHF                        |
| 5'773.63                   | 929.98                     | 36'509.07                  | 5'859.77                   | 1'911.35                   | 308.77                     |
| -74.26                     | -719.86                    | -476.05                    | -4'318.42                  | -24.75                     | -241.10                    |
| 2'564.72                   | 4'592.09                   | 16'130.46                  | 27'312.76                  | 849.94                     | 1'528.05                   |
| 39'321.38                  | 54'113.21                  | 246'540.14                 | 319'932.53                 | 12'910.02                  | 18'106.30                  |
| 0.00                       | 11'891.00                  | 0.00                       | 70'026.22                  | 0.00                       | 3'997.14                   |
| 146'492.36                 | 154'486.69                 | 925'016.60                 | 917'822.41                 | 48'391.36                  | 51'515.84                  |
| 5'715.37                   | 49'646.63                  | 36'421.30                  | 298'132.44                 | 1'964.45                   | 16'652.92                  |
| 220'129.86                 | 257'470.61                 | 1'403'591.10               | 1'495'253.66               | 72'586.22                  | 86'916.16                  |
| 201'758.23                 | 235'771.18                 | 1'277'024.95               | 1'379'962.17               | 66'554.03                  | 78'879.18                  |
| 0.00                       | 83.55                      | 0.00                       | 475.58                     | 0.00                       | 28.43                      |
| 1'585.81                   | 1'470.72                   | 10'296.61                  | 8'723.99                   | 541.66                     | 498.92                     |
| -96.05                     | -81.81                     | -527.48                    | -529.77                    | -32.79                     | -27.64                     |
| 2'509.02                   | 2'267.11                   | 26'940.79                  | 150'748.83                 | 2'917.05                   | 2'010.81                   |
| <b>625'680.07</b>          | <b>771'921.10</b>          | <b>3'977'467.49</b>        | <b>4'669'402.17</b>        | <b>208'568.54</b>          | <b>260'173.78</b>          |
| 153.44                     | 28.43                      | 969.48                     | 168.76                     | 50.87                      | 9.50                       |
| 289.59                     | 311.35                     | 1'826.43                   | 1'861.81                   | 95.40                      | 103.81                     |
| 189'089.53                 | 241'255.32                 | 1'122'725.55               | 1'340'509.81               | 62'483.02                  | 80'500.25                  |
| 5'930.73                   | 7'567.08                   | 37'421.56                  | 44'680.04                  | 1'959.65                   | 2'524.70                   |
| 0.00                       | 0.00                       | 0.00                       | 0.00                       | 0.00                       | 0.00                       |
| -499.02                    | -477.97                    | -3'041.42                  | -2'688.35                  | -170.67                    | -161.30                    |
| 499.02                     | 477.97                     | 3'041.42                   | 2'688.35                   | 170.67                     | 161.30                     |
| 582.75                     | 481.65                     | 3'630.96                   | 2'240.95                   | 194.29                     | 160.49                     |
| 30'620.08                  | 61'141.07                  | 333'944.41                 | 222'011.83                 | 11'082.92                  | 17'255.01                  |
| <b>226'666.12</b>          | <b>310'784.90</b>          | <b>1'500'518.39</b>        | <b>1'611'473.20</b>        | <b>75'866.15</b>           | <b>100'553.76</b>          |
| <b>399'013.95</b>          | <b>461'136.20</b>          | <b>2'476'949.10</b>        | <b>3'057'928.97</b>        | <b>132'702.39</b>          | <b>159'620.02</b>          |
| -816'568.03                | -1'441'322.20              | -2'993'799.63              | -2'014'064.95              | -271'729.39                | -485'671.69                |
| 0.00                       | 0.00                       | 0.00                       | 0.00                       | 0.00                       | 0.00                       |
| <b>-417'554.08</b>         | <b>-980'186.00</b>         | <b>-516'850.53</b>         | <b>1'043'864.02</b>        | <b>-139'027.00</b>         | <b>-326'051.67</b>         |
| 247'143.39                 | -1'600'237.45              | 2'626'937.45               | -12'350'096.40             | 78'040.18                  | -542'799.75                |
| <b>-170'410.69</b>         | <b>-2'580'423.45</b>       | <b>2'110'086.92</b>        | <b>-11'306'232.38</b>      | <b>-60'986.82</b>          | <b>-868'851.42</b>         |
| 399'013.95                 | 461'136.20                 | 2'476'949.10               | 3'057'928.97               | 132'702.39                 | 159'620.02                 |
| 360.61                     | 2'500.57                   | 0.00                       | 0.00                       | 0.00                       | 0.00                       |
| 2'493.96                   | 82'016.84                  | 0.00                       | 0.00                       | 0.00                       | 0.00                       |
| <b>401'868.52</b>          | <b>545'653.61</b>          | <b>2'476'949.10</b>        | <b>3'057'928.97</b>        | <b>132'702.39</b>          | <b>159'620.02</b>          |
| 399'968.66                 | 539'816.63                 | 0.00                       | 0.00                       | 0.00                       | 0.00                       |
| 1'234.47                   | 2'982.41                   | 0.00                       | 0.00                       | 0.00                       | 0.00                       |
| 0.00                       | 0.00                       | 864'672.78                 | 1'068'210.55               | 46'323.51                  | 55'759.12                  |
| 0.00                       | 0.00                       | 1'605'822.02               | 1'983'820.23               | 86'029.45                  | 103'552.71                 |
| 0.00                       | 0.00                       | 6'454.30                   | 5'898.19                   | 349.43                     | 308.19                     |
| 141.40                     | 360.61                     | 0.00                       | 0.00                       | 0.00                       | 0.00                       |
| 523.99                     | 2'493.96                   | 0.00                       | 0.00                       | 0.00                       | 0.00                       |

## Zusammensetzung des Portefolles und Bestandesveränderungen

| Titelbezeichnung   | Währung | 31.12.2022<br>Anzahl/<br>Nominal | Käufe (1) | Verkäufe (1) | 31.12.2023<br>Anzahl/<br>Nominal | Kurswert CHF         | in % des<br>Gesamtfonds-<br>vermögens |
|--|---------|----------------------------------|-----------|--------------|----------------------------------|----------------------|---------------------------------------|
| <b>Börsennotierte / an einem geregelten Markt gehandelte Wertpapiere; bewertet zu den Kursen, die am Hauptmarkt bezahlt werden</b> |         |                                  |           |              |                                  |                      |                                       |
| <b>Aktien (und aktienähnliche Wertpapiere)</b>   |         |                                  |           |              |                                  |                      |                                       |
| <b>AUSTRALISCHER DOLLAR</b>  |         |                                  |           |              |                                  |                      |                                       |
| AMPOL LTD  | AUD     | 65'200                           | 55'800    | 36'000       | 85'000                           | 1'764'615.28         | 0.27                                  |
| ANZ GROUP HOLDINGS LTD   | AUD     | 17'810                           |           | 17'810       |                                  |                      |                                       |
| APA GROUP (stapled security)   | AUD     | 83'100                           | 5'000     | 53'100       | 35'000                           | 171'651.94           | 0.03                                  |
| AURIZON HOLDINGS   | AUD     | 175'330                          | 204'800   | 201'830      | 178'300                          | 389'096.88           | 0.06                                  |
| AUSTRALIA & NEW ZEALAND BANKING GROUP  | AUD     |                                  | 52'630    | 5'830        | 46'800                           | 696'632.38           | 0.11                                  |
| BHP BILLITON   | AUD     | 47'600                           | 5'800     | 19'400       | 34'000                           | 984'279.46           | 0.15                                  |
| COLES GROUP LTD  | AUD     | 41'250                           | 5'000     | 11'550       | 34'700                           | 321'031.63           | 0.05                                  |
| COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA   | AUD     |                                  | 30'000    |              | 30'000                           | 1'926'131.20         | 0.29                                  |
| COMPUTERSHARE  | AUD     | 50'000                           | 6'100     | 56'100       |                                  |                      |                                       |
| FORTESCUE METALS GROUP   | AUD     | 274'730                          | 36'000    | 149'530      | 161'200                          | 2'686'490.16         | 0.41                                  |
| HARVEY NORMAN HOLDINGS   | AUD     | 428'290                          | 52'000    | 443'390      | 36'900                           | 89'001.73            | 0.01                                  |
| IPH  | AUD     | 39'000                           | 4'700     | 43'700       |                                  |                      |                                       |
| JB HI-FI   | AUD     | 41'550                           | 5'000     | 42'850       | 3'700                            | 112'679.82           | 0.02                                  |
| MAGELLAN   | AUD     | 30'550                           | 129'700   | 14'750       | 145'500                          | 775'414.25           | 0.12                                  |
| METCASH  | AUD     | 457'970                          | 265'000   | 140'970      | 582'000                          | 1'166'463.68         | 0.18                                  |
| NINE ENTERTAINMENT COMPANY HOLDINGS  | AUD     | 831'100                          | 1'016'000 | 1'097'100    | 750'000                          | 870'032.43           | 0.13                                  |
| NRW HOLDINGS   | AUD     | 246'300                          | 55'200    | 64'500       | 237'000                          | 405'590.17           | 0.06                                  |
| PENDAL GROUP LTD   | AUD     | 95'250                           |           | 95'250       |                                  |                      |                                       |
| PERPETUAL  | AUD     |                                  | 25'807    |              | 23'400                           | 342'403.42           | 0.05                                  |
| PLATINUM ASSET MANAGEMENT  | AUD     | 260'520                          | 640'500   | 101'020      | 800'000                          | 611'032.68           | 0.09                                  |
| RIO TINTO  | AUD     | 45'710                           | 6'100     | 10'410       | 41'400                           | 3'225'335.98         | 0.49                                  |
| SMARTGROUP CORP LTD  | AUD     | 103'900                          | 13'000    | 116'900      |                                  |                      |                                       |
| SONIC HEALTHCARE   | AUD     |                                  | 17'000    | 17'000       |                                  |                      |                                       |
| SOUTH32  | AUD     | 965'800                          | 228'000   | 693'800      | 500'000                          | 956'174.25           | 0.15                                  |
| SUNCORP GROUP LTD  | AUD     | 116'920                          | 18'800    | 35'120       | 100'600                          | 800'148.44           | 0.12                                  |
| TELSTRA GROUP LIMITED  | AUD     |                                  | 323'500   | 23'500       | 300'000                          | 682'243.25           | 0.10                                  |
| TRANSURBAN GROUP (stapled security)  | AUD     | 46'740                           |           | 46'740       |                                  |                      |                                       |
| WESFARMERS   | AUD     | 129'900                          | 22'300    | 59'400       | 92'800                           | 3'039'837.03         | 0.46                                  |
| WOODSIDE ENERGY GROUP LTD  | AUD     | 87'100                           | 50'000    | 26'500       | 110'600                          | 1'972'783.32         | 0.30                                  |
| WORLEYPARSONS  | AUD     | 116'910                          | 14'500    | 131'410      |                                  |                      |                                       |
|  |         |                                  |           |              |                                  | <b>23'989'069.38</b> | <b>3.66</b>                           |
| <b>ENGLISCHES PFUND</b>  |         |                                  |           |              |                                  |                      |                                       |
| ABRDN PLC  | GBP     | 72'700                           |           | 18'000       | 54'700                           | 104'843.03           | 0.02                                  |
| ADMIRAL GROUP  | GBP     |                                  | 105'000   | 105'000      |                                  |                      |                                       |
| ANGLO AMERICAN   | GBP     | 122'000                          | 48'000    | 35'000       | 135'000                          | 2'854'180.61         | 0.44                                  |
| ANTOFAGASTA  | GBP     | 176'700                          |           | 176'700      |                                  |                      |                                       |
| ASTRAZENECA  | GBP     | 15'600                           |           | 12'900       | 2'700                            | 307'056.88           | 0.05                                  |
| BARRATT DEVELOPMENTS   | GBP     | 143'800                          | 239'700   | 59'500       | 324'000                          | 1'955'662.65         | 0.30                                  |
| BHP GROUP LTD  | GBP     | 56'500                           |           | 14'000       | 42'500                           | 1'226'336.58         | 0.19                                  |
| BP   | GBP     | 115'700                          | 37'200    | 97'100       | 55'800                           | 279'067.39           | 0.04                                  |
| DIRECT LINE INSURANCE GROUP  | GBP     | 68'000                           |           | 68'000       |                                  |                      |                                       |
| FERGUSON   | GBP     | 3'050                            |           | 3'050        |                                  |                      |                                       |
| GLENORE  | GBP     | 175'000                          |           | 30'000       | 145'000                          | 734'431.35           | 0.11                                  |
| GSK PLC  | GBP     | 133'100                          | 18'600    | 120'200      | 31'500                           | 490'103.34           | 0.07                                  |
| HSBC HOLDINGS  | GBP     | 28'500                           | 326'200   | 39'700       | 315'000                          | 2'147'708.39         | 0.33                                  |
| IG GROUP HOLDINGS  | GBP     | 17'700                           | 78'200    | 12'200       | 83'700                           | 687'416.35           | 0.11                                  |
| J. SAINSBURY   | GBP     | 582'100                          |           | 143'600      | 438'500                          | 1'423'599.17         | 0.22                                  |
| KELLER GROUP   | GBP     | 38'700                           |           | 11'700       | 27'000                           | 254'915.15           | 0.04                                  |
| KINGFISHER   | GBP     | 1'189'800                        |           | 293'400      | 896'400                          | 2'339'877.71         | 0.36                                  |
| LEGAL & GENERAL GROUP  | GBP     | 57'100                           | 552'200   | 69'300       | 540'000                          | 1'454'754.39         | 0.22                                  |
| M&G PLC  | GBP     | 74'950                           | 487'300   | 67'250       | 495'000                          | 1'181'106.84         | 0.18                                  |
| NEXT   | GBP     | 49'600                           |           | 49'600       |                                  |                      |                                       |
| PERSIMMON  | GBP     | 67'300                           |           | 16'600       | 50'700                           | 755'543.39           | 0.12                                  |
| RENEWABLES INFRASTRUCTURE GROU   | GBP     | 530'000                          | 170'000   |              | 700'000                          | 854'652.38           | 0.13                                  |
| RIO TINTO  | GBP     | 51'700                           | 66'400    | 61'400       | 56'700                           | 3'553'806.82         | 0.54                                  |
| SHELL PLC  | GBP     | 24'000                           | 6'800     | 19'500       | 11'300                           | 311'755.54           | 0.05                                  |
| SSE  | GBP     |                                  | 80'000    | 8'000        | 72'000                           | 1'433'704.58         | 0.22                                  |
| TESCO PLC  | GBP     | 561'500                          |           | 266'300      | 295'200                          | 920'050.56           | 0.14                                  |
| UNILEVER   | GBP     | 31'400                           |           | 16'100       | 15'300                           | 623'769.64           | 0.10                                  |
| VESUVIUS   | GBP     | 74'700                           |           | 20'700       | 54'000                           | 278'784.47           | 0.04                                  |
| VODAFONE GROUP   | GBP     | 471'600                          |           | 116'400      | 355'200                          | 261'272.06           | 0.04                                  |
| WOODSIDE ENERGY GROUP LTD  | GBP     | 29'800                           |           | 29'800       |                                  |                      |                                       |
|  |         |                                  |           |              |                                  | <b>26'434'399.27</b> | <b>4.04</b>                           |
| <b>EURO</b>  |         |                                  |           |              |                                  |                      |                                       |
| ACTIVIDADES DE CONSTRUCCION Y SERVICIOS  | EUR     | 19'260                           | 3'200     | 5'560        | 16'900                           | 630'991.11           | 0.10                                  |
| ALLIANZ SE (reg. shares) ((restricted))  | EUR     | 10'480                           | 6'200     | 11'980       | 4'700                            | 1'057'222.30         | 0.16                                  |

Jahresbericht per 31. Dezember 2023

| Titelbezeichnung                             | Währung | 31.12.2022<br>Anzahl/<br>Nominal | Käufe (1) | Verkäufe (1) | 31.12.2023<br>Anzahl/<br>Nominal | Kurswert CHF         | in % des<br>Gesamtfonds-<br>vermögens |
|--|---------|----------------------------------|-----------|--------------|----------------------------------|----------------------|---------------------------------------|
| ASR NEDERLAND                                | EUR     | 42'060                           | 6'900     | 12'060       | 36'900                           | 1'464'863.21         | 0.22                                  |
| AXA  | EUR     | 38'000                           | 6'300     | 10'500       | 33'800                           | 926'689.63           | 0.14                                  |
| BASF (reg. shares)                           | EUR     | 48'000                           | 8'100     | 14'100       | 42'000                           | 1'904'732.17         | 0.29                                  |
| BILFINGER                                    | EUR     | 19'500                           |           | 19'500       |                                  |                      |                                       |
| BMW  | EUR     | 30'000                           | 5'000     | 11'000       | 24'000                           | 2'248'683.98         | 0.34                                  |
| BNP PARIBAS -A-                              | EUR     |                                  | 11'300    | 1'400        | 9'900                            | 576'080.24           | 0.09                                  |
| BOUYGUES                                     | EUR     | 14'000                           | 2'300     | 4'300        | 12'000                           | 380'656.37           | 0.06                                  |
| CIE GENERALE DES ETABLISSEMENTS MICHELIN SA  | EUR     |                                  | 28'600    | 1'200        | 27'400                           | 826'878.90           | 0.13                                  |
| COVIVIO FONCIERE DES REGIONS                 | EUR     | 8'500                            |           | 8'500        |                                  |                      |                                       |
| CREDIT AGRICOLE                              | EUR     | 35'000                           | 10'400    | 9'400        | 36'000                           | 430'146.16           | 0.07                                  |
| CRH PLC                                      | EUR     | 21'000                           |           | 21'000       |                                  |                      |                                       |
| DANONE                                       | EUR     | 5'000                            | 19'600    | 3'600        | 21'000                           | 1'145'650.72         | 0.18                                  |
| E.ON (reg. shares)                           | EUR     | 26'000                           | 4'400     | 12'900       | 17'500                           | 197'677.46           | 0.03                                  |
| EBRO FOODS                                   | EUR     | 69'000                           |           | 69'000       |                                  |                      |                                       |
| EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL (reg. shares)       | EUR     | 35'000                           | 5'900     | 9'400        | 31'500                           | 133'395.68           | 0.02                                  |
| ENDESA                                       | EUR     | 61'000                           | 10'200    | 16'600       | 54'600                           | 937'059.51           | 0.14                                  |
| ENEL   | EUR     | 275'000                          | 148'500   | 299'000      | 124'500                          | 778'981.68           | 0.12                                  |
| ENI  | EUR     | 33'000                           | 5'500     | 8'700        | 29'800                           | 425'217.26           | 0.06                                  |
| EVONIK INDUSTRIES (reg. shares)              | EUR     | 21'000                           | 3'500     | 6'000        | 18'500                           | 318'189.83           | 0.05                                  |
| GALP ENERGIA -B-                             | EUR     | 60'000                           |           | 60'000       |                                  |                      |                                       |
| HEIDELBERGCEMENT                             | EUR     | 4'250                            | 1'600     | 1'350        | 4'500                            | 338'624.63           | 0.05                                  |
| KESKO -B-                                    | EUR     | 25'000                           | 110'400   | 18'800       | 116'600                          | 1'943'124.13         | 0.30                                  |
| KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE                   | EUR     | 52'000                           | 20'000    | 53'000       | 19'000                           | 459'536.76           | 0.07                                  |
| MANDATUM HOLDING OY                          | EUR     |                                  | 3'900     |              | 3'900                            | 14'757.13            | 0.00                                  |
| MAFPRE (reg. shares)                         | EUR     | 140'000                          | 40'100    | 40'100       | 140'000                          | 252'896.99           | 0.04                                  |
| MERCEDES-BENZ GROUP AG                       | EUR     |                                  | 39'000    | 4'500        | 34'500                           | 2'006'269.36         | 0.31                                  |
| NATURGY ENERGY GROUP                         | EUR     | 29'000                           | 4'800     | 8'800        | 25'000                           | 627'547.50           | 0.10                                  |
| OESTERREICH POST                             | EUR     | 8'500                            | 1'400     | 2'500        | 7'400                            | 224'968.81           | 0.03                                  |
| ORANGE                                       | EUR     | 110'000                          | 54'500    | 39'500       | 125'000                          | 1'197'453.60         | 0.18                                  |
| ORION CORPORATION (new) -B-                  | EUR     |                                  | 29'500    |              | 29'500                           | 1'077'024.91         | 0.16                                  |
| POSTNL                                       | EUR     | 110'000                          | 31'900    | 33'400       | 108'500                          | 142'532.77           | 0.02                                  |
| PROXIMUS                                     | EUR     | 20'000                           | 70'800    | 5'800        | 85'000                           | 672'498.50           | 0.10                                  |
| RANDSTAD HOLDING                             | EUR     | 9'000                            | 1'500     | 2'600        | 7'900                            | 416'587.41           | 0.06                                  |
| RED ELECTRICA CORPORACION                    | EUR     | 55'000                           | 9'300     | 16'300       | 48'000                           | 665'367.70           | 0.10                                  |
| SAMPO -A-                                    | EUR     | 4'475                            | 700       | 5'175        |                                  |                      |                                       |
| SAMPO PLC -A-                                | EUR     |                                  | 3'900     |              | 3'900                            | 143'619.13           | 0.02                                  |
| SANOFI                                       | EUR     | 18'000                           | 6'200     | 8'200        | 16'000                           | 1'335'197.95         | 0.20                                  |
| SNAM   | EUR     | 240'000                          | 45'000    | 65'000       | 220'000                          | 952'105.77           | 0.15                                  |
| SOLVAY                                       | EUR     | 3'500                            |           | 3'500        |                                  |                      |                                       |
| STELLANTIS NV                                | EUR     |                                  | 90'000    | 4'000        | 86'000                           | 1'691'031.33         | 0.26                                  |
| TELEFONICA                                   | EUR     | 45'000                           | 24'300    | 12'300       | 57'000                           | 187'276.91           | 0.03                                  |
| TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDING (reg. shares) | EUR     | 200'000                          | 45'000    | 245'000      |                                  |                      |                                       |
| TERNA  | EUR     | 100'000                          |           | 100'000      |                                  |                      |                                       |
| TOTAL ENERGIES                               | EUR     | 35'000                           | 34'500    | 29'000       | 40'500                           | 2'319'415.56         | 0.35                                  |
| UPM-KYMMENE                                  | EUR     | 18'000                           | 4'200     | 5'200        | 17'000                           | 538'314.89           | 0.08                                  |
|  |         |                                  |           |              |                                  | <b>31'589'267.95</b> | <b>4.83</b>                           |
| <b>HONGKONG-DOLLAR</b>                       |         |                                  |           |              |                                  |                      |                                       |
| CHINA CONSTRUCTION BANK -H-                  | HKD     | 1'909'000                        |           | 1'909'000    |                                  |                      |                                       |
| CHINA MOLYBDENUM -H-                         | HKD     | 4'269'000                        |           | 3'669'000    | 600'000                          | 276'137.31           | 0.04                                  |
|  |         |                                  |           |              |                                  | <b>276'137.31</b>    | <b>0.04</b>                           |
| <b>KANADISCHER DOLLAR</b>                    |         |                                  |           |              |                                  |                      |                                       |
| ALGONQUIN POWER & UTILITIES                  | CAD     | 135'000                          | 132'500   | 67'500       | 200'000                          | 1'067'182.75         | 0.16                                  |
| ALTAGAS                                      | CAD     | 47'980                           |           | 23'980       | 24'000                           | 426'158.24           | 0.07                                  |
| BANK OF MONTREAL                             | CAD     | 8'250                            |           | 250          | 8'000                            | 669'465.70           | 0.10                                  |
| BANK OF NOVA SCOTIA                          | CAD     | 26'050                           | 5'950     |              | 32'000                           | 1'317'383.50         | 0.20                                  |
| BCE  | CAD     | 32'140                           | 15'000    | 17'140       | 30'000                           | 998'951.99           | 0.15                                  |
| CANADIAN IMPERIAL BANK OF COMMERCE           | CAD     | 18'760                           |           | 1'760        | 17'000                           | 692'264.60           | 0.11                                  |
| CANADIAN TIRE (nv) -A-                       | CAD     | 12'000                           |           | 6'000        | 6'000                            | 538'901.76           | 0.08                                  |
| CANADIAN UTILITIES (nv)                      | CAD     | 40'860                           |           | 860          | 40'000                           | 814'173.64           | 0.12                                  |
| EMERA  | CAD     | 29'160                           |           | 3'160        | 26'000                           | 834'725.84           | 0.13                                  |
| ENBRIDGE                                     | CAD     | 16'500                           | 33'500    |              | 50'000                           | 1'522'267.27         | 0.23                                  |
| FORTIS                                       | CAD     | 17'490                           |           | 490          | 17'000                           | 591'463.06           | 0.09                                  |
| GREAT WEST LIFECO                            | CAD     | 60'540                           | 28'000    | 58'540       | 30'000                           | 839'831.98           | 0.13                                  |
| HYDRO ONE                                    | CAD     | 20'700                           |           | 20'700       |                                  |                      |                                       |
| IGM FINANCIAL                                | CAD     | 26'730                           |           | 1'730        | 25'000                           | 558'643.36           | 0.09                                  |
| KEYERA                                       | CAD     | 30'520                           | 49'480    |              | 80'000                           | 1'635'495.87         | 0.25                                  |
| LUNDIN MINING                                | CAD     | 217'500                          |           | 147'500      | 70'000                           | 484'317.15           | 0.07                                  |
| MANULIFE FINANCIAL                           | CAD     | 46'980                           | 93'020    |              | 140'000                          | 2'616'384.90         | 0.40                                  |
| PEMBINA PIPELINE                             | CAD     |                                  | 55'000    |              | 55'000                           | 1'601'476.23         | 0.24                                  |
| POWER CORP OF CANADA                         | CAD     | 34'200                           |           | 200          | 34'000                           | 822'254.10           | 0.13                                  |

| Titelbezeichnung                                       | Wahrung | 31.12.2022<br>Anzahl/<br>Nominal | Kufe (1) | Verkufe (1) | 31.12.2023<br>Anzahl/<br>Nominal | Kurswert CHF          | in % des<br>Gesamtfonds-<br>vermogens |
|--|----------|----------------------------------|-----------|--------------|----------------------------------|-----------------------|--|
| QUEBECOR (v) -B-                                       | CAD      | 54'000                           | 25'000    | 29'000       | 50'000                           | 1'005'909.10          | 0.15                                   |
| RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL                        | CAD      | 20'020                           |           | 20'020       |                                  |                       |  |
| ROGERS COMMUNICATIONS (nv) -B-                         | CAD      | 28'740                           |           | 28'740       |                                  |                       |  |
| ROYAL BANK OF CANADA                                   | CAD      | 13'500                           | 15'000    | 13'500       | 15'000                           | 1'282'917.07          | 0.20                                   |
| SHAW COMMUNICATIONS (nv) -B-                           | CAD      | 36'000                           |           | 36'000       |                                  |                       |  |
| SUN LIFE FINANCIAL                                     | CAD      | 25'080                           | 6'920     |              | 32'000                           | 1'403'575.10          | 0.21                                   |
| TELUS NON-CANADIAN                                     | CAD      | 65'130                           |           | 22'130       | 43'000                           | 647'164.64            | 0.10                                   |
| TORONTO DOMINION BANK                                  | CAD      | 15'840                           | 4'660     |              | 20'500                           | 1'120'292.97          | 0.17                                   |
|  |          |                                  |           |              |                                  | <b>23'491'200.82</b>  | <b>3.59</b>                            |
| <b>MEXIKANISCHER PESO</b>                              |          |                                  |           |              |                                  |                       |  |
| GRUPO FINANCIERO BANORTE                               | MXN      |                                  | 75'000    |              | 75'000                           | 636'492.16            | 0.10                                   |
| KIMBERLY CLARK DE MEXICO -A-                           | MXN      | 1'166'200                        |           | 1'166'200    |                                  |                       |  |
|  |          |                                  |           |              |                                  | <b>636'492.16</b>     | <b>0.10</b>                            |
| <b>NORWEGISCHE KRONE</b>                               |          |                                  |           |              |                                  |                       |  |
| AKER BP ASA  | NOK      | 10'000                           | 1'600     | 2'800        | 8'800                            | 215'500.46            | 0.03                                   |
| SPAREBANK 1 OESTLANDET                                 | NOK      | 31'600                           | 5'300     | 8'600        | 28'300                           | 310'983.97            | 0.05                                   |
|  |          |                                  |           |              |                                  | <b>526'484.43</b>     | <b>0.08</b>                            |
| <b>SCHWEDISCHE KRONE</b>                               |          |                                  |           |              |                                  |                       |  |
| ELECTROLUX AB -B-                                      | SEK      | 37'000                           |           | 37'000       |                                  |                       |  |
| HENNES & MAURITZ STOCKHOLM -B-                         | SEK      | 49'000                           |           | 49'000       |                                  |                       |  |
|  |          |                                  |           |              |                                  | <b>0.00</b>           | <b>0.00</b>                            |
| <b>SCHWEIZER FRANKEN</b>                               |          |                                  |           |              |                                  |                       |  |
| ABB (reg. shares)                                      | CHF      | 205'200                          | 8'000     | 38'200       | 175'000                          | 6'527'500.00          | 1.00                                   |
| ADECCO (reg. shares)                                   | CHF      | 38'900                           |           | 16'100       | 22'800                           | 940'956.00            | 0.14                                   |
| ALCON INC  | CHF      | 52'060                           |           | 6'560        | 45'500                           | 2'986'620.00          | 0.46                                   |
| APG SGA (reg. shares)                                  | CHF      | 235                              |           |              | 235                              | 43'005.00             | 0.01                                   |
| BANQUE CANTONALE VAUDOISE                              | CHF      | 8'720                            |           | 4'920        | 3'800                            | 412'300.00            | 0.06                                   |
| CEMBRA MONEY (reg. shares)                             | CHF      | 23'980                           |           | 2'980        | 21'000                           | 1'377'600.00          | 0.21                                   |
| CIE FINANCIERE RICHEMONT (reg. shares)                 | CHF      | 37'780                           | 5'500     | 10'280       | 33'000                           | 3'819'750.00          | 0.58                                   |
| CLARIANT (reg. shares)                                 | CHF      | 227'650                          |           | 227'650      |                                  |                       |  |
| CS GROUP (reg. shares)                                 | CHF      | 812'736                          |           | 812'736      |                                  |                       |  |
| EFG INTERNATIONAL                                      | CHF      | 99'230                           |           | 12'230       | 87'000                           | 939'600.00            | 0.14                                   |
| GALENICA AG  | CHF      | 35'520                           |           | 35'520       |                                  |                       |  |
| GEBERIT  | CHF      | 4'180                            |           | 1'680        | 2'500                            | 1'347'500.00          | 0.21                                   |
| HELVETIA HOLDING LTD                                   | CHF      |                                  | 2'800     | 400          | 2'400                            | 278'160.00            | 0.04                                   |
| JULIUS BAER GRUPPE                                     | CHF      | 26'320                           |           | 3'320        | 23'000                           | 1'084'450.00          | 0.17                                   |
| KUEHNE & NAGEL INTERNATIONAL                           | CHF      | 4'910                            |           | 710          | 4'200                            | 1'217'160.00          | 0.19                                   |
| LAFARGEHOLCIM (reg. shares)                            | CHF      | 144'920                          | 53'000    | 30'420       | 167'500                          | 11'058'350.00         | 1.69                                   |
| LANDIS+GYR GROUP AG                                    | CHF      | 16'530                           |           | 2'030        | 14'500                           | 1'102'000.00          | 0.17                                   |
| LONZA GROUP (reg. shares)                              | CHF      | 8'100                            | 1'700     | 1'300        | 8'500                            | 3'006'450.00          | 0.46                                   |
| MOBILEZONE HOLDING (reg. shares)                       | CHF      | 55'100                           |           | 6'900        | 48'200                           | 661'304.00            | 0.10                                   |
| NESTLE (reg. shares)                                   | CHF      | 320'000                          | 134'700   | 193'700      | 261'000                          | 25'450'110.00         | 3.89                                   |
| NOVARTIS (reg. shares)                                 | CHF      | 255'000                          | 134'600   | 189'600      | 200'000                          | 16'974'000.00         | 2.59                                   |
| PARTNERS GROUP   | CHF      | 1'060                            |           | 140          | 920                              | 1'115'960.00          | 0.17                                   |
| ROCHE HOLDINGS (cert. shares)                          | CHF      | 80'000                           | 66'000    | 77'000       | 69'000                           | 16'870'500.00         | 2.58                                   |
| SANDOZ GROUP LTD                                       | CHF      |                                  | 40'000    |              | 40'000                           | 1'082'400.00          | 0.17                                   |
| SGS LTD  | CHF      |                                  | 21'750    | 1'250        | 20'500                           | 1'487'070.00          | 0.23                                   |
| SIKA LTD   | CHF      | 5'640                            |           | 740          | 4'900                            | 1'341'130.00          | 0.20                                   |
| SOCIETE GENERALE DE SURVEILLANCE HOLDING (reg. shares) | CHF      | 970                              |           | 970          |                                  |                       |  |
| SONOVA HOLDING (reg. shares)                           | CHF      | 6'960                            | 4'600     | 6'960        | 4'600                            | 1'262'240.00          | 0.19                                   |
| STRAUMANN HOLDING LTD                                  | CHF      | 12'890                           |           | 1'590        | 11'300                           | 1'532'280.00          | 0.23                                   |
| SWISS LIFE HOLDING (reg. shares)                       | CHF      | 3'970                            |           | 470          | 3'500                            | 2'044'000.00          | 0.31                                   |
| SWISS REINSURANCE                                      | CHF      | 41'350                           | 38'650    | 46'000       | 34'000                           | 3'215'040.00          | 0.49                                   |
| SWISSCOM (reg. shares)                                 | CHF      | 3'455                            |           | 455          | 3'000                            | 1'518'000.00          | 0.23                                   |
| THE SWATCH GROUP (reg. shares)                         | CHF      | 52'770                           |           | 10'670       | 42'100                           | 1'854'505.00          | 0.28                                   |
| UBS GROUP  | CHF      | 377'460                          | 16'903    | 89'363       | 305'000                          | 7'960'500.00          | 1.22                                   |
| VAT GROUP  | CHF      | 3'260                            |           | 360          | 2'900                            | 1'222'350.00          | 0.19                                   |
| ZURICH INSURANCE GROUP (reg. shares)                   | CHF      | 16'390                           |           | 2'790        | 13'600                           | 5'978'560.00          | 0.91                                   |
|  |          |                                  |           |              |                                  | <b>127'711'350.00</b> | <b>19.51</b>                           |
| <b>US DOLLAR</b>                                       |          |                                  |           |              |                                  |                       |  |
| 3M   | USD      | 28'030                           | 24'400    | 10'430       | 42'000                           | 3'864'266.30          | 0.59                                   |
| ABBVIE   | USD      | 21'930                           | 7'300     | 8'430        | 20'800                           | 2'712'870.74          | 0.41                                   |
| ADVANCED MICRO DEVICES                                 | USD      | 5'000                            | 1'000     | 1'850        | 4'150                            | 514'864.77            | 0.08                                   |
| ALPHABET -A-   | USD      | 3'000                            | 2'950     | 4'900        | 1'050                            | 123'444.79            | 0.02                                   |
| ALPHABET -C-   | USD      | 3'000                            | 2'950     | 4'900        | 1'050                            | 124'540.58            | 0.02                                   |
| AMAZON.COM   | USD      | 2'800                            | 550       | 1'000        | 2'350                            | 300'509.44            | 0.05                                   |
| AMGEN  | USD      | 500                              | 100       | 200          | 400                              | 96'961.82             | 0.01                                   |
| APPLE  | USD      | 3'600                            | 2'350     | 4'800        | 1'150                            | 186'343.56            | 0.03                                   |
| ASE TECHNOLOGY HOLDING CO LTD ADR                      | USD      | 121'000                          | 119'000   |              | 240'000                          | 1'900'723.74          | 0.29                                   |

Jahresbericht per 31. Dezember 2023

| Titelbezeichnung   | Währung | 31.12.2022<br>Anzahl/<br>Nominal | Käufe (1) | Verkäufe (1) | 31.12.2023<br>Anzahl/<br>Nominal | Kurswert CHF          | in % des<br>Gesamtfonds-<br>vermögens |
|--|---------|----------------------------------|-----------|--------------|----------------------------------|-----------------------|---------------------------------------|
| AT&T   | USD     | 120'000                          | 11'000    | 83'000       | 48'000                           | 677'877.67            | 0.10                                  |
| BANCO DE CHILE ADR   | USD     |                                  | 25'000    |              | 25'000                           | 485'617.07            | 0.07                                  |
| BANCO DO BRASIL ADR  | USD     | 107'458                          | 92'542    |              | 200'000                          | 1'923'110.94          | 0.29                                  |
| BEST BUY   | USD     | 14'870                           | 4'500     | 8'170        | 11'200                           | 737'882.10            | 0.11                                  |
| BRISTOL MYERS SQUIBB   | USD     |                                  | 24'000    | 1'000        | 23'000                           | 993'225.78            | 0.15                                  |
| BROADCOM INC   | USD     | 300                              |           | 300          |                                  |                       |                                       |
| C.H. ROBINSON WORLDWIDE  | USD     | 3'960                            |           | 3'960        |                                  |                       |                                       |
| CAMPBELL SOUP  | USD     | 18'660                           | 6'200     | 7'860        | 17'000                           | 618'517.93            | 0.09                                  |
| CITIZENS FINANCIAL GROUP   | USD     | 22'000                           |           | 22'000       |                                  |                       |                                       |
| COCA-COLA  | USD     | 17'700                           | 21'000    | 10'700       | 28'000                           | 1'388'713.34          | 0.21                                  |
| CONAGRA BRANDS   | USD     | 45'000                           | 13'000    | 18'000       | 40'000                           | 964'837.80            | 0.15                                  |
| CSX  | USD     | 5'550                            |           | 5'550        |                                  |                       |                                       |
| CUMMINS  | USD     | 5'000                            |           | 5'000        |                                  |                       |                                       |
| DEVON ENERGY   | USD     |                                  | 41'300    | 9'800        | 31'500                           | 1'200'955.43          | 0.18                                  |
| DOW INC  | USD     | 20'000                           | 3'800     | 23'800       |                                  |                       |                                       |
| DUKE ENERGY  | USD     | 12'710                           | 3'900     | 4'610        | 12'000                           | 980'054.37            | 0.15                                  |
| EDISON INTERNATIONAL   | USD     | 21'560                           | 6'000     | 8'060        | 19'500                           | 1'173'270.21          | 0.18                                  |
| FRANKLIN RESOURCES   | USD     | 8'030                            | 1'900     | 2'930        | 7'000                            | 175'503.86            | 0.03                                  |
| GERDAU ADR   | USD     | 323'700                          | 13'750    | 192'450      | 145'000                          | 591'872.11            | 0.09                                  |
| GILEAD SCIENCES  | USD     | 4'200                            | 1'300     | 1'500        | 4'000                            | 272'719.86            | 0.04                                  |
| HASBRO   | USD     | 6'100                            | 3'200     | 2'100        | 7'200                            | 309'407.93            | 0.05                                  |
| HUNTINGTON BANCSHARES  | USD     | 47'700                           | 21'000    | 11'700       | 57'000                           | 610'211.10            | 0.09                                  |
| IBM  | USD     | 22'220                           | 15'000    | 13'220       | 24'000                           | 3'303'542.70          | 0.50                                  |
| INTERNATIONAL PAPER  | USD     |                                  | 28'200    |              | 28'200                           | 857'976.80            | 0.13                                  |
| KBF FINANCIAL GROUP ADR  | USD     |                                  | 35'000    |              | 35'000                           | 1'218'629.53          | 0.19                                  |
| KELLOGG  | USD     | 33'040                           | 7'800     | 12'840       | 28'000                           | 1'317'545.61          | 0.20                                  |
| KEYCORP  | USD     | 28'140                           | 7'000     | 11'140       | 24'000                           | 290'865.27            | 0.04                                  |
| KIMBERLY-CLARK   | USD     | 13'380                           | 4'000     | 4'880        | 12'500                           | 1'278'321.72          | 0.20                                  |
| KINDER MORGAN  | USD     | 30'120                           | 135'900   | 35'020       | 131'000                          | 1'944'858.51          | 0.30                                  |
| KLA-TENCOR   | USD     | 1'000                            | 120       | 400          | 720                              | 352'249.96            | 0.05                                  |
| LAM RESEARCH   | USD     | 800                              | 160       | 260          | 700                              | 461'447.31            | 0.07                                  |
| LEGGETT & PLATT  | USD     | 18'300                           | 6'300     | 6'600        | 18'000                           | 396'455.42            | 0.06                                  |
| LINCOLN NATIONAL   | USD     |                                  | 38'500    | 12'000       | 26'500                           | 601'512.91            | 0.09                                  |
| LYONDELLBASELL INDUSTRIES -A-                                    | USD     | 5'230                            | 1'500     | 1'930        | 4'800                            | 384'103.75            | 0.06                                  |
| MEDTRONIC  | USD     | 2'500                            | 500       | 900          | 2'100                            | 145'599.28            | 0.02                                  |
| MERCK & CO   | USD     | 52'500                           | 19'800    | 54'300       | 18'000                           | 1'651'569.36          | 0.25                                  |
| MICRON TECHNOLOGY  | USD     | 6'800                            | 1'700     | 3'500        | 5'000                            | 359'120.98            | 0.05                                  |
| MICROSOFT  | USD     | 4'210                            | 500       | 2'510        | 2'200                            | 696'265.47            | 0.11                                  |
| MODERNA INC  | USD     | 450                              | 80        | 180          | 350                              | 29'294.83             | 0.00                                  |
| NEW YORK COMMUNITY BANCORP                                       | USD     | 60'000                           |           | 60'000       |                                  |                       |                                       |
| NEWELL BRANDS  | USD     | 70'000                           |           | 70'000       |                                  |                       |                                       |
| NVIDIA   | USD     | 2'300                            | 1'200     | 2'600        | 900                              | 375'110.15            | 0.06                                  |
| ONEOK (new)  | USD     |                                  | 33'800    | 8'100        | 25'700                           | 1'518'840.20          | 0.23                                  |
| PAYPAL HOLDINGS  | USD     | 840                              | 160       | 300          | 700                              | 36'178.89             | 0.01                                  |
| PEPSICO  | USD     | 1'900                            | 2'700     | 1'300        | 3'300                            | 471'706.71            | 0.07                                  |
| PIONEER NATURAL RESOURCES  | USD     |                                  | 10'400    | 2'400        | 8'000                            | 1'514'115.32          | 0.23                                  |
| PROCTER & GAMBLE   | USD     | 8'300                            | 9'300     | 6'100        | 11'500                           | 1'418'313.25          | 0.22                                  |
| PRUDENTIAL FINANCIAL   | USD     | 7'090                            | 2'100     | 3'190        | 6'000                            | 523'708.98            | 0.08                                  |
| REGIONS FINANCIAL  | USD     | 29'760                           | 9'100     | 12'860       | 26'000                           | 424'077.52            | 0.06                                  |
| RENAISSANCE HOLDINGS L.S. -F- 5.75%/PREFERRED STOCK              | USD     | 35'000                           |           |              | 35'000                           | 703'723.94            | 0.11                                  |
| SANLAM LTD ADR   | USD     | 37'900                           |           |              | 37'900                           | 252'335.15            | 0.04                                  |
| SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS PL                                   | USD     | 7'680                            | 1'800     | 2'680        | 6'800                            | 488'576.22            | 0.07                                  |
| SNAP-ON  | USD     | 3'530                            |           | 3'530        |                                  |                       |                                       |
| TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFACTURING ADR                           | USD     |                                  | 6'200     |              | 6'200                            | 542'679.18            | 0.08                                  |
| TESLA MOTORS   | USD     | 1'500                            | 500       | 500          | 1'500                            | 313'690.11            | 0.05                                  |
| THE WENDY'S  | USD     |                                  | 30'500    |              | 30'500                           | 500'042.51            | 0.08                                  |
| TRUIST FINANCIAL CORP  | USD     | 37'980                           | 7'300     | 13'580       | 31'700                           | 985'006.48            | 0.15                                  |
| UNITED MICROELECTRONICS ADR                                      | USD     |                                  | 200'000   |              | 200'000                          | 1'424'027.88          | 0.22                                  |
| UNITED PARCEL SERVICE -B-  | USD     | 7'000                            | 29'900    | 7'900        | 29'000                           | 3'837'527.90          | 0.59                                  |
| VERIZON COMMUNICATIONS   | USD     | 15'470                           | 2'850     | 5'970        | 12'350                           | 391'855.95            | 0.06                                  |
| WALGREENS BOOTS ALLIANCE   | USD     |                                  | 25'000    |              | 25'000                           | 549'370.09            | 0.08                                  |
| WESTERN UNION  | USD     | 16'340                           | 15'100    | 5'940        | 25'500                           | 255'820.04            | 0.04                                  |
| WHIRLPOOL  | USD     | 4'400                            | 1'700     | 1'600        | 4'500                            | 461'180.52            | 0.07                                  |
| WK KELLOGG CO  | USD     |                                  | 6'575     |              | 6'575                            | 72'712.53             | 0.01                                  |
|  |         |                                  |           |              |                                  | <b>55'278'262.17</b>  | <b>8.44</b>                           |
| <b>Total Aktien (und aktienähnliche Wertpapiere)</b>             |         |                                  |           |              |                                  | <b>289'932'663.49</b> | <b>44.29</b>                          |
| <b>Anleihen</b>  |         |                                  |           |              |                                  |                       |                                       |
| <b>US DOLLAR</b>   |         |                                  |           |              |                                  |                       |                                       |
| - AT&T INC 0%/18-01.08.2067                                      | USD     | 45'000                           |           |              | 45'000                           | 939'252.43            | 0.14                                  |
| 4.875 BROOKFIELD BRP HOLDINGS (subordinated) 4.875%/21-PERPETUAL | USD     | 50'000                           |           |              | 50'000                           | 681'715.48            | 0.10                                  |



| Titelbezeichnung   | Währung | 31.12.2022<br>Anzahl/<br>Nominal | Käufe (1) | Verkäufe (1) | 31.12.2023<br>Anzahl/<br>Nominal | Kurswert CHF          | in % des<br>Gesamtfonds-<br>vermögens |
|--|---------|----------------------------------|-----------|--------------|----------------------------------|-----------------------|---------------------------------------|
| 6.625 BRUNSWICK CORP 6.625%/18-15.01.2049  | USD     | 35'000                           |           |              | 35'000                           | 723'460.03            | 0.11                                  |
| 5.750 SEMBRA ENERGY (subordinated) 5.75%/19-01.07.2079   | USD     | 50'000                           |           |              | 50'000                           | 1'051'188.43          | 0.16                                  |
|  |         |                                  |           |              |                                  | <b>3'395'616.37</b>   | <b>0.52</b>                           |
| <b>Total Anleihen</b>  |         |                                  |           |              |                                  | <b>3'395'616.37</b>   | <b>0.52</b>                           |
| <b>Kollektive Kapitalanlagen</b>   |         |                                  |           |              |                                  |                       |                                       |
| <b>ENGLISCHES PFUND</b>  |         |                                  |           |              |                                  |                       |                                       |
| BLUEFIELD SOLAR INCOME FUND LT   | GBP     | 520'000                          | 130'000   |              | 650'000                          | 827'079.49            | 0.13                                  |
| FORESIGHT SOLAR FUND LTD   | GBP     | 610'000                          | 190'000   |              | 800'000                          | 877'182.76            | 0.13                                  |
| GREENCOAT UK WIND PLC/FUNDS  | GBP     | 465'000                          | 85'000    | 50'000       | 500'000                          | 812'702.96            | 0.12                                  |
| JLEN ENVIRONMENTAL ASSETS GROU   | GBP     | 585'000                          | 115'000   |              | 700'000                          | 763'028.84            | 0.12                                  |
| NEXTENERGY SOLAR FUND LTD  | GBP     | 625'000                          | 175'000   |              | 800'000                          | 793'069.34            | 0.12                                  |
|  |         |                                  |           |              |                                  | <b>4'073'063.39</b>   | <b>0.62</b>                           |
| <b>EURO</b>  |         |                                  |           |              |                                  |                       |                                       |
| AMUNDI INDEX EURO AGG SRI UCIT -EUR D- EUR   | EUR     |                                  | 40'000    | 20'000       | 20'000                           | 838'291.90            | 0.13                                  |
| ISHARES EUR CORP BOND ESG UCIT -EUR DIST- EUR  | EUR     | 150'000                          |           | 150'000      |                                  |                       |                                       |
| ISHARES EUR HIGH YIELD CORP BO -EUR DIST- EUR  | EUR     | 700'000                          |           | 525'000      | 175'000                          | 736'564.12            | 0.11                                  |
| UBS ETF SICAV - UBS ETF - MSCI EMU SOCIALLY RESPONSIBLE UCITS ETF - A- EUR   | EUR     | 75'000                           | 9'800     | 32'500       | 52'300                           | 5'325'224.91          | 0.81                                  |
|  |         |                                  |           |              |                                  | <b>6'900'080.93</b>   | <b>1.05</b>                           |
| <b>SCHWEIZER FRANKEN</b>   |         |                                  |           |              |                                  |                       |                                       |
| CREDIT SUISSE REAL ESTATE FUND GREEN PROPERTY  | CHF     | 5'000                            |           |              | 5'000                            | 605'000.00            | 0.09                                  |
| CREDIT SUISSE REAL ESTATE FUND HOSPITALITY   | CHF     | 9'000                            |           |              | 9'000                            | 640'800.00            | 0.10                                  |
| CREDIT SUISSE REAL ESTATE FUND INTERSWISS  | CHF     | 5'000                            |           |              | 5'000                            | 815'000.00            | 0.12                                  |
| CREDIT SUISSE REAL ESTATE FUND LIVINGPLUS  | CHF     | 6'000                            |           |              | 6'000                            | 861'000.00            | 0.13                                  |
| CREDIT SUISSE REAL ESTATE FUND LOGISTICS PLUS  | CHF     | 6'857                            |           |              | 6'857                            | 648'672.20            | 0.10                                  |
| CREDIT SUISSE REAL ESTATE SIAT   | CHF     | 7'000                            |           | 500          | 6'500                            | 1'378'000.00          | 0.21                                  |
| SCHRODER IMMOPLUS  | CHF     | 5'000                            |           |              | 5'000                            | 755'000.00            | 0.12                                  |
| UBS ETF CH - MSCI SWITZERLAND -CHF A-DIS- CHF  | CHF     | 233'100                          | 100'000   | 78'100       | 255'000                          | 4'183'530.00          | 0.64                                  |
| UBS PROPERTY FUND - SWISS MIXED SIMA   | CHF     | 25'000                           |           | 5'000        | 20'000                           | 2'690'000.00          | 0.41                                  |
| UBS PROPERTY SWISS COMMERCIAL SWISSREAL  | CHF     | 10'769                           |           |              | 10'769                           | 665'524.20            | 0.10                                  |
| UBS PROPERTY SWISS RESIDENTIAL ANFOS   | CHF     | 10'700                           |           |              | 10'700                           | 873'120.00            | 0.13                                  |
|  |         |                                  |           |              |                                  | <b>14'115'646.40</b>  | <b>2.16</b>                           |
| <b>US DOLLAR</b>   |         |                                  |           |              |                                  |                       |                                       |
| ABERDEEN ASIA-PACIFIC INCOME F   | USD     | 245'000                          | 105'000   | 350'000      |                                  |                       |                                       |
| CREDIT SUISSE INDEX FUND (IE) ETF ICAV - CSIF (IE) MSCI WORLD ESG LEADERS BLUE UCITS ETF -B- USD   | USD     |                                  | 7'000     | 7'000        |                                  |                       |                                       |
| CSIF IE FTSE EPRA NAREIT DEVEL -B USD- EUR   | USD     | 35'500                           |           | 10'500       | 25'000                           | 2'395'682.84          | 0.37                                  |
| CSIF IE MSCI USA SMALL CAP ESG -B USD- EUR   | USD     |                                  | 28'000    | 28'000       |                                  |                       |                                       |
| EATON VANCE LTD DURATION INCOM   | USD     | 85'000                           |           | 85'000       |                                  |                       |                                       |
| INVESCO PREFERRED SHARES UCITS ETF -A- USD   | USD     | 440'000                          |           | 190'000      | 250'000                          | 3'247'616.78          | 0.50                                  |
| INVESCO US HIGH YIELD FALLEN ANGELS  | USD     | 110'000                          | 30'000    | 140'000      |                                  |                       |                                       |
| ISHARES CHINA CNY BOND UCITS E -USD DIST- USD  | USD     | 650'000                          |           | 650'000      |                                  |                       |                                       |
| ISHARES EM DIVIDEND UCITS ETF -USD DIST- USD   | USD     | 262'900                          | 375'000   | 12'900       | 625'000                          | 7'807'272.84          | 1.19                                  |
| ISHARES II PLC - ISHARES JP MORGAN USD EMERGING MARKETS BOND UCITS ETF   | USD     | 105'000                          |           | 65'000       | 40'000                           | 2'942'395.09          | 0.45                                  |
| ISHARES MSCI EM SRI UCITS ETF -USD DIST- USD   | USD     |                                  | 385'000   | 385'000      |                                  |                       |                                       |
| ISHARES MSCI EMERGING MARKETS LOCAL GOVERNMENT BOND UCITS  | USD     | 45'000                           |           | 5'000        | 40'000                           | 1'562'889.12          | 0.24                                  |
| ISHARES MSCI USA SRI UCITS ETF -USD DIST- USD  | USD     | 1'000'000                        | 444'500   | 669'500      | 775'000                          | 6'266'444.37          | 0.96                                  |
| ISHARES USD HIGH YIELD CORP BO -USD DIST- USD  | USD     | 2'450'000                        | 250'000   | 350'000      | 2'350'000                        | 8'989'176.01          | 1.37                                  |
| L&G ESG EMERGING MARKETS CORPO -USD DISTRIBUTING- USD  | USD     | 1'050'000                        |           | 200'000      | 850'000                          | 6'205'925.29          | 0.95                                  |
| NUVEEN CREDIT STRATEGIES INCOM   | USD     | 150'000                          |           | 150'000      |                                  |                       |                                       |
| PGIM GLOBAL HIGH YIELD FUND IN   | USD     | 70'000                           |           | 70'000       |                                  |                       |                                       |
| PIMCO FIXED INCOME SOURCE ETF - EMERGING MARKETS ADVANTAGE LOCAL USD BOND INDEX SOURCE ETF   | USD     | 35'000                           | 30'000    | 5'000        | 60'000                           | 3'373'481.65          | 0.52                                  |
| SOURCE MORNINGSTAR US ENERGY INFRASTRUCTURE MLP UCITS ETF - B- USD   | USD     | 250'000                          | 80'000    | 20'000       | 310'000                          | 11'886'761.35         | 1.82                                  |
| UBS ETF SICAV - UBS ETF - MSCI EMERGING MARKETS SOCIALLY RESPONSIBLE UCITS ETF -A- USD   | USD     | 872'000                          | 100'000   | 397'000      | 575'000                          | 6'149'831.05          | 0.94                                  |
| VIRTUS ALLIANZGI CONVERTIBLE &   | USD     | 160'000                          |           | 160'000      |                                  |                       |                                       |
|  |         |                                  |           |              |                                  | <b>60'827'476.39</b>  | <b>9.29</b>                           |
| <b>Total Kollektive Kapitalanlagen</b>   |         |                                  |           |              |                                  | <b>85'916'267.11</b>  | <b>13.12</b>                          |
| <b>Total Börsennotierte / an einem geregelten Markt gehandelte Wertpapiere; bewertet zu den Kursen, die am Hauptmarkt bezahlt werden</b> |         |                                  |           |              |                                  | <b>379'244'546.97</b> | <b>57.93</b>                          |
| <b>Wertpapiere bewertet aufgrund von am Markt beobachtbaren Parametern</b>   |         |                                  |           |              |                                  |                       |                                       |
| <b>Aktien (und aktienähnliche Wertpapiere)</b>   |         |                                  |           |              |                                  |                       |                                       |
| <b>EURO</b>  |         |                                  |           |              |                                  |                       |                                       |
| ACS ACTIVIDADES DE CONSTRUCCIO (rights) 03.02.2023   | EUR     |                                  | 19'260    | 19'260       |                                  |                       |                                       |

Jahresbericht per 31. Dezember 2023

| Titelbezeichnung                                     | Währung   | 31.12.2022<br>Anzahl/<br>Nominal | Käufe (1) | Verkäufe (1) | 31.12.2023<br>Anzahl/<br>Nominal | Kurswert CHF         | in % des<br>Gesamtfonds-<br>vermögens |
|--|---|----------------------------------|-----------|--------------|----------------------------------|----------------------|---------------------------------------|
| ACS ACTIVIDADES DE CONSTRUCCIO (rights) 17.07.2023   | EUR   |                                  | 16'000    | 16'000       |                                  | 0.00                 | 0.00                                  |
| <b>Total Aktien (und aktienähnliche Wertpapiere)</b> |   |                                  |           |              |                                  | <b>0.00</b>          | <b>0.00</b>                           |
| <b>Anleihen</b>                                      |   |                                  |           |              |                                  |                      |                                       |
| <b>AUSTRALISCHER DOLLAR</b>                          |   |                                  |           |              |                                  |                      |                                       |
| 4.600  | AT&T INC 4.6%/18-19.09.2028   | AUD                              | 2'500'000 |              | 2'500'000                        | 1'413'041.78         | 0.22                                  |
| 4.760  | ATHENE GLOBAL FUNDING 4.76%/22-21.04.2027   | AUD                              | 1'500'000 |              | 1'500'000                        | 808'053.39           | 0.12                                  |
| 6.134  | AUSNET SERVICES HOLDINGS 6.134%/23-31.05.2033   | AUD                              |           | 1'000'000    | 1'000'000                        | 592'431.79           | 0.09                                  |
| 4.750  | AUSTRALIA S. 136 4.75%/11-21.04.2027  | AUD                              | 2'000'000 |              | 2'000'000                        | 1'189'159.18         | 0.18                                  |
| 4.500  | AUSTRALIA S. 140 4.5%/13-21.04.2033   | AUD                              | 300'000   |              | 300'000                          | 179'710.80           | 0.03                                  |
| 3.147  | COMPUTERSHARE US INC 3.147%/21-30.11.2027   | AUD                              | 800'000   | 800'000      |                                  |                      |                                       |
| 4.100  | FBG FINANCE PTY LTD 4.1%/17-06.09.2027  | AUD                              | 1'000'000 | 1'000'000    |                                  |                      |                                       |
| 3.700  | LENDLEASE FINANCE LTD 3.7%/21-31.03.2031  | AUD                              | 1'200'000 | 200'000      | 1'000'000                        | 466'279.95           | 0.07                                  |
| -  | NATIONAL AUSTRALIA BANK (subordinated) FIX-TO-FRN FRN/22-03.08.2032                     | AUD                              | 1'000'000 |              | 1'000'000                        | 591'047.77           | 0.09                                  |
| 4.000  | NEW SOUTH WALES TREASURY 4%/13-20.04.2023   | AUD                              | 1'500'000 | 1'500'000    |                                  |                      |                                       |
| 5.400  | PACIFIC NATIONAL FINANCE 5.4%/17-12.05.2027   | AUD                              | 2'600'000 |              | 2'600'000                        | 1'449'137.50         | 0.22                                  |
| 5.250  | QANTAS AIRWAYS LTD 5.25%/20-09.09.2030  | AUD                              | 400'000   |              | 400'000                          | 222'967.20           | 0.03                                  |
| 5.000  | SOIETE GENERALE (subordinated) 5%/17-19.05.2027   | AUD                              | 1'000'000 |              | 1'000'000                        | 553'386.57           | 0.08                                  |
| 4.000  | TELSTRA CORP LTD 4%/17-19.04.2027   | AUD                              | 2'200'000 | 1'200'000    | 1'000'000                        | 566'233.18           | 0.09                                  |
| 5.500  | TREASURY CORP OF VICTORIA 5.5%/11-17.11.2026  | AUD                              | 2'500'000 |              | 2'500'000                        | 1'495'264.15         | 0.23                                  |
| 4.500  | VERIZON COMMUNICATIONS 4.5%/17-17.08.2027   | AUD                              | 1'000'000 |              | 1'000'000                        | 569'615.69           | 0.09                                  |
| 4.200  | VODAFONE GROUP PLC 4.2%/17-13.12.2027   | AUD                              | 1'500'000 |              | 1'500'000                        | 837'953.21           | 0.13                                  |
| 5.300  | WESTPAC BANKING CORP 5.3%/22-11.11.2027   | AUD                              |           | 500'000      | 500'000                          | 294'539.00           | 0.04                                  |
| 2.800  | WOOLWORTHS GROUP LTD 2.8%/20-20.05.2030   | AUD                              | 500'000   |              | 500'000                          | 250'730.14           | 0.04                                  |
|  |   |                                  |           |              |                                  | <b>11'479'551.30</b> | <b>1.75</b>                           |
| <b>DAENISCHE KRONE</b>                               |   |                                  |           |              |                                  |                      |                                       |
| 7.000  | KINGDOM OF DENMARK 7%/94-10.11.2024   | DKK                              |           | 7'500'000    | 7'500'000                        | 967'919.15           | 0.15                                  |
|  |   |                                  |           |              |                                  | <b>967'919.15</b>    | <b>0.15</b>                           |
| <b>ENGLISCHES PFUND</b>                              |   |                                  |           |              |                                  |                      |                                       |
| 6.625  | AEGON s 46 6.625%/09-16.12.2039   | GBP                              | 800'000   |              | 800'000                          | 979'758.21           | 0.15                                  |
| 9.750  | AHHEUSER-BUSCH INBEV 9.75%/09-30.07.2024  | GBP                              | 600'000   |              | 600'000                          | 657'636.02           | 0.10                                  |
| 4.000  | AMGEN (reg. -S-) 4%/12-13.09.2029   | GBP                              | 500'000   | 500'000      |                                  |                      |                                       |
| 4.500  | ANGLIAN WATER SERVICES FINANCING 4.5%/13-22.02.2026                                     | GBP                              | 800'000   | 800'000      |                                  |                      |                                       |
| 5.750  | ASTRAZENECA PLC S. -3- 5.75%/07-13.11.2031  | GBP                              | 500'000   |              | 500'000                          | 603'095.33           | 0.09                                  |
| 5.750  | BT GROUP (reg. -S-) 5.75%/99-07.12.2028   | GBP                              | 1'000'000 |              | 1'000'000                        | 1'130'724.63         | 0.17                                  |
| -  | CENTRICA (reg.-S) (subordinated) FIX-TO-FLOATER 5.25%/15-10.04.2075                     | GBP                              | 2'000'000 | 1'000'000    | 1'000'000                        | 1'056'953.73         | 0.16                                  |
| 6.800  | CITIGROUP INC 6.8%/08-25.06.2038  | GBP                              | 300'000   |              | 300'000                          | 384'712.66           | 0.06                                  |
| 7.375  | CREDIT AGRICOLE s283 7.375%/08-18.12.2023   | GBP                              | 300'000   | 300'000      |                                  |                      |                                       |
| 6.000  | EIB 6%/98-07.12.2028  | GBP                              | 600'000   | 1'200'000    | 1'800'000                        | 2'130'588.52         | 0.33                                  |
| 8.125  | FRANCE TELECOM (reg. -S-) S. 103 T.1 8.125%/08-20.11.2028                               | GBP                              | 700'000   |              | 700'000                          | 880'502.24           | 0.13                                  |
| 7.250  | HAMMERSON PLC 7.25%/98-21.04.2028   | GBP                              | 550'000   |              | 550'000                          | 612'610.66           | 0.09                                  |
| 6.750  | HEATHROW FUNDING LIMITED (reg. -S-) A-10 S. 2 6.75%/09-03.12.2028                       | GBP                              |           | 700'000      | 700'000                          | 789'554.60           | 0.12                                  |
| 7.125  | HEATHROW FUNDING LIMITED (subordinated) (reg. -S-) S. -11- C. -B2- 7.125%/12-14.02.2024 | GBP                              | 300'000   |              | 300'000                          |                      |                                       |
| 5.750  | HSBC HOLDINGS 5.75%/02-20.12.2027   | GBP                              | 300'000   | 300'000      | 300'000                          | 334'402.32           | 0.05                                  |
| 7.375  | IBERDROLA FINANZAS SAU 7.375%/09-29.01.2024   | GBP                              | 300'000   |              | 300'000                          | 322'184.42           | 0.05                                  |
| 6.000  | ITALY 6%/98-04.08.2028  | GBP                              | 200'000   |              | 200'000                          | 225'263.02           | 0.03                                  |
| 5.500  | JOHNSON & JOHNSON 5.5%/07-06.11.2024  | GBP                              | 1'200'000 |              | 1'200'000                        |                      |                                       |
| 5.375  | NEDERLANDSE WATERSCHAPSBANK 5.375%/01-07.06.2032  | GBP                              |           | 700'000      | 700'000                          | 828'111.59           | 0.13                                  |
| -  | NGG FINANCE ff 13-18.06.2073  | GBP                              | 1'000'000 |              | 1'000'000                        | 1'056'932.27         | 0.16                                  |
| 5.625  | RECKITT BENCKISER TSY 5.625%/23-14.12.2038  | GBP                              | 400'000   |              | 400'000                          | 482'145.82           | 0.07                                  |
| 8.375  | SSE (reg. -S-) S. 3 8.375%/08-20.11.2028  | GBP                              | 600'000   |              | 600'000                          | 754'329.97           | 0.12                                  |
| 2.250  | UNITED KINGDOM 2.25%/13-07.09.2023  | GBP                              | 2'000'000 |              | 2'000'000                        |                      |                                       |
| 2.750  | UNITED KINGDOM 2.75%/14-07.09.2024  | GBP                              | 1'000'000 |              | 1'000'000                        |                      |                                       |
| 6.000  | UNITED KINGDOM 6%/98-07.12.2028   | GBP                              | 1'400'000 |              | 1'400'000                        | 1'681'036.64         | 0.26                                  |
|  |   |                                  |           |              |                                  | <b>14'910'542.65</b> | <b>2.28</b>                           |
| <b>EURO</b>  |   |                                  |           |              |                                  |                      |                                       |
| 4.875  | ALD SA S. -0- 4.875%/23-06.10.2028  | EUR                              |           | 1'000'000    | 1'000'000                        | 984'310.58           | 0.15                                  |
| -  | BANK OF AMERICA CORP FIX-TO-FRN FRN/20-31.03.2029                                       | EUR                              | 1'500'000 |              | 1'500'000                        |                      |                                       |
| 4.250  | BAYER AG 4.25%/23-26.08.2029  | EUR                              |           | 350'000      | 350'000                          | 337'034.38           | 0.05                                  |
| -  | BAYER FIX-TO-FRN 3.75%/14-01.07.2074  | EUR                              | 500'000   |              | 500'000                          |                      |                                       |
| 4.000  | BELGIUM KINGDOM S. 66 4%/12-28.03.2032  | EUR                              |           | 850'000      | 850'000                          | 878'554.88           | 0.13                                  |
| 3.750  | CAISSE NATIONALE DES AUTOROUTES 3.75%/05-15.07.2025                                     | EUR                              | 500'000   |              | 500'000                          |                      |                                       |
| 4.875  | CEZ (reg. -S-) S. 15 4.875%/10-16.04.2025   | EUR                              | 700'000   |              | 500'000                          | 470'999.97           | 0.07                                  |
| 4.250  | CYPRUS (reg. -S-) 4.25%/15-04.11.2025   | EUR                              | 1'200'000 |              | 1'200'000                        | 1'149'254.23         | 0.18                                  |
| 3.500  | DEUTSCHE LUFTHANSA AG 3.5%/21-14.07.2029  | EUR                              | 800'000   |              | 800'000                          |                      |                                       |

| Titelbezeichnung   | Währung | 31.12.2022<br>Anzahl/<br>Nominal | Käufe (1) | Verkäufe (1) | 31.12.2023<br>Anzahl/<br>Nominal | Kurswert CHF         | in % des<br>Gesamtfonds-<br>vermögens |
|--|---------|----------------------------------|-----------|--------------|----------------------------------|----------------------|---------------------------------------|
| - ENERGIAS DE PORTUGAL SA (subordinated) FIX-TO-FRN FRN/19-30.04.2079              | EUR     | 1'300'000                        |           |              | 1'300'000                        | 1'207'836.49         | 0.18                                  |
| 4.500 FIAT CHRYSLER AUTOMOBILE 4.5%/20-07.07.2028                                  | EUR     | 700'000                          |           |              | 700'000                          | 685'281.87           | 0.10                                  |
| 5.750 FRANCE 5.75%/01-25.10.2032   | EUR     |                                  | 1'500'000 | 500'000      | 1'000'000                        | 1'168'614.31         | 0.18                                  |
| 6.000 FRANCE 6%/94-25.10.2025  | EUR     | 500'000                          | 2'000'000 | 1'500'000    | 1'000'000                        | 986'569.75           | 0.15                                  |
| 4.000 FRESENIUS FINANCE (reg. -S-) 4%/14-01.02.2024                                | EUR     | 500'000                          |           | 500'000      |                                  |                      |                                       |
| 4.250 GERMANY 4.25%/07-04.07.2039  | EUR     |                                  | 750'000   |              | 750'000                          | 877'883.17           | 0.13                                  |
| 6.500 GERMANY 6.5%/97-04.07.2027   | EUR     | 500'000                          |           | 500'000      |                                  |                      |                                       |
| 6.250 GERMANY S. 00 6.25%/00-04.01.2030  | EUR     |                                  | 750'000   |              | 750'000                          | 865'764.53           | 0.13                                  |
| 6.000 GROUPAMA ASSURANCES MUTUELLES SA (subordinated) 6%/17-23.01.2027             | EUR     | 500'000                          |           |              | 500'000                          | 499'411.60           | 0.08                                  |
| 3.875 HARLEY-DAVIDSON FINL SER 3.875%/20-19.05.2023                                | EUR     | 1'000'000                        |           | 1'000'000    |                                  |                      |                                       |
| 5.400 IRELAND 5.4%/09-13.03.2025   | EUR     | 500'000                          |           |              | 500'000                          | 477'810.02           | 0.07                                  |
| 3.750 ITALY BTP 3.75%/14-01.09.2024  | EUR     | 650'000                          |           | 650'000      |                                  |                      |                                       |
| 6.500 ITALY BTP 6.5%/97-01.11.2027   | EUR     | 600'000                          |           | 100'000      | 500'000                          | 526'126.53           | 0.08                                  |
| 4.000 NYKREDIT REALKREDIT AS S. -5- 4%/23-17.07.2028                               | EUR     |                                  | 1'000'000 | 1'000'000    |                                  |                      |                                       |
| - OMV FIX-TO-FRN 6.25%/15-PERPETUAL  | EUR     | 1'000'000                        |           |              | 1'000'000                        | 962'118.64           | 0.15                                  |
| 5.250 POLAND (reg -S-) S. 24 5.25%/10-20.01.2025                                   | EUR     | 500'000                          |           |              | 500'000                          | 473'714.69           | 0.07                                  |
| 4.125 PORTUGAL (OBRIGACOES DO TESOURO) 4.125%/17-14.04.2027                        | EUR     | 500'000                          |           |              | 500'000                          | 492'187.83           | 0.08                                  |
| 4.875 PROCTER & GAMBLE CO (reg. -S-) 4.875%/07-11.05.2027                          | EUR     | 500'000                          |           |              | 500'000                          | 495'014.12           | 0.08                                  |
| 4.000 REPUBLIC OF ESTONIA 4%/22-12.10.2032   | EUR     |                                  | 750'000   |              | 750'000                          | 750'902.42           | 0.11                                  |
| 4.250 SNCF RESEAU (reg. -S-) S. -84- 4.25%/11-07.10.2026                           | EUR     | 500'000                          |           |              | 500'000                          | 484'057.60           | 0.07                                  |
| 3.800 SPAIN 3.8%/14-30.04.2024   | EUR     | 650'000                          |           | 650'000      |                                  |                      |                                       |
| 5.750 SPAIN 5.75%/01-30.07.2032  | EUR     |                                  | 600'000   |              | 600'000                          | 681'042.44           | 0.10                                  |
| 5.500 SUEZ ENVIRONNEMENT COMPANY 5.5%/09-22.07.2024                                | EUR     | 500'000                          |           | 500'000      |                                  |                      |                                       |
| - TELEFONICA EUROPE BV (subordinated) FIX-TO-FRN FRN/19-PERPETUAL                  | EUR     | 1'300'000                        |           |              | 1'300'000                        | 1'201'044.10         | 0.18                                  |
| 3.875 TELIASONERA (reg. -S-) S. -69- 3.875%/10-01.10.2025                          | EUR     | 1'000'000                        |           | 1'000'000    |                                  |                      |                                       |
| 4.875 WAL-MART STORES 4.875%/09-21.09.2029   | EUR     | 1'000'000                        |           |              | 1'000'000                        | 1'034'458.60         | 0.16                                  |
|  |         |                                  |           |              |                                  | <b>17'689'992.75</b> | <b>2.70</b>                           |
| <b>KANADISCHER DOLLAR</b>  |         |                                  |           |              |                                  |                      |                                       |
| 5.500 BANK OF NOVA SCOTIA 5.5%/23-29.12.2025                                       | CAD     |                                  | 500'000   |              | 500'000                          | 324'054.64           | 0.05                                  |
| 7.850 BELL CANADA S. -M-11- 7.85%/01-02.04.2031                                    | CAD     | 500'000                          |           |              | 500'000                          | 376'960.61           | 0.06                                  |
| 5.400 BRITISH COLUMBIA PROV OF S. -BCCD-7- 5.4%/04-18.06.2035                      | CAD     |                                  | 1'000'000 |              | 1'000'000                        | 728'703.28           | 0.11                                  |
| 6.150 BRITISH COLUMBIA PROV OF S. -BCCD-W- 6.15%/97-19.11.2027                     | CAD     |                                  | 2'000'000 |              | 2'000'000                        | 1'393'388.35         | 0.21                                  |
| 3.500 CANADIAN GOVERNMENT 3.5%/22-01.03.2028                                       | CAD     |                                  | 3'500'000 | 2'000'000    | 1'500'000                        | 967'731.15           | 0.15                                  |
| 6.100 ENBRIDGE INC 6.1%/22-09.11.2032  | CAD     |                                  | 2'500'000 |              | 2'500'000                        | 1'736'006.99         | 0.27                                  |
| 7.050 GREATER TORONTO AIRPORT S. 2000-1 7.05%/00-12.06.2030                        | CAD     | 500'000                          |           |              | 500'000                          | 367'539.78           | 0.06                                  |
| 4.400 IADB 4.4%/06-26.01.2026  | CAD     | 400'000                          |           |              | 400'000                          | 256'922.97           | 0.04                                  |
| 4.488 LOBLAW COS LTD S. -2028- 4.488%/18-11.12.2028                                | CAD     | 3'500'000                        |           |              | 3'500'000                        | 2'263'021.03         | 0.35                                  |
| 5.219 NATIONAL BANK OF CANADA 5.219%/23-14.06.2028                                 | CAD     |                                  | 1'000'000 |              | 1'000'000                        | 657'555.63           | 0.10                                  |
| 4.400 ROGERS COMMUNICATIONS INC 4.4%/18-02.11.2028                                 | CAD     |                                  | 2'000'000 |              | 2'000'000                        | 1'272'321.83         | 0.19                                  |
| 4.400 SHAW COMMUNICATIONS INC 4.4%/18-02.11.2028                                   | CAD     | 2'000'000                        |           | 2'000'000    |                                  |                      |                                       |
| 3.750 TELUS S. -CV- 3.75%/15-10.03.2026  | CAD     | 3'500'000                        |           | 1'500'000    | 2'000'000                        | 1'257'692.75         | 0.19                                  |
| 3.057 WALT DISNEY COMPANY/THE 3.057%/20-30.03.2027                                 | CAD     | 3'500'000                        |           | 3'500'000    |                                  |                      |                                       |
| 3.460 WELLS FARGO CANADA 3.46%/13-24.01.2023                                       | CAD     | 3'500'000                        |           | 3'500'000    |                                  |                      |                                       |
|  |         |                                  |           |              |                                  | <b>11'601'899.01</b> | <b>1.77</b>                           |
| <b>US DOLLAR</b>   |         |                                  |           |              |                                  |                      |                                       |
| 6.150 ABBOTT LABORATORIES 6.15%/07-30.11.2037                                      | USD     | 1'000'000                        |           |              | 1'000'000                        | 968'153.80           | 0.15                                  |
| 4.625 AERCAP IRELAND CAP/GLOBA 4.625%/20-15.10.2027                                | USD     | 1'000'000                        |           | 500'000      | 500'000                          | 413'435.19           | 0.06                                  |
| 6.500 AERCAP IRELAND CAPITAL DAC / AERCAP GLOBAL AVIATION TRUST 6.5%/20-15.07.2025 | USD     | 600'000                          |           |              | 600'000                          | 512'488.45           | 0.08                                  |
| 4.250 AIRCASTLE LTD 4.25%/19-15.06.2026  | USD     | 1'000'000                        |           |              | 1'000'000                        | 814'254.43           | 0.12                                  |
| 5.050 ALBEMARLE CORP 5.05%/22-01.06.2032   | USD     |                                  | 1'000'000 |              | 1'000'000                        | 821'795.38           | 0.13                                  |
| 3.800 AMAZON.COM 3.8%/14-05.12.2024  | USD     | 1'000'000                        |           | 1'000'000    |                                  |                      |                                       |
| 3.500 ANHEUSER-BUSCH INBEV WOR 3.5%/20-01.06.2030                                  | USD     | 500'000                          |           | 500'000      |                                  |                      |                                       |
| 3.350 ANTHEM INC 3.35%/17-01.12.2024   | USD     | 1'500'000                        |           | 1'500'000    |                                  |                      |                                       |
| 3.000 APPLE INC 3%/17-20.06.2027   | USD     | 1'400'000                        |           | 400'000      | 1'000'000                        | 809'305.68           | 0.12                                  |
| 4.000 ASHTEAD CAPITAL INC 4%/19-01.05.2028   | USD     | 1'000'000                        |           |              | 1'000'000                        | 791'193.93           | 0.12                                  |
| 5.820 ASIAN DEVELOPMENT BANK 5.82%/98-16.06.2028                                   | USD     | 500'000                          |           |              | 500'000                          | 449'704.98           | 0.07                                  |
| 3.800 AVANGRID INC 3.8%/19-01.06.2029  | USD     | 1'000'000                        |           | 1'000'000    |                                  |                      |                                       |
| 3.500 BANC CREDITO INVERSIONES 3.5%/17-12.10.2027                                  | USD     | 1'000'000                        |           | 1'000'000    |                                  |                      |                                       |
| 5.500 BARRY CALLEBAUT SERVICES (reg. -S-) 5.5%/13-15.06.2023                       | USD     | 1'700'000                        |           | 1'700'000    |                                  |                      |                                       |
| 3.750 BECLE SA DE CV S. -14- 3.75%/15-13.05.2025                                   | USD     | 800'000                          |           | 800'000      |                                  |                      |                                       |
| 3.700 BECTON DICKINSON AND CO 3.7%/17-06.06.2027                                   | USD     | 500'000                          |           |              | 500'000                          | 407'825.76           | 0.06                                  |
| 4.150 BMW US CAPITAL LLC 4.15%/20-09.04.2030                                       | USD     | 1'000'000                        |           | 1'000'000    |                                  |                      |                                       |
| 5.700 BPCE 5.7%/13-23.10.2023  | USD     | 1'800'000                        |           | 1'800'000    |                                  |                      |                                       |
| - BRITISH TELECOMMUNICATIONS STEP UP 00-15.12.2030                                 | USD     |                                  | 2'000'000 |              | 2'000'000                        | 2'083'457.15         | 0.32                                  |
| 4.200 CELLULOSA ARAUCO CONSTITU 4.2%/19-29.01.2030                                 | USD     | 1'000'000                        |           | 1'000'000    |                                  |                      |                                       |
| 4.125 CERRO DEL AGUILA SA 4.125%/17-16.08.2027                                     | USD     | 1'500'000                        |           | 1'500'000    |                                  |                      |                                       |
| 5.500 CISCO SYSTEMS 5.5%/09-15.01.2040   | USD     | 1'000'000                        | 200'000   | 400'000      | 800'000                          | 717'386.87           | 0.11                                  |

Jahresbericht per 31. Dezember 2023

| Titelbezeichnung   | Währung | 31.12.2022<br>Anzahl/<br>Nominal | Käufe (1) | Verkäufe (1) | 31.12.2023<br>Anzahl/<br>Nominal | Kurswert CHF | in % des<br>Gesamtfonds-<br>vermögens |
|--|---------|----------------------------------|-----------|--------------|----------------------------------|--------------|---------------------------------------|
| 4.450 CITIGROUP INC 4.45%/15-29.09.2027                                  | USD     | 1'000'000                        |           | 1'000'000    |                                  |              |                                       |
| 6.500 COMCAST 6.5%/05-15.11.2035   | USD     |                                  | 1'200'000 |              | 1'200'000                        | 1'153'482.78 | 0.18                                  |
| 3.700 COMCAST CORP 3.7%/18-15.04.2024                                    | USD     | 2'000'000                        |           | 2'000'000    |                                  |              |                                       |
| 8.500 DAIMLERCHRYSLER NORTH AMERICA 8.5%/01-18.01.2031                   | USD     | 700'000                          |           |              | 700'000                          | 738'642.08   | 0.11                                  |
| 6.020 DELL INT LLC / EMC CORP 6.02%/21-15.06.2026                        | USD     | 2'000'000                        |           |              | 2'000'000                        | 1'722'551.93 | 0.26                                  |
| 9.250 DEUTSCHE TELECOM INTERNATIONAL FINANCE 9.25%/02-01.06.2032         | USD     |                                  | 1'500'000 |              | 1'500'000                        | 1'638'844.00 | 0.25                                  |
| 8.750 DEUTSCHE TELEKOM INTERNATIONAL FINANCE STEP UP 8.75%/00-15.06.2030 | USD     |                                  | 800'000   |              | 800'000                          | 811'655.49   | 0.12                                  |
| 6.700 DISCOVER FINANCIAL SVS 6.7%/22-29.11.2032                          | USD     |                                  | 1'000'000 |              | 1'000'000                        | 880'734.31   | 0.13                                  |
| 7.375 DOW CHEMICAL 7.375%/99-01.11.2029                                  | USD     | 500'000                          |           |              | 500'000                          | 475'147.27   | 0.07                                  |
| 4.493 DOWDUPONT INC 4.493%/18-15.11.2025                                 | USD     | 500'000                          |           |              | 500'000                          | 418'173.53   | 0.06                                  |
| 3.625 EDF (reg. -S-) 3.625%/15-13.10.2025                                | USD     | 1'000'000                        |           | 1'000'000    |                                  |              |                                       |
| 5.750 EDISON INTERNATIONAL 5.75%/19-15.06.2027                           | USD     | 1'200'000                        |           |              | 1'200'000                        | 1'032'450.51 | 0.16                                  |
| 3.500 ENEL FINANCE INTL NV 3.5%/17-06.04.2028                            | USD     | 1'000'000                        |           | 1'000'000    |                                  |              |                                       |
| 4.375 EXPORT DEVELOPMNT CANADA 4.375%/23-29.06.2026                      | USD     |                                  | 500'000   |              | 500'000                          | 422'604.68   | 0.06                                  |
| 6.625 FANNIE MAE 6.625%/00-15.11.2030                                    | USD     | 500'000                          |           |              | 500'000                          | 484'152.65   | 0.07                                  |
| 4.250 FEDEX CORP 4.25%/20-15.05.2030                                     | USD     | 500'000                          |           |              | 500'000                          | 412'126.46   | 0.06                                  |
| 4.400 GC TREASURY CENTRE CO 4.4%/22-30.03.2032                           | USD     | 1'000'000                        |           | 1'000'000    |                                  |              |                                       |
| 3.100 GECC T. 881 3.1%/13-09.01.2023                                     | USD     | 2'000'000                        |           | 2'000'000    |                                  |              |                                       |
| 5.800 GENERAL MOTORS FINL CO 5.8%/23-23.06.2028                          | USD     |                                  | 600'000   |              | 600'000                          | 519'123.81   | 0.08                                  |
| 6.250 GLOBELEQ MESOAMERICA 6.25%/21-26.04.2029                           | USD     | 200'000                          |           |              | 200'000                          | 158'156.31   | 0.02                                  |
| 5.625 HCA INC 5.625%/18-01.09.2028                                       | USD     | 1'000'000                        |           |              | 1'000'000                        | 861'318.05   | 0.13                                  |
| 4.950 HEXCEL 4.95%/15-15.08.2025   | USD     | 500'000                          |           |              | 500'000                          | 417'256.16   | 0.06                                  |
| 5.500 HP INC 5.5%/22-15.01.2033  | USD     | 1'000'000                        | 200'000   | 400'000      | 800'000                          | 690'858.88   | 0.11                                  |
| 5.875 IBM 5.875%/02-29.11.2032   | USD     | 700'000                          |           |              | 700'000                          | 644'810.26   | 0.10                                  |
| 8.500 INDONESIA (reg. -S-) 8.5%/05-12.10.2035                            | USD     |                                  | 500'000   |              | 500'000                          | 560'862.47   | 0.09                                  |
| 6.250 JEFFERIES GROUP 6.25%/06-15.01.2036                                | USD     |                                  | 1'000'000 |              | 1'000'000                        | 884'976.10   | 0.14                                  |
| 8.375 KONINKLUKE KPN -144A- 8.375%/00-01.10.2030                         | USD     | 700'000                          |           |              | 700'000                          | 693'808.77   | 0.11                                  |
| 4.625 KRAFT HEINZ FOODS CO 4.625%/18-30.01.2029                          | USD     | 700'000                          |           |              | 700'000                          | 593'520.01   | 0.09                                  |
| 3.700 KROGER CO 3.7%/17-01.08.2027                                       | USD     | 500'000                          |           | 500'000      |                                  |              |                                       |
| 4.750 MCKESSON CORP 4.75%/18-30.05.2029                                  | USD     | 1'000'000                        |           |              | 1'000'000                        | 843'500.87   | 0.13                                  |
| 5.000 MEGLOBAL CANADA INC 5%/20-18.05.2025                               | USD     | 700'000                          |           | 700'000      |                                  |              |                                       |
| - MERCK & CO STEP UP 03-01.12.2033                                       | USD     | 700'000                          |           |              | 700'000                          | 692'412.52   | 0.11                                  |
| 6.375 METLIFE INC 6.375%/04-15.06.2034                                   | USD     |                                  | 1'000'000 |              | 1'000'000                        | 944'882.90   | 0.14                                  |
| 6.250 MORGAN STANLEY 6.25%/06-09.08.2026                                 | USD     | 1'000'000                        |           |              | 1'000'000                        | 867'748.05   | 0.13                                  |
| 5.602 NATIONAL GRID PLC 5.602%/23-12.06.2028                             | USD     |                                  | 800'000   |              | 800'000                          | 694'171.51   | 0.11                                  |
| 4.950 NESTLE HOLDINGS INC 4.95%/23-14.03.2030                            | USD     | 1'000'000                        |           |              | 1'000'000                        | 868'303.53   | 0.13                                  |
| 4.450 NEWELL RUBBERMAID 4.45%/16-01.04.2026                              | USD     | 500'000                          |           |              | 500'000                          | 414'352.56   | 0.06                                  |
| 6.950 OCCIDENTAL PETROLEUM COR 6.95%/19-01.07.2024                       | USD     | 251'000                          |           |              | 251'000                          | 212'407.38   | 0.03                                  |
| 7.950 OCCIDENTAL PETROLEUM COR 7.95%/19-15.06.2039                       | USD     |                                  | 800'000   |              | 800'000                          | 785'188.10   | 0.12                                  |
| 6.250 ORACLE CORP 6.25%/22-09.11.2032                                    | USD     |                                  | 1'500'000 |              | 1'500'000                        | 1'372'810.85 | 0.21                                  |
| 8.750 PERU 8.75%/03-21.11.2033   | USD     |                                  | 2'000'000 |              | 2'000'000                        | 2'113'604.13 | 0.32                                  |
| 6.500 PFIZER 6.5%/03-01.02.2034  | USD     | 1'000'000                        |           |              | 1'000'000                        | 949'848.48   | 0.15                                  |
| 4.650 PFIZER INVESTMENT ENTER 4.65%/23-19.05.2030                        | USD     |                                  | 1'400'000 |              | 1'400'000                        | 1'186'498.01 | 0.18                                  |
| 10.625 PHILIPPINES 10.625%/00-16.03.2025                                 | USD     | 500'000                          |           |              | 500'000                          | 448'181.64   | 0.07                                  |
| - PRUDENTIAL FINANCIAL INC (subordinated) FIX-TO-FRN FRN/18-15.09.2048   | USD     | 2'500'000                        |           |              | 2'500'000                        | 2'046'471.98 | 0.31                                  |
| 5.500 PULTEGROUP INC 5.5%/16-01.03.2026                                  | USD     | 1'500'000                        |           | 700'000      | 800'000                          | 682'233.92   | 0.10                                  |
| 3.250 ROCHE HOLDINGS INC 3.25%/18-17.09.2023                             | USD     | 1'400'000                        |           | 1'400'000    |                                  |              |                                       |
| 6.000 ROMANIA 6%/22-25.05.2034   | USD     |                                  | 1'500'000 |              | 1'500'000                        | 1'269'518.33 | 0.19                                  |
| 4.000 SCHLUMBERGER HOLDINGS (reg. -S-) 4%/15-21.12.2025                  | USD     | 1'000'000                        |           |              | 1'000'000                        | 828'301.14   | 0.13                                  |
| 6.450 SOUTHWESTERN ENERGY 6.45%/15-23.01.2025                            | USD     | 500'000                          |           |              | 500'000                          | 419'250.81   | 0.06                                  |
| 4.050 STANDARD CHARTERED (reg. -S-) 4.05%/16-12.04.2026                  | USD     | 1'000'000                        |           | 1'000'000    |                                  |              |                                       |
| 4.000 STATE OF QATAR 4%/19-14.03.2029                                    | USD     | 500'000                          |           | 500'000      |                                  |              |                                       |
| 7.250 STATOIL ASA 7.25%/00-23.09.2027                                    | USD     | 1'500'000                        |           |              | 1'500'000                        | 1'384'942.86 | 0.21                                  |
| 5.950 SYSCO CORPORATION 5.95%/20-01.04.2030                              | USD     |                                  | 1'000'000 | 300'000      | 700'000                          | 627'036.00   | 0.10                                  |
| 4.450 TOYOTA MOTOR CREDIT CORP S. -B- 4.45%/22-29.06.2029                | USD     | 500'000                          |           |              | 500'000                          | 422'890.83   | 0.06                                  |
| 6.750 TRAVELERS COS INC 6.75%/06-20.06.2036                              | USD     | 1'000'000                        |           |              | 1'000'000                        | 991'845.52   | 0.15                                  |
| 7.125 TYCO ELECTRONICS GROUP S 7.125%/08-01.10.2037                      | USD     | 1'000'000                        |           |              | 1'000'000                        | 991'020.73   | 0.15                                  |
| - UBS GROUP AG FIX-TO-FRN FRN/23-22.12.2027                              | USD     |                                  | 1'000'000 |              | 1'000'000                        | 867'344.07   | 0.13                                  |
| 6.338 UNITED MEXICAN STATES 6.338%/23-04.05.2053                         | USD     | 1'000'000                        |           |              | 1'000'000                        | 858'363.95   | 0.13                                  |
| 4.500 UNITED STATES OF AMERICA 4.5%/06-15.02.2036                        | USD     | 1'300'000                        |           | 1'300'000    |                                  |              |                                       |
| 4.625 UNITED STATES OF AMERICA 4.625%/10-15.02.2040                      | USD     | 1'000'000                        |           | 300'000      | 700'000                          | 631'435.02   | 0.10                                  |
| 6.250 UNITED STATES OF AMERICA 6.25%/00-15.05.2030                       | USD     | 2'000'000                        | 2'000'000 | 1'000'000    | 3'000'000                        | 2'855'472.58 | 0.44                                  |
| 6.500 UNITED STATES OF AMERICA 6.5%/96-15.11.2026                        | USD     | 8'000'000                        |           | 1'000'000    | 7'000'000                        | 6'272'466.19 | 0.96                                  |
| 2.500 UNITED STATES OF AMERICA E-2023 2.5%/13-15.08.2023                 | USD     | 3'500'000                        |           | 3'500'000    |                                  |              |                                       |
| 2.250 UNITED STATES OF AMERICA -F-2025- 2.25%/15-15.11.2025              | USD     | 2'500'000                        |           | 2'500'000    |                                  |              |                                       |
| 2.500 UNITED STATES OF AMERICA S. -U-2024- 2.5%/19-31.01.2024            | USD     |                                  | 2'700'000 | 2'700'000    |                                  |              |                                       |
| 4.625 UNITEDHEALTH GROUP 4.625%/15-15.07.2035                            | USD     | 1'000'000                        |           | 1'000'000    |                                  |              |                                       |
| 7.875 URUGUAY 7.875%/03-15.01.2033                                       | USD     |                                  | 500'000   |              | 500'000                          | 513'664.19   | 0.08                                  |

| Titelbezeichnung   | Währung | 31.12.2022<br>Anzahl/<br>Nominal | Käufe (1)  | Verkäufe (1) | 31.12.2023<br>Anzahl/<br>Nominal | Kurswert CHF          | in % des<br>Gesamtfonds-<br>vermögens |
|--|---------|----------------------------------|------------|--------------|----------------------------------|-----------------------|---------------------------------------|
| 5.000 US 5%/07-15.05.2037  | USD     |                                  | 1'750'000  |              | 1'750'000                        | 1'648'892.73          | 0.25                                  |
| 6.250 US 6.25%/93-15.08.2023   | USD     | 4'000'000                        | 4'700'000  | 8'700'000    |                                  |                       |                                       |
| 6.375 US 6.375%/97-15.08.2027  | USD     | 6'000'000                        |            |              | 6'000'000                        | 5'455'893.63          | 0.83                                  |
| 6.875 US 6.875%/95-15.08.2025  | USD     | 8'000'000                        |            | 1'000'000    | 7'000'000                        | 6'115'056.20          | 0.93                                  |
| 7.500 US 7.5%/94-15.11.2024  | USD     | 2'400'000                        | 2'600'000  |              | 5'000'000                        | 4'314'638.26          | 0.66                                  |
| 2.625 US TREASURY N/B S. -AA-2023- 2.625%/18-30.06.2023  | USD     |                                  | 9'200'000  | 9'200'000    |                                  |                       |                                       |
| 2.750 US TREASURY N/B S. -Y-2023- 2.75%/18-30.04.2023  | USD     |                                  | 13'500'000 | 13'500'000   |                                  |                       |                                       |
| 7.750 VERIZON GLOBAL FUNDING 7.75%/01-01.12.2030   | USD     |                                  | 400'000    |              | 400'000                          | 394'583.65            | 0.06                                  |
| 6.875 VIACOM 6.875%/06-30.04.2036  | USD     |                                  | 1'000'000  |              | 1'000'000                        | 854'492.48            | 0.13                                  |
| 6.000 VIRGINIA ELEC & POWER CO 6%/06-15.01.2036  | USD     |                                  | 1'000'000  |              | 1'000'000                        | 902'843.78            | 0.14                                  |
| - VODAFONE GROUP PLC (subordinated) FIX-TO-FRN FRN/19-04.04.2079   | USD     | 1'500'000                        |            |              | 1'500'000                        | 1'304'500.44          | 0.20                                  |
| 4.950 WABTEC 4.95%/18-15.09.2028   | USD     | 700'000                          |            |              | 700'000                          | 582'721.13            | 0.09                                  |
| 4.000 WELLTOWER 4%/15-01.06.2025   | USD     | 1'500'000                        |            | 1'500'000    |                                  |                       |                                       |
|  |         |                                  |            |              |                                  | <b>80'634'049.08</b>  | <b>12.32</b>                          |
| <b>Total Anleihen</b>  |         |                                  |            |              |                                  | <b>137'283'953.94</b> | <b>20.97</b>                          |
| <b>Kollektive Kapitalanlagen</b>   |         |                                  |            |              |                                  |                       |                                       |
| <b>EURO</b>  |         |                                  |            |              |                                  |                       |                                       |
| CREDIT SUISSE INDEX FUND (LUX) SICAV - CSIF (LUX) EQUITY EMU ESG BLUE -QAX- EUR  | EUR     | 8'600                            | 1'400      | 2'600        | 7'400                            | 8'478'709.67          | 1.30                                  |
| CS INVESTMENT FUNDS 1 SICAV - CREDIT SUISSE (LUX) FINANCIAL BOND FUND -EA- EUR   | EUR     | 3'000                            |            | 3'000        |                                  |                       |                                       |
| INVESCO ZODIAC FUNDS FCP-SIF - INVESCO EUROPEAN SENIOR LOAN ESG FUND -GX EUR MD- EUR                                     | EUR     | 41'500                           |            |              | 41'500                           | 3'432'303.65          | 0.52                                  |
|  |         |                                  |            |              |                                  | <b>11'911'013.32</b>  | <b>1.82</b>                           |
| <b>JAPANISCHER YEN</b>   |         |                                  |            |              |                                  |                       |                                       |
| CREDIT SUISSE INDEX FUND (LUX) SICAV - CSIF (LUX) EQUITY JAPAN ESG BLUE -QAX- JPY  | JPY     | 1'150                            |            | 150          | 1'000                            | 717'368.42            | 0.11                                  |
|  |         |                                  |            |              |                                  | <b>717'368.42</b>     | <b>0.11</b>                           |
| <b>NORWEGISCHE KRONE</b>   |         |                                  |            |              |                                  |                       |                                       |
| STORM FUND II SICAV - STORM BOND FUND -IC DIST NOK- NOK  | NOK     | 780'000                          |            |              | 780'000                          | 7'022'510.52          | 1.07                                  |
|  |         |                                  |            |              |                                  | <b>7'022'510.52</b>   | <b>1.07</b>                           |
| <b>US DOLLAR</b>   |         |                                  |            |              |                                  |                       |                                       |
| BLACKROCK STRATEGIC FUNDS SICAV - BLACKROCK GLOBAL REAL ASSET SECURITIES FUND -D3 USD- USD                               | USD     | 55'000                           |            | 30'000       | 25'000                           | 1'516'396.12          | 0.23                                  |
| BNP PARIBAS EASY SICAV - JPM ESG EMBI GLOBAL DIVERSIFIED COMPOSITE - TRACK PRIVILEGE USD DIST- USD                       | USD     | 200'000                          |            | 155'000      | 45'000                           | 2'931'475.01          | 0.45                                  |
| BNP PARIBAS INSTICASH SICAV - BNP PARIBAS INSTICASH USD 1D LVNAV -I PLUS DIS USD INC- USD                                | USD     |                                  | 2'000'000  | 2'000'000    |                                  |                       |                                       |
| CIM INVESTMENT FUND ICAV - CIM DIVIDEND INCOME FUND -H ORDINARY- USD   | USD     |                                  | 1'000'000  |              | 1'000'000                        | 8'037'501.20          | 1.23                                  |
| CREDIT SUISSE (LUX) EMERGING MARKET CORPORATE BOND FUND -EA- USD   | USD     | 10'000                           |            | 10'000       |                                  |                       |                                       |
| CREDIT SUISSE FUND (LUX) ASIA PACIFIC INCOME EQUITY FUND -DA- USD  | USD     | 8'600                            |            | 8'600        |                                  |                       |                                       |
| CREDIT SUISSE INDEX FUND (LUX) SICAV - CSIF (LUX) BOND GOVERNMENT EMERGING MARKETS USD -QAX- USD                         | USD     |                                  | 10'000     |              | 10'000                           | 6'611'882.65          | 1.01                                  |
| CREDIT SUISSE INDEX FUND (LUX) SICAV - CSIF (LUX) EQUITY CHINA TOTAL MARKET BLUE -QB- USD                                | USD     |                                  | 7'750      | 5'000        | 2'750                            | 2'028'189.81          | 0.31                                  |
| CREDIT SUISSE INDEX FUND (LUX) SICAV - CSIF (LUX) EQUITY EMERGING MARKETS ESG BLUE -QA USD INC- USD                      | USD     | 11'100                           | 3'900      | 4'000        | 11'000                           | 8'174'138.87          | 1.25                                  |
| CREDIT SUISSE NOVA (LUX) GLOBAL SENIOR LOAN FUND -EA- USD  | USD     | 3'800                            |            |              | 3'800                            | 3'280'364.37          | 0.50                                  |
| CS INVESTMENT FUNDS 1 SICAV - CREDIT SUISSE(LUX)LATIN AMERICA CORPORATE BOND FUND -IA USD- USD                           | USD     | 4'750                            |            | 4'750        |                                  |                       |                                       |
| CS INVESTMENT FUNDS 4 SICAV - CREDIT SUISSE (LUX) ALTERNATIVE OPPORTUNITIES FUND -EA- USD                                | USD     |                                  | 20'000     | 1'500        | 18'500                           | 15'210'532.48         | 2.32                                  |
| DIVAS GLOBAL BARRIER COUPON FUND -F USD DIST- USD  | USD     | 50'000                           | 30'000     |              | 80'000                           | 6'116'923.55          | 0.93                                  |
| DWS INVEST SICAV - DWS INVEST ESG ASIAN BONDS -USD IDQ- USD  | USD     |                                  | 65'000     |              | 65'000                           | 5'625'373.03          | 0.86                                  |
| INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC - BLACKROCK ICS US DOLLAR LIQUIDITY FUND -PREMIER (ACC TO)- USD                            | USD     |                                  | 1'432      | 1'432        |                                  |                       |                                       |
| INVESCO ZODIAC FUNDS FCP-SIF - INVESCO US SENIORLOAN ESG FUND -GX USD MD- USD  | USD     | 160'000                          |            | 35'000       | 125'000                          | 9'843'845.22          | 1.50                                  |
| LEGAL & GENERAL ICAV - L&G ESG EMERGING MARKETS GOVERNMENT BOND (LOCAL CURRENCY) INDEX FUND -C DIS UNHEDGED USD INC- USD | USD     | 10'359'921                       | 1'000'000  | 2'359'921    | 9'000'000                        | 7'189'068.42          | 1.10                                  |
| LEGAL & GENERAL ICAV - L&G ESG GLOBAL HIGH YELDBOND INDEX FUND -C USD INC UNHEDGED- USD                                  | USD     |                                  | 6'300'000  |              | 6'300'000                        | 5'666'494.78          | 0.87                                  |
| PRINCIPAL GLOBAL INVESTORS FUNDS - FINISTERRE UNCONSTRAINED EMERGING MARKETS FIXED INCOME FUND -I3 INCOME USD- USD       | USD     | 550'000                          | 700'000    |              | 1'250'000                        | 9'377'269.89          | 1.43                                  |
| PRINCIPAL GLOBAL INVESTORS FUNDS - PREFERRED SECURITIES FUND -I CLASS INCOME- USD  | USD     | 1'000'000                        |            |              | 1'000'000                        | 7'768'189.92          | 1.19                                  |
| SIMAG INVESTMENT FUNDS SICAV - SIMAG SYSTEMATIC USA ESG EQUITY FUND -SA- USD   | USD     | 37'000                           |            | 37'000       |                                  |                       |                                       |

Jahresbericht per 31. Dezember 2023

| Titelbezeichnung   | Währung | 31.12.2022<br>Anzahl/<br>Nominal | Käufe (1) | Verkäufe (1) | 31.12.2023<br>Anzahl/<br>Nominal | Kurswert CHF          | in % des<br>Gesamtfonds-<br>vermögens |
|--|---------|----------------------------------|-----------|--------------|----------------------------------|-----------------------|---------------------------------------|
|  |         |                                  |           |              |                                  | 99'377'645.32         | 15.18                                 |
| <b>Total Kollektive Kapitalanlagen</b>   |         |                                  |           |              |                                  | <b>119'028'537.58</b> | <b>18.18</b>                          |
| <b>Strukturierte Produkte</b>  |         |                                  |           |              |                                  |                       |                                       |
| <b>EURO</b>  |         |                                  |           |              |                                  |                       |                                       |
| CREDIT SUISSE AG NASSAU BRANCH 6%/20-PERPETUAL   | EUR     | 16'500                           |           | 16'500       |                                  |                       |                                       |
| J.P.MORGAN STRUCTURED PRODUCTS B.V./20-26.05.2025  | EUR     | 45'000                           |           | 45'000       |                                  |                       |                                       |
| UBS AG/20-18.05.2027   | EUR     | 3'750                            |           | 3'750        |                                  |                       |                                       |
|  |         |                                  |           |              |                                  | <b>0.00</b>           | <b>0.00</b>                           |
| <b>SCHWEIZER FRANKEN</b>   |         |                                  |           |              |                                  |                       |                                       |
| CREDIT SUISSE AG NASSAU BRANCH 6%/20-PERPETUAL   | CHF     | 18'000                           |           | 18'000       |                                  |                       |                                       |
| J.P.MORGAN STRUCTURED PRODUCTS B.V./20-26.05.2025  | CHF     | 40'000                           |           | 40'000       |                                  |                       |                                       |
| UBS AG/20-18.05.2027   | CHF     | 4'000                            |           | 4'000        |                                  |                       |                                       |
|  |         |                                  |           |              |                                  | <b>0.00</b>           | <b>0.00</b>                           |
| <b>US DOLLAR</b>   |         |                                  |           |              |                                  |                       |                                       |
| CREDIT SUISSE AG NASSAU BRANCH 6%/20-PERPETUAL   | USD     | 22'000                           |           | 22'000       |                                  |                       |                                       |
| J.P.MORGAN STRUCTURED PRODUCTS B.V./20-26.05.2025  | USD     | 60'000                           |           | 60'000       |                                  |                       |                                       |
| UBS AG/20-18.05.2027   | USD     | 3'500                            |           | 3'500        |                                  |                       |                                       |
|  |         |                                  |           |              |                                  | <b>0.00</b>           | <b>0.00</b>                           |
| <b>Total Strukturierte Produkte</b>  |         |                                  |           |              |                                  | <b>0.00</b>           | <b>0.00</b>                           |
| <b>Total Wertpapiere bewertet aufgrund von am Markt beobachtbaren Parametern</b>   |         |                                  |           |              |                                  | <b>256'312'491.52</b> | <b>39.15</b>                          |
| <b>Wertpapiere bewertet aufgrund geeigneten Bewertungsmodellen unter Berücksichtigung der aktuellen Marktgegebenheiten</b>         |         |                                  |           |              |                                  |                       |                                       |
| <b>Kollektive Kapitalanlagen</b>   |         |                                  |           |              |                                  |                       |                                       |
| <b>US DOLLAR</b>   |         |                                  |           |              |                                  |                       |                                       |
| THOMASLOYD ENERGY IMPACT TRUS  | USD     | 1'650'000                        |           |              | 1'650'000                        | 699'894.55            | 0.11                                  |
|  |         |                                  |           |              |                                  | <b>699'894.55</b>     | <b>0.11</b>                           |
| <b>Total Kollektive Kapitalanlagen</b>   |         |                                  |           |              |                                  | <b>699'894.55</b>     | <b>0.11</b>                           |
| <b>Total Wertpapiere bewertet aufgrund geeigneten Bewertungsmodellen unter Berücksichtigung der aktuellen Marktgegebenheiten</b>   |         |                                  |           |              |                                  | <b>699'894.55</b>     | <b>0.11</b>                           |
| <b>Derivative Finanzinstrumente</b>  |         |                                  |           |              |                                  |                       |                                       |
| <b>Börsennotierte / an einem geregelten Markt gehandelte Wertpapiere; bewertet zu den Kursen, die am Hauptmarkt bezahlt werden</b> |         |                                  |           |              |                                  |                       |                                       |
| <b>Financial Futures</b>   |         |                                  |           |              |                                  |                       |                                       |
| <b>ENGLISCHES PFUND</b>  |         |                                  |           |              |                                  |                       |                                       |
| FTSE 100 Index -10- 03/23  | GBP     | -45                              | 81        | 36           |                                  |                       |                                       |
| FTSE 100 Index -10- 06/23  | GBP     |                                  | 36        | 36           |                                  |                       |                                       |
| FTSE 100 Index -10- 09/23  | GBP     |                                  | 30        | 30           |                                  |                       |                                       |
| FTSE 100 Index -10- 12/23  | GBP     |                                  | 30        | 30           |                                  |                       |                                       |
| FTSE 100 Index -10- 03/24  | GBP     |                                  | 30        | 30           |                                  |                       |                                       |
|  |         |                                  |           |              |                                  | <b>0.00</b>           | <b>0.00</b>                           |
| <b>EURO</b>  |         |                                  |           |              |                                  |                       |                                       |
| EURO STOXX 50 Index -10- 03/23   | EUR     | -250                             | 265       | 15           |                                  |                       |                                       |
| EURO STOXX 50 Index -10- 06/23   | EUR     |                                  | 130       | 130          |                                  |                       |                                       |
| EURO STOXX 50 Index -10- 09/23   | EUR     |                                  | 160       | 160          |                                  |                       |                                       |
|  |         |                                  |           |              |                                  | <b>0.00</b>           | <b>0.00</b>                           |
| <b>SCHWEIZER FRANKEN</b>   |         |                                  |           |              |                                  |                       |                                       |
| SMI Index -10- 03/23   | CHF     | -100                             | 140       | 40           |                                  |                       |                                       |
| SMI Index -10- 06/23   | CHF     |                                  | 30        | 30           |                                  |                       |                                       |
| SMI Index -10- 09/23   | CHF     |                                  | 37        | 37           |                                  |                       |                                       |
|  |         |                                  |           |              |                                  | <b>0.00</b>           | <b>0.00</b>                           |
| <b>US DOLLAR</b>   |         |                                  |           |              |                                  |                       |                                       |
| S&P E-MINI 500 Index -50- 03/23  | USD     | -70                              | 81        | 11           |                                  |                       |                                       |
| S&P E-MINI 500 Index -50- 06/23  | USD     |                                  | 22        | 22           |                                  |                       |                                       |
| S&P E-MINI 500 Index -50- 09/23  | USD     |                                  | 22        | 22           |                                  |                       |                                       |
|  |         |                                  |           |              |                                  | <b>0.00</b>           | <b>0.00</b>                           |
| <b>Total Financial Futures</b>   |         |                                  |           |              |                                  | <b>0.00</b>           | <b>0.00</b>                           |
| <b>Options</b>   |         |                                  |           |              |                                  |                       |                                       |
| <b>ENGLISCHES PFUND</b>  |         |                                  |           |              |                                  |                       |                                       |
| RIO TINTO (call) -61- 20.01.23   | GBP     | -50                              | 50        |              |                                  |                       |                                       |
|  |         |                                  |           |              |                                  | <b>0.00</b>           | <b>0.00</b>                           |
| <b>EURO</b>  |         |                                  |           |              |                                  |                       |                                       |
| ENDESA (put) -19- 16.06.23   | EUR     | -50                              | 50        |              |                                  |                       |                                       |
|  |         |                                  |           |              |                                  | <b>0.00</b>           | <b>0.00</b>                           |
| <b>KANADISCHER DOLLAR</b>  |         |                                  |           |              |                                  |                       |                                       |
| GREAT WEST LIFECO (call) -36- 17.02.23   | CAD     |                                  | 280       | 280          |                                  |                       |                                       |

| Titelbezeichnung  | Wahrung | 31.12.2022<br>Anzahl/<br>Nominal | Kufe (1) | Verkufe (1) | 31.12.2023<br>Anzahl/<br>Nominal | Kurswert CHF | in % des<br>Gesamtfonds-<br>vermogens |
|---|----------|----------------------------------|-----------|--------------|----------------------------------|--------------|--|
| POWER CORP OF CANADA (call) -37- 17.02.23               | CAD      |                                  | 170       | 170          |                                  |              |  |
|   |          |                                  |           |              |                                  | 0.00         | 0.00                                   |
| <b>SCHWEIZER FRANKEN</b>                                |          |                                  |           |              |                                  |              |  |
| EUREX FRANKFURT AKTIENGESELLSCHAFT (call) -94- 20.10.23 | CHF      |                                  | 370       | 370          |                                  |              |  |
| EUREX FRANKFURT AKTIENGESELLSCHAFT (put) -86- 20.10.23  | CHF      |                                  | 370       | 370          |                                  |              |  |
| NESTLE reg (call) -102- 17.11.23                        | CHF      |                                  | 330       | 330          |                                  |              |  |
| NESTLE reg (call) -102- 19.01.24                        | CHF      |                                  |           | 340          | -340                             | -3'740.00    | 0.00                                   |
| NESTLE reg (call) -103- 15.12.23                        | CHF      |                                  | 330       | 330          |                                  |              |  |
| NESTLE reg (call) -108- 25.08.23                        | CHF      |                                  | 330       | 330          |                                  |              |  |
| NESTLE reg (call) -112- 20.01.23                        | CHF      | -360                             | 360       |              |                                  |              |  |
| NESTLE reg (call) -112- 20.10.23                        | CHF      |                                  | 320       | 320          |                                  |              |  |
| NESTLE reg (call) -112- 21.07.23                        | CHF      |                                  | 330       | 330          |                                  |              |  |
| NESTLE reg (call) -114- 21.04.23                        | CHF      |                                  | 340       | 340          |                                  |              |  |
| NESTLE reg (call) -116- 17.03.23                        | CHF      |                                  | 370       | 370          |                                  |              |  |
| NESTLE reg (call) -122- 16.06.23                        | CHF      |                                  | 320       | 320          |                                  |              |  |
| NESTLE reg (put) -102- 20.10.23                         | CHF      |                                  | 320       | 320          |                                  |              |  |
| NESTLE reg (put) -102- 25.08.23                         | CHF      |                                  | 330       | 330          |                                  |              |  |
| NESTLE reg (put) -104- 20.01.23                         | CHF      | -360                             | 360       |              |                                  |              |  |
| NESTLE reg (put) -104- 21.04.23                         | CHF      |                                  | 340       | 340          |                                  |              |  |
| NESTLE reg (put) -104- 21.07.23                         | CHF      |                                  | 330       | 330          |                                  |              |  |
| NESTLE reg (put) -105- 17.03.23                         | CHF      |                                  | 370       | 370          |                                  |              |  |
| NESTLE reg (put) -108- 16.06.23                         | CHF      |                                  | 320       | 320          |                                  |              |  |
| NESTLE reg (put) -92- 19.01.24                          | CHF      |                                  |           | 340          | -340                             | -5'100.00    | 0.00                                   |
| NESTLE reg (put) -94- 17.11.23                          | CHF      |                                  | 330       | 330          |                                  |              |  |
| NESTLE reg (put) -97- 15.12.23                          | CHF      |                                  | 330       | 330          |                                  |              |  |
| NOVARTIS reg (call) -78- 21.04.23                       | CHF      |                                  | 490       | 490          |                                  |              |  |
| NOVARTIS reg (call) -87- 17.03.23                       | CHF      |                                  | 480       | 480          |                                  |              |  |
| NOVARTIS reg (call) -88- 19.01.24                       | CHF      |                                  |           | 390          | -390                             | -8'190.00    | 0.00                                   |
| NOVARTIS reg (call) -88- 20.01.23                       | CHF      | -460                             | 460       |              |                                  |              |  |
| NOVARTIS reg (call) -89- 15.12.23                       | CHF      |                                  | 380       | 380          |                                  |              |  |
| NOVARTIS reg (call) -89- 17.11.23                       | CHF      |                                  | 370       | 370          |                                  |              |  |
| NOVARTIS reg (call) -93- 21.07.23                       | CHF      |                                  | 390       | 390          |                                  |              |  |
| NOVARTIS reg (call) -93- 25.08.23                       | CHF      |                                  | 390       | 390          |                                  |              |  |
| NOVARTIS reg (call) -97- 16.06.23                       | CHF      |                                  | 390       | 390          |                                  |              |  |
| NOVARTIS reg (put) -72- 21.04.23                        | CHF      |                                  | 490       | 490          |                                  |              |  |
| NOVARTIS reg (put) -79- 17.03.23                        | CHF      |                                  | 480       | 480          |                                  |              |  |
| NOVARTIS reg (put) -80- 19.01.24                        | CHF      |                                  |           | 390          | -390                             | -4'680.00    | 0.00                                   |
| NOVARTIS reg (put) -81- 20.01.23                        | CHF      | -460                             | 460       |              |                                  |              |  |
| NOVARTIS reg (put) -82- 17.11.23                        | CHF      |                                  | 370       | 370          |                                  |              |  |
| NOVARTIS reg (put) -83- 15.12.23                        | CHF      |                                  | 380       | 380          |                                  |              |  |
| NOVARTIS reg (put) -87- 16.06.23                        | CHF      |                                  | 390       | 390          |                                  |              |  |
| NOVARTIS reg (put) -87- 21.07.23                        | CHF      |                                  | 390       | 390          |                                  |              |  |
| NOVARTIS reg (put) -87- 25.08.23                        | CHF      |                                  | 390       | 390          |                                  |              |  |
| ROCHE HOLDING cert (call) -245- 15.12.23                | CHF      |                                  | 140       | 140          |                                  |              |  |
| ROCHE HOLDING cert (call) -245- 17.11.23                | CHF      |                                  | 140       | 140          |                                  |              |  |
| ROCHE HOLDING cert (call) -255- 19.01.24                | CHF      |                                  |           | 140          | -140                             | -9'240.00    | 0.00                                   |
| ROCHE HOLDING cert (call) -270- 20.10.23                | CHF      |                                  | 130       | 130          |                                  |              |  |
| ROCHE HOLDING cert (call) -270- 21.04.23                | CHF      |                                  | 150       | 150          |                                  |              |  |
| ROCHE HOLDING cert (call) -285- 21.07.23                | CHF      |                                  | 130       | 130          |                                  |              |  |
| ROCHE HOLDING cert (call) -285- 25.08.23                | CHF      |                                  | 130       | 130          |                                  |              |  |
| ROCHE HOLDING cert (call) -295- 16.06.23                | CHF      |                                  | 130       | 130          |                                  |              |  |
| ROCHE HOLDING cert (call) -305- 17.03.23                | CHF      |                                  | 140       | 140          |                                  |              |  |
| ROCHE HOLDING cert (call) -315- 20.01.23                | CHF      | -130                             | 130       |              |                                  |              |  |
| ROCHE HOLDING cert (put) -225- 17.11.23                 | CHF      |                                  | 140       | 140          |                                  |              |  |
| ROCHE HOLDING cert (put) -230- 15.12.23                 | CHF      |                                  | 140       | 140          |                                  |              |  |
| ROCHE HOLDING cert (put) -230- 19.01.24                 | CHF      |                                  |           | 140          | -140                             | -4'480.00    | 0.00                                   |
| ROCHE HOLDING cert (put) -250- 20.10.23                 | CHF      |                                  | 130       | 130          |                                  |              |  |
| ROCHE HOLDING cert (put) -250- 21.04.23                 | CHF      |                                  | 150       | 150          |                                  |              |  |
| ROCHE HOLDING cert (put) -260- 25.08.23                 | CHF      |                                  | 260       | 260          |                                  |              |  |
| ROCHE HOLDING cert (put) -265- 16.06.23                 | CHF      |                                  | 130       | 130          |                                  |              |  |
| ROCHE HOLDING cert (put) -265- 21.07.23                 | CHF      |                                  | 130       | 130          |                                  |              |  |
| ROCHE HOLDING cert (put) -275- 17.03.23                 | CHF      |                                  | 140       | 140          |                                  |              |  |
| ROCHE HOLDING cert (put) -290- 20.01.23                 | CHF      | -130                             | 130       |              |                                  |              |  |
| SWISS LIFE HOLDING reg (call) -570- 17.02.23            | CHF      |                                  | 20        | 20           |                                  |              |  |
| SWISS REINSURANCE reg (call) -92- 20.01.23              | CHF      | -413                             | 413       |              |                                  |              |  |



Jahresbericht per 31. Dezember 2023

| Titelbezeichnung   | Währung | 31.12.2022<br>Anzahl/<br>Nominal | Käufe (1) | Verkäufe (1) | 31.12.2023<br>Anzahl/<br>Nominal | Kurswert CHF          | in % des<br>Gesamtfonds-<br>vermögens |
|--|---------|----------------------------------|-----------|--------------|----------------------------------|-----------------------|---------------------------------------|
|  |         |                                  |           |              |                                  | -35'430.00            | -0.01                                 |
| <b>US DOLLAR</b>   |         |                                  |           |              |                                  |                       |                                       |
| NVIDIA (call) -210- 17.02.23   | USD     |                                  | 10        | 10           |                                  | 0.00                  | 0.00                                  |
| <b>Total Options</b>   |         |                                  |           |              |                                  | -35'430.00            | -0.01                                 |
| <b>Total Börsennotierte / an einem geregelten Markt gehandelte Wertpapiere; bewertet zu den Kursen, die am Hauptmarkt bezahlt werden</b> |         |                                  |           |              |                                  | -35'430.00            | -0.01                                 |
| <b>Wertpapiere bewertet aufgrund von am Markt beobachtbaren Parametern</b>   |         |                                  |           |              |                                  |                       |                                       |
| <b>Devisentermingeschäfte</b>  |         |                                  |           |              |                                  |                       |                                       |
| Devisentermingeschäfte (siehe Liste)   |         |                                  |           |              |                                  | 10'877'787.57         | 1.66                                  |
| <b>Total Devisentermingeschäfte</b>  |         |                                  |           |              |                                  | <b>10'877'787.57</b>  | <b>1.66</b>                           |
| <b>Total Wertpapiere bewertet aufgrund von am Markt beobachtbaren Parametern</b>   |         |                                  |           |              |                                  | <b>10'877'787.57</b>  | <b>1.66</b>                           |
| <b>Total Derivative Finanzinstrumente</b>  |         |                                  |           |              |                                  | <b>10'842'357.57</b>  | <b>1.66</b>                           |
| <b>Total Anlagen</b>   |         |                                  |           |              |                                  | <b>647'099'290.61</b> | <b>98.85</b>                          |
| Bankguthaben auf Sicht   |         |                                  |           |              |                                  | 4'087'355.90          | 0.62                                  |
| Bankguthaben auf Zeit  |         |                                  |           |              |                                  | 0.00                  | 0.00                                  |
| Sonstige Vermögenswerte  |         |                                  |           |              |                                  | 3'448'540.73          | 0.53                                  |
| <b>Gesamtfondsvermögen (GFV)</b>   |         |                                  |           |              |                                  | <b>654'635'187.24</b> | <b>100.00</b>                         |
| ./. Bankverbindlichkeiten  |         |                                  |           |              |                                  | 0.00                  | 0.00                                  |
| ./. Andere Verbindlichkeiten   |         |                                  |           |              |                                  | 767'584.89            | 0.12                                  |
| ./. Andere Kredite   |         |                                  |           |              |                                  | 0.00                  | 0.00                                  |
| <b>Nett fondsvermögen</b>  |         |                                  |           |              |                                  | <b>653'867'602.35</b> | <b>99.88</b>                          |

(1) Umfassen auch Corporate Actions

## Summarische Gliederung des Portefeuilles gemäss KKV FINMA Art. 84 Absatz 2

| Anlagekategorien   | Kurswert CHF          | in % des<br>Gesamtfonds-<br>vermögens |
|--|-----------------------|---------------------------------------|
| <b>Börsennotierte / an einem geregelten Markt gehandelte Wertpapiere; bewertet zu den Kursen, die am Hauptmarkt bezahlt werden</b> | <b>379'209'116.97</b> | <b>57.93</b>                          |
| <b>Wertpapiere bewertet aufgrund von am Markt beobachtbaren Parametern</b>   | <b>267'190'279.09</b> | <b>40.82</b>                          |
| <b>Wertpapiere bewertet aufgrund geeigneten Bewertungsmodellen unter Berücksichtigung der aktuellen Marktgegebenheiten</b>         | <b>699'894.55</b>     | <b>0.11</b>                           |

## Aufstellung der Devisentermingeschäfte für die Zeit vom 1. Januar 2023 bis zum 31. Dezember 2023

| Fälligkeit | Transaktion | Währung | Betrag      | Gegen | Gegenwert   | Devisengewinn/-verlust<br>Mandatswährung | in % des GFV |
|------------|-------------|---------|-------------|-------|-------------|--|--------------|
| 10.01.2023 | Bought      | CHF     | 804'319     | EUR   | 818'500     | 0.00                                     | 0.00         |
| 10.01.2023 | Bought      | CHF     | 81'738      | EUR   | 82'900      | 0.00                                     | 0.00         |
| 10.01.2023 | Bought      | EUR     | 18'744'100  | CHF   | 18'480'427  | 0.00                                     | 0.00         |
| 10.01.2023 | Bought      | EUR     | 500         | CHF   | 495         | 0.00                                     | 0.00         |
| 25.01.2023 | Bought      | CHF     | 5'024       | EUR   | 5'100       | 0.00                                     | 0.00         |
| 25.01.2023 | Bought      | CHF     | 5'905       | EUR   | 5'900       | 0.00                                     | 0.00         |
| 25.01.2023 | Bought      | EUR     | 18'494'800  | CHF   | 18'200'918  | 0.00                                     | 0.00         |
| 25.01.2023 | Bought      | EUR     | 776'900     | CHF   | 766'572     | 0.00                                     | 0.00         |
| 25.01.2023 | Bought      | EUR     | 818'700     | CHF   | 821'121     | 0.00                                     | 0.00         |
| 25.01.2023 | Bought      | EUR     | 1'000       | CHF   | 990         | 0.00                                     | 0.00         |
| 09.02.2023 | Bought      | AUD     | 4'550'000   | CHF   | 2'950'739   | 0.00                                     | 0.00         |
| 09.02.2023 | Bought      | CAD     | 1'200'000   | CHF   | 811'265     | 0.00                                     | 0.00         |
| 09.02.2023 | Bought      | CAD     | 1'100'000   | CHF   | 744'579     | 0.00                                     | 0.00         |
| 09.02.2023 | Bought      | CHF     | 15'694'133  | AUD   | 24'700'000  | 0.00                                     | 0.00         |
| 09.02.2023 | Bought      | CHF     | 3'149'550   | AUD   | 5'000'000   | 0.00                                     | 0.00         |
| 09.02.2023 | Bought      | CHF     | 14'896'594  | CAD   | 20'540'000  | 0.00                                     | 0.00         |
| 09.02.2023 | Bought      | CHF     | 36'910'273  | EUR   | 37'470'000  | 0.00                                     | 0.00         |
| 09.02.2023 | Bought      | CHF     | 3'167'046   | EUR   | 3'200'000   | 0.00                                     | 0.00         |
| 09.02.2023 | Bought      | CHF     | 101'401     | EUR   | 101'400     | 0.00                                     | 0.00         |
| 09.02.2023 | Bought      | CHF     | 86'003      | EUR   | 85'700      | 0.00                                     | 0.00         |
| 09.02.2023 | Bought      | CHF     | 1'553'549   | GBP   | 1'400'000   | 0.00                                     | 0.00         |
| 09.02.2023 | Bought      | CHF     | 1'891'741   | GBP   | 1'700'000   | 0.00                                     | 0.00         |
| 09.02.2023 | Bought      | CHF     | 20'135'487  | GBP   | 17'885'000  | 0.00                                     | 0.00         |
| 09.02.2023 | Bought      | CHF     | 1'480'050   | GBP   | 1'300'000   | 0.00                                     | 0.00         |
| 09.02.2023 | Bought      | CHF     | 4'004'936   | NOK   | 42'000'000  | 0.00                                     | 0.00         |
| 09.02.2023 | Bought      | CHF     | 189'607'700 | USD   | 193'700'000 | 0.00                                     | 0.00         |
| 09.02.2023 | Bought      | CHF     | 3'725'064   | USD   | 4'000'000   | 0.00                                     | 0.00         |
| 09.02.2023 | Bought      | CHF     | 10'985'388  | USD   | 12'000'000  | 0.00                                     | 0.00         |
| 09.02.2023 | Bought      | EUR     | 500         | CHF   | 499         | 0.00                                     | 0.00         |



## Aufstellung der Devisentermingeschäfte für die Zeit vom 1. Januar 2023 bis zum 31. Dezember 2023

| Fälligkeit | Transaktion | Währung | Betrag      | Gegen | Gegenwert   | Devisengewinn/-verlust<br>Mandatswährung | in % des GFV |
|------------|-------------|---------|-------------|-------|-------------|--|--------------|
| 09.02.2023 | Bought      | EUR     | 17'843'200  | CHF   | 17'606'332  | 0.00                                     | 0.00         |
| 09.02.2023 | Bought      | EUR     | 1'114'400   | CHF   | 1'115'880   | 0.00                                     | 0.00         |
| 09.02.2023 | Bought      | EUR     | 3'500'000   | CHF   | 3'490'372   | 0.00                                     | 0.00         |
| 09.02.2023 | Bought      | USD     | 4'500'000   | CHF   | 4'375'070   | 0.00                                     | 0.00         |
| 09.02.2023 | Bought      | USD     | 800'000     | CHF   | 743'081     | 0.00                                     | 0.00         |
| 09.02.2023 | Bought      | USD     | 1'000'000   | CHF   | 923'433     | 0.00                                     | 0.00         |
| 09.02.2023 | Bought      | USD     | 6'500'000   | CHF   | 5'999'610   | 0.00                                     | 0.00         |
| 09.02.2023 | Bought      | USD     | 4'300'000   | CHF   | 3'953'970   | 0.00                                     | 0.00         |
| 24.02.2023 | Bought      | CHF     | 1'205'671   | EUR   | 1'221'700   | 0.00                                     | 0.00         |
| 24.02.2023 | Bought      | CHF     | 30'631      | EUR   | 31'000      | 0.00                                     | 0.00         |
| 24.02.2023 | Bought      | CHF     | 36'119      | EUR   | 36'600      | 0.00                                     | 0.00         |
| 24.02.2023 | Bought      | CHF     | 26'880      | EUR   | 27'300      | 0.00                                     | 0.00         |
| 24.02.2023 | Bought      | CHF     | 135'993     | EUR   | 137'700     | 0.00                                     | 0.00         |
| 24.02.2023 | Bought      | CHF     | 382'345     | EUR   | 386'100     | 0.00                                     | 0.00         |
| 24.02.2023 | Bought      | EUR     | 18'957'700  | CHF   | 18'970'155  | 0.00                                     | 0.00         |
| 24.02.2023 | Bought      | EUR     | 135'600     | CHF   | 133'848     | 0.00                                     | 0.00         |
| 24.02.2023 | Bought      | EUR     | 71'900      | CHF   | 70'902      | 0.00                                     | 0.00         |
| 09.03.2023 | Bought      | CHF     | 38'037      | EUR   | 38'100      | 0.00                                     | 0.00         |
| 09.03.2023 | Bought      | EUR     | 500         | CHF   | 500         | 0.00                                     | 0.00         |
| 09.03.2023 | Bought      | EUR     | 18'744'300  | CHF   | 18'565'892  | 0.00                                     | 0.00         |
| 09.03.2023 | Bought      | EUR     | 16'300      | CHF   | 16'052      | 0.00                                     | 0.00         |
| 23.03.2023 | Bought      | CHF     | 244'010     | EUR   | 245'300     | 0.00                                     | 0.00         |
| 23.03.2023 | Bought      | CHF     | 11'423      | EUR   | 11'500      | 0.00                                     | 0.00         |
| 23.03.2023 | Bought      | CHF     | 73'395      | EUR   | 74'100      | 0.00                                     | 0.00         |
| 23.03.2023 | Bought      | CHF     | 771'806     | EUR   | 789'000     | 0.00                                     | 0.00         |
| 23.03.2023 | Bought      | CHF     | 20'035      | EUR   | 20'300      | 0.00                                     | 0.00         |
| 23.03.2023 | Bought      | CHF     | 35'972      | EUR   | 36'400      | 0.00                                     | 0.00         |
| 23.03.2023 | Bought      | EUR     | 17'324'800  | CHF   | 17'076'484  | 0.00                                     | 0.00         |
| 23.03.2023 | Bought      | EUR     | 200         | CHF   | 199         | 0.00                                     | 0.00         |
| 23.03.2023 | Bought      | EUR     | 699'000     | CHF   | 693'873     | 0.00                                     | 0.00         |
| 11.04.2023 | Bought      | EUR     | 60'544      | CHF   | 59'961      | 0.00                                     | 0.00         |
| 13.04.2023 | Bought      | CHF     | 108'962     | EUR   | 109'600     | 0.00                                     | 0.00         |
| 13.04.2023 | Bought      | CHF     | 20'098      | EUR   | 20'200      | 0.00                                     | 0.00         |
| 13.04.2023 | Bought      | CHF     | 8'948       | EUR   | 9'000       | 0.00                                     | 0.00         |
| 13.04.2023 | Bought      | CHF     | 50'731      | EUR   | 50'900      | 0.00                                     | 0.00         |
| 13.04.2023 | Bought      | CHF     | 30'046      | EUR   | 30'200      | 0.00                                     | 0.00         |
| 13.04.2023 | Bought      | CHF     | 14'027      | EUR   | 14'100      | 0.00                                     | 0.00         |
| 13.04.2023 | Bought      | CHF     | 293'227     | EUR   | 294'700     | 0.00                                     | 0.00         |
| 13.04.2023 | Bought      | CHF     | 59'019      | EUR   | 59'600      | 0.00                                     | 0.00         |
| 13.04.2023 | Bought      | EUR     | 18'024'000  | CHF   | 17'874'779  | 0.00                                     | 0.00         |
| 26.04.2023 | Bought      | EUR     | 16'778'300  | CHF   | 16'664'728  | 0.00                                     | 0.00         |
| 26.04.2023 | Bought      | EUR     | 328'700     | CHF   | 324'204     | 0.00                                     | 0.00         |
| 10.05.2023 | Bought      | CHF     | 78'734      | EUR   | 80'400      | 0.00                                     | 0.00         |
| 10.05.2023 | Bought      | CHF     | 174'939     | EUR   | 178'500     | 0.00                                     | 0.00         |
| 10.05.2023 | Bought      | CHF     | 192'863     | EUR   | 196'400     | 0.00                                     | 0.00         |
| 10.05.2023 | Bought      | CHF     | 147'236     | EUR   | 150'500     | 0.00                                     | 0.00         |
| 10.05.2023 | Bought      | CHF     | 349'332     | EUR   | 355'500     | 0.00                                     | 0.00         |
| 10.05.2023 | Bought      | CHF     | 159'631     | EUR   | 161'800     | 0.00                                     | 0.00         |
| 10.05.2023 | Bought      | CHF     | 64'729      | EUR   | 66'000      | 0.00                                     | 0.00         |
| 10.05.2023 | Bought      | EUR     | 500         | CHF   | 492         | 0.00                                     | 0.00         |
| 10.05.2023 | Bought      | EUR     | 1'000       | CHF   | 982         | 0.00                                     | 0.00         |
| 10.05.2023 | Bought      | EUR     | 17'107'000  | CHF   | 16'860'437  | 0.00                                     | 0.00         |
| 10.05.2023 | Bought      | EUR     | 581'300     | CHF   | 572'528     | 0.00                                     | 0.00         |
| 12.05.2023 | Bought      | AUD     | 400'000     | CHF   | 242'984     | 0.00                                     | 0.00         |
| 12.05.2023 | Bought      | AUD     | 400'000     | CHF   | 236'381     | 0.00                                     | 0.00         |
| 12.05.2023 | Bought      | AUD     | 1'750'000   | CHF   | 1'055'229   | 0.00                                     | 0.00         |
| 12.05.2023 | Bought      | CAD     | 1'500'000   | CHF   | 1'005'218   | 0.00                                     | 0.00         |
| 12.05.2023 | Bought      | CHF     | 16'056'942  | AUD   | 25'150'000  | 0.00                                     | 0.00         |
| 12.05.2023 | Bought      | CHF     | 12'476'069  | CAD   | 18'240'000  | 0.00                                     | 0.00         |
| 12.05.2023 | Bought      | CHF     | 1'495'553   | CAD   | 2'200'000   | 0.00                                     | 0.00         |
| 12.05.2023 | Bought      | CHF     | 36'726'711  | EUR   | 37'170'000  | 0.00                                     | 0.00         |
| 12.05.2023 | Bought      | CHF     | 24'605'960  | GBP   | 22'285'000  | 0.00                                     | 0.00         |
| 12.05.2023 | Bought      | CHF     | 3'744'985   | NOK   | 42'000'000  | 0.00                                     | 0.00         |
| 12.05.2023 | Bought      | CHF     | 176'553'146 | USD   | 192'600'000 | 0.00                                     | 0.00         |
| 12.05.2023 | Bought      | CHF     | 2'987'494   | USD   | 3'250'000   | 0.00                                     | 0.00         |
| 12.05.2023 | Bought      | EUR     | 4'500'000   | CHF   | 4'452'754   | 0.00                                     | 0.00         |
| 12.05.2023 | Bought      | EUR     | 1'000'000   | CHF   | 995'133     | 0.00                                     | 0.00         |
| 12.05.2023 | Bought      | GBP     | 400'000     | CHF   | 444'206     | 0.00                                     | 0.00         |
| 12.05.2023 | Bought      | GBP     | 500'000     | CHF   | 561'161     | 0.00                                     | 0.00         |

## Aufstellung der Devisentermingeschäfte für die Zeit vom 1. Januar 2023 bis zum 31. Dezember 2023

| Fälligkeit | Transaktion | Währung | Betrag      | Gegen | Gegenwert   | Devisengewinn/-verlust<br>Mandatswährung | in % des GFV |
|------------|-------------|---------|-------------|-------|-------------|--|--------------|
| 12.05.2023 | Bought      | GBP     | 1'800'000   | CHF   | 2'018'286   | 0.00                                     | 0.00         |
| 12.05.2023 | Bought      | GBP     | 650'000     | CHF   | 734'683     | 0.00                                     | 0.00         |
| 12.05.2023 | Bought      | GBP     | 250'000     | CHF   | 277'062     | 0.00                                     | 0.00         |
| 12.05.2023 | Bought      | USD     | 1'000'000   | CHF   | 910'748     | 0.00                                     | 0.00         |
| 12.05.2023 | Bought      | USD     | 1'500'000   | CHF   | 1'365'951   | 0.00                                     | 0.00         |
| 12.05.2023 | Bought      | USD     | 1'500'000   | CHF   | 1'355'765   | 0.00                                     | 0.00         |
| 12.05.2023 | Bought      | USD     | 2'000'000   | CHF   | 1'779'154   | 0.00                                     | 0.00         |
| 12.05.2023 | Bought      | USD     | 750'000     | CHF   | 668'066     | 0.00                                     | 0.00         |
| 24.05.2023 | Bought      | CHF     | 55'958      | EUR   | 57'200      | 0.00                                     | 0.00         |
| 24.05.2023 | Bought      | CHF     | 5'742       | EUR   | 5'900       | 0.00                                     | 0.00         |
| 24.05.2023 | Bought      | EUR     | 17'107'000  | CHF   | 16'711'093  | 0.00                                     | 0.00         |
| 24.05.2023 | Bought      | EUR     | 171'000     | CHF   | 167'491     | 0.00                                     | 0.00         |
| 09.06.2023 | Bought      | CHF     | 8'564       | EUR   | 8'800       | 0.00                                     | 0.00         |
| 09.06.2023 | Bought      | CHF     | 38'104      | EUR   | 39'300      | 0.00                                     | 0.00         |
| 09.06.2023 | Bought      | CHF     | 39'161      | EUR   | 40'400      | 0.00                                     | 0.00         |
| 09.06.2023 | Bought      | CHF     | 16'206      | EUR   | 16'700      | 0.00                                     | 0.00         |
| 09.06.2023 | Bought      | EUR     | 200         | CHF   | 194         | 0.00                                     | 0.00         |
| 09.06.2023 | Bought      | EUR     | 16'500'700  | CHF   | 16'150'539  | 0.00                                     | 0.00         |
| 09.06.2023 | Bought      | EUR     | 361'500     | CHF   | 349'995     | 0.00                                     | 0.00         |
| 09.06.2023 | Bought      | EUR     | 101'900     | CHF   | 99'051      | 0.00                                     | 0.00         |
| 26.06.2023 | Bought      | CHF     | 62'446      | EUR   | 64'300      | 0.00                                     | 0.00         |
| 26.06.2023 | Bought      | CHF     | 33'923      | EUR   | 35'000      | 0.00                                     | 0.00         |
| 26.06.2023 | Bought      | CHF     | 12'223      | EUR   | 12'500      | 0.00                                     | 0.00         |
| 26.06.2023 | Bought      | EUR     | 1'000       | CHF   | 979         | 0.00                                     | 0.00         |
| 26.06.2023 | Bought      | EUR     | 16'853'400  | CHF   | 16'301'923  | 0.00                                     | 0.00         |
| 26.06.2023 | Bought      | EUR     | 2'900       | CHF   | 2'810       | 0.00                                     | 0.00         |
| 26.06.2023 | Bought      | EUR     | 152'100     | CHF   | 148'243     | 0.00                                     | 0.00         |
| 11.07.2023 | Bought      | CHF     | 1'473       | EUR   | 1'500       | 0.00                                     | 0.00         |
| 11.07.2023 | Bought      | CHF     | 14'476      | EUR   | 14'800      | 0.00                                     | 0.00         |
| 11.07.2023 | Bought      | CHF     | 46'408      | EUR   | 47'500      | 0.00                                     | 0.00         |
| 11.07.2023 | Bought      | CHF     | 26'844      | EUR   | 27'500      | 0.00                                     | 0.00         |
| 11.07.2023 | Bought      | CHF     | 217'774     | EUR   | 222'400     | 0.00                                     | 0.00         |
| 11.07.2023 | Bought      | EUR     | 16'856'300  | CHF   | 16'321'214  | 0.00                                     | 0.00         |
| 11.07.2023 | Bought      | EUR     | 8'800       | CHF   | 8'642       | 0.00                                     | 0.00         |
| 11.07.2023 | Bought      | EUR     | 10'500      | CHF   | 10'270      | 0.00                                     | 0.00         |
| 25.07.2023 | Bought      | CHF     | 13'745      | EUR   | 14'100      | 0.00                                     | 0.00         |
| 25.07.2023 | Bought      | CHF     | 594'626     | EUR   | 610'600     | 0.00                                     | 0.00         |
| 25.07.2023 | Bought      | CHF     | 8'133       | EUR   | 8'400       | 0.00                                     | 0.00         |
| 25.07.2023 | Bought      | CHF     | 46'949      | EUR   | 48'600      | 0.00                                     | 0.00         |
| 25.07.2023 | Bought      | CHF     | 16'972      | EUR   | 17'600      | 0.00                                     | 0.00         |
| 25.07.2023 | Bought      | EUR     | 16'865'100  | CHF   | 16'549'672  | 0.00                                     | 0.00         |
| 10.08.2023 | Bought      | CHF     | 13'500'765  | AUD   | 22'600'000  | 0.00                                     | 0.00         |
| 10.08.2023 | Bought      | CHF     | 1'643'412   | AUD   | 2'800'000   | 0.00                                     | 0.00         |
| 10.08.2023 | Bought      | CHF     | 12'491'593  | CAD   | 18'940'000  | 0.00                                     | 0.00         |
| 10.08.2023 | Bought      | CHF     | 677'249     | CAD   | 1'000'000   | 0.00                                     | 0.00         |
| 10.08.2023 | Bought      | CHF     | 29'587'589  | EUR   | 30'470'000  | 0.00                                     | 0.00         |
| 10.08.2023 | Bought      | CHF     | 4'942'787   | EUR   | 5'100'000   | 0.00                                     | 0.00         |
| 10.08.2023 | Bought      | CHF     | 1'449'867   | EUR   | 1'500'000   | 0.00                                     | 0.00         |
| 10.08.2023 | Bought      | CHF     | 686'476     | EUR   | 700'000     | 0.00                                     | 0.00         |
| 10.08.2023 | Bought      | CHF     | 63'176      | EUR   | 66'200      | 0.00                                     | 0.00         |
| 10.08.2023 | Bought      | CHF     | 10'257      | EUR   | 10'700      | 0.00                                     | 0.00         |
| 10.08.2023 | Bought      | CHF     | 72'071      | EUR   | 75'300      | 0.00                                     | 0.00         |
| 10.08.2023 | Bought      | CHF     | 20'838'091  | GBP   | 18'685'000  | 0.00                                     | 0.00         |
| 10.08.2023 | Bought      | CHF     | 3'522'255   | NOK   | 42'000'000  | 0.00                                     | 0.00         |
| 10.08.2023 | Bought      | CHF     | 166'695'999 | USD   | 189'100'000 | 0.00                                     | 0.00         |
| 10.08.2023 | Bought      | CHF     | 3'295'656   | USD   | 3'700'000   | 0.00                                     | 0.00         |
| 10.08.2023 | Bought      | CHF     | 899'925     | USD   | 1'050'000   | 0.00                                     | 0.00         |
| 10.08.2023 | Bought      | CHF     | 3'236'595   | USD   | 3'750'000   | 0.00                                     | 0.00         |
| 10.08.2023 | Bought      | EUR     | 16'561'900  | CHF   | 16'114'166  | 0.00                                     | 0.00         |
| 10.08.2023 | Bought      | EUR     | 950'000     | CHF   | 916'240     | 0.00                                     | 0.00         |
| 10.08.2023 | Bought      | EUR     | 67'400      | CHF   | 64'898      | 0.00                                     | 0.00         |
| 10.08.2023 | Bought      | EUR     | 3'200'000   | CHF   | 3'067'771   | 0.00                                     | 0.00         |
| 10.08.2023 | Bought      | EUR     | 628'800     | CHF   | 601'776     | 0.00                                     | 0.00         |
| 10.08.2023 | Bought      | EUR     | 3'000'000   | CHF   | 2'879'586   | 0.00                                     | 0.00         |
| 10.08.2023 | Bought      | GBP     | 700'000     | CHF   | 795'802     | 0.00                                     | 0.00         |
| 10.08.2023 | Bought      | USD     | 1'000'000   | CHF   | 887'905     | 0.00                                     | 0.00         |
| 10.08.2023 | Bought      | USD     | 400'000     | CHF   | 351'428     | 0.00                                     | 0.00         |
| 24.08.2023 | Bought      | CHF     | 344'715     | EUR   | 359'900     | 0.00                                     | 0.00         |
| 24.08.2023 | Bought      | CHF     | 52'021      | EUR   | 54'300      | 0.00                                     | 0.00         |

## Aufstellung der Devisentermingeschäfte für die Zeit vom 1. Januar 2023 bis zum 31. Dezember 2023

| Fälligkeit | Transaktion | Währung | Betrag      | Gegen | Gegenwert   | Devisengewinn/-verlust<br>Mandatswährung | in % des GFV |
|------------|-------------|---------|-------------|-------|-------------|--|--------------|
| 24.08.2023 | Bought      | CHF     | 4'777       | EUR   | 5'000       | 0.00                                     | 0.00         |
| 24.08.2023 | Bought      | EUR     | 1'000       | CHF   | 957         | 0.00                                     | 0.00         |
| 24.08.2023 | Bought      | EUR     | 16'165'800  | CHF   | 15'551'661  | 0.00                                     | 0.00         |
| 24.08.2023 | Bought      | EUR     | 470'100     | CHF   | 451'018     | 0.00                                     | 0.00         |
| 11.09.2023 | Bought      | CHF     | 4'782       | EUR   | 5'000       | 0.00                                     | 0.00         |
| 11.09.2023 | Bought      | CHF     | 11'767      | EUR   | 12'300      | 0.00                                     | 0.00         |
| 11.09.2023 | Bought      | EUR     | 200         | CHF   | 190         | 0.00                                     | 0.00         |
| 11.09.2023 | Bought      | EUR     | 16'636'000  | CHF   | 15'943'876  | 0.00                                     | 0.00         |
| 11.09.2023 | Bought      | EUR     | 3'200       | CHF   | 3'058       | 0.00                                     | 0.00         |
| 25.09.2023 | Bought      | CHF     | 202'498     | EUR   | 212'100     | 0.00                                     | 0.00         |
| 25.09.2023 | Bought      | CHF     | 7'727       | EUR   | 8'100       | 0.00                                     | 0.00         |
| 25.09.2023 | Bought      | CHF     | 15'202      | EUR   | 15'900      | 0.00                                     | 0.00         |
| 25.09.2023 | Bought      | CHF     | 103'023     | EUR   | 107'500     | 0.00                                     | 0.00         |
| 25.09.2023 | Bought      | CHF     | 15'047      | EUR   | 15'700      | 0.00                                     | 0.00         |
| 25.09.2023 | Bought      | CHF     | 5'161       | EUR   | 5'400       | 0.00                                     | 0.00         |
| 25.09.2023 | Bought      | CHF     | 47'106      | EUR   | 49'100      | 0.00                                     | 0.00         |
| 25.09.2023 | Bought      | EUR     | 1'000       | CHF   | 956         | 0.00                                     | 0.00         |
| 25.09.2023 | Bought      | EUR     | 16'217'700  | CHF   | 15'499'159  | 0.00                                     | 0.00         |
| 25.09.2023 | Bought      | EUR     | 185'700     | CHF   | 177'180     | 0.00                                     | 0.00         |
| 10.10.2023 | Bought      | CHF     | 5'749       | EUR   | 6'000       | 0.00                                     | 0.00         |
| 10.10.2023 | Bought      | CHF     | 27'707      | EUR   | 28'700      | 0.00                                     | 0.00         |
| 10.10.2023 | Bought      | CHF     | 148'266     | EUR   | 153'400     | 0.00                                     | 0.00         |
| 10.10.2023 | Bought      | CHF     | 192'585     | EUR   | 199'800     | 0.00                                     | 0.00         |
| 10.10.2023 | Bought      | CHF     | 23'660      | EUR   | 24'500      | 0.00                                     | 0.00         |
| 10.10.2023 | Bought      | EUR     | 16'403'500  | CHF   | 15'637'046  | 0.00                                     | 0.00         |
| 10.10.2023 | Bought      | EUR     | 3'100       | CHF   | 2'998       | 0.00                                     | 0.00         |
| 24.10.2023 | Bought      | CHF     | 51'587      | EUR   | 53'600      | 0.00                                     | 0.00         |
| 24.10.2023 | Bought      | CHF     | 526'834     | EUR   | 547'400     | 0.00                                     | 0.00         |
| 24.10.2023 | Bought      | CHF     | 43'069      | EUR   | 44'900      | 0.00                                     | 0.00         |
| 24.10.2023 | Bought      | CHF     | 86'196      | EUR   | 90'800      | 0.00                                     | 0.00         |
| 24.10.2023 | Bought      | CHF     | 15'981      | EUR   | 16'800      | 0.00                                     | 0.00         |
| 24.10.2023 | Bought      | EUR     | 15'990'600  | CHF   | 15'417'401  | 0.00                                     | 0.00         |
| 24.10.2023 | Bought      | EUR     | 28'600      | CHF   | 27'520      | 0.00                                     | 0.00         |
| 09.11.2023 | Bought      | AUD     | 2'000'000   | CHF   | 1'126'466   | 0.00                                     | 0.00         |
| 09.11.2023 | Bought      | AUD     | 850'000     | CHF   | 480'440     | 0.00                                     | 0.00         |
| 09.11.2023 | Bought      | CAD     | 350'000     | CHF   | 227'113     | 0.00                                     | 0.00         |
| 09.11.2023 | Bought      | CHF     | 14'382'496  | AUD   | 25'400'000  | 0.00                                     | 0.00         |
| 09.11.2023 | Bought      | CHF     | 746'066     | AUD   | 1'300'000   | 0.00                                     | 0.00         |
| 09.11.2023 | Bought      | CHF     | 12'865'128  | CAD   | 19'940'000  | 0.00                                     | 0.00         |
| 09.11.2023 | Bought      | CHF     | 29'232'393  | EUR   | 30'620'000  | 0.00                                     | 0.00         |
| 09.11.2023 | Bought      | CHF     | 10'597      | EUR   | 11'200      | 0.00                                     | 0.00         |
| 09.11.2023 | Bought      | CHF     | 23'806      | EUR   | 25'100      | 0.00                                     | 0.00         |
| 09.11.2023 | Bought      | CHF     | 26'682      | EUR   | 28'200      | 0.00                                     | 0.00         |
| 09.11.2023 | Bought      | CHF     | 20'195      | EUR   | 21'000      | 0.00                                     | 0.00         |
| 09.11.2023 | Bought      | CHF     | 19'858'767  | GBP   | 17'985'000  | 0.00                                     | 0.00         |
| 09.11.2023 | Bought      | CHF     | 388'410     | GBP   | 350'000     | 0.00                                     | 0.00         |
| 09.11.2023 | Bought      | CHF     | 3'558'762   | NOK   | 42'000'000  | 0.00                                     | 0.00         |
| 09.11.2023 | Bought      | CHF     | 169'788'537 | USD   | 196'200'000 | 0.00                                     | 0.00         |
| 09.11.2023 | Bought      | CHF     | 3'596'288   | USD   | 4'000'000   | 0.00                                     | 0.00         |
| 09.11.2023 | Bought      | EUR     | 500         | CHF   | 480         | 0.00                                     | 0.00         |
| 09.11.2023 | Bought      | EUR     | 1'000       | CHF   | 948         | 0.00                                     | 0.00         |
| 09.11.2023 | Bought      | EUR     | 1'100'000   | CHF   | 1'060'394   | 0.00                                     | 0.00         |
| 09.11.2023 | Bought      | EUR     | 1'000'000   | CHF   | 965'039     | 0.00                                     | 0.00         |
| 09.11.2023 | Bought      | EUR     | 300'000     | CHF   | 285'634     | 0.00                                     | 0.00         |
| 09.11.2023 | Bought      | EUR     | 15'965'600  | CHF   | 15'346'326  | 0.00                                     | 0.00         |
| 09.11.2023 | Bought      | USD     | 4'500'000   | CHF   | 4'076'726   | 0.00                                     | 0.00         |
| 09.11.2023 | Bought      | USD     | 1'200'000   | CHF   | 1'063'728   | 0.00                                     | 0.00         |
| 09.11.2023 | Bought      | USD     | 3'000'000   | CHF   | 2'633'796   | 0.00                                     | 0.00         |
| 09.11.2023 | Bought      | USD     | 5'000'000   | CHF   | 4'502'160   | 0.00                                     | 0.00         |
| 09.11.2023 | Bought      | USD     | 550'000     | CHF   | 503'066     | 0.00                                     | 0.00         |
| 09.11.2023 | Bought      | USD     | 1'600'000   | CHF   | 1'453'171   | 0.00                                     | 0.00         |
| 09.11.2023 | Bought      | USD     | 1'396'142   | GBP   | 1'150'000   | 0.00                                     | 0.00         |
| 24.11.2023 | Bought      | CHF     | 22'442      | EUR   | 23'200      | 0.00                                     | 0.00         |
| 24.11.2023 | Bought      | CHF     | 20'064      | EUR   | 20'800      | 0.00                                     | 0.00         |
| 24.11.2023 | Bought      | CHF     | 3'084       | EUR   | 3'200       | 0.00                                     | 0.00         |
| 24.11.2023 | Bought      | CHF     | 10          | EUR   | 10          | 0.00                                     | 0.00         |
| 24.11.2023 | Bought      | EUR     | 1'000       | CHF   | 966         | 0.00                                     | 0.00         |
| 24.11.2023 | Bought      | EUR     | 200         | CHF   | 193         | 0.00                                     | 0.00         |
| 24.11.2023 | Bought      | EUR     | 15'265'700  | CHF   | 14'375'817  | 0.00                                     | 0.00         |

## Aufstellung der Devisentermingeschäfte für die Zeit vom 1. Januar 2023 bis zum 31. Dezember 2023

| Fälligkeit                          | Transaktion | Währung | Betrag      | Gegen | Gegenwert   | Devisengewinn/-verlust<br>Mandatswährung | in % des GFV |
|-------------------------------------|-------------|---------|-------------|-------|-------------|--|--------------|
| 24.11.2023                          | Bought      | EUR     | 307'900     | CHF   | 295'884     | 0.00                                     | 0.00         |
| 24.11.2023                          | Bought      | EUR     | 158'000     | CHF   | 151'879     | 0.00                                     | 0.00         |
| 08.12.2023                          | Bought      | CHF     | 15'217      | EUR   | 15'800      | 0.00                                     | 0.00         |
| 08.12.2023                          | Bought      | CHF     | 209'855     | EUR   | 218'000     | 0.00                                     | 0.00         |
| 08.12.2023                          | Bought      | CHF     | 19'012      | EUR   | 20'000      | 0.00                                     | 0.00         |
| 08.12.2023                          | Bought      | EUR     | 500         | CHF   | 473         | 0.00                                     | 0.00         |
| 08.12.2023                          | Bought      | EUR     | 15'573'800  | CHF   | 14'952'296  | 0.00                                     | 0.00         |
| 08.12.2023                          | Bought      | EUR     | 55'900      | CHF   | 53'823      | 0.00                                     | 0.00         |
| 08.12.2023                          | Bought      | EUR     | 13'100      | CHF   | 12'629      | 0.00                                     | 0.00         |
| 08.12.2023                          | Bought      | EUR     | 15'800      | CHF   | 15'205      | 0.00                                     | 0.00         |
| 22.12.2023                          | Bought      | CHF     | 16'481      | EUR   | 17'500      | 0.00                                     | 0.00         |
| 22.12.2023                          | Bought      | CHF     | 34'161      | EUR   | 36'100      | 0.00                                     | 0.00         |
| 22.12.2023                          | Bought      | CHF     | 32'302      | EUR   | 34'200      | 0.00                                     | 0.00         |
| 22.12.2023                          | Bought      | CHF     | 40'186      | EUR   | 42'300      | 0.00                                     | 0.00         |
| 22.12.2023                          | Bought      | EUR     | 1'000       | CHF   | 948         | 0.00                                     | 0.00         |
| 22.12.2023                          | Bought      | EUR     | 15'629'700  | CHF   | 15'035'068  | 0.00                                     | 0.00         |
| 22.12.2023                          | Bought      | EUR     | 207'300     | CHF   | 195'391     | 0.00                                     | 0.00         |
| 28.12.2023                          | Bought      | EUR     | 83'372      | CHF   | 78'413      | 0.00                                     | 0.00         |
| 03.01.2024                          | Bought      | CHF     | 2'953       | EUR   | 3'176       | 1.82                                     | 0.00         |
| 10.01.2024                          | Bought      | CHF     | 77'151      | EUR   | 82'100      | 882.18                                   | 0.00         |
| 10.01.2024                          | Bought      | EUR     | 3'100       | CHF   | 2'882       | -1.80                                    | 0.00         |
| 10.01.2024                          | Bought      | EUR     | 15'837'100  | CHF   | 14'907'636  | -195'223.93                              | -0.03        |
| 24.01.2024                          | Bought      | EUR     | 15'707'900  | CHF   | 14'801'633  | -222'078.29                              | -0.03        |
| 07.02.2024                          | Bought      | AUD     | 1'000'000   | CHF   | 570'946     | 1'641.49                                 | 0.00         |
| 07.02.2024                          | Bought      | AUD     | 5'600'000   | CHF   | 3'208'358   | -1'867.66                                | 0.00         |
| 07.02.2024                          | Bought      | CAD     | 400'000     | CHF   | 256'442     | -2'067.15                                | 0.00         |
| 07.02.2024                          | Bought      | CHF     | 13'680'169  | AUD   | 23'850'000  | 24'028.37                                | 0.00         |
| 07.02.2024                          | Bought      | CHF     | 12'705'565  | CAD   | 19'590'000  | 248'443.16                               | 0.04         |
| 07.02.2024                          | Bought      | CHF     | 334'681     | CAD   | 520'000     | 4'007.90                                 | 0.00         |
| 07.02.2024                          | Bought      | CHF     | 24'393'445  | EUR   | 25'520'000  | 729'079.27                               | 0.11         |
| 07.02.2024                          | Bought      | CHF     | 21'356'904  | GBP   | 19'485'000  | 536'170.92                               | 0.08         |
| 07.02.2024                          | Bought      | CHF     | 928'707     | GBP   | 850'000     | 20'425.95                                | 0.00         |
| 07.02.2024                          | Bought      | CHF     | 3'359'069   | NOK   | 42'000'000  | -110'853.65                              | -0.02        |
| 07.02.2024                          | Bought      | CHF     | 163'055'979 | USD   | 182'953'858 | 9'755'815.68                             | 1.49         |
| 07.02.2024                          | Bought      | CHF     | 2'866'962   | USD   | 3'300'000   | 101'527.39                               | 0.02         |
| 07.02.2024                          | Bought      | CHF     | 1'707'082   | USD   | 2'000'000   | 30'933.82                                | 0.00         |
| 07.02.2024                          | Bought      | EUR     | 1'000'000   | CHF   | 961'410     | -34'050.60                               | -0.01        |
| 07.02.2024                          | Bought      | GBP     | 300'000     | CHF   | 329'625     | -9'027.30                                | 0.00         |
| <b>Total Devisentermingeschäfte</b> |             |         |             |       |             | <b>10'877'787.57</b>                     | <b>1.66</b>  |

## Ausgeliehene Wertpapierbestände (Lending and Borrowing)

| Titelbezeichnung                        | Agent                      | Lending / Borrowing | 31.12.2023<br>Anzahl/ Nominal |
|---|----------------------------|---------------------|-------------------------------|
| ALGONQUIN POWER & UTILITIES             | Credit Suisse (Schweiz) AG | Lending             | 180'000                       |
| ASIAN DEVELOPMENT BANK 5.8200 16/06/28  | Credit Suisse (Schweiz) AG | Lending             | 451'000                       |
| AT&T INC 4.6000 19/09/28                | Credit Suisse (Schweiz) AG | Lending             | 2'110'000                     |
| BANK OF NOVA SCOTIA                     | Credit Suisse (Schweiz) AG | Lending             | 28'800                        |
| BAYER AG 4.2500 26/08/29                | Credit Suisse (Schweiz) AG | Lending             | 350'000                       |
| CAISSE NAT REASSURANCE 6.0000 23/01/27  | Credit Suisse (Schweiz) AG | Lending             | 300'000                       |
| CANADIAN GOVERNMENT 3.5000 01/03/28     | Credit Suisse (Schweiz) AG | Lending             | 1'300'000                     |
| CANADIAN TIRE CORP-CLASS A              | Credit Suisse (Schweiz) AG | Lending             | 1'000                         |
| CREDIT SUISSE REAL EST INTSW            | Credit Suisse (Schweiz) AG | Lending             | 2'885                         |
| CREDIT SUISSE REAL EST SIAT             | Credit Suisse (Schweiz) AG | Lending             | 2'851                         |
| CS REAL EST LOGISTICSPLUS-A             | Credit Suisse (Schweiz) AG | Lending             | 2'043                         |
| CS REAL ESTATE FD GREEN PROP            | Credit Suisse (Schweiz) AG | Lending             | 1'869                         |
| CS REAL ESTATE FD HOSPITALIT            | Credit Suisse (Schweiz) AG | Lending             | 1'551                         |
| CS REAL ESTATE LIVINGPLUS               | Credit Suisse (Schweiz) AG | Lending             | 3'570                         |
| DELL INT LLC / EMC CORP 6.0200 15/06/26 | Credit Suisse (Schweiz) AG | Lending             | 1'318'000                     |
| HAMMERSON PLC 7.2500 21/04/28           | Credit Suisse (Schweiz) AG | Lending             | 550'000                       |
| IBM CORP 5.8750 29/11/32                | Credit Suisse (Schweiz) AG | Lending             | 700'000                       |
| KUEHNE + NAGEL INTL AG-REG              | Credit Suisse (Schweiz) AG | Lending             | 337                           |
| MERCEDES-BENZ FIN NA 8.5000 18/01/31    | Credit Suisse (Schweiz) AG | Lending             | 700'000                       |
| NATURGY ENERGY GROUP SA                 | Credit Suisse (Schweiz) AG | Lending             | 23'130                        |
| OESTERREICHISCHE POST AG                | Credit Suisse (Schweiz) AG | Lending             | 7'360                         |
| OMV AG 6.2500 //                        | Credit Suisse (Schweiz) AG | Lending             | 150'000                       |
| POWER CORP OF CANADA                    | Credit Suisse (Schweiz) AG | Lending             | 16'000                        |
| PRUDENTIAL FINANCIAL IN 5.7000 15/09/48 | Credit Suisse (Schweiz) AG | Lending             | 1'320'000                     |
| REDEIA CORP SA                          | Credit Suisse (Schweiz) AG | Lending             | 44'640                        |
| REPUBLICA ORIENT URUGUA 7.8750 15/01/33 | Credit Suisse (Schweiz) AG | Lending             | 450'000                       |

| <b>Ausgeliehene Wertpapierbestände (Lending and Borrowing)</b>                   |  |                            |  |                     |
|--|--|----------------------------|--|---------------------|
| <b>Titelbezeichnung</b>  | <b>Agent</b>                               | <b>Lending / Borrowing</b> | <b>31.12.2023</b>                          |                     |
|  |  |                            | <b>Anzahl/ Nominal</b>                     |                     |
| ROMANIA 6.0000 25/05/34  | Credit Suisse (Schweiz) AG                 | Lending                    | 48'000                                     |                     |
| SCHLUMBERGER HLDGS CORP 4.0000 21/12/25  | Credit Suisse (Schweiz) AG                 | Lending                    | 502'000                                    |                     |
| SCHRODER IMMOPLUS  | Credit Suisse (Schweiz) AG                 | Lending                    | 3'060                                      |                     |
| SPAREBANK 1 OESTLANDET   | Credit Suisse (Schweiz) AG                 | Lending                    | 6'234                                      |                     |
| STELLANTIS NV 4.5000 07/07/28  | Credit Suisse (Schweiz) AG                 | Lending                    | 600'000                                    |                     |
| SUN LIFE FINANCIAL INC   | Credit Suisse (Schweiz) AG                 | Lending                    | 400  |                     |
| TELEFONICA SA  | Credit Suisse (Schweiz) AG                 | Lending                    | 52'000                                     |                     |
| TOTALENERGIES SE   | Credit Suisse (Schweiz) AG                 | Lending                    | 36'450                                     |                     |
| UBS PRPRTY FD SW COM SW REAL   | Credit Suisse (Schweiz) AG                 | Lending                    | 1'398                                      |                     |
| UBS PRPRTY FD SW RESIDTL ANF   | Credit Suisse (Schweiz) AG                 | Lending                    | 8'089                                      |                     |
| UNITED MICROELECTRON-SP ADR  | Credit Suisse (Schweiz) AG                 | Lending                    | 200'000                                    |                     |
| US TREASURY N/B 5.0000 15/05/37  | Credit Suisse (Schweiz) AG                 | Lending                    | 1'750'000                                  |                     |
| WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC   | Credit Suisse (Schweiz) AG                 | Lending                    | 25'000                                     |                     |
| <b>Ausserbilanzgeschäfte</b>   |  |                            |  |                     |
|  | <b>31.12.2023</b>                          |                            | <b>31.12.2022</b>                          |                     |
|  | <b>Basiswertäquivalent in Fondswährung</b> | <b>in % des NFV</b>        | <b>Basiswertäquivalent in Fondswährung</b> | <b>in % des NFV</b> |
| - Marktrisiko (Aktienkursänderungsrisiko)  | 20'096'540.00                              | 3.07%                      | 66'205'546.02                              | 8.69%               |
| - Währungsrisiko   | 268'701'221.87                             | 41.09%                     | 326'386'230.19                             | 42.84%              |
| <b>Total engagementerhöhende Positionen</b>                                      | <b>288'797'761.87</b>                      | <b>44.17%</b>              | <b>392'591'776.21</b>                      | <b>51.53%</b>       |
| - Marktrisiko (Aktienkursänderungsrisiko)  | 20'096'540.00                              | 3.07%                      | 66'205'546.02                              | 8.69%               |
| - Währungsrisiko   | 268'701'221.87                             | 41.09%                     | 326'386'230.19                             | 42.84%              |
| <b>Total engagementreduzierende Positionen</b>                                   | <b>288'797'761.87</b>                      | <b>44.17%</b>              | <b>392'591'776.21</b>                      | <b>51.53%</b>       |
| <b>Volumen der verliehenen Wertpapiere und Provisionserträge aus Wertpapiere</b> |  |                            |  |                     |
| - Volumen der verliehenen Positionen   | 22'550'800.65                              | 3.45%                      | 19'004'087.15                              | 2.49%               |
| - Kommission Einkommen   | 128'374.70                                 | 0.02%                      | 213'229.35                                 | 0.03%               |

## Kurze Übersicht

| Kennzahlen                            | Währung | 31.12.2023 | 31.12.2022 | 31.12.2021 |
|---------------------------------------|---------|------------|------------|------------|
| <b>Konsolidierung</b>                 |         |            |            |            |
| Nettofondsvermögen in Mio.            | CHF     | 177.14     | 210.48     | 259.23     |
| <b>Anteilklasse A</b>                 |         |            |            |            |
| Nettofondsvermögen in Mio.            | CHF     | 21.98      | 26.75      | 33.88      |
| Inventarwert pro Anteil               | CHF     | -          | -          | 1'248.15   |
| Inventarwert pro Anteil (Swung NAV)   | CHF     | 1'061.46   | 1'074.05   | -          |
| Inventarwert pro Anteil (Unswung NAV) | CHF     | 1'063.06   | 1'071.86   | -          |
| <b>Anteilklasse AH EUR</b>            |         |            |            |            |
| Nettofondsvermögen in Mio.            | CHF     | 2.13       | 3.03       | 4.34       |
| Inventarwert pro Anteil               | EUR     | -          | -          | 125.62     |
| Inventarwert pro Anteil (Swung NAV)   | EUR     | 108.81     | 108.23     | -          |
| Inventarwert pro Anteil (Unswung NAV) | EUR     | 108.98     | 108.01     | -          |
| <b>Anteilklasse B</b>                 |         |            |            |            |
| Nettofondsvermögen in Mio.            | CHF     | 11.53      | 12.58      | 13.87      |
| Inventarwert pro Anteil               | CHF     | -          | -          | 152.46     |
| Inventarwert pro Anteil (Swung NAV)   | CHF     | 136.76     | 135.13     | -          |
| Inventarwert pro Anteil (Unswung NAV) | CHF     | 136.97     | 134.86     | -          |
| <b>Anteilklasse BH EUR</b>            |         |            |            |            |
| Nettofondsvermögen in Mio.            | CHF     | 1.27       | 1.33       | 1.55       |
| Inventarwert pro Anteil               | EUR     | -          | -          | 127.85     |
| Inventarwert pro Anteil (Swung NAV)   | EUR     | 116.81     | 113.33     | -          |
| Inventarwert pro Anteil (Unswung NAV) | EUR     | 116.98     | 113.10     | -          |
| <b>Anteilklasse IA</b>                |         |            |            |            |
| Nettofondsvermögen in Mio.            | CHF     | 2.80       | 11.36      | 21.52      |
| Inventarwert pro Anteil               | CHF     | -          | -          | 1'142.94   |
| Inventarwert pro Anteil (Swung NAV)   | CHF     | 991.33     | 994.39     | -          |
| Inventarwert pro Anteil (Unswung NAV) | CHF     | 992.82     | 992.36     | -          |
| <b>Anteilklasse UA</b>                |         |            |            |            |
| Nettofondsvermögen in Mio.            | CHF     | 100.09     | 113.00     | 133.13     |
| Inventarwert pro Anteil               | CHF     | -          | -          | 118.42     |
| Inventarwert pro Anteil (Swung NAV)   | CHF     | 101.20     | 102.19     | -          |
| Inventarwert pro Anteil (Unswung NAV) | CHF     | 101.35     | 101.98     | -          |
| <b>Anteilklasse UAH EUR</b>           |         |            |            |            |
| Nettofondsvermögen in Mio.            | CHF     | 4.32       | 5.47       | 6.58       |
| Inventarwert pro Anteil               | EUR     | -          | -          | 126.51     |
| Inventarwert pro Anteil (Swung NAV)   | EUR     | 110.18     | 109.28     | -          |
| Inventarwert pro Anteil (Unswung NAV) | EUR     | 110.34     | 109.06     | -          |
| <b>Anteilklasse UB</b>                |         |            |            |            |
| Nettofondsvermögen in Mio.            | CHF     | 30.97      | 34.72      | 41.53      |
| Inventarwert pro Anteil               | CHF     | -          | -          | 135.83     |
| Inventarwert pro Anteil (Swung NAV)   | CHF     | 122.57     | 120.75     | -          |
| Inventarwert pro Anteil (Unswung NAV) | CHF     | 122.75     | 120.50     | -          |
| <b>Anteilklasse UBH EUR</b>           |         |            |            |            |
| Nettofondsvermögen in Mio.            | CHF     | 2.05       | 2.25       | 2.82       |
| Inventarwert pro Anteil               | EUR     | -          | -          | 129.02     |
| Inventarwert pro Anteil (Swung NAV)   | EUR     | 118.59     | 114.71     | -          |
| Inventarwert pro Anteil (Unswung NAV) | EUR     | 118.77     | 114.48     | -          |

## Verwendung des Erfolges

### Ausschüttung pro Anteil

#### 1. Für in der Schweiz und im Ausland domizilierte Anteilinhaber

| Ausschüttung 2023                         | Anteilklasse A |               | Anteilklasse UAH EUR |              |
|---|----------------|---------------|----------------------|--------------|
| Bruttoausschüttung aus Ertrag             | CHF            | 26.960        | EUR                  | 2.900        |
| ./. 35% Eidgenössische Verrechnungssteuer | CHF            | 9.436         | EUR                  | 1.015        |
| <b>Nettoausschüttung aus Ertrag</b>       | <b>CHF</b>     | <b>17.524</b> | <b>EUR</b>           | <b>1.885</b> |
| <b>Coupon Nr. Ertrag</b>                  |                | <b>29</b>     |                      | <b>12</b>    |
| und                                       |                |               |                      |              |
| <b>Kapitalrückzahlung</b>                 | <b>CHF</b>     | <b>10.160</b> | <b>EUR</b>           | <b>0.980</b> |
| <b>Coupon Nr. Kapitalrückzahlung</b>      |                | <b>31</b>     |                      | <b>14</b>    |

#### 2. Für in der Schweiz und im Ausland domizilierte Anteilinhaber (verrechnungssteuerbefreite Erträge aus direktem Immobilienbesitz)

| Ausschüttung 2023                   | Anteilklasse A |              | Anteilklasse UAH EUR |              |
|-------------------------------------|----------------|--------------|----------------------|--------------|
| Bruttoausschüttung aus Ertrag       | CHF            | 0.030        | EUR                  | 0.000        |
| <b>Nettoausschüttung aus Ertrag</b> | <b>CHF</b>     | <b>0.030</b> | <b>EUR</b>           | <b>0.000</b> |
| <b>Coupon Nr. Ertrag</b>            |                | <b>30</b>    |                      | <b>13</b>    |

#### Für in der Schweiz und im Ausland domizilierte Anteilinhaber

| Ausschüttung 2023                         | Anteilklasse AH EUR |              | Anteilklasse UA |              |
|---|---------------------|--------------|-----------------|--------------|
| Bruttoausschüttung aus Ertrag             | EUR                 | 2.840        | CHF             | 2.600        |
| ./. 35% Eidgenössische Verrechnungssteuer | EUR                 | 0.994        | CHF             | 0.910        |
| <b>Nettoausschüttung aus Ertrag</b>       | <b>EUR</b>          | <b>1.846</b> | <b>CHF</b>      | <b>1.690</b> |
| <b>Coupon Nr. Ertrag</b>                  |                     | <b>12</b>    |                 | <b>21</b>    |
| und                                       |                     |              |                 |              |
| <b>Kapitalrückzahlung</b>                 | <b>EUR</b>          | <b>1.000</b> | <b>CHF</b>      | <b>0.960</b> |
| <b>Coupon Nr. Kapitalrückzahlung</b>      |                     | <b>13</b>    |                 | <b>22</b>    |

Zahlbar ab 15.02.2024 bei der CREDIT SUISSE (SCHWEIZ) AG und deren sämtlichen Geschäftsstellen in der Schweiz.

#### 1. Für in der Schweiz und im Ausland domizilierte Anteilinhaber

| Ausschüttung 2023                         | Anteilklasse IA |               |
|---|-----------------|---------------|
| Bruttoausschüttung aus Ertrag             | CHF             | 36.000        |
| ./. 35% Eidgenössische Verrechnungssteuer | CHF             | 12.600        |
| <b>Nettoausschüttung aus Ertrag</b>       | <b>CHF</b>      | <b>23.400</b> |
| <b>Coupon Nr. Ertrag</b>                  |                 | <b>20</b>     |

#### 2. Für in der Schweiz und im Ausland domizilierte Anteilinhaber (verrechnungssteuerbefreite Erträge aus direktem Immobilienbesitz)

| Ausschüttung 2023                   | Anteilklasse IA |              |
|-------------------------------------|-----------------|--------------|
| Bruttoausschüttung aus Ertrag       | CHF             | 0.010        |
| <b>Nettoausschüttung aus Ertrag</b> | <b>CHF</b>      | <b>0.010</b> |
| <b>Coupon Nr. Ertrag</b>            |                 | <b>21</b>    |

Zahlbar ab 15.02.2024 bei der CREDIT SUISSE (SCHWEIZ) AG und deren sämtlichen Geschäftsstellen in der Schweiz.

**Thesaurierung pro Anteil****1. Für in der Schweiz und im Ausland domizilierte Anteilinhaber**

| <b>Thesaurierung 2023</b>                        | <b>Anteilklasse B</b> |              | <b>Anteilklasse BH EUR</b> |              | <b>Anteilklasse UB</b> |              |
|--|-----------------------|--------------|----------------------------|--------------|------------------------|--------------|
| Zur Thesaurierung verfügbarer Erfolg             | CHF                   | 3.487        | EUR                        | 3.083        | CHF                    | 3.138        |
| ./.. 35% Eidgenössische Verrechnungssteuer       | CHF                   | 1.221        | EUR                        | 1.079        | CHF                    | 1.098        |
| <b>Zur Thesaurierung zurückbehaltener Erfolg</b> | <b>CHF</b>            | <b>2.267</b> | <b>EUR</b>                 | <b>2.004</b> | <b>CHF</b>             | <b>2.040</b> |
| <b>Coupon Nr. Ertrag</b>                         |                       | <b>18</b>    |                            | <b>9</b>     |                        | <b>16</b>    |

**2. Für in der Schweiz und im Ausland domizilierte Anteilinhaber  
(verrechnungssteuerbefreite Erträge aus direktem Immobilienbesitz)**

| <b>Thesaurierung 2023</b>                        | <b>Anteilklasse B</b> |              | <b>Anteilklasse BH EUR</b> |              | <b>Anteilklasse UB</b> |              |
|--|-----------------------|--------------|----------------------------|--------------|------------------------|--------------|
| Zur Thesaurierung verfügbarer Erfolg             | CHF                   | 0.004        | EUR                        | 0.004        | CHF                    | 0.004        |
| <b>Zur Thesaurierung zurückbehaltener Erfolg</b> | <b>CHF</b>            | <b>0.004</b> | <b>EUR</b>                 | <b>0.004</b> | <b>CHF</b>             | <b>0.004</b> |
| <b>Coupon Nr. Ertrag</b>                         |                       | <b>19</b>    |                            | <b>10</b>    |                        | <b>17</b>    |

**1. Für in der Schweiz und im Ausland domizilierte Anteilinhaber**

| <b>Thesaurierung 2023</b>                        | <b>Anteilklasse UBH EUR</b> |              |
|--|-----------------------------|--------------|
| Zur Thesaurierung verfügbarer Erfolg             | EUR                         | 3.123        |
| ./.. 35% Eidgenössische Verrechnungssteuer       | EUR                         | 1.093        |
| <b>Zur Thesaurierung zurückbehaltener Erfolg</b> | <b>EUR</b>                  | <b>2.030</b> |
| <b>Coupon Nr. Ertrag</b>                         |                             | <b>9</b>     |

**2. Für in der Schweiz und im Ausland domizilierte Anteilinhaber  
(verrechnungssteuerbefreite Erträge aus direktem Immobilienbesitz)**

| <b>Thesaurierung 2023</b>                        | <b>Anteilklasse UBH EUR</b> |              |
|--|-----------------------------|--------------|
| Zur Thesaurierung verfügbarer Erfolg             | EUR                         | 0.004        |
| <b>Zur Thesaurierung zurückbehaltener Erfolg</b> | <b>EUR</b>                  | <b>0.004</b> |
| <b>Coupon Nr. Ertrag</b>                         |                             | <b>10</b>    |



## Wechselkurse

| <b>Wechselkurse per</b> | <b>31.12.2023</b> |
|-------------------------|-------------------|
| AUSTRALISCHER DOLLAR    | 0.574279          |
| DAENISCHE KRONE         | 0.124716          |
| ENGLISCHES PFUND        | 1.072875          |
| EURO                    | 0.929700          |
| HONGKONG-DOLLAR         | 0.107782          |
| JAPANISCHER YEN         | 0.005970          |
| KANADISCHER DOLLAR      | 0.638267          |
| MEXIKANISCHER PESO      | 0.049699          |
| NEUER POLNISCHER ZŁOTY  | 0.214032          |
| NORWEGISCHE KRONE       | 0.082872          |
| SCHWEDISCHE KRONE       | 0.083512          |
| SCHWEIZER FRANKEN       | 1.000000          |
| US DOLLAR               | 0.841624          |

## Vermögensrechnung per 31. Dezember 2023

|  | Konsolidierung        |                       |
|--|-----------------------|-----------------------|
|  | 31.12.2023            | 31.12.2022            |
|  | CHF                   | CHF                   |
| <b>Vermögenswerte</b>  |                       |                       |
| Bankguthaben, einschliesslich Treuhandanlagen bei Drittbanken, aufgeteilt in:                      |                       |                       |
| - Sichtguthaben  | 1'072'750.28          | 2'020'122.03          |
| Effekten, einschliesslich ausgeliehene und pensionierte Effekten, aufgeteilt in:                   |                       |                       |
| - Obligationen, Wandelobligationen, Optionsanleihen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte | 19'457'371.49         | 22'378'371.62         |
| - Strukturierte Produkte   | 0.00                  | 12'305'414.33         |
| - Aktien und sonstige Beteiligungswertpapiere und -rechte  | 107'060'900.14        | 121'348'061.18        |
| - Anteile anderer kollektiver Kapitalanlagen   | 47'545'535.38         | 49'174'066.05         |
| Derivative Finanzinstrumente   | 1'357'889.57          | 1'707'836.68          |
| Sonstige Vermögenswerte  | 890'303.00            | 1'865'052.82          |
| <b>Gesamtfondsvermögen abzüglich:</b>  | <b>177'384'749.86</b> | <b>210'798'924.71</b> |
| Andere Verbindlichkeiten   | 245'481.32            | 322'100.87            |
| <b>Nettofondsvermögen</b>  | <b>177'139'268.54</b> | <b>210'476'823.84</b> |
| <b>Veränderung des Nettofondsvermögens</b>   |                       |                       |
|  | 01.01.2023 -          | 01.01.2022 -          |
|  | 31.12.2023            | 31.12.2022            |
|  | CHF                   | CHF                   |
| Nettofondsvermögen zu Beginn der Berichtsperiode   | 210'476'823.84        | 259'225'092.91        |
| Ausschüttungen   | -5'595'267.25         | -4'207'799.29         |
| Ablieferung Verrechnungssteuer   | -483'064.33           | -441'522.07           |
| Kapitalausschüttung  | 0.00                  | -3'030'578.45         |
| Ausgaben von Anteilen  | 7'789'407.70          | 18'299'135.23         |
| Rücknahmen von Anteilen  | -40'288'863.49        | -32'097'254.01        |
| Sonstiges aus Anteilverkehr  | 815'105.31            | -1'313'734.98         |
| Gesamterfolg   | 4'425'126.76          | -25'956'515.50        |
| <b>Nettofondsvermögen am Ende der Berichtsperiode</b>  | <b>177'139'268.54</b> | <b>210'476'823.84</b> |
| <b>Entwicklung der Anteile im Umlauf</b>   |                       |                       |
| Bestand zu Beginn der Berichtsperiode  | 1'636'804.402         | 1'683'315.891         |
| Ausgegebene Anteile  | 61'665.040            | 154'064.233           |
| Zurückgenommene Anteile  | -257'555.437          | -200'575.722          |
| <b>Bestand am Ende der Berichtsperiode</b>   | <b>1'440'914.005</b>  | <b>1'636'804.402</b>  |
| <b>Währung Anteilklasse</b>  |                       |                       |
| <b>Inventarwert pro Anteil (Swung NAV)</b>   |                       |                       |
| <b>Inventarwert pro Anteil (Unswung NAV)</b>   |                       |                       |

| Anteilklasse A             |                            | Anteilklasse AH EUR        |                            | Anteilklasse B             |                            | Anteilklasse BH EUR        |                            |
|----------------------------|----------------------------|----------------------------|----------------------------|----------------------------|----------------------------|----------------------------|----------------------------|
| 01.01.2023 -<br>31.12.2023 | 01.01.2022 -<br>31.12.2022 | 01.01.2023 -<br>31.12.2023 | 01.01.2022 -<br>31.12.2022 | 01.01.2023 -<br>31.12.2023 | 01.01.2022 -<br>31.12.2022 | 01.01.2023 -<br>31.12.2023 | 01.01.2022 -<br>31.12.2022 |
| CHF                        | CHF                        | CHF                        | CHF                        | CHF                        | CHF                        | CHF                        | CHF                        |
| 26'749'584.15              | 33'883'324.60              | 3'028'694.64               | 4'338'492.94               | 12'577'919.62              | 13'871'591.71              | 1'327'054.16               | 1'548'240.09               |
| -906'802.73                | -695'904.47                | -106'950.07                | -88'130.98                 | 0.00                       | 0.00                       | 0.00                       | 0.00                       |
| 0.00                       | 0.00                       | 0.00                       | 0.00                       | -121'315.43                | -101'616.91                | -13'061.16                 | -11'998.07                 |
| 0.00                       | -502'909.10                | 0.00                       | -63'650.15                 | 0.00                       | 0.00                       | 0.00                       | 0.00                       |
| 580'198.59                 | 559'593.95                 | 11'798.02                  | 0.00                       | 1'379'739.78               | 2'109'646.33               | 23'794.43                  | 74'443.65                  |
| -5'116'128.15              | -3'034'608.58              | -781'815.38                | -567'112.98                | -2'623'111.06              | -1'737'643.54              | -51'796.60                 | -48'408.12                 |
| 106'790.28                 | -157'550.49                | 9'613.80                   | -50'084.01                 | 41'695.05                  | -22'263.98                 | 895.23                     | 370.05                     |
| 563'805.35                 | -3'302'361.76              | -33'550.64                 | -540'820.18                | 279'854.59                 | -1'541'793.99              | -21'558.69                 | -235'593.44                |
| <b>21'977'447.49</b>       | <b>26'749'584.15</b>       | <b>2'127'790.37</b>        | <b>3'028'694.64</b>        | <b>11'534'782.55</b>       | <b>12'577'919.62</b>       | <b>1'265'327.37</b>        | <b>1'327'054.16</b>        |
| 24'956.319                 | 27'146.830                 | 28'397.681                 | 33'331.919                 | 93'268.088                 | 90'985.884                 | 11'882.902                 | 11'687.623                 |
| 542.564                    | 486.082                    | 109.251                    | 0.000                      | 10'093.184                 | 14'720.159                 | 212.115                    | 595.281                    |
| -4'825.095                 | -2'676.593                 | -7'505.692                 | -4'934.238                 | -19'146.234                | -12'437.955                | -461.221                   | -400.002                   |
| <b>20'673.788</b>          | <b>24'956.319</b>          | <b>21'001.240</b>          | <b>28'397.681</b>          | <b>84'215.038</b>          | <b>93'268.088</b>          | <b>11'633.796</b>          | <b>11'882.902</b>          |
| (CHF)                      | (CHF)                      | (EUR)                      | (EUR)                      | (CHF)                      | (CHF)                      | (EUR)                      | (EUR)                      |
| <b>1'061.46</b>            | <b>1'074.05</b>            | <b>108.81</b>              | <b>108.23</b>              | <b>136.76</b>              | <b>135.13</b>              | <b>116.81</b>              | <b>113.33</b>              |
| <b>1'063.06</b>            | <b>1'071.86</b>            | <b>108.98</b>              | <b>108.01</b>              | <b>136.97</b>              | <b>134.86</b>              | <b>116.98</b>              | <b>113.10</b>              |

|   | Anteilklasse IA            |                            |
|---|----------------------------|----------------------------|
|   | 01.01.2023 -<br>31.12.2023 | 01.01.2022 -<br>31.12.2022 |
|   | CHF                        | CHF                        |
| <b>Veränderung des Nettofondsvermögens</b>            |                            |                            |
| Nettofondsvermögen zu Beginn der Berichtsperiode      | 11'357'438.75              | 21'520'535.87              |
| Ausschüttungen  | -412'244.72                | -582'152.95                |
| Ablieferung Verrechnungssteuer                        | 0.00                       | 0.00                       |
| Kapitalausschüttung                                   | 0.00                       | -201'792.72                |
| Ausgaben von Anteilen                                 | 522'532.50                 | 300'277.07                 |
| Rücknahmen von Anteilen                               | -9'010'769.98              | -7'765'369.05              |
| Sonstiges aus Anteilverkehr                           | 333'335.56                 | -575'978.68                |
| Gesamterfolg  | 9'464.27                   | -1'338'080.79              |
| <b>Nettofondsvermögen am Ende der Berichtsperiode</b> | <b>2'799'756.38</b>        | <b>11'357'438.75</b>       |
| <b>Entwicklung der Anteile im Umlauf</b>              |                            |                            |
| Bestand zu Beginn der Berichtsperiode                 | 11'444.884                 | 18'829.049                 |
| Ausgegebene Anteile                                   | 525.000                    | 268.556                    |
| Zurückgenommene Anteile                               | -9'149.884                 | -7'652.721                 |
| <b>Bestand am Ende der Berichtsperiode</b>            | <b>2'820.000</b>           | <b>11'444.884</b>          |
| <b>Währung Anteilklasse</b>                           | <b>(CHF)</b>               | <b>(CHF)</b>               |
| <b>Inventarwert pro Anteil (Swung NAV)</b>            | <b>991.33</b>              | <b>994.39</b>              |
| <b>Inventarwert pro Anteil (Unswung NAV)</b>          | <b>992.82</b>              | <b>992.36</b>              |

| Anteilklasse UA            |                            | Anteilklasse UAH EUR       |                            | Anteilklasse UB            |                            | Anteilklasse UBH EUR       |                            |
|----------------------------|----------------------------|----------------------------|----------------------------|----------------------------|----------------------------|----------------------------|----------------------------|
| 01.01.2023 -<br>31.12.2023 | 01.01.2022 -<br>31.12.2022 | 01.01.2023 -<br>31.12.2023 | 01.01.2022 -<br>31.12.2022 | 01.01.2023 -<br>31.12.2023 | 01.01.2022 -<br>31.12.2022 | 01.01.2023 -<br>31.12.2023 | 01.01.2022 -<br>31.12.2022 |
| CHF                        | CHF                        | CHF                        | CHF                        | CHF                        | CHF                        | CHF                        | CHF                        |
| 112'999'095.19             | 133'132'990.93             | 5'465'385.41               | 6'582'684.21               | 34'724'381.07              | 41'525'436.35              | 2'247'271.14               | 2'821'796.51               |
| -3'975'697.71              | -2'706'324.32              | -193'572.02                | -135'286.57                | 0.00                       | 0.00                       | 0.00                       | 0.00                       |
| 0.00                       | 0.00                       | 0.00                       | 0.00                       | -327'556.83                | -303'998.70                | -21'130.91                 | -23'908.39                 |
| 0.00                       | -2'160'511.02              | 0.00                       | -101'715.46                | 0.00                       | 0.00                       | 0.00                       | 0.00                       |
| 4'636'501.61               | 13'274'793.92              | 11'908.45                  | 552'528.86                 | 599'393.45                 | 1'109'424.85               | 23'540.87                  | 318'426.60                 |
| -16'628'074.13             | -14'702'559.46             | -920'043.11                | -520'096.47                | -4'981'463.16              | -3'270'542.03              | -175'661.92                | -450'913.78                |
| 195'007.23                 | -321'707.53                | 13'151.82                  | 36'564.52                  | 108'049.20                 | -196'005.99                | 6'567.17                   | -27'078.88                 |
| 2'861'597.42               | -13'517'587.33             | -55'126.66                 | -949'293.68                | 849'347.22                 | -4'139'933.41              | -28'706.10                 | -391'050.92                |
| <b>100'088'429.61</b>      | <b>112'999'095.19</b>      | <b>4'321'703.89</b>        | <b>5'465'385.41</b>        | <b>30'972'150.95</b>       | <b>34'724'381.07</b>       | <b>2'051'880.25</b>        | <b>2'247'271.14</b>        |
| 1'108'062.880              | 1'124'284.935              | 50'751.773                 | 50'219.290                 | 288'159.142                | 305'721.296                | 19'880.733                 | 21'109.065                 |
| 45'016.657                 | 121'928.182                | 105.533                    | 4'930.978                  | 4'863.357                  | 8'784.111                  | 197.379                    | 2'350.884                  |
| -165'537.280               | -138'150.237               | -8'728.075                 | -4'398.495                 | -40'706.587                | -26'346.265                | -1'495.369                 | -3'579.216                 |
| <b>987'542.257</b>         | <b>1'108'062.880</b>       | <b>42'129.231</b>          | <b>50'751.773</b>          | <b>252'315.912</b>         | <b>288'159.142</b>         | <b>18'582.743</b>          | <b>19'880.733</b>          |
| (CHF)                      | (CHF)                      | (EUR)                      | (EUR)                      | (CHF)                      | (CHF)                      | (EUR)                      | (EUR)                      |
| <b>101.20</b>              | <b>102.19</b>              | <b>110.18</b>              | <b>109.28</b>              | <b>122.57</b>              | <b>120.75</b>              | <b>118.59</b>              | <b>114.71</b>              |
| <b>101.35</b>              | <b>101.98</b>              | <b>110.34</b>              | <b>109.06</b>              | <b>122.75</b>              | <b>120.50</b>              | <b>118.77</b>              | <b>114.48</b>              |

## Erfolgsrechnung für die Zeit vom 1. Januar 2023 bis zum 31. Dezember 2023

|  | Konsolidierung             |                            |
|--|----------------------------|----------------------------|
|  | 01.01.2023 -<br>31.12.2023 | 01.01.2022 -<br>31.12.2022 |
|  | CHF                        | CHF                        |
| <b>Ertrag</b>  |                            |                            |
| Erträge der Bankguthaben   | 52'001.36                  | 15'185.14                  |
| Negativzinsen  | -523.74                    | -9'991.82                  |
| Erträge der Effektenleihen   | 70'524.05                  | 110'666.30                 |
| Erträge der Ausgleichszahlungen  | 721'890.32                 | 1'172'185.33               |
| Erträge der Geldmarktinstrumenten  | 0.00                       | 159'628.51                 |
| Erträge der Effekten, aufgeteilt in:   |                            |                            |
| - Obligationen, Wandelobligationen, Optionsanleihen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte     | 1'052'999.15               | 872'843.53                 |
| - Strukturierte Produkte   | 112'420.85                 | 880'528.52                 |
| - Aktien und sonstige Beteiligungswertpapiere und -rechte, einschliesslich Gratisaktien                | 4'043'460.33               | 4'152'443.68               |
| - Anteile anderer kollektiver Kapitalanlagen   | 1'977'807.09               | 2'262'138.70               |
| Erträge der Rückvergütungen  | 0.00                       | 507.72                     |
| Erträge aus kollektiven Kapitalanlagen mit Immobilien im Direktbesitz                                  | 9'558.21                   | 6'910.50                   |
| Sonstige Erträge   | -6'026.29                  | -1'316.67                  |
| Einkauf in laufende Nettoerträge bei der Ausgabe von Anteilen  | 84'059.15                  | 343'274.99                 |
| <b>Total Erträge</b>   | <b>8'118'170.48</b>        | <b>9'965'004.43</b>        |
| <b>Aufwendungen</b>  |                            |                            |
| Passivzinsen   | 1'300.40                   | 800.98                     |
| Prüfaufwand  | 14'494.70                  | 14'512.48                  |
| Reglementarische Vergütung an:   |                            |                            |
| - die Fondsleitung   | 2'845'575.24               | 3'333'849.02               |
| - die Depotbank  | 82'988.17                  | 99'516.82                  |
| Teilübertrag von Aufwendungen auf realisierte Kapitalverluste  | -116'740.49                | -143'058.97                |
| Teilübertrag von Aufwendungen auf kollektiven Kapitalanlagen mit Immobilien im Direktbesitz            | -3'387.16                  | -2'388.69                  |
| Aufwände aus kollektiven Kapitalanlagen mit Immobilien im Direktbesitz                                 | 3'387.16                   | 2'388.69                   |
| Sonstige Aufwendungen  | 24'311.35                  | 17'227.40                  |
| Ausrichtung laufender Nettoerträge bei Rücknahme von Anteilen  | 804'024.55                 | 853'123.85                 |
| <b>Total Aufwendungen</b>  | <b>3'655'953.92</b>        | <b>4'175'971.58</b>        |
| <b>Nettoertrag</b>   | <b>4'462'216.56</b>        | <b>5'789'032.85</b>        |
| Realisierte Kapitalgewinne und -verluste   | -5'810'248.85              | -2'448'377.29              |
| Teilübertrag von Aufwendungen auf realisierte Kapitalverluste  | -116'740.49                | -143'058.97                |
| <b>Realisierter Erfolg</b>   | <b>-1'464'772.78</b>       | <b>3'197'596.59</b>        |
| Nicht realisierte Kapitalgewinne und -verluste   | 5'889'899.54               | -29'154'112.09             |
| <b>Gesamterfolg</b>  | <b>4'425'126.76</b>        | <b>-25'956'515.50</b>      |
| <b>Verwendung des Erfolgs</b>  |                            |                            |
| Nettoertrag des Rechnungsjahres  | 4'462'216.56               | 5'789'032.85               |
| Vortrag des Vorjahres aus kollektiven Kapitalanlagen mit Immobilien im Direktbesitz                    | 6'711.87                   | 4'290.62                   |
| Vortrag des Vorjahres  | 146'490.25                 | 1'330'222.23               |
| <b>Zur Verteilung verfügbarer Erfolg</b>   | <b>4'615'418.68</b>        | <b>7'123'545.70</b>        |
| Zur Ausschüttung an die Anlegerinnen und Anleger vorgesehener Erfolg                                   | 3'395'531.65               | 5'566'026.20               |
| Zur Ausschüttung bestimmter Erfolg aus Kapitalanlagen mit Immobilien im Direktbesitz                   | 648.41                     | 728.03                     |
| Ablieferung/Ausschüttung der Verrechnungssteuer (35%)  | 410'464.56                 | 490'905.67                 |
| Zur Wiederanlage zurückbehaltener Ertrag (65%)   | 762'291.70                 | 911'682.42                 |
| Zur Wiederanlage zurückbehaltener Ertrag aus kollektiven Kapitalanlagen mit Immobilien im Direktbesitz | 1'393.33                   | 1'001.26                   |
| Vortrag Nettoerträge aus kollektiven Kapitalanlagen mit Immobilien im Direktbesitz                     | 9'960.39                   | 6'711.87                   |
| Vortrag auf neue Rechnung  | 35'128.64                  | 146'490.25                 |

| Anteilklasse A             |                            | Anteilklasse AH EUR        |                            | Anteilklasse B             |                            | Anteilklasse BH EUR        |                            |
|----------------------------|----------------------------|----------------------------|----------------------------|----------------------------|----------------------------|----------------------------|----------------------------|
| 01.01.2023 -<br>31.12.2023 | 01.01.2022 -<br>31.12.2022 | 01.01.2023 -<br>31.12.2023 | 01.01.2022 -<br>31.12.2022 | 01.01.2023 -<br>31.12.2023 | 01.01.2022 -<br>31.12.2022 | 01.01.2023 -<br>31.12.2023 | 01.01.2022 -<br>31.12.2022 |
| CHF                        | CHF                        | CHF                        | CHF                        | CHF                        | CHF                        | CHF                        | CHF                        |
| 6'398.75                   | 1'861.44                   | 714.17                     | 215.48                     | 3'193.58                   | 885.85                     | 348.33                     | 90.46                      |
| -66.52                     | -1'237.39                  | -7.17                      | -149.89                    | -31.89                     | -577.67                    | -3.15                      | -59.15                     |
| 8'694.91                   | 13'797.62                  | 964.45                     | 1'649.60                   | 4'358.26                   | 6'336.78                   | 475.25                     | 660.95                     |
| 88'835.38                  | 145'817.46                 | 9'806.49                   | 17'539.34                  | 44'688.52                  | 67'222.25                  | 4'901.00                   | 6'991.97                   |
| 0.00                       | 19'593.35                  | 0.00                       | 2'321.37                   | 0.00                       | 9'293.94                   | 0.00                       | 948.27                     |
| 129'497.04                 | 108'783.81                 | 14'378.02                  | 13'028.43                  | 64'840.78                  | 49'971.18                  | 7'083.90                   | 5'219.71                   |
| 13'866.22                  | 110'012.22                 | 1'616.64                   | 13'224.23                  | 6'805.33                   | 51'072.99                  | 739.08                     | 5'302.82                   |
| 493'567.08                 | 523'228.36                 | 56'240.40                  | 63'953.24                  | 246'276.25                 | 234'709.15                 | 26'769.35                  | 24'894.71                  |
| 242'798.66                 | 284'183.86                 | 26'975.47                  | 34'589.26                  | 121'474.56                 | 128'390.41                 | 13'240.15                  | 13'614.86                  |
| 0.00                       | 63.84                      | 0.00                       | 7.79                       | 0.00                       | 29.00                      | 0.00                       | 3.10                       |
| 1'192.22                   | 871.17                     | 133.81                     | 105.53                     | 584.19                     | 388.96                     | 62.26                      | 41.29                      |
| -759.74                    | -167.65                    | -70.87                     | -19.21                     | -406.42                    | -78.93                     | -45.25                     | -8.30                      |
| 6'262.29                   | 10'109.05                  | 7.98                       | 0.00                       | 18'399.20                  | 29'272.74                  | 365.31                     | 1'015.46                   |
| <b>990'286.29</b>          | <b>1'216'917.14</b>        | <b>110'759.39</b>          | <b>146'465.17</b>          | <b>510'182.36</b>          | <b>576'916.65</b>          | <b>53'936.23</b>           | <b>58'716.15</b>           |
| 158.07                     | 99.13                      | 18.15                      | 11.80                      | 79.09                      | 46.40                      | 8.70                       | 4.73                       |
| 1'781.22                   | 1'809.66                   | 197.48                     | 217.42                     | 893.81                     | 830.12                     | 97.84                      | 86.90                      |
| 414'329.44                 | 504'657.74                 | 48'147.82                  | 63'741.29                  | 207'551.63                 | 230'242.83                 | 23'725.22                  | 25'324.31                  |
| 10'208.15                  | 12'434.24                  | 1'133.68                   | 1'500.89                   | 5'113.02                   | 5'672.30                   | 558.58                     | 596.29                     |
| -65'354.68                 | -82'388.86                 | -9'270.16                  | -12'876.39                 | -33'584.10                 | -37'614.40                 | -4'767.62                  | -5'077.34                  |
| -441.22                    | -317.28                    | -48.98                     | -38.20                     | -215.76                    | -142.42                    | -23.01                     | -15.10                     |
| 441.22                     | 317.28                     | 48.98                      | 38.20                      | 215.76                     | 142.42                     | 23.01                      | 15.10                      |
| 3'006.87                   | 2'127.02                   | 312.05                     | 325.73                     | 1'553.15                   | 973.09                     | 170.75                     | 128.01                     |
| 68'412.07                  | 58'857.21                  | 14'394.19                  | 12'171.09                  | 34'549.90                  | 31'501.88                  | 753.69                     | 407.41                     |
| <b>432'541.14</b>          | <b>497'596.14</b>          | <b>54'933.21</b>           | <b>65'091.83</b>           | <b>216'156.50</b>          | <b>231'652.22</b>          | <b>20'547.16</b>           | <b>21'470.31</b>           |
| <b>557'745.15</b>          | <b>719'321.00</b>          | <b>55'826.18</b>           | <b>81'373.34</b>           | <b>294'025.86</b>          | <b>345'264.43</b>          | <b>33'389.07</b>           | <b>37'245.84</b>           |
| -685'254.91                | -195'468.96                | -121'938.62                | -243'323.47                | -359'623.47                | -95'019.46                 | -73'641.38                 | -106'905.37                |
| -65'354.68                 | -82'388.86                 | -9'270.16                  | -12'876.39                 | -33'584.10                 | -37'614.40                 | -4'767.62                  | -5'077.34                  |
| <b>-192'864.44</b>         | <b>441'463.18</b>          | <b>-75'382.60</b>          | <b>-174'826.52</b>         | <b>-99'181.71</b>          | <b>212'630.57</b>          | <b>-45'019.93</b>          | <b>-74'736.87</b>          |
| 756'669.79                 | -3'743'824.94              | 41'831.96                  | -365'993.66                | 379'036.30                 | -1'754'424.56              | 23'461.24                  | -160'856.57                |
| <b>563'805.35</b>          | <b>-3'302'361.76</b>       | <b>-33'550.64</b>          | <b>-540'820.18</b>         | <b>279'854.59</b>          | <b>-1'541'793.99</b>       | <b>-21'558.69</b>          | <b>-235'593.44</b>         |
| 557'745.15                 | 719'321.00                 | 55'826.18                  | 81'373.34                  | 294'025.86                 | 345'264.43                 | 33'389.07                  | 37'245.84                  |
| 72.95                      | 53.35                      | 83.21                      | 24.64                      | 0.00                       | 0.00                       | 0.00                       | 0.00                       |
| 335.51                     | 189'444.13                 | 0.01                       | 25'635.31                  | 0.00                       | 0.00                       | 0.00                       | 0.00                       |
| <b>558'153.61</b>          | <b>908'818.48</b>          | <b>55'909.40</b>           | <b>107'033.29</b>          | <b>294'025.86</b>          | <b>345'264.43</b>          | <b>33'389.07</b>           | <b>37'245.84</b>           |
| 557'365.32                 | 907'910.89                 | 55'450.58                  | 106'950.07                 | 0.00                       | 0.00                       | 0.00                       | 0.00                       |
| 620.21                     | 499.13                     | 0.00                       | 0.00                       | 0.00                       | 0.00                       | 0.00                       | 0.00                       |
| 0.00                       | 0.00                       | 0.00                       | 0.00                       | 102'786.79                 | 120'756.78                 | 11'672.59                  | 13'026.72                  |
| 0.00                       | 0.00                       | 0.00                       | 0.00                       | 190'889.91                 | 224'262.68                 | 21'677.69                  | 24'192.49                  |
| 0.00                       | 0.00                       | 0.00                       | 0.00                       | 349.16                     | 244.97                     | 38.79                      | 26.63                      |
| 128.44                     | 72.95                      | 150.66                     | 83.21                      | 0.00                       | 0.00                       | 0.00                       | 0.00                       |
| 39.64                      | 335.51                     | 308.16                     | 0.01                       | 0.00                       | 0.00                       | 0.00                       | 0.00                       |

|  | Anteilklasse IA            |                            |
|--|----------------------------|----------------------------|
|  | 01.01.2023 -<br>31.12.2023 | 01.01.2022 -<br>31.12.2022 |
|  | CHF                        | CHF                        |
| <b>Ertrag</b>  |                            |                            |
| Erträge der Bankguthaben   | 2'247.89                   | 1'251.69                   |
| Negativzinsen  | -27.59                     | -846.25                    |
| Erträge der Effektenleihen   | 2'911.17                   | 9'117.65                   |
| Erträge der Ausgleichszahlungen  | 28'837.94                  | 98'052.66                  |
| Erträge der Geldmarktinstrumenten  | 0.00                       | 13'472.85                  |
| Erträge der Effekten, aufgeteilt in:   |                            |                            |
| - Obligationen, Wandelobligationen, Optionsanleihen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte     | 44'445.10                  | 72'468.49                  |
| - Strukturierte Produkte   | 6'158.34                   | 68'700.42                  |
| - Aktien und sonstige Beteiligungswertpapiere und -rechte, einschliesslich Gratisaktien                | 204'953.44                 | 349'807.34                 |
| - Anteile anderer kollektiver Kapitalanlagen   | 87'508.10                  | 188'345.78                 |
| Erträge der Rückvergütungen  | 0.00                       | 42.69                      |
| Erträge aus kollektiven Kapitalanlagen mit Immobilien im Direktbesitz                                  | 478.62                     | 588.30                     |
| Sonstige Erträge   | -27.10                     | -71.02                     |
| Einkauf in laufende Nettoerträge bei der Ausgabe von Anteilen  | 12'844.63                  | 3'412.59                   |
| <b>Total Erträge</b>   | <b>390'330.54</b>          | <b>804'343.19</b>          |
| <b>Aufwendungen</b>  |                            |                            |
| Passivzinsen   | 60.91                      | 67.73                      |
| Prüfaufwand  | 602.14                     | 1'203.60                   |
| Reglementarische Vergütung an:   |                            |                            |
| - die Fondsleitung   | 51'508.72                  | 121'891.23                 |
| - die Depotbank  | 3'502.63                   | 8'288.20                   |
| Teilübertrag von Aufwendungen auf realisierte Kapitalverluste  | 0.00                       | 0.00                       |
| Teilübertrag von Aufwendungen auf kollektiven Kapitalanlagen mit Immobilien im Direktbesitz            | -71.46                     | -98.06                     |
| Aufwände aus kollektiven Kapitalanlagen mit Immobilien im Direktbesitz                                 | 71.46                      | 98.06                      |
| Sonstige Aufwendungen  | 659.31                     | 1'342.90                   |
| Ausrichtung laufender Nettoerträge bei Rücknahme von Anteilen  | 332'959.65                 | 346'841.89                 |
| <b>Total Aufwendungen</b>  | <b>389'293.36</b>          | <b>479'635.55</b>          |
| <b>Nettoertrag</b>   | <b>1'037.18</b>            | <b>324'707.64</b>          |
| Realisierte Kapitalgewinne und -verluste   | -87'756.73                 | -84'561.23                 |
| Teilübertrag von Aufwendungen auf realisierte Kapitalverluste  | 0.00                       | 0.00                       |
| <b>Realisierter Erfolg</b>   | <b>-86'719.55</b>          | <b>240'146.41</b>          |
| Nicht realisierte Kapitalgewinne und -verluste   | 96'183.82                  | -1'578'227.20              |
| <b>Gesamterfolg</b>  | <b>9'464.27</b>            | <b>-1'338'080.79</b>       |
| <b>Verwendung des Erfolgs</b>  |                            |                            |
| Nettoertrag des Rechnungsjahres  | 1'037.18                   | 324'707.64                 |
| Vortrag des Vorjahres aus kollektiven Kapitalanlagen mit Immobilien im Direktbesitz                    | 48.02                      | 38.67                      |
| Vortrag des Vorjahres  | 122'781.26                 | 210'327.69                 |
| <b>Zur Verteilung verfügbarer Erfolg</b>   | <b>123'866.46</b>          | <b>535'074.00</b>          |
| Zur Ausschüttung an die Anlegerinnen und Anleger vorgesehener Erfolg                                   | 101'520.00                 | 412'015.82                 |
| Zur Ausschüttung bestimmter Erfolg aus Kapitalanlagen mit Immobilien im Direktbesitz                   | 28.20                      | 228.90                     |
| Ablieferung/Ausschüttung der Verrechnungssteuer (35%)  | 0.00                       | 0.00                       |
| Zur Wiederanlage zurückbehaltener Ertrag (65%)   | 0.00                       | 0.00                       |
| Zur Wiederanlage zurückbehaltener Ertrag aus kollektiven Kapitalanlagen mit Immobilien im Direktbesitz | 0.00                       | 0.00                       |
| Vortrag Nettoerträge aus kollektiven Kapitalanlagen mit Immobilien im Direktbesitz                     | 21.13                      | 48.02                      |
| Vortrag auf neue Rechnung  | 22'297.13                  | 122'781.26                 |



| Anteilklasse UA            |                            | Anteilklasse UAH EUR       |                            | Anteilklasse UB            |                            | Anteilklasse UBH EUR       |                            |
|----------------------------|----------------------------|----------------------------|----------------------------|----------------------------|----------------------------|----------------------------|----------------------------|
| 01.01.2023 -<br>31.12.2023 | 01.01.2022 -<br>31.12.2022 | 01.01.2023 -<br>31.12.2023 | 01.01.2022 -<br>31.12.2022 | 01.01.2023 -<br>31.12.2023 | 01.01.2022 -<br>31.12.2022 | 01.01.2023 -<br>31.12.2023 | 01.01.2022 -<br>31.12.2022 |
| CHF                        | CHF                        | CHF                        | CHF                        | CHF                        | CHF                        | CHF                        | CHF                        |
| 28'561.89                  | 7'929.04                   | 1'318.15                   | 363.64                     | 8'652.71                   | 2'428.86                   | 565.89                     | 158.68                     |
| -283.18                    | -5'154.46                  | -13.31                     | -237.69                    | -85.62                     | -1'622.30                  | -5.31                      | -107.02                    |
| 38'792.94                  | 57'408.74                  | 1'785.84                   | 2'670.20                   | 11'771.20                  | 17'824.26                  | 770.03                     | 1'200.50                   |
| 397'773.58                 | 606'540.54                 | 18'272.11                  | 28'173.04                  | 120'827.34                 | 189'210.18                 | 7'947.96                   | 12'637.89                  |
| 0.00                       | 82'910.95                  | 0.00                       | 3'777.85                   | 0.00                       | 25'625.78                  | 0.00                       | 1'684.15                   |
| 579'046.71                 | 452'265.58                 | 26'667.41                  | 21'070.90                  | 175'529.03                 | 140'616.51                 | 11'511.16                  | 9'418.92                   |
| 60'463.06                  | 458'080.55                 | 2'930.49                   | 21'454.00                  | 18'642.50                  | 143'129.34                 | 1'199.19                   | 9'551.95                   |
| 2'201'434.61               | 2'135'204.58               | 101'833.50                 | 100'465.95                 | 668'977.53                 | 674'549.42                 | 43'408.17                  | 45'630.93                  |
| 1'085'581.76               | 1'167'302.34               | 49'921.47                  | 55'072.15                  | 328'806.95                 | 365'878.45                 | 21'499.97                  | 24'761.59                  |
| 0.00                       | 260.74                     | 0.00                       | 12.26                      | 0.00                       | 82.71                      | 0.00                       | 5.59                       |
| 5'175.27                   | 3'556.63                   | 244.72                     | 168.55                     | 1'586.11                   | 1'114.06                   | 101.01                     | 76.01                      |
| -3'412.83                  | -705.99                    | -149.21                    | -34.41                     | -1'082.09                  | -216.85                    | -72.78                     | -14.31                     |
| 39'932.45                  | 266'790.74                 | 52.03                      | 15'812.50                  | 6'090.88                   | 16'640.47                  | 104.38                     | 221.44                     |
| <b>4'433'066.26</b>        | <b>5'232'389.98</b>        | <b>202'863.20</b>          | <b>248'768.94</b>          | <b>1'339'716.54</b>        | <b>1'575'260.89</b>        | <b>87'029.67</b>           | <b>105'226.32</b>          |
| 713.09                     | 414.10                     | 33.13                      | 19.05                      | 215.05                     | 129.58                     | 14.21                      | 8.46                       |
| 7'977.47                   | 7'517.84                   | 366.84                     | 350.36                     | 2'419.03                   | 2'339.56                   | 158.87                     | 157.02                     |
| 1'529'694.85               | 1'726'385.76               | 74'439.33                  | 85'292.27                  | 464'039.42                 | 538'017.96                 | 32'138.81                  | 38'295.63                  |
| 45'623.32                  | 51'489.86                  | 2'102.14                   | 2'408.63                   | 13'839.09                  | 16'045.00                  | 907.56                     | 1'081.41                   |
| 0.00                       | 0.00                       | -2'449.52                  | -3'492.99                  | 0.00                       | 0.00                       | -1'314.41                  | -1'608.99                  |
| -1'882.20                  | -1'287.77                  | -90.63                     | -61.68                     | -576.50                    | -400.50                    | -37.40                     | -27.68                     |
| 1'882.20                   | 1'287.77                   | 90.63                      | 61.68                      | 576.50                     | 400.50                     | 37.40                      | 27.68                      |
| 13'560.53                  | 8'826.22                   | 608.72                     | 522.93                     | 4'162.72                   | 2'746.55                   | 277.25                     | 234.95                     |
| 275'128.53                 | 331'296.94                 | 14'672.57                  | 10'086.43                  | 62'328.59                  | 57'919.61                  | 825.36                     | 4'041.39                   |
| <b>1'872'697.79</b>        | <b>2'125'930.72</b>        | <b>89'773.21</b>           | <b>95'186.68</b>           | <b>547'003.90</b>          | <b>617'198.26</b>          | <b>33'007.65</b>           | <b>42'209.87</b>           |
| <b>2'560'368.47</b>        | <b>3'106'459.26</b>        | <b>113'089.99</b>          | <b>153'582.26</b>          | <b>792'712.64</b>          | <b>958'062.63</b>          | <b>54'022.02</b>           | <b>63'016.45</b>           |
| -3'143'999.88              | -838'575.86                | -250'557.55                | -440'275.46                | -968'102.66                | -263'647.99                | -119'373.65                | -180'599.49                |
| 0.00                       | 0.00                       | -2'449.52                  | -3'492.99                  | 0.00                       | 0.00                       | -1'314.41                  | -1'608.99                  |
| <b>-583'631.41</b>         | <b>2'267'883.40</b>        | <b>-139'917.08</b>         | <b>-290'186.19</b>         | <b>-175'390.02</b>         | <b>694'414.64</b>          | <b>-66'666.04</b>          | <b>-119'192.03</b>         |
| 3'445'228.83               | -15'785'470.73             | 84'790.42                  | -659'107.49                | 1'024'737.24               | -4'834'348.05              | 37'959.94                  | -271'858.89                |
| <b>2'861'597.42</b>        | <b>-13'517'587.33</b>      | <b>-55'126.66</b>          | <b>-949'293.68</b>         | <b>849'347.22</b>          | <b>-4'139'933.41</b>       | <b>-28'706.10</b>          | <b>-391'050.92</b>         |
| 2'560'368.47               | 3'106'459.26               | 113'089.99                 | 153'582.26                 | 792'712.64                 | 958'062.63                 | 54'022.02                  | 63'016.45                  |
| 6'339.81                   | 4'117.10                   | 167.88                     | 56.87                      | 0.00                       | 0.00                       | 0.00                       | 0.00                       |
| 22'129.75                  | 862'597.05                 | 1'243.72                   | 42'218.04                  | 0.00                       | 0.00                       | 0.00                       | 0.00                       |
| <b>2'588'838.03</b>        | <b>3'973'173.41</b>        | <b>114'501.59</b>          | <b>195'857.17</b>          | <b>792'712.64</b>          | <b>958'062.63</b>          | <b>54'022.02</b>           | <b>63'016.45</b>           |
| 2'567'609.87               | 3'944'703.85               | 113'585.88                 | 194'445.57                 | 0.00                       | 0.00                       | 0.00                       | 0.00                       |
| 0.00                       | 0.00                       | 0.00                       | 0.00                       | 0.00                       | 0.00                       | 0.00                       | 0.00                       |
| 0.00                       | 0.00                       | 0.00                       | 0.00                       | 277'119.45                 | 335'082.37                 | 18'885.73                  | 22'039.80                  |
| 0.00                       | 0.00                       | 0.00                       | 0.00                       | 514'650.54                 | 622'296.17                 | 35'073.56                  | 40'931.08                  |
| 0.00                       | 0.00                       | 0.00                       | 0.00                       | 942.65                     | 684.09                     | 62.73                      | 45.57                      |
| 9'355.83                   | 6'339.81                   | 304.33                     | 167.88                     | 0.00                       | 0.00                       | 0.00                       | 0.00                       |
| 11'872.33                  | 22'129.75                  | 611.38                     | 1'243.72                   | 0.00                       | 0.00                       | 0.00                       | 0.00                       |

## Zusammensetzung des Portefolles und Bestandesveränderungen

| Titelbezeichnung   | Währung | 31.12.2022<br>Anzahl/<br>Nominal | Käufe (1) | Verkäufe (1) | 31.12.2023<br>Anzahl/<br>Nominal | Kurswert CHF        | in % des<br>Gesamtfonds-<br>vermögens |
|--|---------|----------------------------------|-----------|--------------|----------------------------------|---------------------|---------------------------------------|
| <b>Börsennotierte / an einem geregelten Markt gehandelte Wertpapiere; bewertet zu den Kursen, die am Hauptmarkt bezahlt werden</b> |         |                                  |           |              |                                  |                     |                                       |
| <b>Aktien (und aktienähnliche Wertpapiere)</b>   |         |                                  |           |              |                                  |                     |                                       |
| <b>AUSTRALISCHER DOLLAR</b>  |         |                                  |           |              |                                  |                     |                                       |
| AMPOL LTD  | AUD     | 21'000                           | 30'000    | 26'000       | 25'000                           | 519'004.49          | 0.29                                  |
| ANZ GROUP HOLDINGS LTD   | AUD     | 6'210                            |           | 6'210        |                                  |                     |                                       |
| APA GROUP (stapled security)   | AUD     | 26'040                           | 2'000     | 17'040       | 11'000                           | 53'947.75           | 0.03                                  |
| AURIZON HOLDINGS   | AUD     | 56'700                           | 63'300    | 65'000       | 55'000                           | 120'024.28          | 0.07                                  |
| AUSTRALIA & NEW ZEALAND BANKING GROUP  | AUD     |                                  | 16'910    | 2'410        | 14'500                           | 215'836.96          | 0.12                                  |
| BHP BILLITON   | AUD     | 10'700                           | 4'100     | 4'300        | 10'500                           | 303'968.66          | 0.17                                  |
| COLES GROUP LTD  | AUD     | 13'440                           | 1'700     | 4'440        | 10'700                           | 98'992.46           | 0.06                                  |
| COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA   | AUD     |                                  | 10'000    |              | 10'000                           | 642'043.73          | 0.36                                  |
| COMPUTERSHARE  | AUD     | 18'000                           | 2'400     | 20'400       |                                  |                     |                                       |
| FORTESCUE METALS GROUP   | AUD     | 88'890                           | 16'700    | 60'590       | 45'000                           | 749'950.73          | 0.42                                  |
| HARVEY NORMAN HOLDINGS   | AUD     | 135'140                          | 20'100    | 141'440      | 13'800                           | 33'285.20           | 0.02                                  |
| IPH  | AUD     | 14'000                           | 1'700     | 15'700       |                                  |                     |                                       |
| JB HI-FI   | AUD     | 13'190                           | 1'825     | 13'915       | 1'100                            | 33'499.41           | 0.02                                  |
| MAGELLAN   | AUD     | 10'940                           | 52'894    | 4'834        | 59'000                           | 314'429.15          | 0.18                                  |
| METCASH  | AUD     | 137'870                          | 109'200   | 67'070       | 180'000                          | 360'761.96          | 0.20                                  |
| NINE ENTERTAINMENT COMPANY HOLDINGS  | AUD     | 268'000                          | 316'800   | 359'800      | 225'000                          | 261'009.73          | 0.15                                  |
| NRW HOLDINGS   | AUD     | 93'200                           | 11'700    | 26'900       | 78'000                           | 133'485.37          | 0.08                                  |
| PENDAL GROUP LTD   | AUD     | 29'630                           |           | 29'630       |                                  |                     |                                       |
| PERPETUAL  | AUD     |                                  | 8'332     | 1'832        | 6'500                            | 95'112.06           | 0.05                                  |
| PLATINUM ASSET MANAGEMENT  | AUD     | 78'280                           | 259'800   | 38'080       | 300'000                          | 229'137.25          | 0.13                                  |
| RIO TINTO  | AUD     | 15'000                           | 2'000     | 4'200        | 12'800                           | 997'205.33          | 0.56                                  |
| SMARTGROUP CORP LTD  | AUD     | 28'980                           | 3'900     | 32'880       |                                  |                     |                                       |
| SONIC HEALTHCARE   | AUD     |                                  | 6'000     | 6'000        |                                  |                     |                                       |
| SOUTH32  | AUD     | 311'500                          | 79'700    | 241'200      | 150'000                          | 286'852.28          | 0.16                                  |
| SUNCORP GROUP LTD  | AUD     | 38'360                           | 6'700     | 13'860       | 31'200                           | 248'157.37          | 0.14                                  |
| TELSTRA GROUP LIMITED  | AUD     |                                  | 104'300   | 12'300       | 92'000                           | 209'221.26          | 0.12                                  |
| TRANSURBAN GROUP (stapled security)  | AUD     | 16'320                           |           | 16'320       |                                  |                     |                                       |
| WESFARMERS   | AUD     | 41'400                           | 11'500    | 24'400       | 28'500                           | 933'570.64          | 0.53                                  |
| WOODSIDE ENERGY GROUP LTD  | AUD     | 27'100                           | 18'500    | 12'600       | 33'000                           | 588'624.32          | 0.33                                  |
| WORLEYPARSONS  | AUD     | 38'640                           | 4'900     | 43'540       |                                  |                     |                                       |
|  |         |                                  |           |              |                                  | <b>7'428'120.39</b> | <b>4.19</b>                           |
| <b>ENGLISCHES PFUND</b>  |         |                                  |           |              |                                  |                     |                                       |
| ABRDN PLC  | GBP     | 25'000                           | 1'500     | 8'500        | 18'000                           | 34'500.45           | 0.02                                  |
| ADMIRAL GROUP  | GBP     |                                  | 35'000    | 35'000       |                                  |                     |                                       |
| ANGLO AMERICAN   | GBP     | 40'000                           | 21'300    | 16'300       | 45'000                           | 951'393.54          | 0.54                                  |
| ANTOFAGASTA  | GBP     | 57'000                           | 4'200     | 61'200       |                                  |                     |                                       |
| ASTRAZENECA  | GBP     | 5'000                            |           | 4'100        | 900                              | 102'352.29          | 0.06                                  |
| BARRATT DEVELOPMENTS   | GBP     | 50'000                           | 84'800    | 26'800       | 108'000                          | 651'887.55          | 0.37                                  |
| BHP GROUP LTD  | GBP     | 19'000                           | 1'000     | 6'500        | 13'500                           | 389'542.21          | 0.22                                  |
| BP   | GBP     | 41'700                           | 16'000    | 39'700       | 18'000                           | 90'021.74           | 0.05                                  |
| DIRECT LINE INSURANCE GROUP  | GBP     | 20'000                           |           | 20'000       |                                  |                     |                                       |
| FERGUSON   | GBP     | 1'100                            |           | 1'100        |                                  |                     |                                       |
| GLENORE  | GBP     | 55'000                           |           | 10'000       | 45'000                           | 227'926.97          | 0.13                                  |
| GSK PLC  | GBP     | 44'000                           | 7'300     | 42'300       | 9'000                            | 140'029.52          | 0.08                                  |
| HSBC HOLDINGS  | GBP     | 10'300                           | 91'700    | 12'000       | 90'000                           | 613'630.97          | 0.35                                  |
| IG GROUP HOLDINGS  | GBP     | 6'400                            | 32'800    | 6'700        | 32'500                           | 266'917.94          | 0.15                                  |
| J. SAINSBURY   | GBP     | 195'000                          | 20'000    | 66'500       | 148'500                          | 482'108.27          | 0.27                                  |
| KELLER GROUP   | GBP     | 14'000                           | 500       | 5'500        | 9'000                            | 84'971.72           | 0.05                                  |
| KINGFISHER   | GBP     | 400'000                          | 23'000    | 130'500      | 292'500                          | 763'514.31          | 0.43                                  |
| LEGAL & GENERAL GROUP  | GBP     | 20'600                           | 204'300   | 35'900       | 189'000                          | 509'164.04          | 0.29                                  |
| M&G PLC  | GBP     | 27'000                           | 160'300   | 25'300       | 162'000                          | 386'544.06          | 0.22                                  |
| NEXT   | GBP     | 16'000                           |           | 16'000       |                                  |                     |                                       |
| PERSIMMON  | GBP     | 22'000                           | 1'300     | 9'800        | 13'500                           | 201'180.19          | 0.11                                  |
| RENEWABLES INFRASTRUCTURE GROU   | GBP     | 150'000                          | 50'000    |              | 200'000                          | 244'186.39          | 0.14                                  |
| RIO TINTO  | GBP     | 18'700                           | 24'176    | 23'876       | 19'000                           | 1'190'870.01        | 0.67                                  |
| SHELL PLC  | GBP     | 8'000                            | 3'800     | 8'200        | 3'600                            | 99'320.35           | 0.06                                  |
| SSE  | GBP     |                                  | 30'000    | 7'500        | 22'500                           | 448'032.68          | 0.25                                  |
| TESCO PLC  | GBP     | 185'000                          | 10'300    | 105'300      | 90'000                           | 280'503.22          | 0.16                                  |
| UNILEVER   | GBP     | 10'000                           | 500       | 6'000        | 4'500                            | 183'461.66          | 0.10                                  |
| VESUVIUS   | GBP     | 20'000                           | 1'000     | 7'500        | 13'500                           | 69'696.12           | 0.04                                  |
| VODAFONE GROUP   | GBP     | 160'000                          | 8'900     | 47'400       | 121'500                          | 89'370.93           | 0.05                                  |
| WOODSIDE ENERGY GROUP LTD  | GBP     | 10'000                           |           | 10'000       |                                  |                     |                                       |
|  |         |                                  |           |              |                                  | <b>8'501'127.13</b> | <b>4.79</b>                           |
| <b>EURO</b>  |         |                                  |           |              |                                  |                     |                                       |
| ACTIVIDADES DE CONSTRUCCION Y SERVICIOS  | EUR     | 6'990                            | 900       | 1'890        | 6'000                            | 224'020.51          | 0.13                                  |
| ALLIANZ SE (reg. shares) ((restricted))  | EUR     | 3'700                            | 1'900     | 4'100        | 1'500                            | 337'411.37          | 0.19                                  |

| Titelbezeichnung                             | Währung | 31.12.2022<br>Anzahl/<br>Nominal | Käufe (1) | Verkäufe (1) | 31.12.2023<br>Anzahl/<br>Nominal | Kurswert CHF         | in % des<br>Gesamtfonds-<br>vermögens |
|--|---------|----------------------------------|-----------|--------------|----------------------------------|----------------------|---------------------------------------|
| ASR NEDERLAND                                | EUR     | 14'990                           | 2'000     | 4'490        | 12'500                           | 496'227.38           | 0.28                                  |
| AXA  | EUR     | 13'830                           | 1'900     | 3'330        | 12'400                           | 339'968.98           | 0.19                                  |
| BASF (reg. shares)                           | EUR     | 17'240                           | 2'200     | 4'840        | 14'600                           | 662'121.18           | 0.37                                  |
| BILFINGER                                    | EUR     | 7'000                            |           | 7'000        |                                  |                      |                                       |
| BMW  | EUR     | 10'050                           | 1'800     | 3'850        | 8'000                            | 749'561.33           | 0.42                                  |
| BNP PARIBAS -A-                              | EUR     |                                  | 4'300     | 600          | 3'700                            | 215'302.72           | 0.12                                  |
| BOUYGUES                                     | EUR     | 5'000                            | 700       | 1'700        | 4'000                            | 126'885.46           | 0.07                                  |
| CIE GENERALE DES ETABLISSEMENTS MICHELIN SA  | EUR     |                                  | 10'400    | 400          | 10'000                           | 301'780.62           | 0.17                                  |
| COVIVIO FONCIERE DES REGIONS                 | EUR     | 3'050                            |           | 3'050        |                                  |                      |                                       |
| CREDIT AGRICOLE                              | EUR     | 15'290                           | 2'100     | 4'890        | 12'500                           | 149'356.31           | 0.08                                  |
| CRH PLC                                      | EUR     | 7'000                            |           | 7'000        |                                  |                      |                                       |
| DANONE                                       | EUR     | 1'675                            | 7'100     | 1'275        | 7'500                            | 409'160.97           | 0.23                                  |
| E.ON (reg. shares)                           | EUR     | 7'000                            | 1'000     | 1'700        | 6'300                            | 71'163.89            | 0.04                                  |
| EBRO FOODS                                   | EUR     | 24'000                           |           | 24'000       |                                  |                      |                                       |
| EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL (reg. shares)       | EUR     | 15'000                           | 2'000     | 3'800        | 13'200                           | 55'899.14            | 0.03                                  |
| ENDESA                                       | EUR     | 21'000                           | 4'300     | 6'300        | 19'000                           | 326'082.98           | 0.18                                  |
| ENEL   | EUR     | 100'000                          | 58'000    | 113'000      | 45'000                           | 281'559.65           | 0.16                                  |
| ENI  | EUR     | 11'000                           | 2'600     | 2'600        | 11'000                           | 156'959.39           | 0.09                                  |
| EVONIK INDUSTRIES (reg. shares)              | EUR     | 7'000                            | 1'000     | 2'000        | 6'000                            | 103'196.70           | 0.06                                  |
| GALP ENERGIA -B-                             | EUR     | 20'000                           |           | 20'000       |                                  |                      |                                       |
| HEIDELBERGCEMENT                             | EUR     | 2'460                            | 300       | 760          | 2'000                            | 150'499.84           | 0.08                                  |
| KESKO -B-                                    | EUR     | 8'960                            | 38'200    | 7'860        | 39'300                           | 654'929.49           | 0.37                                  |
| KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE                   | EUR     | 19'000                           | 6'800     | 19'000       | 6'800                            | 164'465.79           | 0.09                                  |
| MANDATUM HOLDING OY                          | EUR     |                                  | 1'400     |              | 1'400                            | 5'297.43             | 0.00                                  |
| MAFPRE (reg. shares)                         | EUR     | 56'000                           | 7'700     | 14'700       | 49'000                           | 88'513.95            | 0.05                                  |
| MERCEDES-BENZ GROUP AG                       | EUR     |                                  | 13'400    | 1'400        | 12'000                           | 697'832.82           | 0.39                                  |
| NATURGY ENERGY GROUP                         | EUR     | 10'400                           | 1'400     | 3'300        | 8'500                            | 213'366.15           | 0.12                                  |
| OESTERREICH POST                             | EUR     | 3'200                            | 400       | 850          | 2'750                            | 83'603.27            | 0.05                                  |
| ORANGE                                       | EUR     | 40'000                           | 15'700    | 10'700       | 45'000                           | 431'083.30           | 0.24                                  |
| ORION CORPORATION (new) -B-                  | EUR     |                                  | 10'000    |              | 10'000                           | 365'093.19           | 0.21                                  |
| POSTNL                                       | EUR     | 40'000                           | 9'100     | 11'100       | 38'000                           | 49'919.31            | 0.03                                  |
| PROXIMUS                                     | EUR     | 7'000                            | 24'800    | 1'800        | 30'000                           | 237'352.41           | 0.13                                  |
| RANDSTAD HOLDING                             | EUR     | 3'400                            | 500       | 900          | 3'000                            | 158'197.75           | 0.09                                  |
| RED ELECTRICA CORPORACION                    | EUR     | 18'000                           | 3'400     | 4'700        | 16'700                           | 231'492.51           | 0.13                                  |
| SAMPO -A-                                    | EUR     | 1'800                            | 200       | 2'000        |                                  |                      |                                       |
| SAMPO PLC -A-                                | EUR     |                                  | 1'400     |              | 1'400                            | 51'555.58            | 0.03                                  |
| SANOFI                                       | EUR     | 6'000                            | 800       | 1'400        | 5'400                            | 450'629.31           | 0.25                                  |
| SNAM   | EUR     | 93'240                           | 11'300    | 29'540       | 75'000                           | 324'581.51           | 0.18                                  |
| SOLVAY                                       | EUR     | 1'170                            |           | 1'170        |                                  |                      |                                       |
| STELLANTIS NV                                | EUR     |                                  | 30'000    |              | 30'000                           | 589'894.65           | 0.33                                  |
| TELEFONICA                                   | EUR     | 26'720                           | 3'700     | 9'920        | 20'500                           | 67'353.98            | 0.04                                  |
| TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDING (reg. shares) | EUR     | 70'000                           | 12'100    | 82'100       |                                  |                      |                                       |
| TERNA  | EUR     | 35'000                           |           | 35'000       |                                  |                      |                                       |
| TOTAL ENERGIES                               | EUR     | 12'000                           | 11'700    | 9'700        | 14'000                           | 801'773.28           | 0.45                                  |
| UPM-KYMMENE                                  | EUR     | 6'500                            | 1'000     | 1'500        | 6'000                            | 189'993.49           | 0.11                                  |
|  |         |                                  |           |              |                                  | <b>11'014'087.59</b> | <b>6.21</b>                           |
| <b>HONGKONG-DOLLAR</b>                       |         |                                  |           |              |                                  |                      |                                       |
| CHINA CONSTRUCTION BANK -H-                  | HKD     | 708'000                          |           | 708'000      |                                  |                      |                                       |
| CHINA MOLYBDENUM -H-                         | HKD     | 1'593'000                        |           | 1'392'000    | 201'000                          | 92'506.00            | 0.05                                  |
|  |         |                                  |           |              |                                  | <b>92'506.00</b>     | <b>0.05</b>                           |
| <b>KANADISCHER DOLLAR</b>                    |         |                                  |           |              |                                  |                      |                                       |
| ALGONQUIN POWER & UTILITIES                  | CAD     | 39'000                           | 40'000    | 19'000       | 60'000                           | 320'154.83           | 0.18                                  |
| ALTAGAS                                      | CAD     | 15'500                           |           | 8'000        | 7'500                            | 133'174.45           | 0.08                                  |
| BANK OF MONTREAL                             | CAD     | 2'500                            |           |              | 2'500                            | 209'208.03           | 0.12                                  |
| BANK OF NOVA SCOTIA                          | CAD     | 8'000                            | 6'000     | 4'000        | 10'000                           | 411'682.34           | 0.23                                  |
| BCE  | CAD     | 9'500                            | 5'600     | 5'100        | 10'000                           | 332'984.00           | 0.19                                  |
| CANADIAN IMPERIAL BANK OF COMMERCE           | CAD     | 5'500                            |           | 500          | 5'000                            | 203'607.24           | 0.11                                  |
| CANADIAN TIRE (nv) -A-                       | CAD     | 3'600                            | 500       | 2'100        | 2'000                            | 179'633.92           | 0.10                                  |
| CANADIAN UTILITIES (nv)                      | CAD     | 12'000                           | 1'000     | 2'000        | 11'000                           | 223'897.75           | 0.13                                  |
| EMERA  | CAD     | 8'500                            |           |              | 8'500                            | 272'891.14           | 0.15                                  |
| ENBRIDGE                                     | CAD     | 5'000                            | 10'000    |              | 15'000                           | 456'680.18           | 0.26                                  |
| FORTIS                                       | CAD     | 6'030                            |           | 1'030        | 5'000                            | 173'959.72           | 0.10                                  |
| GREAT WEST LIFECO                            | CAD     | 18'000                           | 9'000     | 17'000       | 10'000                           | 279'943.99           | 0.16                                  |
| HYDRO ONE                                    | CAD     | 6'800                            |           | 6'800        |                                  |                      |                                       |
| IGM FINANCIAL                                | CAD     | 8'500                            |           |              | 8'500                            | 189'938.74           | 0.11                                  |
| KEYERA                                       | CAD     | 9'000                            | 16'000    |              | 25'000                           | 511'092.46           | 0.29                                  |
| LUNDIN MINING                                | CAD     | 67'000                           |           | 47'000       | 20'000                           | 138'376.33           | 0.08                                  |
| MANULIFE FINANCIAL                           | CAD     | 15'000                           | 30'000    |              | 45'000                           | 840'980.86           | 0.47                                  |
| PEMBINA PIPELINE                             | CAD     |                                  | 17'000    |              | 17'000                           | 495'001.74           | 0.28                                  |
| POWER CORP OF CANADA                         | CAD     | 10'500                           |           | 500          | 10'000                           | 241'839.44           | 0.14                                  |

Jahresbericht per 31. Dezember 2023

| Titelbezeichnung                                       | Währung | 31.12.2022<br>Anzahl/<br>Nominal | Käufe (1) | Verkäufe (1) | 31.12.2023<br>Anzahl/<br>Nominal | Kurswert CHF         | in % des<br>Gesamtfonds-<br>vermögens |
|--|---------|----------------------------------|-----------|--------------|----------------------------------|----------------------|---------------------------------------|
| QUEBECOR (v) -B-                                       | CAD     | 16'000                           | 8'000     | 8'000        | 16'000                           | 321'890.91           | 0.18                                  |
| RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL                        | CAD     | 6'000                            |           | 6'000        |                                  |                      |                                       |
| ROGERS COMMUNICATIONS (nv) -B-                         | CAD     | 9'000                            |           | 9'000        |                                  |                      |                                       |
| ROYAL BANK OF CANADA                                   | CAD     | 4'200                            | 4'600     | 4'400        | 4'400                            | 376'322.34           | 0.21                                  |
| SHAW COMMUNICATIONS (nv) -B-                           | CAD     | 10'000                           | 10'000    | 20'000       |                                  |                      |                                       |
| SUN LIFE FINANCIAL                                     | CAD     | 7'540                            | 2'460     |              | 10'000                           | 438'617.22           | 0.25                                  |
| TELUS NON-CANADIAN                                     | CAD     | 20'000                           |           | 7'000        | 13'000                           | 195'654.43           | 0.11                                  |
| TORONTO DOMINION BANK                                  | CAD     | 5'000                            | 1'000     |              | 6'000                            | 327'890.62           | 0.18                                  |
|  |         |                                  |           |              |                                  | <b>7'275'422.68</b>  | <b>4.10</b>                           |
| <b>MEXIKANISCHER PESO</b>                              |         |                                  |           |              |                                  |                      |                                       |
| GRUPO FINANCIERO BANORTE                               | MXN     |                                  | 35'000    | 5'000        | 30'000                           | 254'596.86           | 0.14                                  |
| KIMBERLY CLARK DE MEXICO -A-                           | MXN     | 434'900                          |           | 434'900      |                                  |                      |                                       |
|  |         |                                  |           |              |                                  | <b>254'596.86</b>    | <b>0.14</b>                           |
| <b>NORWEGISCHE KRONE</b>                               |         |                                  |           |              |                                  |                      |                                       |
| AKER BP ASA  | NOK     | 3'500                            | 500       | 1'000        | 3'000                            | 73'466.07            | 0.04                                  |
| SPAREBANK 1 OESTLANDET                                 | NOK     | 10'000                           | 1'600     | 1'600        | 10'000                           | 109'888.33           | 0.06                                  |
|  |         |                                  |           |              |                                  | <b>183'354.40</b>    | <b>0.10</b>                           |
| <b>SCHWEDISCHE KRONE</b>                               |         |                                  |           |              |                                  |                      |                                       |
| ELECTROLUX AB -B-                                      | SEK     | 14'000                           |           | 14'000       |                                  |                      |                                       |
| HENNES & MAURITZ STOCKHOLM -B-                         | SEK     | 16'000                           |           | 16'000       |                                  |                      |                                       |
|  |         |                                  |           |              |                                  | <b>0.00</b>          | <b>0.00</b>                           |
| <b>SCHWEIZER FRANKEN</b>                               |         |                                  |           |              |                                  |                      |                                       |
| ABB (reg. shares)                                      | CHF     | 79'000                           | 2'000     | 14'000       | 67'000                           | 2'499'100.00         | 1.41                                  |
| ADECCO (reg. shares)                                   | CHF     | 16'840                           |           | 6'840        | 10'000                           | 412'700.00           | 0.23                                  |
| ALCON INC  | CHF     | 20'500                           |           | 2'500        | 18'000                           | 1'181'520.00         | 0.67                                  |
| APG SGA (reg. shares)                                  | CHF     | 446                              |           |              | 446                              | 81'618.00            | 0.05                                  |
| BANQUE CANTONALE VAUDOISE                              | CHF     | 3'700                            |           | 2'100        | 1'600                            | 173'600.00           | 0.10                                  |
| CEMBRA MONEY (reg. shares)                             | CHF     | 9'780                            |           | 780          | 9'000                            | 590'400.00           | 0.33                                  |
| CIE FINANCIERE RICHEMONT (reg. shares)                 | CHF     | 15'000                           | 2'380     | 4'380        | 13'000                           | 1'504'750.00         | 0.85                                  |
| CLARIANT (reg. shares)                                 | CHF     | 89'800                           |           | 89'800       |                                  |                      |                                       |
| CS GROUP (reg. shares)                                 | CHF     | 315'000                          |           | 315'000      |                                  |                      |                                       |
| EFG INTERNATIONAL                                      | CHF     | 35'000                           |           | 3'000        | 32'000                           | 345'600.00           | 0.19                                  |
| GALENICA AG  | CHF     | 14'000                           |           | 14'000       |                                  |                      |                                       |
| GEBERIT  | CHF     | 1'760                            |           | 760          | 1'000                            | 539'000.00           | 0.30                                  |
| HELVETIA HOLDING LTD                                   | CHF     |                                  | 1'000     | 100          | 900                              | 104'310.00           | 0.06                                  |
| JULIUS BAER GRUPPE                                     | CHF     | 10'860                           |           | 860          | 10'000                           | 471'500.00           | 0.27                                  |
| KUEHNE & NAGEL INTERNATIONAL                           | CHF     | 2'010                            |           | 210          | 1'800                            | 521'640.00           | 0.29                                  |
| LAFARGEHOLCIM (reg. shares)                            | CHF     | 55'000                           | 23'480    | 10'480       | 68'000                           | 4'489'360.00         | 2.53                                  |
| LANDIS+GYR GROUP AG                                    | CHF     | 6'760                            |           | 560          | 6'200                            | 471'200.00           | 0.27                                  |
| LONZA GROUP (reg. shares)                              | CHF     | 3'000                            |           | 500          | 2'500                            | 884'250.00           | 0.50                                  |
| MOBILEZONE HOLDING (reg. shares)                       | CHF     | 22'070                           |           | 2'070        | 20'000                           | 274'400.00           | 0.15                                  |
| NESTLE (reg. shares)                                   | CHF     | 123'000                          | 39'500    | 59'000       | 103'500                          | 10'092'285.00        | 5.69                                  |
| NOVARTIS (reg. shares)                                 | CHF     | 96'000                           | 37'000    | 55'700       | 77'300                           | 6'560'451.00         | 3.70                                  |
| PARTNERS GROUP   | CHF     | 400                              |           | 60           | 340                              | 412'420.00           | 0.23                                  |
| ROCHE HOLDINGS (cert. shares)                          | CHF     | 31'000                           | 20'700    | 25'000       | 26'700                           | 6'528'150.00         | 3.68                                  |
| SANDOZ GROUP LTD                                       | CHF     |                                  | 16'300    |              | 16'300                           | 441'078.00           | 0.25                                  |
| SGS LTD  | CHF     |                                  | 9'750     | 1'750        | 8'000                            | 580'320.00           | 0.33                                  |
| SIKA LTD   | CHF     | 2'360                            |           | 260          | 2'100                            | 574'770.00           | 0.32                                  |
| SOCIETE GENERALE DE SURVEILLANCE HOLDING (reg. shares) | CHF     | 410                              | 390       | 800          |                                  |                      |                                       |
| SONOVA HOLDING (reg. shares)                           | CHF     | 2'850                            | 1'850     | 2'850        | 1'850                            | 507'640.00           | 0.29                                  |
| STRAUMANN HOLDING LTD                                  | CHF     | 4'830                            |           | 430          | 4'400                            | 596'640.00           | 0.34                                  |
| SWISS LIFE HOLDING (reg. shares)                       | CHF     | 1'500                            |           | 200          | 1'300                            | 759'200.00           | 0.43                                  |
| SWISS REINSURANCE                                      | CHF     | 16'740                           | 16'260    | 19'000       | 14'000                           | 1'323'840.00         | 0.75                                  |
| SWISSCOM (reg. shares)                                 | CHF     | 1'430                            |           | 230          | 1'200                            | 607'200.00           | 0.34                                  |
| THE SWATCH GROUP (reg. shares)                         | CHF     | 20'000                           |           | 3'400        | 16'600                           | 731'230.00           | 0.41                                  |
| UBS GROUP  | CHF     | 148'000                          | 7'161     | 35'161       | 120'000                          | 3'132'000.00         | 1.77                                  |
| VAT GROUP  | CHF     | 1'160                            |           | 160          | 1'000                            | 421'500.00           | 0.24                                  |
| ZURICH INSURANCE GROUP (reg. shares)                   | CHF     | 6'400                            |           | 900          | 5'500                            | 2'417'800.00         | 1.36                                  |
|  |         |                                  |           |              |                                  | <b>50'231'472.00</b> | <b>28.32</b>                          |
| <b>US DOLLAR</b>                                       |         |                                  |           |              |                                  |                      |                                       |
| 3M   | USD     | 10'600                           | 9'700     | 3'000        | 17'300                           | 1'591'709.69         | 0.90                                  |
| ABBVIE   | USD     | 8'500                            | 2'550     | 2'550        | 8'500                            | 1'108'625.06         | 0.62                                  |
| ADVANCED MICRO DEVICES                                 | USD     | 2'100                            | 400       | 800          | 1'700                            | 210'908.46           | 0.12                                  |
| ALPHABET -A-   | USD     | 1'200                            | 975       | 1'800        | 375                              | 44'087.42            | 0.02                                  |
| ALPHABET -C-   | USD     | 1'200                            | 975       | 1'800        | 375                              | 44'478.78            | 0.03                                  |
| AMAZON.COM   | USD     | 960                              | 200       | 260          | 900                              | 115'088.72           | 0.06                                  |
| AMGEN  | USD     | 150                              | 25        | 60           | 115                              | 27'876.52            | 0.02                                  |
| APPLE  | USD     | 1'400                            | 800       | 1'700        | 500                              | 81'018.94            | 0.05                                  |
| ASE TECHNOLOGY HOLDING CO LTD ADR                      | USD     | 45'400                           | 39'600    |              | 85'000                           | 673'172.99           | 0.38                                  |

| Titelbezeichnung   | Währung | 31.12.2022<br>Anzahl/<br>Nominal | Käufe (1) | Verkäufe (1) | 31.12.2023<br>Anzahl/<br>Nominal | Kurswert CHF          | in % des<br>Gesamtfonds-<br>vermögens |
|--|---------|----------------------------------|-----------|--------------|----------------------------------|-----------------------|---------------------------------------|
| AT&T   | USD     | 45'000                           | 4'000     | 29'000       | 20'000                           | 282'449.03            | 0.16                                  |
| BANCO DE CHILE ADR   | USD     |                                  | 10'000    |              | 10'000                           | 194'246.83            | 0.11                                  |
| BANCO DO BRASIL ADR  | USD     | 54'048                           | 20'952    |              | 75'000                           | 721'166.60            | 0.41                                  |
| BEST BUY   | USD     | 5'890                            | 1'300     | 2'890        | 4'300                            | 283'294.02            | 0.16                                  |
| BRISTOL MYERS SQUIBB   | USD     |                                  | 9'300     |              | 9'300                            | 401'608.69            | 0.23                                  |
| BROADCOM INC   | USD     | 100                              |           | 100          |                                  |                       |                                       |
| C.H. ROBINSON WORLDWIDE  | USD     | 1'460                            |           | 1'460        |                                  |                       |                                       |
| CAMPBELL SOUP  | USD     | 7'500                            | 1'850     | 2'350        | 7'000                            | 254'683.85            | 0.14                                  |
| CITIZENS FINANCIAL GROUP   | USD     | 8'800                            |           | 8'800        |                                  |                       |                                       |
| COCA-COLA  | USD     | 7'000                            | 8'600     | 4'100        | 11'500                           | 570'364.41            | 0.32                                  |
| CONAGRA BRANDS   | USD     | 17'000                           | 3'300     | 4'000        | 16'300                           | 393'171.41            | 0.22                                  |
| CSX  | USD     | 2'040                            |           | 2'040        |                                  |                       |                                       |
| CUMMINS  | USD     | 1'960                            |           | 1'960        |                                  |                       |                                       |
| DEVON ENERGY   | USD     |                                  | 14'800    | 1'800        | 13'000                           | 495'632.40            | 0.28                                  |
| DOW INC  | USD     | 7'600                            | 1'500     | 9'100        |                                  |                       |                                       |
| DUKE ENERGY  | USD     | 5'000                            | 1'300     | 1'300        | 5'000                            | 408'355.99            | 0.23                                  |
| EDISON INTERNATIONAL   | USD     | 8'000                            | 1'800     | 2'000        | 7'800                            | 469'308.08            | 0.26                                  |
| FRANKLIN RESOURCES   | USD     | 2'960                            | 600       | 660          | 2'900                            | 72'708.74             | 0.04                                  |
| GERDAU ADR   | USD     | 120'700                          | 5'750     | 71'450       | 55'000                           | 224'503.21            | 0.13                                  |
| GILEAD SCIENCES  | USD     | 1'600                            | 300       | 400          | 1'500                            | 102'269.95            | 0.06                                  |
| HASBRO   | USD     | 2'500                            | 1'500     | 1'000        | 3'000                            | 128'919.97            | 0.07                                  |
| HUNTINGTON BANCSHARES  | USD     | 20'000                           | 5'300     | 2'000        | 23'300                           | 249'437.17            | 0.14                                  |
| IBM  | USD     | 8'000                            | 6'100     | 3'900        | 10'200                           | 1'404'005.65          | 0.79                                  |
| INTERNATIONAL PAPER  | USD     |                                  | 11'600    |              | 11'600                           | 352'926.63            | 0.20                                  |
| KBF FINANCIAL GROUP ADR  | USD     |                                  | 15'000    |              | 15'000                           | 522'269.80            | 0.29                                  |
| KELLOGG  | USD     | 13'000                           | 3'200     | 4'700        | 11'500                           | 541'134.80            | 0.31                                  |
| KEYCORP  | USD     | 11'000                           | 2'200     | 3'200        | 10'000                           | 121'193.86            | 0.07                                  |
| KIMBERLY-CLARK   | USD     | 5'400                            | 1'200     | 1'900        | 4'700                            | 480'648.97            | 0.27                                  |
| KINDER MORGAN  | USD     | 10'000                           | 55'600    | 12'600       | 53'000                           | 786'851.15            | 0.44                                  |
| KLA-TENCOR   | USD     | 400                              | 75        | 100          | 375                              | 183'463.52            | 0.10                                  |
| LAM RESEARCH   | USD     | 300                              | 50        | 70           | 280                              | 184'578.93            | 0.10                                  |
| LEGGETT & PLATT  | USD     | 7'500                            | 1'900     | 2'000        | 7'400                            | 162'987.23            | 0.09                                  |
| LINCOLN NATIONAL   | USD     |                                  | 14'300    | 3'500        | 10'800                           | 245'144.89            | 0.14                                  |
| LYONDELLBASELL INDUSTRIES -A-                                    | USD     | 2'000                            | 400       | 400          | 2'000                            | 160'043.23            | 0.09                                  |
| MEDTRONIC  | USD     | 1'000                            | 200       | 200          | 1'000                            | 69'332.99             | 0.04                                  |
| MERCK & CO   | USD     | 20'000                           | 5'500     | 19'000       | 6'500                            | 596'400.05            | 0.34                                  |
| MICRON TECHNOLOGY  | USD     | 2'800                            | 500       | 800          | 2'500                            | 179'560.49            | 0.10                                  |
| MICROSOFT  | USD     | 1'700                            | 200       | 900          | 1'000                            | 316'484.31            | 0.18                                  |
| MODERNA INC  | USD     | 160                              | 30        | 40           | 150                              | 12'554.93             | 0.01                                  |
| NEW YORK COMMUNITY BANCORP                                       | USD     | 23'000                           |           | 23'000       |                                  |                       |                                       |
| NEWELL BRANDS  | USD     | 25'000                           |           | 25'000       |                                  |                       |                                       |
| NVIDIA   | USD     | 1'000                            | 575       | 1'200        | 375                              | 156'295.90            | 0.09                                  |
| ONEOK (new)  | USD     |                                  | 12'900    | 2'400        | 10'500                           | 620'537.82            | 0.35                                  |
| PAYPAL HOLDINGS  | USD     | 310                              | 60        | 70           | 300                              | 15'505.24             | 0.01                                  |
| PEPSICO  | USD     | 800                              | 1'020     | 320          | 1'500                            | 214'412.14            | 0.12                                  |
| PIONEER NATURAL RESOURCES  | USD     |                                  | 3'800     | 600          | 3'200                            | 605'646.13            | 0.34                                  |
| PROCTER & GAMBLE   | USD     | 3'300                            | 3'700     | 2'300        | 4'700                            | 579'658.46            | 0.33                                  |
| PRUDENTIAL FINANCIAL   | USD     | 2'920                            | 500       | 920          | 2'500                            | 218'212.07            | 0.12                                  |
| REGIONS FINANCIAL  | USD     | 12'080                           | 2'400     | 3'780        | 10'700                           | 174'524.21            | 0.10                                  |
| RENAISSANCE HOLDINGS L.S. -F- 5.75%/PREFERRED STOCK              | USD     | 10'000                           |           |              | 10'000                           | 201'063.98            | 0.11                                  |
| SANLAM LTD ADR   | USD     | 15'000                           |           |              | 15'000                           | 99'868.79             | 0.06                                  |
| SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS PL                                   | USD     | 3'000                            | 600       | 600          | 3'000                            | 215'548.33            | 0.12                                  |
| SNAP-ON  | USD     | 1'410                            |           | 1'410        |                                  |                       |                                       |
| TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFACTURING ADR                           | USD     |                                  | 2'200     |              | 2'200                            | 192'563.58            | 0.11                                  |
| TESLA MOTORS   | USD     | 600                              | 125       | 125          | 600                              | 125'476.05            | 0.07                                  |
| THE WENDY'S  | USD     |                                  | 9'000     |              | 9'000                            | 147'553.53            | 0.08                                  |
| TRUIST FINANCIAL CORP  | USD     | 15'000                           | 2'700     | 4'700        | 13'000                           | 403'945.88            | 0.23                                  |
| UNITED MICROELECTRONICS ADR                                      | USD     |                                  | 85'000    | 15'000       | 70'000                           | 498'409.76            | 0.28                                  |
| UNITED PARCEL SERVICE -B-  | USD     | 2'820                            | 10'300    | 2'120        | 11'000                           | 1'455'614.03          | 0.82                                  |
| VERIZON COMMUNICATIONS   | USD     | 5'810                            | 1'000     | 1'810        | 5'000                            | 158'646.13            | 0.09                                  |
| WALGREENS BOOTS ALLIANCE   | USD     |                                  | 10'500    | 500          | 10'000                           | 219'748.04            | 0.12                                  |
| WESTERN UNION  | USD     | 6'020                            | 5'500     | 1'020        | 10'500                           | 105'337.67            | 0.06                                  |
| WHIRLPOOL  | USD     | 1'800                            | 550       | 650          | 1'700                            | 174'223.75            | 0.10                                  |
| WK KELLOGG CO  | USD     |                                  | 2'600     |              | 2'600                            | 28'753.24             | 0.02                                  |
| <b>Total Aktien (und aktienähnliche Wertpapiere)</b>             |         |                                  |           |              |                                  | <b>22'080'213.09</b>  | <b>12.45</b>                          |
| <b>Anleihen</b>  |         |                                  |           |              |                                  | <b>107'060'900.14</b> | <b>60.36</b>                          |
| <b>US DOLLAR</b>   |         |                                  |           |              |                                  |                       |                                       |
| - AT&T INC 0%/18-01.08.2067                                      | USD     | 15'000                           |           |              | 15'000                           | 313'084.14            | 0.18                                  |
| 4.875 BROOKFIELD BRP HOLDINGS (subordinated) 4.875%/21-PERPETUAL | USD     | 20'000                           |           |              | 20'000                           | 272'686.19            | 0.15                                  |

Jahresbericht per 31. Dezember 2023

| Titelbezeichnung   | Währung | 31.12.2022<br>Anzahl/<br>Nominal | Käufe (1) | Verkäufe (1) | 31.12.2023<br>Anzahl/<br>Nominal | Kurswert CHF          | in % des<br>Gesamtfonds-<br>vermögens |
|--|---------|----------------------------------|-----------|--------------|----------------------------------|-----------------------|---------------------------------------|
| 6.625 BRUNSWICK CORP 6.625%/18-15.01.2049  | USD     | 15'000                           |           |              | 15'000                           | 310'054.30            | 0.17                                  |
| 5.750 SEMPRO ENERGY (subordinated) 5.75%/19-01.07.2079   | USD     | 18'000                           |           |              | 18'000                           | 378'427.84            | 0.21                                  |
|  |         |                                  |           |              |                                  | <b>1'274'252.47</b>   | <b>0.72</b>                           |
| <b>Total Anleihen</b>  |         |                                  |           |              |                                  | <b>1'274'252.47</b>   | <b>0.72</b>                           |
| <b>Kollektive Kapitalanlagen</b>   |         |                                  |           |              |                                  |                       |                                       |
| <b>ENGLISCHES PFUND</b>  |         |                                  |           |              |                                  |                       |                                       |
| BLUEFIELD SOLAR INCOME FUND LT   | GBP     | 150'000                          | 25'000    |              | 175'000                          | 222'675.25            | 0.13                                  |
| FORESIGHT SOLAR FUND LTD   | GBP     | 175'000                          | 50'000    |              | 225'000                          | 246'707.65            | 0.14                                  |
| GREENCOAT UK WIND PLC/FUNDS  | GBP     | 130'000                          | 30'000    | 30'000       | 130'000                          | 211'302.77            | 0.12                                  |
| JLEN ENVIRONMENTAL ASSETS GROU   | GBP     | 165'000                          | 35'000    |              | 200'000                          | 218'008.24            | 0.12                                  |
| NEXTENERGY SOLAR FUND LTD  | GBP     | 180'000                          | 45'000    |              | 225'000                          | 223'050.75            | 0.13                                  |
|  |         |                                  |           |              |                                  | <b>1'121'744.66</b>   | <b>0.63</b>                           |
| <b>EURO</b>  |         |                                  |           |              |                                  |                       |                                       |
| AMUNDI INDEX EURO AGG SRI UCIT -EUR D- EUR   | EUR     |                                  | 4'500     | 3'000        | 1'500                            | 62'871.89             | 0.04                                  |
| ISHARES EUR CORP BOND ESG UCIT -EUR DIST- EUR  | EUR     | 12'500                           |           | 12'500       |                                  |                       |                                       |
| ISHARES EUR HIGH YIELD CORP BO -EUR DIST- EUR  | EUR     | 60'000                           |           | 25'000       | 35'000                           | 147'312.82            | 0.08                                  |
| UBS ETF SICAV - UBS ETF - MSCI EMU SOCIALLY RESPONSIBLE UCITS ETF - A- EUR   | EUR     | 30'000                           | 3'000     | 14'000       | 19'000                           | 1'934'594.14          | 1.09                                  |
|  |         |                                  |           |              |                                  | <b>2'144'778.85</b>   | <b>1.21</b>                           |
| <b>SCHWEIZER FRANKEN</b>   |         |                                  |           |              |                                  |                       |                                       |
| CREDIT SUISSE REAL ESTATE FUND GREEN PROPERTY  | CHF     | 1'750                            | 450       |              | 1'300                            | 157'300.00            | 0.09                                  |
| CREDIT SUISSE REAL ESTATE FUND HOSPITALITY   | CHF     | 2'750                            | 250       |              | 2'500                            | 178'000.00            | 0.10                                  |
| CREDIT SUISSE REAL ESTATE FUND INTERSWISS  | CHF     | 1'500                            |           | 100          | 1'400                            | 228'200.00            | 0.13                                  |
| CREDIT SUISSE REAL ESTATE FUND LIVINGPLUS  | CHF     | 1'750                            |           | 150          | 1'600                            | 229'600.00            | 0.13                                  |
| CREDIT SUISSE REAL ESTATE FUND LOGISTICS PLUS  | CHF     | 2'000                            |           | 300          | 1'700                            | 160'820.00            | 0.09                                  |
| CREDIT SUISSE REAL ESTATE SIAT   | CHF     | 1'750                            |           | 150          | 1'600                            | 339'200.00            | 0.19                                  |
| SCHRODER IMMOPLUS  | CHF     | 1'250                            |           | 50           | 1'200                            | 181'200.00            | 0.10                                  |
| UBS ETF CH - MSCI SWITZERLAND -CHF A-DIS- CHF  | CHF     | 92'400                           | 26'000    | 33'400       | 85'000                           | 1'394'510.00          | 0.79                                  |
| UBS PROPERTY FUND - SWISS MIXED SIMA   | CHF     | 6'500                            |           | 1'100        | 5'400                            | 726'300.00            | 0.41                                  |
| UBS PROPERTY SWISS COMMERCIAL SWISSREAL  | CHF     | 3'230                            |           | 230          | 3'000                            | 185'400.00            | 0.10                                  |
| UBS PROPERTY SWISS RESIDENTIAL ANFOS   | CHF     | 3'000                            |           | 200          | 2'800                            | 228'480.00            | 0.13                                  |
|  |         |                                  |           |              |                                  | <b>4'009'010.00</b>   | <b>2.26</b>                           |
| <b>US DOLLAR</b>   |         |                                  |           |              |                                  |                       |                                       |
| ABERDEEN ASIA-PACIFIC INCOME F   | USD     | 70'000                           |           | 70'000       |                                  |                       |                                       |
| CREDIT SUISSE INDEX FUND (IE) ETF ICAV - CSIF (IE) MSCI WORLD ESG LEADERS BLUE UCITS ETF -B- USD   | USD     |                                  | 2'200     | 2'200        |                                  |                       |                                       |
| CSIF IE FTSE EPRA NAREIT DEVEL -B USD- EUR   | USD     | 10'000                           |           | 3'000        | 7'000                            | 670'791.20            | 0.38                                  |
| CSIF IE MSCI USA SMALL CAP ESG -B USD- EUR   | USD     |                                  | 8'000     | 8'000        |                                  |                       |                                       |
| EATON VANCE LTD DURATION INCOM   | USD     | 20'000                           |           |              | 20'000                           |                       |                                       |
| INVESCO PREFERRED SHARES UCITS ETF -A- USD   | USD     | 180'000                          |           | 60'000       | 120'000                          | 1'558'856.05          | 0.88                                  |
| INVESCO US HIGH YIELD FALLEN ANGELS  | USD     | 10'000                           | 3'000     | 13'000       |                                  |                       |                                       |
| ISHARES CHINA CNY BOND UCITS E -USD DIST- USD  | USD     | 85'000                           |           | 85'000       |                                  |                       |                                       |
| ISHARES EM DIVIDEND UCITS ETF -USD DIST- USD   | USD     | 97'000                           | 128'000   |              | 225'000                          | 2'810'618.22          | 1.58                                  |
| ISHARES II PLC - ISHARES JP MORGAN USD EMERGING MARKETS BOND UCITS ETF   | USD     | 10'000                           |           | 5'500        | 4'500                            | 331'019.45            | 0.19                                  |
| ISHARES MSCI EM SRI UCITS ETF -USD DIST- USD   | USD     |                                  | 110'000   | 110'000      |                                  |                       |                                       |
| ISHARES MSCI EMERGING MARKETS LOCAL GOVERNMENT BOND UCITS  | USD     | 5'500                            |           |              | 5'500                            | 214'897.25            | 0.12                                  |
| ISHARES MSCI USA SRI UCITS ETF -USD DIST- USD  | USD     | 415'030                          | 218'500   | 318'530      | 315'000                          | 2'547'006.42          | 1.44                                  |
| ISHARES USD HIGH YIELD CORP BO -USD DIST- USD  | USD     | 230'000                          | 20'000    |              | 250'000                          | 956'295.32            | 0.54                                  |
| L&G ESG EMERGING MARKETS CORPO -USD DISTRIBUTING- USD  | USD     | 125'000                          |           | 30'000       | 95'000                           | 693'603.42            | 0.39                                  |
| NUVEEN CREDIT STRATEGIES INCOM   | USD     | 40'000                           |           | 40'000       |                                  |                       |                                       |
| PGIM GLOBAL HIGH YIELD FUND IN   | USD     | 18'000                           |           | 18'000       |                                  |                       |                                       |
| PIMCO FIXED INCOME SOURCE ETF - EMERGING MARKETS ADVANTAGE LOCAL USD BOND INDEX SOURCE ETF   | USD     | 5'000                            | 4'000     | 1'000        | 8'000                            | 449'797.55            | 0.25                                  |
| SOURCE MORNINGSTAR US ENERGY INFRASTRUCTURE MLP UCITS ETF - B- USD   | USD     | 70'000                           | 25'000    | 12'000       | 83'000                           | 3'182'584.49          | 1.79                                  |
| UBS ETF SICAV - UBS ETF - MSCI EMERGING MARKETS SOCIALLY RESPONSIBLE UCITS ETF -A- USD   | USD     | 321'900                          | 57'000    | 178'900      | 200'000                          | 2'139'071.67          | 1.21                                  |
| VIRTUS ALLIANZGI CONVERTIBLE &   | USD     | 45'000                           |           | 45'000       |                                  |                       |                                       |
|  |         |                                  |           |              |                                  | <b>15'554'541.04</b>  | <b>8.77</b>                           |
| <b>Total Kollektive Kapitalanlagen</b>   |         |                                  |           |              |                                  | <b>22'830'074.55</b>  | <b>12.87</b>                          |
| <b>Total Börsennotierte / an einem geregelten Markt gehandelte Wertpapiere; bewertet zu den Kursen, die am Hauptmarkt bezahlt werden</b> |         |                                  |           |              |                                  | <b>131'165'227.16</b> | <b>73.94</b>                          |
| <b>Wertpapiere bewertet aufgrund von am Markt beobachtbaren Parametern</b>   |         |                                  |           |              |                                  |                       |                                       |
| <b>Aktien (und aktienähnliche Wertpapiere)</b>   |         |                                  |           |              |                                  |                       |                                       |
| <b>EURO</b>  |         |                                  |           |              |                                  |                       |                                       |
| ACS ACTIVIDADES DE CONSTRUCCIO (rights) 03.02.2023   | EUR     |                                  | 6'990     | 6'990        |                                  |                       |                                       |

| Titelbezeichnung                                     | Währung   | 31.12.2022<br>Anzahl/<br>Nominal | Käufe (1) | Verkäufe (1) | 31.12.2023<br>Anzahl/<br>Nominal | Kurswert CHF        | in % des<br>Gesamtfonds-<br>vermögens |
|--|---|----------------------------------|-----------|--------------|----------------------------------|---------------------|---------------------------------------|
| ACS ACTIVIDADES DE CONSTRUCCIO (rights) 17.07.2023   | EUR   |                                  | 6'250     | 6'250        |                                  | 0.00                | 0.00                                  |
| <b>Total Aktien (und aktienähnliche Wertpapiere)</b> |   |                                  |           |              |                                  | <b>0.00</b>         | <b>0.00</b>                           |
| <b>Anleihen</b>                                      |   |                                  |           |              |                                  |                     |                                       |
| <b>AUSTRALISCHER DOLLAR</b>                          |   |                                  |           |              |                                  |                     |                                       |
| 4.600  | AT&T INC 4.6%/18-19.09.2028   | AUD                              | 300'000   |              | 300'000                          | 169'565.01          | 0.10                                  |
| 6.134  | AUSNET SERVICES HOLDINGS 6.134%/23-31.05.2033   | AUD                              |           | 200'000      | 200'000                          | 118'486.36          | 0.07                                  |
| 4.750  | AUSTRALIA S. 136 4.75%/11-21.04.2027  | AUD                              | 200'000   |              | 200'000                          | 118'915.92          | 0.07                                  |
| 4.500  | AUSTRALIA S. 140 4.5%/13-21.04.2033   | AUD                              | 50'000    |              | 50'000                           | 29'951.80           | 0.02                                  |
| 3.147  | COMPUTERSHARE US INC 3.147%/21-30.11.2027   | AUD                              | 200'000   | 200'000      |                                  |                     |                                       |
| 4.100  | FBG FINANCE PTY LTD 4.1%/17-06.09.2027  | AUD                              | 150'000   | 150'000      |                                  |                     |                                       |
| 3.700  | LENDLEASE FINANCE LTD 3.7%/21-31.03.2031  | AUD                              | 300'000   |              | 300'000                          | 139'883.99          | 0.08                                  |
| -  | NATIONAL AUSTRALIA BANK (subordinated) FIX-TO-FRN FRN/22-03.08.2032                     | AUD                              | 200'000   |              | 200'000                          | 118'209.55          | 0.07                                  |
| 4.000  | NEW SOUTH WALES TREASURY 4%/13-20.04.2023   | AUD                              | 150'000   | 150'000      |                                  |                     |                                       |
| 5.400  | PACIFIC NATIONAL FINANCE 5.4%/17-12.05.2027   | AUD                              | 350'000   |              | 350'000                          | 195'076.20          | 0.11                                  |
| 5.250  | QANTAS AIRWAYS LTD 5.25%/20-09.09.2030  | AUD                              | 50'000    |              | 50'000                           | 27'870.90           | 0.02                                  |
| 5.000  | SOCIETE GENERALE (subordinated) 5%/17-19.05.2027  | AUD                              | 200'000   |              | 200'000                          | 110'677.31          | 0.06                                  |
| 4.000  | TELSTRA CORP LTD 4%/17-19.04.2027   | AUD                              | 400'000   | 400'000      |                                  |                     |                                       |
| 5.500  | TREASURY CORP OF VICTORIA 5.5%/11-17.11.2026  | AUD                              | 300'000   |              | 300'000                          | 179'431.70          | 0.10                                  |
| 4.200  | VODAFONE GROUP PLC 4.2%/17-13.12.2027   | AUD                              | 400'000   |              | 400'000                          | 223'454.19          | 0.13                                  |
| 5.300  | WESTPAC BANKING CORP 5.3%/22-11.11.2027   | AUD                              | 100'000   |              | 100'000                          | 58'907.80           | 0.03                                  |
| 2.800  | WOOLWORTHS GROUP LTD 2.8%/20-20.05.2030   | AUD                              | 100'000   |              | 100'000                          | 50'146.03           | 0.03                                  |
|  |   |                                  |           |              |                                  | <b>1'540'576.76</b> | <b>0.87</b>                           |
| <b>DAENISCHE KRONE</b>                               |   |                                  |           |              |                                  |                     |                                       |
| 7.000  | KINGDOM OF DENMARK 7%/94-10.11.2024   | DKK                              | 750'000   |              | 750'000                          | 96'791.92           | 0.05                                  |
|  |   |                                  |           |              |                                  | <b>96'791.92</b>    | <b>0.05</b>                           |
| <b>ENGLISCHES PFUND</b>                              |   |                                  |           |              |                                  |                     |                                       |
| 6.625  | AEGON s 46 6.625%/09-16.12.2039   | GBP                              | 100'000   |              | 100'000                          | 122'469.78          | 0.07                                  |
| 9.750  | AHHEUSER-BUSCH INBEV 9.75%/09-30.07.2024  | GBP                              | 100'000   |              | 100'000                          | 109'606.00          | 0.06                                  |
| 4.000  | AMGEN (reg. -S-) 4%/12-13.09.2029   | GBP                              | 100'000   | 100'000      |                                  |                     |                                       |
| 4.500  | ANGLIAN WATER SERVICES FINANCING 4.5%/13-22.02.2026                                     | GBP                              | 100'000   | 100'000      |                                  |                     |                                       |
| 5.750  | ASTRAZENECA PLC S. -3- 5.75%/07-13.11.2031  | GBP                              | 100'000   |              | 100'000                          | 120'619.07          | 0.07                                  |
| 5.750  | BT GROUP (reg. -S-) 5.75%/99-07.12.2028   | GBP                              | 150'000   |              | 150'000                          | 169'608.69          | 0.10                                  |
| -  | CENTRICA (reg.-S) (subordinated) FIX-TO-FLOATER 5.25%/15-10.04.2075                     | GBP                              | 250'000   | 100'000      | 150'000                          | 158'543.06          | 0.09                                  |
| 6.800  | CITIGROUP INC 6.8%/08-25.06.2038  | GBP                              | 50'000    |              | 50'000                           | 64'118.78           | 0.04                                  |
| 7.375  | CREDIT AGRICOLE s283 7.375%/08-18.12.2023   | GBP                              | 100'000   | 150'000      | 250'000                          |                     |                                       |
| 6.000  | EIB 6%/98-07.12.2028  | GBP                              | 100'000   | 300'000      | 400'000                          | 473'464.11          | 0.27                                  |
| 8.125  | FRANCE TELECOM (reg. -S-) S. 103 T.1 8.125%/08-20.11.2028                               | GBP                              | 100'000   |              | 100'000                          | 125'786.03          | 0.07                                  |
| 7.250  | HAMMERSON PLC 7.25%/98-21.04.2028   | GBP                              | 100'000   | 50'000       | 50'000                           | 55'691.88           | 0.03                                  |
| 6.750  | HEATHROW FUNDING LIMITED (reg. -S-) A-10 S. 2 6.75%/09-03.12.2028                       | GBP                              | 100'000   | 100'000      | 100'000                          | 112'793.52          | 0.06                                  |
| 7.125  | HEATHROW FUNDING LIMITED (subordinated) (reg. -S-) S. -11- C. -B2- 7.125%/12-14.02.2024 | GBP                              | 100'000   | 100'000      |                                  |                     |                                       |
| 5.750  | HSBC HOLDINGS 5.75%/02-20.12.2027   | GBP                              | 350'000   |              | 350'000                          | 390'136.04          | 0.22                                  |
| 7.375  | IBERDROLA FINANZAS SAU 7.375%/09-29.01.2024   | GBP                              | 100'000   |              | 100'000                          | 107'394.81          | 0.06                                  |
| 6.000  | ITALY 6%/98-04.08.2028  | GBP                              | 50'000    |              | 50'000                           | 56'315.76           | 0.03                                  |
| 5.500  | JOHNSON & JOHNSON 5.5%/07-06.11.2024  | GBP                              | 100'000   | 100'000      |                                  |                     |                                       |
| 5.375  | NEDERLANDSE WATERSCHAPS BANK 5.375%/01-07.06.2032                                       | GBP                              | 150'000   | 100'000      | 50'000                           | 59'150.83           | 0.03                                  |
| -  | NGG FINANCE ff 13-18.06.2073  | GBP                              | 100'000   |              | 100'000                          | 105'693.23          | 0.06                                  |
| 5.625  | RECKITT BENCKISER TSY 5.625%/23-14.12.2038  | GBP                              | 100'000   | 100'000      | 100'000                          | 120'536.46          | 0.07                                  |
| 8.375  | SSE (reg. -S-) S. 3 8.375%/08-20.11.2028  | GBP                              | 100'000   |              | 100'000                          | 125'721.66          | 0.07                                  |
| 2.250  | UNITED KINGDOM 2.25%/13-07.09.2023  | GBP                              | 170'000   | 170'000      |                                  |                     |                                       |
| 2.750  | UNITED KINGDOM 2.75%/14-07.09.2024  | GBP                              | 100'000   | 100'000      |                                  |                     |                                       |
| 6.000  | UNITED KINGDOM 6%/98-07.12.2028   | GBP                              | 100'000   |              | 100'000                          | 120'074.05          | 0.07                                  |
|  |   |                                  |           |              |                                  | <b>2'597'723.76</b> | <b>1.46</b>                           |
| <b>EURO</b>  |   |                                  |           |              |                                  |                     |                                       |
| 4.875  | ALD SA S. -0- 4.875%/23-06.10.2028  | EUR                              | 100'000   |              | 100'000                          | 98'431.06           | 0.06                                  |
| -  | BANK OF AMERICA CORP FIX-TO-FRN FRN/20-31.03.2029                                       | EUR                              | 100'000   | 100'000      |                                  |                     |                                       |
| 4.250  | BAYER AG 4.25%/23-26.08.2029  | EUR                              | 50'000    |              | 50'000                           | 48'147.77           | 0.03                                  |
| -  | BAYER FIX-TO-FRN 3.75%/14-01.07.2074  | EUR                              | 50'000    | 50'000       |                                  |                     |                                       |
| 4.000  | BELGIUM KINGDOM S. 66 4%/12-28.03.2032  | EUR                              | 50'000    | 50'000       | 50'000                           | 51'679.70           | 0.03                                  |
| 3.750  | CAISSE NATIONALE DES AUTOROUTES 3.75%/05-15.07.2025                                     | EUR                              | 50'000    |              | 50'000                           |                     |                                       |
| 4.875  | CEZ (reg. -S-) S. 15 4.875%/10-16.04.2025   | EUR                              | 150'000   | 100'000      | 50'000                           | 47'100.00           | 0.03                                  |
| 4.250  | CYPRUS (reg. -S-) 4.25%/15-04.11.2025   | EUR                              | 100'000   |              | 100'000                          | 95'771.19           | 0.05                                  |
| 3.500  | DEUTSCHE LUFTHANSA AG 3.5%/21-14.07.2029  | EUR                              | 100'000   | 100'000      |                                  |                     |                                       |
| -  | ENERGIAS DE PORTUGAL SA (subordinated) FIX-TO-FRN FRN/19-30.04.2079                     | EUR                              | 100'000   |              | 100'000                          | 92'910.50           | 0.05                                  |
| 4.500  | FIAT CHRYSLER AUTOMOBILE 4.5%/20-07.07.2028   | EUR                              | 100'000   |              | 100'000                          | 97'897.41           | 0.06                                  |



Jahresbericht per 31. Dezember 2023

| Titelbezeichnung   | Währung | 31.12.2022<br>Anzahl/<br>Nominal | Käufe (1) | Verkäufe (1) | 31.12.2023<br>Anzahl/<br>Nominal | Kurswert CHF        | in % des<br>Gesamtfonds-<br>vermögens |
|--|---------|----------------------------------|-----------|--------------|----------------------------------|---------------------|---------------------------------------|
| 5.750 FRANCE 5.75%/01-25.10.2032   | EUR     |                                  | 300'000   | 100'000      | 200'000                          | 233'722.86          | 0.13                                  |
| 6.000 FRANCE 6%/94-25.10.2025  | EUR     | 50'000                           | 350'000   | 200'000      | 200'000                          | 197'313.95          | 0.11                                  |
| 4.000 FRESENIUS FINANCE (reg. -S-) 4%/14-01.02.2024                                | EUR     | 50'000                           |           | 50'000       |                                  |                     |                                       |
| 4.250 GERMANY 4.25%/07-04.07.2039  | EUR     |                                  | 50'000    |              | 50'000                           | 58'525.54           | 0.03                                  |
| 6.500 GERMANY 6.5%/97-04.07.2027   | EUR     | 50'000                           |           | 50'000       |                                  |                     |                                       |
| 6.250 GERMANY S. 00 6.25%/00-04.01.2030  | EUR     |                                  | 50'000    |              | 50'000                           | 57'717.64           | 0.03                                  |
| 6.000 GROUPAMA ASSURANCES MUTUELLES SA (subordinated) 6%/17-23.01.2027             | EUR     | 100'000                          |           |              | 100'000                          | 99'882.32           | 0.06                                  |
| 3.875 HARLEY-DAVIDSON FINL SER 3.875%/20-19.05.2023                                | EUR     | 100'000                          |           | 100'000      |                                  |                     |                                       |
| 5.400 IRELAND 5.4%/09-13.03.2025   | EUR     | 50'000                           |           |              | 50'000                           | 47'781.00           | 0.03                                  |
| 3.750 ITALY BTP 3.75%/14-01.09.2024  | EUR     | 150'000                          |           | 150'000      |                                  |                     |                                       |
| 6.500 ITALY BTP 6.5%/97-01.11.2027   | EUR     | 100'000                          |           | 50'000       | 50'000                           | 52'612.65           | 0.03                                  |
| 4.000 NYKREDIT REALKREDIT AS S. -5- 4%/23-17.07.2028                               | EUR     |                                  | 200'000   | 200'000      |                                  |                     |                                       |
| - OMV FIX-TO-FRN 6.25%/15-PERPETUAL  | EUR     | 100'000                          |           | 50'000       | 50'000                           | 48'105.93           | 0.03                                  |
| 5.250 POLAND (reg -S-) S. 24 5.25%/10-20.01.2025                                   | EUR     | 100'000                          |           |              | 100'000                          | 94'742.94           | 0.05                                  |
| 4.125 PORTUGAL (OBRIGACOES DO TESOURO) 4.125%/17-14.04.2027                        | EUR     | 100'000                          |           | 50'000       | 50'000                           | 49'218.78           | 0.03                                  |
| 4.875 PROCTER & GAMBLE CO (reg. -S-) 4.875%/07-11.05.2027                          | EUR     | 50'000                           |           |              | 50'000                           | 49'501.41           | 0.03                                  |
| 4.000 REPUBLIC OF ESTONIA 4%/22-12.10.2032   | EUR     |                                  | 100'000   |              | 100'000                          | 100'120.32          | 0.06                                  |
| 4.250 SNCF RESEAU (reg. -S-) S. -84- 4.25%/11-07.10.2026                           | EUR     | 100'000                          |           |              | 100'000                          | 96'811.52           | 0.05                                  |
| 3.800 SPAIN 3.8%/14-30.04.2024   | EUR     | 100'000                          |           | 100'000      |                                  |                     |                                       |
| 5.750 SPAIN 5.75%/01-30.07.2032  | EUR     |                                  | 100'000   |              | 100'000                          | 113'507.07          | 0.06                                  |
| 5.500 SUEZ ENVIRONNEMENT COMPANY 5.5%/09-22.07.2024                                | EUR     | 100'000                          |           | 100'000      |                                  |                     |                                       |
| - TELEFONICA EUROPE BV (subordinated) FIX-TO-FRN FRN/19-PERPETUAL                  | EUR     | 100'000                          |           |              | 100'000                          | 92'388.01           | 0.05                                  |
| 3.875 TELIASONERA (reg. -S-) S. -69- 3.875%/10-01.10.2025                          | EUR     | 100'000                          |           | 100'000      |                                  |                     |                                       |
| 4.875 WAL-MART STORES 4.875%/09-21.09.2029   | EUR     | 100'000                          |           | 50'000       | 50'000                           | 51'722.93           | 0.03                                  |
|  |         |                                  |           |              |                                  | <b>1'975'612.50</b> | <b>1.11</b>                           |
| <b>KANADISCHER DOLLAR</b>  |         |                                  |           |              |                                  |                     |                                       |
| 5.500 BANK OF NOVA SCOTIA 5.5%/23-29.12.2025                                       | CAD     |                                  | 50'000    |              | 50'000                           | 32'405.46           | 0.02                                  |
| 7.850 BELL CANADA S. -M-11- 7.85%/01-02.04.2031                                    | CAD     | 300'000                          |           |              | 300'000                          | 226'176.36          | 0.13                                  |
| 5.400 BRITISH COLUMBIA PROV OF S. -BCCD-7- 5.4%/04-18.06.2035                      | CAD     |                                  | 50'000    |              | 50'000                           | 36'435.16           | 0.02                                  |
| 6.150 BRITISH COLUMBIA PROV OF S. -BCCD-W- 6.15%/97-19.11.2027                     | CAD     |                                  | 250'000   |              | 250'000                          | 174'173.54          | 0.10                                  |
| 3.500 CANADIAN GOVERNMENT 3.5%/22-01.03.2028                                       | CAD     |                                  | 500'000   | 300'000      | 200'000                          | 129'030.82          | 0.07                                  |
| 6.100 ENBRIDGE INC 6.1%/22-09.11.2032  | CAD     |                                  | 200'000   |              | 200'000                          | 138'880.56          | 0.08                                  |
| 7.050 GREATER TORONTO AIRPORT S. 2000-1 7.05%/00-12.06.2030                        | CAD     | 300'000                          |           |              | 300'000                          | 220'523.87          | 0.12                                  |
| 4.400 IADB 4.4%/06-26.01.2026  | CAD     |                                  | 91'000    |              | 91'000                           | 58'449.98           | 0.03                                  |
| 4.488 LOBLAW COS LTD S. -2028- 4.488%/18-11.12.2028                                | CAD     | 300'000                          |           |              | 300'000                          | 193'973.23          | 0.11                                  |
| 5.219 NATIONAL BANK OF CANADA 5.219%/23-14.06.2028                                 | CAD     |                                  | 150'000   |              | 150'000                          | 98'633.34           | 0.06                                  |
| 4.400 ROGERS COMMUNICATIONS IN 4.4%/18-02.11.2028                                  | CAD     |                                  | 300'000   |              | 300'000                          | 190'848.27          | 0.11                                  |
| 4.400 SHAW COMMUNICATIONS INC 4.4%/18-02.11.2028                                   | CAD     | 300'000                          | 300'000   | 600'000      |                                  |                     |                                       |
| 3.750 TELUS S. -CV- 3.75%/15-10.03.2026  | CAD     | 300'000                          |           | 150'000      | 150'000                          | 94'326.96           | 0.05                                  |
| 3.057 WALT DISNEY COMPANY/THE 3.057%/20-30.03.2027                                 | CAD     | 300'000                          |           | 300'000      |                                  |                     |                                       |
| 3.460 WELLS FARGO CANADA 3.46%/13-24.01.2023                                       | CAD     | 400'000                          |           | 400'000      |                                  |                     |                                       |
|  |         |                                  |           |              |                                  | <b>1'593'857.55</b> | <b>0.90</b>                           |
| <b>US DOLLAR</b>   |         |                                  |           |              |                                  |                     |                                       |
| 6.150 ABBOTT LABORATORIES 6.15%/07-30.11.2037                                      | USD     | 200'000                          |           |              | 200'000                          | 193'630.76          | 0.11                                  |
| 4.625 AERCAP IRELAND CAP/GLOBA 4.625%/20-15.10.2027                                | USD     | 200'000                          |           | 200'000      |                                  |                     |                                       |
| 6.500 AERCAP IRELAND CAPITAL DAC / AERCAP GLOBAL AVIATION TRUST 6.5%/20-15.07.2025 | USD     | 150'000                          |           |              | 150'000                          | 128'122.11          | 0.07                                  |
| 4.250 AIRCASTLE LTD 4.25%/19-15.06.2026  | USD     | 200'000                          |           |              | 200'000                          | 162'850.89          | 0.09                                  |
| 5.050 ALBEMARLE CORP 5.05%/22-01.06.2032   | USD     |                                  | 200'000   |              | 200'000                          | 164'359.08          | 0.09                                  |
| 3.800 AMAZON.COM 3.8%/14-05.12.2024  | USD     | 200'000                          |           | 200'000      |                                  |                     |                                       |
| 3.500 ANHEUSER-BUSCH INBEV WOR 3.5%/20-01.06.2030                                  | USD     | 50'000                           |           | 50'000       |                                  |                     |                                       |
| 3.000 APPLE INC 3%/17-20.06.2027   | USD     | 250'000                          |           | 150'000      | 100'000                          | 80'930.57           | 0.05                                  |
| 4.000 ASHTEAD CAPITAL INC 4%/19-01.05.2028   | USD     | 200'000                          |           |              | 200'000                          | 158'238.79          | 0.09                                  |
| 5.820 ASIAN DEVELOPMENT BANK 5.82%/98-16.06.2028                                   | USD     | 50'000                           |           |              | 50'000                           | 44'970.50           | 0.03                                  |
| 3.800 AVANGRID INC 3.8%/19-01.06.2029  | USD     | 200'000                          |           | 200'000      |                                  |                     |                                       |
| 3.500 BANC CREDITO INVERSIONES 3.5%/17-12.10.2027                                  | USD     | 300'000                          |           | 300'000      |                                  |                     |                                       |
| 5.500 BARRY CALLEBAUT SERVICES (reg. -S-) 5.5%/13-15.06.2023                       | USD     | 200'000                          |           |              | 200'000                          |                     |                                       |
| 3.750 BECLE SA DE CV S. -14- 3.75%/15-13.05.2025                                   | USD     | 150'000                          |           | 150'000      |                                  |                     |                                       |
| 3.700 BECTON DICKINSON AND CO 3.7%/17-06.06.2027                                   | USD     | 50'000                           |           |              | 50'000                           | 40'782.58           | 0.02                                  |
| 4.150 BMW US CAPITAL LLC 4.15%/20-09.04.2030                                       | USD     | 100'000                          |           | 100'000      |                                  |                     |                                       |
| 5.700 BPCE 5.7%/13-23.10.2023  | USD     | 200'000                          |           | 200'000      |                                  |                     |                                       |
| - BRITISH TELECOMMUNICATIONS STEP UP 00-15.12.2030                                 | USD     |                                  | 400'000   |              | 400'000                          | 416'691.43          | 0.23                                  |
| 4.200 CELULOSA ARAUCO CONSTITU 4.2%/19-29.01.2030                                  | USD     | 200'000                          |           | 200'000      |                                  |                     |                                       |
| 4.125 CERRO DEL AGUILA SA 4.125%/17-16.08.2027                                     | USD     | 300'000                          |           | 300'000      |                                  |                     |                                       |
| 5.500 CISCO SYSTEMS 5.5%/09-15.01.2040   | USD     | 200'000                          |           | 100'000      | 100'000                          | 89'673.36           | 0.05                                  |
| 4.450 CITIGROUP INC 4.45%/15-29.09.2027  | USD     | 200'000                          |           | 200'000      |                                  |                     |                                       |
| 6.500 COMCAST 6.5%/05-15.11.2035   | USD     |                                  | 200'000   |              | 200'000                          | 192'247.13          | 0.11                                  |
| 3.700 COMCAST CORP 3.7%/18-15.04.2024  | USD     | 300'000                          |           | 300'000      |                                  |                     |                                       |
| 8.500 DAIMLERCHRYSLER NORTH AMERICA 8.5%/01-18.01.2031                             | USD     | 100'000                          |           |              | 100'000                          | 105'520.30          | 0.06                                  |



| Titelbezeichnung   | Währung | 31.12.2022<br>Anzahl/<br>Nominal | Käufe (1) | Verkäufe (1) | 31.12.2023<br>Anzahl/<br>Nominal | Kurswert CHF | in % des<br>Gesamtfonds-<br>vermögens |
|--|---------|----------------------------------|-----------|--------------|----------------------------------|--------------|---------------------------------------|
| 6.020 DELL INT LLC / EMC CORP 6.02%/21-15.06.2026                        | USD     | 200'000                          |           |              | 200'000                          | 172'255.19   | 0.10                                  |
| 9.250 DEUTSCHE TELECOM INTERNATIONAL FINANCE 9.25%/02-01.06.2032         | USD     |                                  | 200'000   |              | 200'000                          | 218'512.53   | 0.12                                  |
| 8.750 DEUTSCHE TELEKOM INTERNATIONAL FINANCE STEP UP 8.75%/00-15.06.2030 | USD     |                                  | 150'000   |              | 150'000                          | 152'185.41   | 0.09                                  |
| 6.700 DISCOVER FINANCIAL SVS 6.7%/22-29.11.2032                          | USD     |                                  | 100'000   |              | 100'000                          | 88'073.43    | 0.05                                  |
| 7.375 DOW CHEMICAL 7.375%/99-01.11.2029                                  | USD     | 50'000                           |           |              | 50'000                           | 47'514.73    | 0.03                                  |
| 4.493 DOWDUPONT INC 4.493%/18-15.11.2025                                 | USD     | 50'000                           |           |              | 50'000                           | 41'817.35    | 0.02                                  |
| 3.625 EDF (reg. -S-) 3.625%/15-13.10.2025                                | USD     | 100'000                          |           | 100'000      |                                  |              |                                       |
| 5.750 EDISON INTERNATIONAL 5.75%/19-15.06.2027                           | USD     | 200'000                          |           |              | 200'000                          | 172'075.09   | 0.10                                  |
| 3.500 ENEL FINANCE INTL NV 3.5%/17-06.04.2028                            | USD     | 200'000                          |           | 200'000      |                                  |              |                                       |
| 4.375 EXPORT DEVELOPMNT CANADA 4.375%/23-29.06.2026                      | USD     |                                  | 50'000    |              | 50'000                           | 42'260.47    | 0.02                                  |
| 6.625 FANNIE MAE 6.625%/00-15.11.2030                                    | USD     | 50'000                           |           |              | 50'000                           | 48'415.26    | 0.03                                  |
| 4.250 FEDEX CORP 4.25%/20-15.05.2030                                     | USD     | 50'000                           |           |              | 50'000                           | 41'212.65    | 0.02                                  |
| 4.400 GC TREASURY CENTRE CO 4.4%/22-30.03.2032                           | USD     | 200'000                          |           | 200'000      |                                  |              |                                       |
| 3.100 GECC T. 881 3.1%/13-09.01.2023                                     | USD     | 280'000                          |           | 280'000      |                                  |              |                                       |
| 5.800 GENERAL MOTORS FINL CO 5.8%/23-23.06.2028                          | USD     |                                  | 100'000   |              | 100'000                          | 86'520.64    | 0.05                                  |
| 6.250 GLOBELEC MESOAMERICA 6.25%/21-26.04.2029                           | USD     | 200'000                          |           |              | 200'000                          | 158'156.31   | 0.09                                  |
| 5.625 HCA INC 5.625%/18-01.09.2028                                       | USD     | 200'000                          |           | 100'000      | 100'000                          | 86'131.80    | 0.05                                  |
| 4.950 HEXCEL 4.95%/15-15.08.2025   | USD     | 100'000                          |           |              | 100'000                          | 83'451.23    | 0.05                                  |
| 5.500 HP INC 5.5%/22-15.01.2033  | USD     | 200'000                          |           | 100'000      | 100'000                          | 86'357.36    | 0.05                                  |
| 5.875 IBM 5.875%/02-29.11.2032   | USD     | 200'000                          |           |              | 200'000                          | 184'231.50   | 0.10                                  |
| 6.250 JEFFERIES GROUP 6.25%/06-15.01.2036                                | USD     |                                  | 200'000   | 100'000      | 100'000                          | 88'497.61    | 0.05                                  |
| 8.375 KONINKLIJKE KPN -144A- 8.375%/00-01.10.2030                        | USD     | 200'000                          |           | 100'000      | 100'000                          | 99'115.54    | 0.06                                  |
| 4.625 KRAFT HEINZ FOODS CO 4.625%/18-30.01.2029                          | USD     | 100'000                          |           |              | 100'000                          | 84'788.57    | 0.05                                  |
| 3.700 KRÖGER CO 3.7%/17-01.08.2027                                       | USD     | 50'000                           |           | 50'000       |                                  |              |                                       |
| 4.750 MCKESSON CORP 4.75%/18-30.05.2029                                  | USD     | 200'000                          |           |              | 200'000                          | 168'700.17   | 0.10                                  |
| 5.000 MEGLOBAL CANADA INC 5%/20-18.05.2025                               | USD     | 200'000                          |           | 200'000      |                                  |              |                                       |
| - MERCK & CO STEP UP 03-01.12.2033                                       | USD     | 100'000                          |           |              | 100'000                          | 98'916.07    | 0.06                                  |
| 6.375 METLIFE INC 6.375%/04-15.06.2034                                   | USD     |                                  | 200'000   |              | 200'000                          | 188'976.58   | 0.11                                  |
| 6.250 MORGAN STANLEY 6.25%/06-09.08.2026                                 | USD     | 300'000                          |           | 150'000      | 150'000                          | 130'162.21   | 0.07                                  |
| 5.602 NATIONAL GRID PLC 5.602%/23-12.06.2028                             | USD     |                                  | 50'000    |              | 50'000                           | 43'385.72    | 0.02                                  |
| 4.950 NESTLE HOLDINGS INC 4.95%/23-14.03.2030                            | USD     |                                  | 180'000   |              | 180'000                          | 156'294.63   | 0.09                                  |
| 4.450 NEWELL RUBBERMAID 4.45%/16-01.04.2026                              | USD     | 100'000                          |           |              | 100'000                          | 82'870.51    | 0.05                                  |
| 6.950 OCCIDENTAL PETROLEUM COR 6.95%/19-01.07.2024                       | USD     | 51'000                           |           |              | 51'000                           | 43'158.47    | 0.02                                  |
| 7.950 OCCIDENTAL PETROLEUM COR 7.95%/19-15.06.2039                       | USD     |                                  | 150'000   |              | 150'000                          | 147'222.77   | 0.08                                  |
| 6.250 ORACLE CORP 6.25%/22-09.11.2032                                    | USD     |                                  | 200'000   |              | 200'000                          | 183'041.45   | 0.10                                  |
| 8.750 PERU 8.75%/03-21.11.2033   | USD     |                                  | 250'000   |              | 250'000                          | 264'200.52   | 0.15                                  |
| 6.500 PFIZER 6.5%/03-01.02.2034  | USD     | 200'000                          |           |              | 200'000                          | 189'969.70   | 0.11                                  |
| 4.650 PFIZER INVESTMENT ENTER 4.65%/23-19.05.2030                        | USD     |                                  | 100'000   |              | 100'000                          | 84'749.86    | 0.05                                  |
| 10.625 PHILIPPINES 10.625%/00-16.03.2025                                 | USD     | 50'000                           |           |              | 50'000                           | 44'818.16    | 0.03                                  |
| - PRUDENTIAL FINANCIAL INC (subordinated) FIX-TO-FRN FRN/18-15.09.2048   | USD     | 700'000                          |           |              | 700'000                          | 573'012.16   | 0.32                                  |
| 5.500 PULTEGROUP INC 5.5%/16-01.03.2026                                  | USD     | 300'000                          |           | 200'000      | 100'000                          | 85'279.24    | 0.05                                  |
| 3.250 ROCHE HOLDINGS INC 3.25%/18-17.09.2023                             | USD     | 200'000                          |           | 200'000      |                                  |              |                                       |
| 6.000 ROMANIA 6%/22-25.05.2034   | USD     |                                  | 150'000   |              | 150'000                          | 126'951.83   | 0.07                                  |
| 4.000 SCHLUMBERGER HOLDINGS (reg. -S-) 4%/15-21.12.2025                  | USD     | 100'000                          |           |              | 100'000                          | 82'830.11    | 0.05                                  |
| 6.450 SOUTHWESTERN ENERGY 6.45%/15-23.01.2025                            | USD     | 100'000                          |           |              | 100'000                          | 83'850.16    | 0.05                                  |
| 4.050 STANDARD CHARTERED (reg. -S-) 4.05%/16-12.04.2026                  | USD     | 200'000                          |           | 200'000      |                                  |              |                                       |
| 7.250 STATOIL ASA 7.25%/00-23.09.2027                                    | USD     | 200'000                          |           | 100'000      | 100'000                          | 92'329.52    | 0.05                                  |
| 5.950 SYSCO CORPORATION 5.95%/20-01.04.2030                              | USD     |                                  | 200'000   | 100'000      | 100'000                          | 89'576.57    | 0.05                                  |
| 4.450 TOYOTA MOTOR CREDIT CORP S. -B- 4.45%/22-29.06.2029                | USD     |                                  | 50'000    |              | 50'000                           | 42'289.08    | 0.02                                  |
| 6.750 TRAVELERS COS INC 6.75%/06-20.06.2036                              | USD     |                                  | 200'000   |              | 200'000                          | 198'369.10   | 0.11                                  |
| 7.125 TYCO ELECTRONICS GROUP S 7.125%/08-01.10.2037                      | USD     | 200'000                          |           |              | 200'000                          | 198'204.15   | 0.11                                  |
| - UBS GROUP AG FIX-TO-FRN FRN/23-22.12.2027                              | USD     |                                  | 200'000   |              | 200'000                          | 173'468.81   | 0.10                                  |
| 6.338 UNITED MEXICAN STATES 6.338%/23-04.05.2053                         | USD     |                                  | 200'000   |              | 200'000                          | 171'672.79   | 0.10                                  |
| 4.500 UNITED STATES OF AMERICA 4.5%/06-15.02.2036                        | USD     |                                  | 300'000   | 300'000      |                                  |              |                                       |
| 4.625 UNITED STATES OF AMERICA 4.625%/10-15.02.2040                      | USD     |                                  | 40'000    | 40'000       |                                  |              |                                       |
| 6.250 UNITED STATES OF AMERICA 6.25%/00-15.05.2030                       | USD     |                                  | 150'000   | 150'000      |                                  |              |                                       |
| 6.500 UNITED STATES OF AMERICA 6.5%/96-15.11.2026                        | USD     | 500'000                          |           |              | 500'000                          | 448'033.30   | 0.25                                  |
| 2.250 UNITED STATES OF AMERICA -F-2025- 2.25%/15-15.11.2025              | USD     | 50'000                           |           | 50'000       |                                  |              |                                       |
| 2.500 UNITED STATES OF AMERICA S. -U-2024- 2.5%/19-31.01.2024            | USD     |                                  | 500'000   | 500'000      |                                  |              |                                       |
| 4.625 UNITEDHEALTH GROUP 4.625%/15-15.07.2035                            | USD     |                                  | 200'000   | 200'000      |                                  |              |                                       |
| 7.875 URUGUAY 7.875%/03-15.01.2033                                       | USD     |                                  | 50'000    |              | 50'000                           | 51'366.42    | 0.03                                  |
| 6.250 US 6.25%/93-15.08.2023   | USD     | 1'100'000                        | 800'000   | 1'900'000    |                                  |              |                                       |
| 6.375 US 6.375%/97-15.08.2027  | USD     | 1'000'000                        |           | 500'000      | 500'000                          | 454'657.81   | 0.26                                  |
| 6.875 US 6.875%/95-15.08.2025  | USD     | 300'000                          |           |              | 300'000                          | 262'073.84   | 0.15                                  |
| 7.500 US 7.5%/94-15.11.2024  | USD     | 130'000                          | 670'000   |              | 800'000                          | 690'342.12   | 0.39                                  |
| 2.625 US TREASURY N/B S. -AA-2023- 2.625%/18-30.06.2023                  | USD     |                                  | 2'600'000 | 2'600'000    |                                  |              |                                       |
| 2.750 US TREASURY N/B S. -Y-2023- 2.75%/18-30.04.2023                    | USD     |                                  | 3'700'000 | 3'700'000    |                                  |              |                                       |
| 7.750 VERIZON GLOBAL FUNDING 7.75%/01-01.12.2030                         | USD     |                                  | 100'000   |              | 100'000                          | 98'645.91    | 0.06                                  |

Jahresbericht per 31. Dezember 2023

| Titelbezeichnung   | Währung | 31.12.2022<br>Anzahl/<br>Nominal | Käufe (1) | Verkäufe (1) | 31.12.2023<br>Anzahl/<br>Nominal | Kurswert CHF         | in % des<br>Gesamtfonds-<br>vermögens |
|--|---------|----------------------------------|-----------|--------------|----------------------------------|----------------------|---------------------------------------|
| 6.875 VIACOM 6.875%/06-30.04.2036  | USD     |                                  | 200'000   |              | 200'000                          | 170'898.50           | 0.10                                  |
| 6.000 VIRGINIA ELEC & POWER CO 6%/06-15.01.2036  | USD     |                                  | 200'000   |              | 200'000                          | 180'568.76           | 0.10                                  |
| - VODAFONE GROUP PLC (subordinated) FIX-TO-FRN FRN/19-04.04.2079   | USD     | 500'000                          |           |              | 500'000                          | 434'833.48           | 0.25                                  |
| 4.950 WABTEC 4.95%/18-15.09.2028   | USD     | 100'000                          |           |              | 100'000                          | 83'245.88            | 0.05                                  |
| 4.000 WELLTOWER 4%/15-01.06.2025   | USD     | 200'000                          |           | 200'000      |                                  |                      |                                       |
|  |         |                                  |           |              |                                  | <b>10'378'556.53</b> | <b>5.85</b>                           |
| <b>Total Anleihen</b>  |         |                                  |           |              |                                  | <b>18'183'119.02</b> | <b>10.25</b>                          |
| <b>Kollektive Kapitalanlagen</b>   |         |                                  |           |              |                                  |                      |                                       |
| <b>EURO</b>  |         |                                  |           |              |                                  |                      |                                       |
| CREDIT SUISSE INDEX FUND (LUX) SICAV - CSIF (LUX) EQUITY EMU ESG BLUE -QAX- EUR  | EUR     | 2'500                            | 650       | 680          | 2'470                            | 2'830'055.80         | 1.60                                  |
| CS INVESTMENT FUNDS 1 SICAV - CREDIT SUISSE (LUX) FINANCIAL BOND FUND -EA- EUR   | EUR     | 750                              |           | 750          |                                  |                      |                                       |
| INVESTCO ZODIAC FUNDS FCP-SIF - INVESCO EUROPEAN SENIOR LOAN ESG FUND -GX EUR MD- EUR  | EUR     | 2'650                            |           |              | 2'650                            | 219'171.20           | 0.12                                  |
|  |         |                                  |           |              |                                  | <b>3'049'227.00</b>  | <b>1.72</b>                           |
| <b>JAPANISCHER YEN</b>   |         |                                  |           |              |                                  |                      |                                       |
| CREDIT SUISSE INDEX FUND (LUX) SICAV - CSIF (LUX) EQUITY JAPAN ESG BLUE -QAX- JPY  | JPY     | 325                              |           | 75           | 250                              | 179'342.10           | 0.10                                  |
|  |         |                                  |           |              |                                  | <b>179'342.10</b>    | <b>0.10</b>                           |
| <b>NORWEGISCHE KRONE</b>   |         |                                  |           |              |                                  |                      |                                       |
| STORM FUND II SICAV - STORM BOND FUND -IC DIST NOK- NOK  | NOK     | 65'000                           |           |              | 65'000                           | 585'209.21           | 0.33                                  |
|  |         |                                  |           |              |                                  | <b>585'209.21</b>    | <b>0.33</b>                           |
| <b>US DOLLAR</b>   |         |                                  |           |              |                                  |                      |                                       |
| BLACKROCK STRATEGIC FUNDS SICAV - BLACKROCK GLOBAL REAL ASSET SECURITIES FUND -D3 USD- USD                                   | USD     | 15'000                           |           | 7'500        | 7'500                            | 454'918.84           | 0.26                                  |
| BNP PARIBAS EASY SICAV - JPM ESG EMBI GLOBAL DIVERSIFIED COMPOSITE - USD TRACK PRIVILEGE USD DIST- USD                       | USD     | 25'000                           |           | 20'000       | 5'000                            | 325'719.45           | 0.18                                  |
| BNP PARIBAS INSTICASH SICAV - BNP PARIBAS INSTICASH USD 1D LVNAV -I PLUS DIS USD INC- USD                                    | USD     |                                  | 900'000   | 900'000      |                                  |                      |                                       |
| CIM INVESTMENT FUND ICAV - CIM DIVIDEND INCOME FUND -H ORDINARY- USD   | USD     |                                  | 365'000   |              | 365'000                          | 2'933'687.94         | 1.65                                  |
| CREDIT SUISSE (LUX) EMERGING MARKET CORPORATE BOND FUND -EA- USD   | USD     | 750                              |           | 750          |                                  |                      |                                       |
| CREDIT SUISSE FUND (LUX) ASIA PACIFIC INCOME EQUITY FUND -DA- USD  | USD     | 3'200                            |           | 3'200        |                                  |                      |                                       |
| CREDIT SUISSE INDEX FUND (LUX) SICAV - CSIF (LUX) BOND GOVERNMENT EMERGING MARKETS USD -QAX- USD                             | USD     |                                  | 1'000     |              | 1'000                            | 661'188.27           | 0.37                                  |
| CREDIT SUISSE INDEX FUND (LUX) SICAV - CSIF (LUX) EQUITY CHINA TOTAL MARKET BLUE -OB- USD                                    | USD     |                                  | 2'500     | 1'650        | 850                              | 626'895.03           | 0.35                                  |
| CREDIT SUISSE INDEX FUND (LUX) SICAV - CSIF (LUX) EQUITY EMERGING MARKETS ESG BLUE -QA USD INC- USD                          | USD     | 4'000                            | 1'750     | 1'950        | 3'800                            | 2'823'793.43         | 1.59                                  |
| CREDIT SUISSE NOVA (LUX) GLOBAL SENIOR LOAN FUND -EA- USD  | USD     | 250                              |           |              | 250                              | 215'813.45           | 0.12                                  |
| CS INVESTMENT FUNDS 1 SICAV - CREDIT SUISSE(LUX)LATIN AMERICA CORPORATE BOND FUND -IA USD- USD                               | USD     | 500                              |           | 500          |                                  |                      |                                       |
| CS INVESTMENT FUNDS 4 SICAV - CREDIT SUISSE (LUX) ALTERNATIVE OPPORTUNITIES FUND -EA- USD                                    | USD     |                                  | 5'750     | 750          | 5'000                            | 4'110'954.72         | 2.32                                  |
| DIVAS GLOBAL BARRIER COUPON FUND -F USD DIST- USD  | USD     | 15'000                           | 8'000     |              | 23'000                           | 1'758'615.52         | 0.99                                  |
| DWS INVEST SICAV - DWS INVEST ESG ASIAN BONDS -USD IDO- USD  | USD     |                                  | 7'500     |              | 7'500                            | 649'081.50           | 0.37                                  |
| INSTITUTIONAL CASH SERIES PLC - BLACKROCK ICS US DOLLAR LIQUIDITY FUND -PREMIER (ACC TO)- USD                                | USD     |                                  | 477       | 477          |                                  |                      |                                       |
| INVESTCO ZODIAC FUNDS FCP-SIF - INVESCO US SENIORLOAN ESG FUND -GX USD MD- USD   | USD     | 10'000                           |           | 2'000        | 8'000                            | 630'006.09           | 0.36                                  |
| LEGAL & GENERAL ICAV - L&G ESG EMERGING MARKETS GOVERNMENT BOND USD (LOCAL CURRENCY) INDEX FUND -C DIS UNHEDGED USD INC- USD | USD     | 1'412'716                        | 100'000   | 262'716      | 1'250'000                        | 998'481.73           | 0.56                                  |
| LEGAL & GENERAL ICAV - L&G ESG GLOBAL HIGH YELDBOND INDEX FUND -C USD USD INC UNHEDGED- USD                                  | USD     |                                  | 550'000   |              | 550'000                          | 494'693.99           | 0.28                                  |
| PRINCIPAL GLOBAL INVESTORS FUNDS - FINISTERRE UNCONSTRAINED EMERGING MARKETS FIXED INCOME FUND -I3 INCOME USD- USD           | USD     | 60'000                           | 80'000    |              | 140'000                          | 1'050'254.23         | 0.59                                  |
| PRINCIPAL GLOBAL INVESTORS FUNDS - PREFERRED SECURITIES FUND -I CLASS INCOME- USD  | USD     | 375'000                          |           |              | 375'000                          | 2'913'071.22         | 1.64                                  |
| SIMAG INVESTMENT FUNDS SICAV - SIMAG SYSTEMATIC USA ESG EQUITY FUND -SA- USD   | USD     | 12'500                           |           | 12'500       |                                  |                      |                                       |
|  |         |                                  |           |              |                                  | <b>20'647'175.41</b> | <b>11.64</b>                          |
| <b>Total Kollektive Kapitalanlagen</b>   |         |                                  |           |              |                                  | <b>24'460'953.72</b> | <b>13.79</b>                          |
| <b>Strukturierte Produkte</b>  |         |                                  |           |              |                                  |                      |                                       |
| <b>EURO</b>  |         |                                  |           |              |                                  |                      |                                       |
| CREDIT SUISSE AG NASSAU BRANCH 6%/20-PERPETUAL   | EUR     | 7'000                            |           | 7'000        |                                  |                      |                                       |
| J.P.MORGAN STRUCTURED PRODUCTS B.V./20-26.05.2025  | EUR     | 13'500                           |           | 13'500       |                                  |                      |                                       |
| UBS AG/20-18.05.2027   | EUR     | 1'300                            |           | 1'300        |                                  |                      |                                       |
|  |         |                                  |           |              |                                  | <b>0.00</b>          | <b>0.00</b>                           |
| <b>SCHWEIZER FRANKEN</b>   |         |                                  |           |              |                                  |                      |                                       |
| CREDIT SUISSE AG NASSAU BRANCH 6%/20-PERPETUAL   | CHF     | 7'500                            |           | 7'500        |                                  |                      |                                       |
| J.P.MORGAN STRUCTURED PRODUCTS B.V./20-26.05.2025  | CHF     | 16'000                           |           | 16'000       |                                  |                      |                                       |

| Titelbezeichnung   | Währung | 31.12.2022<br>Anzahl/<br>Nominal | Käufe (1) | Verkäufe (1) | 31.12.2023<br>Anzahl/<br>Nominal | Kurswert CHF         | in % des<br>Gesamtfonds-<br>vermögens |             |
|--|---------|----------------------------------|-----------|--------------|----------------------------------|----------------------|---------------------------------------|-------------|
| UBS AG/20-18.05.2027   | CHF     | 1'600                            |           | 1'600        |                                  | 0.00                 | 0.00                                  |             |
| <b>US DOLLAR</b>   |         |                                  |           |              |                                  |                      |                                       |             |
| CREDIT SUISSE AG NASSAU BRANCH 6%/20-PERPETUAL   | USD     | 8'500                            |           | 8'500        |                                  |                      |                                       |             |
| J.P.MORGAN STRUCTURED PRODUCTS B.V./20-26.05.2025  | USD     | 25'000                           |           | 25'000       |                                  |                      |                                       |             |
| UBS AG/20-18.05.2027   | USD     | 1'700                            |           | 1'700        |                                  | 0.00                 | 0.00                                  |             |
| <b>Total Strukturierte Produkte</b>  |         |                                  |           |              |                                  |                      | <b>0.00</b>                           | <b>0.00</b> |
| <b>Total Wertpapiere bewertet aufgrund von am Markt beobachtbaren Parametern</b>   |         |                                  |           |              |                                  | <b>42'644'072.74</b> | <b>24.04</b>                          |             |
| <b>Wertpapiere bewertet aufgrund geeigneten Bewertungsmodellen unter Berücksichtigung der aktuellen Marktgegebenheiten</b>         |         |                                  |           |              |                                  |                      |                                       |             |
| <b>Kollektive Kapitalanlagen</b>   |         |                                  |           |              |                                  |                      |                                       |             |
| <b>US DOLLAR</b>   |         |                                  |           |              |                                  |                      |                                       |             |
| THOMASLOYD ENERGY IMPACT TRUS  | USD     | 600'000                          |           |              | 600'000                          | 254'507.11           | 0.14                                  |             |
| <b>Total Kollektive Kapitalanlagen</b>   |         |                                  |           |              |                                  |                      | <b>254'507.11</b>                     | <b>0.14</b> |
| <b>Total Wertpapiere bewertet aufgrund geeigneten Bewertungsmodellen unter Berücksichtigung der aktuellen Marktgegebenheiten</b>   |         |                                  |           |              |                                  | <b>254'507.11</b>    | <b>0.14</b>                           |             |
| <b>Derivative Finanzinstrumente</b>  |         |                                  |           |              |                                  |                      |                                       |             |
| <b>Börsennotierte / an einem geregelten Markt gehandelte Wertpapiere; bewertet zu den Kursen, die am Hauptmarkt bezahlt werden</b> |         |                                  |           |              |                                  |                      |                                       |             |
| <b>Financial Futures</b>   |         |                                  |           |              |                                  |                      |                                       |             |
| <b>ENGLISCHES PFUND</b>  |         |                                  |           |              |                                  |                      |                                       |             |
| FTSE 100 Index -10- 03/23  | GBP     | -10                              | 10        |              |                                  |                      |                                       |             |
| FTSE 100 Index -10- 09/23  | GBP     |                                  | 12        | 12           |                                  |                      |                                       |             |
| FTSE 100 Index -10- 12/23  | GBP     |                                  | 10        | 10           |                                  |                      |                                       |             |
| FTSE 100 Index -10- 03/24  | GBP     |                                  | 10        | 10           |                                  |                      |                                       |             |
| <b>Total Financial Futures</b>   |         |                                  |           |              |                                  |                      | <b>0.00</b>                           | <b>0.00</b> |
| <b>EURO</b>  |         |                                  |           |              |                                  |                      |                                       |             |
| EURO STOXX 50 Index -10- 03/23   | EUR     | -65                              | 70        | 5            |                                  |                      |                                       |             |
| EURO STOXX 50 Index -10- 06/23   | EUR     |                                  | 40        | 40           |                                  |                      |                                       |             |
| EURO STOXX 50 Index -10- 09/23   | EUR     |                                  | 50        | 50           |                                  |                      |                                       |             |
| <b>Total Financial Futures</b>   |         |                                  |           |              |                                  |                      | <b>0.00</b>                           | <b>0.00</b> |
| <b>SCHWEIZER FRANKEN</b>   |         |                                  |           |              |                                  |                      |                                       |             |
| SMI Index -10- 03/23   | CHF     | -25                              | 35        | 10           |                                  |                      |                                       |             |
| SMI Index -10- 06/23   | CHF     |                                  | 12        | 12           |                                  |                      |                                       |             |
| SMI Index -10- 09/23   | CHF     |                                  | 10        | 10           |                                  |                      |                                       |             |
| <b>Total Financial Futures</b>   |         |                                  |           |              |                                  |                      | <b>0.00</b>                           | <b>0.00</b> |
| <b>US DOLLAR</b>   |         |                                  |           |              |                                  |                      |                                       |             |
| S&P E-MINI 500 Index -50- 03/23  | USD     | -20                              | 21        | 1            |                                  |                      |                                       |             |
| S&P E-MINI 500 Index -50- 06/23  | USD     |                                  | 1         | 1            |                                  |                      |                                       |             |
| S&P E-MINI 500 Index -50- 09/23  | USD     |                                  | 1         | 1            |                                  |                      |                                       |             |
| <b>Total Financial Futures</b>   |         |                                  |           |              |                                  |                      | <b>0.00</b>                           | <b>0.00</b> |
| <b>Options</b>   |         |                                  |           |              |                                  |                      |                                       |             |
| <b>ENGLISCHES PFUND</b>  |         |                                  |           |              |                                  |                      |                                       |             |
| RIO TINTO (call) -61- 20.01.23   | GBP     | -18                              | 18        |              |                                  | 0.00                 | 0.00                                  |             |
| <b>EURO</b>  |         |                                  |           |              |                                  |                      |                                       |             |
| ENDESA (put) -19- 16.06.23   | EUR     | -50                              | 50        |              |                                  | 0.00                 | 0.00                                  |             |
| <b>KANADISCHER DOLLAR</b>  |         |                                  |           |              |                                  |                      |                                       |             |
| GREAT WEST LIFECO (call) -36- 17.02.23   | CAD     |                                  | 90        | 90           |                                  |                      |                                       |             |
| POWER CORP OF CANADA (call) -37- 17.02.23  | CAD     |                                  | 50        | 50           |                                  |                      |                                       |             |
| <b>Total Options</b>   |         |                                  |           |              |                                  |                      | <b>0.00</b>                           | <b>0.00</b> |
| <b>SCHWEIZER FRANKEN</b>   |         |                                  |           |              |                                  |                      |                                       |             |
| EUREX FRANKFURT AKTIENGESELLSCHAFT (call) -94- 20.10.23  | CHF     |                                  | 110       | 110          |                                  |                      |                                       |             |
| EUREX FRANKFURT AKTIENGESELLSCHAFT (put) -86- 20.10.23   | CHF     |                                  | 110       | 110          |                                  |                      |                                       |             |
| NESTLE reg (call) -102- 17.11.23   | CHF     |                                  | 90        | 90           |                                  |                      |                                       |             |
| NESTLE reg (call) -102- 19.01.24   | CHF     |                                  |           | 100          | -100                             | -1'100.00            | 0.00                                  |             |
| NESTLE reg (call) -103- 15.12.23   | CHF     |                                  | 90        | 90           |                                  |                      |                                       |             |
| NESTLE reg (call) -108- 25.08.23   | CHF     |                                  | 100       | 100          |                                  |                      |                                       |             |
| NESTLE reg (call) -112- 20.01.23   | CHF     | -100                             | 100       |              |                                  |                      |                                       |             |
| NESTLE reg (call) -112- 20.10.23   | CHF     |                                  | 90        | 90           |                                  |                      |                                       |             |
| NESTLE reg (call) -112- 21.07.23   | CHF     |                                  | 100       | 100          |                                  |                      |                                       |             |
| NESTLE reg (call) -114- 21.04.23   | CHF     |                                  | 100       | 100          |                                  |                      |                                       |             |
| NESTLE reg (call) -116- 17.03.23   | CHF     |                                  | 110       | 110          |                                  |                      |                                       |             |
| NESTLE reg (call) -122- 16.06.23   | CHF     |                                  | 90        | 90           |                                  |                      |                                       |             |
| NESTLE reg (put) -102- 20.10.23  | CHF     |                                  | 90        | 90           |                                  |                      |                                       |             |

Jahresbericht per 31. Dezember 2023

| Titelbezeichnung   | Währung | 31.12.2022<br>Anzahl/<br>Nominal | Käufe (1) | Verkäufe (1) | 31.12.2023<br>Anzahl/<br>Nominal | Kurswert CHF        | in % des<br>Gesamtfonds-<br>vermögens |
|--|---------|----------------------------------|-----------|--------------|----------------------------------|---------------------|---------------------------------------|
| NESTLE reg (put) -102- 25.08.23  | CHF     |                                  | 100       | 100          |                                  |                     |                                       |
| NESTLE reg (put) -104- 20.01.23  | CHF     | -100                             | 100       |              |                                  |                     |                                       |
| NESTLE reg (put) -104- 21.04.23  | CHF     |                                  | 100       | 100          |                                  |                     |                                       |
| NESTLE reg (put) -104- 21.07.23  | CHF     |                                  | 100       | 100          |                                  |                     |                                       |
| NESTLE reg (put) -105- 17.03.23  | CHF     |                                  | 110       | 110          |                                  |                     |                                       |
| NESTLE reg (put) -108- 16.06.23  | CHF     |                                  | 90        | 90           |                                  |                     |                                       |
| NESTLE reg (put) -92- 19.01.24   | CHF     |                                  |           | 100          | -100                             | -1'500.00           | 0.00                                  |
| NESTLE reg (put) -94- 17.11.23   | CHF     |                                  | 90        | 90           |                                  |                     |                                       |
| NESTLE reg (put) -97- 15.12.23   | CHF     |                                  | 90        | 90           |                                  |                     |                                       |
| NOVARTIS reg (call) -78- 21.04.23  | CHF     |                                  | 140       | 140          |                                  |                     |                                       |
| NOVARTIS reg (call) -87- 17.03.23  | CHF     |                                  | 140       | 140          |                                  |                     |                                       |
| NOVARTIS reg (call) -88- 19.01.24  | CHF     |                                  |           | 110          | -110                             | -2'310.00           | 0.00                                  |
| NOVARTIS reg (call) -88- 20.01.23  | CHF     | -130                             | 130       |              |                                  |                     |                                       |
| NOVARTIS reg (call) -89- 15.12.23  | CHF     |                                  | 110       | 110          |                                  |                     |                                       |
| NOVARTIS reg (call) -89- 17.11.23  | CHF     |                                  | 100       | 100          |                                  |                     |                                       |
| NOVARTIS reg (call) -93- 21.07.23  | CHF     |                                  | 120       | 120          |                                  |                     |                                       |
| NOVARTIS reg (call) -93- 25.08.23  | CHF     |                                  | 110       | 110          |                                  |                     |                                       |
| NOVARTIS reg (call) -97- 16.06.23  | CHF     |                                  | 120       | 120          |                                  |                     |                                       |
| NOVARTIS reg (put) -72- 21.04.23   | CHF     |                                  | 140       | 140          |                                  |                     |                                       |
| NOVARTIS reg (put) -79- 17.03.23   | CHF     |                                  | 140       | 140          |                                  |                     |                                       |
| NOVARTIS reg (put) -80- 19.01.24   | CHF     |                                  |           | 110          | -110                             | -1'320.00           | 0.00                                  |
| NOVARTIS reg (put) -81- 20.01.23   | CHF     | -130                             | 130       |              |                                  |                     |                                       |
| NOVARTIS reg (put) -82- 17.11.23   | CHF     |                                  | 100       | 100          |                                  |                     |                                       |
| NOVARTIS reg (put) -83- 15.12.23   | CHF     |                                  | 110       | 110          |                                  |                     |                                       |
| NOVARTIS reg (put) -87- 16.06.23   | CHF     |                                  | 120       | 120          |                                  |                     |                                       |
| NOVARTIS reg (put) -87- 21.07.23   | CHF     |                                  | 120       | 120          |                                  |                     |                                       |
| NOVARTIS reg (put) -87- 25.08.23   | CHF     |                                  | 110       | 110          |                                  |                     |                                       |
| ROCHE HOLDING cert (call) -245- 15.12.23   | CHF     |                                  | 40        | 40           |                                  |                     |                                       |
| ROCHE HOLDING cert (call) -245- 17.11.23   | CHF     |                                  | 40        | 40           |                                  |                     |                                       |
| ROCHE HOLDING cert (call) -255- 19.01.24   | CHF     |                                  |           | 40           | -40                              | -2'640.00           | 0.00                                  |
| ROCHE HOLDING cert (call) -270- 20.10.23   | CHF     |                                  | 40        | 40           |                                  |                     |                                       |
| ROCHE HOLDING cert (call) -270- 21.04.23   | CHF     |                                  | 40        | 40           |                                  |                     |                                       |
| ROCHE HOLDING cert (call) -285- 21.07.23   | CHF     |                                  | 40        | 40           |                                  |                     |                                       |
| ROCHE HOLDING cert (call) -285- 25.08.23   | CHF     |                                  | 40        | 40           |                                  |                     |                                       |
| ROCHE HOLDING cert (call) -295- 16.06.23   | CHF     |                                  | 40        | 40           |                                  |                     |                                       |
| ROCHE HOLDING cert (call) -305- 17.03.23   | CHF     |                                  | 40        | 40           |                                  |                     |                                       |
| ROCHE HOLDING cert (call) -315- 20.01.23   | CHF     | -40                              | 40        |              |                                  |                     |                                       |
| ROCHE HOLDING cert (put) -225- 17.11.23  | CHF     |                                  | 40        | 40           |                                  |                     |                                       |
| ROCHE HOLDING cert (put) -230- 15.12.23  | CHF     |                                  | 40        | 40           |                                  |                     |                                       |
| ROCHE HOLDING cert (put) -230- 19.01.24  | CHF     |                                  |           | 40           | -40                              | -1'280.00           | 0.00                                  |
| ROCHE HOLDING cert (put) -250- 20.10.23  | CHF     |                                  | 40        | 40           |                                  |                     |                                       |
| ROCHE HOLDING cert (put) -250- 21.04.23  | CHF     |                                  | 40        | 40           |                                  |                     |                                       |
| ROCHE HOLDING cert (put) -260- 25.08.23  | CHF     |                                  | 80        | 80           |                                  |                     |                                       |
| ROCHE HOLDING cert (put) -265- 16.06.23  | CHF     |                                  | 40        | 40           |                                  |                     |                                       |
| ROCHE HOLDING cert (put) -265- 21.07.23  | CHF     |                                  | 40        | 40           |                                  |                     |                                       |
| ROCHE HOLDING cert (put) -275- 17.03.23  | CHF     |                                  | 40        | 40           |                                  |                     |                                       |
| ROCHE HOLDING cert (put) -290- 20.01.23  | CHF     | -40                              | 40        |              |                                  |                     |                                       |
| SWISS LIFE HOLDING reg (call) -570- 17.02.23   | CHF     |                                  | 10        | 10           |                                  |                     |                                       |
| SWISS REINSURANCE reg (call) -92- 20.01.23   | CHF     | -167                             | 167       |              |                                  |                     |                                       |
|  |         |                                  |           |              |                                  | <b>-10'150.00</b>   | <b>-0.01</b>                          |
| <b>US DOLLAR</b>   |         |                                  |           |              |                                  |                     |                                       |
| NVIDIA (call) -210- 17.02.23   | USD     |                                  | 5         | 5            |                                  |                     |                                       |
|  |         |                                  |           |              |                                  | <b>0.00</b>         | <b>0.00</b>                           |
| <b>Total Options</b>   |         |                                  |           |              |                                  | <b>-10'150.00</b>   | <b>-0.01</b>                          |
| <b>Total Börsennotierte / an einem geregelten Markt gehandelte Wertpapiere; bewertet zu den Kursen, die am Hauptmarkt bezahlt werden</b> |         |                                  |           |              |                                  | <b>-10'150.00</b>   | <b>-0.01</b>                          |
| <b>Wertpapiere bewertet aufgrund von am Markt beobachtbaren Parametern</b>   |         |                                  |           |              |                                  |                     |                                       |
| <b>Devisentermingeschäfte</b>  |         |                                  |           |              |                                  |                     |                                       |
| Devisentermingeschäfte (siehe Liste)   |         |                                  |           |              |                                  | 1'368'039.57        | 0.77                                  |
| <b>Total Devisentermingeschäfte</b>  |         |                                  |           |              |                                  | <b>1'368'039.57</b> | <b>0.77</b>                           |
| <b>Total Wertpapiere bewertet aufgrund von am Markt beobachtbaren Parametern</b>   |         |                                  |           |              |                                  | <b>1'368'039.57</b> | <b>0.77</b>                           |

| Titelbezeichnung                          | Währung | 31.12.2022<br>Anzahl/<br>Nominal | Käufe (1) | Verkäufe (1) | 31.12.2023<br>Anzahl/<br>Nominal | Kurswert CHF          | in % des<br>Gesamtfonds-<br>vermögens |
|---|---------|----------------------------------|-----------|--------------|----------------------------------|-----------------------|---------------------------------------|
| <b>Total Derivative Finanzinstrumente</b> |         |                                  |           |              |                                  | <b>1'357'889.57</b>   | <b>0.77</b>                           |
| <b>Total Anlagen</b>                      |         |                                  |           |              |                                  | <b>175'421'696.58</b> | <b>98.89</b>                          |
| Bankguthaben auf Sicht                    |         |                                  |           |              |                                  | 1'072'750.28          | 0.60                                  |
| Bankguthaben auf Zeit                     |         |                                  |           |              |                                  | 0.00                  | 0.00                                  |
| Sonstige Vermögenswerte                   |         |                                  |           |              |                                  | 890'303.00            | 0.50                                  |
| <b>Gesamtfondsvermögen (GFV)</b>          |         |                                  |           |              |                                  | <b>177'384'749.86</b> | <b>100.00</b>                         |
| ./. Bankverbindlichkeiten                 |         |                                  |           |              |                                  | 0.00                  | 0.00                                  |
| ./. Andere Verbindlichkeiten              |         |                                  |           |              |                                  | 245'481.32            | 0.14                                  |
| ./. Andere Kredite                        |         |                                  |           |              |                                  | 0.00                  | 0.00                                  |
| <b>Nettobondsvermögen</b>                 |         |                                  |           |              |                                  | <b>177'139'268.54</b> | <b>99.86</b>                          |

(1) Umfassen auch Corporate Actions

## Summarische Gliederung des Portefeuilles gemäss KKV FINMA Art. 84 Absatz 2

| Anlagekategorien   | Kurswert CHF          | in % des<br>Gesamtfonds-<br>vermögens |
|--|-----------------------|---------------------------------------|
| <b>Börsennotierte / an einem geregelten Markt gehandelte Wertpapiere; bewertet zu den Kursen, die am Hauptmarkt bezahlt werden</b> | <b>131'155'077.16</b> | <b>73.94</b>                          |
| <b>Wertpapiere bewertet aufgrund von am Markt beobachtbaren Parametern</b>   | <b>44'012'112.31</b>  | <b>24.81</b>                          |
| <b>Wertpapiere bewertet aufgrund geeigneten Bewertungsmodellen unter Berücksichtigung der aktuellen Marktgegebenheiten</b>         | <b>254'507.11</b>     | <b>0.14</b>                           |

## Aufstellung der Devisentermingeschäfte für die Zeit vom 1. Januar 2023 bis zum 31. Dezember 2023

| Fälligkeit | Transaktion | Währung | Betrag     | Gegen | Gegenwert  | Devisengewinn/-verlust<br>Mandatswährung | in % des GFV |
|------------|-------------|---------|------------|-------|------------|--|--------------|
| 10.01.2023 | Bought      | CHF     | 40'275     | EUR   | 40'900     | 0.00                                     | 0.00         |
| 10.01.2023 | Bought      | CHF     | 40'616     | EUR   | 41'100     | 0.00                                     | 0.00         |
| 10.01.2023 | Bought      | CHF     | 42'624     | EUR   | 43'300     | 0.00                                     | 0.00         |
| 10.01.2023 | Bought      | CHF     | 99         | EUR   | 100        | 0.00                                     | 0.00         |
| 10.01.2023 | Bought      | EUR     | 500        | CHF   | 492        | 0.00                                     | 0.00         |
| 10.01.2023 | Bought      | EUR     | 2'500      | CHF   | 2'460      | 0.00                                     | 0.00         |
| 10.01.2023 | Bought      | EUR     | 6'261'600  | CHF   | 6'173'518  | 0.00                                     | 0.00         |
| 10.01.2023 | Bought      | EUR     | 400        | CHF   | 396        | 0.00                                     | 0.00         |
| 25.01.2023 | Bought      | CHF     | 55'708     | EUR   | 56'300     | 0.00                                     | 0.00         |
| 25.01.2023 | Bought      | EUR     | 6'113'600  | CHF   | 6'016'455  | 0.00                                     | 0.00         |
| 25.01.2023 | Bought      | EUR     | 13'000     | CHF   | 12'839     | 0.00                                     | 0.00         |
| 25.01.2023 | Bought      | EUR     | 261'300    | CHF   | 257'826    | 0.00                                     | 0.00         |
| 25.01.2023 | Bought      | EUR     | 262'500    | CHF   | 263'276    | 0.00                                     | 0.00         |
| 09.02.2023 | Bought      | AUD     | 1'150'000  | CHF   | 745'791    | 0.00                                     | 0.00         |
| 09.02.2023 | Bought      | CAD     | 1'200'000  | CHF   | 811'265    | 0.00                                     | 0.00         |
| 09.02.2023 | Bought      | CHF     | 2'068'194  | AUD   | 3'255'000  | 0.00                                     | 0.00         |
| 09.02.2023 | Bought      | CHF     | 787'388    | AUD   | 1'250'000  | 0.00                                     | 0.00         |
| 09.02.2023 | Bought      | CHF     | 2'088'714  | CAD   | 2'880'000  | 0.00                                     | 0.00         |
| 09.02.2023 | Bought      | CHF     | 6'151'712  | EUR   | 6'245'000  | 0.00                                     | 0.00         |
| 09.02.2023 | Bought      | CHF     | 247'425    | EUR   | 250'000    | 0.00                                     | 0.00         |
| 09.02.2023 | Bought      | CHF     | 4'700      | EUR   | 4'700      | 0.00                                     | 0.00         |
| 09.02.2023 | Bought      | CHF     | 30'917     | EUR   | 30'800     | 0.00                                     | 0.00         |
| 09.02.2023 | Bought      | CHF     | 4'030'475  | GBP   | 3'580'000  | 0.00                                     | 0.00         |
| 09.02.2023 | Bought      | CHF     | 443'871    | GBP   | 400'000    | 0.00                                     | 0.00         |
| 09.02.2023 | Bought      | CHF     | 222'558    | GBP   | 200'000    | 0.00                                     | 0.00         |
| 09.02.2023 | Bought      | CHF     | 455'400    | GBP   | 400'000    | 0.00                                     | 0.00         |
| 09.02.2023 | Bought      | CHF     | 286'067    | NOK   | 3'000'000  | 0.00                                     | 0.00         |
| 09.02.2023 | Bought      | CHF     | 25'450'698 | USD   | 26'000'000 | 0.00                                     | 0.00         |
| 09.02.2023 | Bought      | CHF     | 1'024'393  | USD   | 1'100'000  | 0.00                                     | 0.00         |
| 09.02.2023 | Bought      | CHF     | 4'211'470  | USD   | 4'600'000  | 0.00                                     | 0.00         |
| 09.02.2023 | Bought      | EUR     | 500        | CHF   | 501        | 0.00                                     | 0.00         |
| 09.02.2023 | Bought      | EUR     | 1'000'000  | CHF   | 988'431    | 0.00                                     | 0.00         |
| 09.02.2023 | Bought      | EUR     | 1'000'000  | CHF   | 997'249    | 0.00                                     | 0.00         |
| 09.02.2023 | Bought      | EUR     | 1'500      | CHF   | 1'496      | 0.00                                     | 0.00         |
| 09.02.2023 | Bought      | EUR     | 400        | CHF   | 401        | 0.00                                     | 0.00         |
| 09.02.2023 | Bought      | EUR     | 6'126'600  | CHF   | 6'045'269  | 0.00                                     | 0.00         |
| 09.02.2023 | Bought      | EUR     | 233'700    | CHF   | 234'010    | 0.00                                     | 0.00         |
| 09.02.2023 | Bought      | EUR     | 17'400     | CHF   | 17'493     | 0.00                                     | 0.00         |
| 09.02.2023 | Bought      | GBP     | 975'000    | CHF   | 1'106'108  | 0.00                                     | 0.00         |
| 09.02.2023 | Bought      | USD     | 400'000    | CHF   | 371'540    | 0.00                                     | 0.00         |
| 09.02.2023 | Bought      | USD     | 1'500'000  | CHF   | 1'384'526  | 0.00                                     | 0.00         |
| 09.02.2023 | Bought      | USD     | 2'000'000  | CHF   | 1'838'668  | 0.00                                     | 0.00         |

## Aufstellung der Devisentermingeschäfte für die Zeit vom 1. Januar 2023 bis zum 31. Dezember 2023

| Fälligkeit | Transaktion | Währung | Betrag     | Gegen | Gegenwert  | Devisengewinn/-verlust<br>Mandatswährung | in % des GFV |
|------------|-------------|---------|------------|-------|------------|--|--------------|
| 09.02.2023 | Bought      | USD     | 3'000'000  | CHF   | 2'758'584  | 0.00                                     | 0.00         |
| 09.02.2023 | Bought      | USD     | 200'000    | CHF   | 184'687    | 0.00                                     | 0.00         |
| 24.02.2023 | Bought      | CHF     | 381'330    | EUR   | 386'400    | 0.00                                     | 0.00         |
| 24.02.2023 | Bought      | CHF     | 43'875     | EUR   | 44'500     | 0.00                                     | 0.00         |
| 24.02.2023 | Bought      | CHF     | 22'715     | EUR   | 23'000     | 0.00                                     | 0.00         |
| 24.02.2023 | Bought      | EUR     | 6'360'400  | CHF   | 6'364'579  | 0.00                                     | 0.00         |
| 24.02.2023 | Bought      | EUR     | 50'400     | CHF   | 49'749     | 0.00                                     | 0.00         |
| 09.03.2023 | Bought      | CHF     | 64'206     | EUR   | 65'200     | 0.00                                     | 0.00         |
| 09.03.2023 | Bought      | CHF     | 16'692     | EUR   | 16'700     | 0.00                                     | 0.00         |
| 09.03.2023 | Bought      | EUR     | 6'345'100  | CHF   | 6'284'707  | 0.00                                     | 0.00         |
| 09.03.2023 | Bought      | EUR     | 700        | CHF   | 694        | 0.00                                     | 0.00         |
| 23.03.2023 | Bought      | CHF     | 60'580     | EUR   | 60'900     | 0.00                                     | 0.00         |
| 23.03.2023 | Bought      | CHF     | 353'916    | EUR   | 361'800    | 0.00                                     | 0.00         |
| 23.03.2023 | Bought      | EUR     | 500        | CHF   | 497        | 0.00                                     | 0.00         |
| 23.03.2023 | Bought      | EUR     | 5'956'900  | CHF   | 5'871'520  | 0.00                                     | 0.00         |
| 23.03.2023 | Bought      | EUR     | 153'200    | CHF   | 152'076    | 0.00                                     | 0.00         |
| 13.04.2023 | Bought      | CHF     | 25'869     | EUR   | 26'000     | 0.00                                     | 0.00         |
| 13.04.2023 | Bought      | CHF     | 58'432     | EUR   | 59'200     | 0.00                                     | 0.00         |
| 13.04.2023 | Bought      | CHF     | 105'249    | EUR   | 105'600    | 0.00                                     | 0.00         |
| 13.04.2023 | Bought      | EUR     | 400        | CHF   | 399        | 0.00                                     | 0.00         |
| 13.04.2023 | Bought      | EUR     | 6'110'700  | CHF   | 6'060'110  | 0.00                                     | 0.00         |
| 13.04.2023 | Bought      | EUR     | 258'800    | CHF   | 257'506    | 0.00                                     | 0.00         |
| 26.04.2023 | Bought      | EUR     | 5'687'900  | CHF   | 5'649'399  | 0.00                                     | 0.00         |
| 26.04.2023 | Bought      | EUR     | 245'600    | CHF   | 242'241    | 0.00                                     | 0.00         |
| 10.05.2023 | Bought      | CHF     | 29'744     | EUR   | 30'200     | 0.00                                     | 0.00         |
| 10.05.2023 | Bought      | CHF     | 15'877     | EUR   | 16'200     | 0.00                                     | 0.00         |
| 10.05.2023 | Bought      | CHF     | 35'806     | EUR   | 36'600     | 0.00                                     | 0.00         |
| 10.05.2023 | Bought      | EUR     | 500        | CHF   | 489        | 0.00                                     | 0.00         |
| 10.05.2023 | Bought      | EUR     | 700        | CHF   | 688        | 0.00                                     | 0.00         |
| 10.05.2023 | Bought      | EUR     | 5'933'500  | CHF   | 5'847'980  | 0.00                                     | 0.00         |
| 10.05.2023 | Bought      | EUR     | 23'200     | CHF   | 22'682     | 0.00                                     | 0.00         |
| 10.05.2023 | Bought      | EUR     | 2'100      | CHF   | 2'066      | 0.00                                     | 0.00         |
| 12.05.2023 | Bought      | AUD     | 60'000     | CHF   | 36'472     | 0.00                                     | 0.00         |
| 12.05.2023 | Bought      | AUD     | 175'000    | CHF   | 105'523    | 0.00                                     | 0.00         |
| 12.05.2023 | Bought      | CAD     | 400'000    | CHF   | 268'058    | 0.00                                     | 0.00         |
| 12.05.2023 | Bought      | CHF     | 2'141'990  | AUD   | 3'355'000  | 0.00                                     | 0.00         |
| 12.05.2023 | Bought      | CHF     | 188'965    | AUD   | 300'000    | 0.00                                     | 0.00         |
| 12.05.2023 | Bought      | CHF     | 1'149'112  | CAD   | 1'680'000  | 0.00                                     | 0.00         |
| 12.05.2023 | Bought      | CHF     | 611'817    | CAD   | 900'000    | 0.00                                     | 0.00         |
| 12.05.2023 | Bought      | CHF     | 4'441'393  | EUR   | 4'495'000  | 0.00                                     | 0.00         |
| 12.05.2023 | Bought      | CHF     | 3'980'457  | GBP   | 3'605'000  | 0.00                                     | 0.00         |
| 12.05.2023 | Bought      | CHF     | 267'499    | NOK   | 3'000'000  | 0.00                                     | 0.00         |
| 12.05.2023 | Bought      | CHF     | 22'550'402 | USD   | 24'600'000 | 0.00                                     | 0.00         |
| 12.05.2023 | Bought      | CHF     | 1'194'998  | USD   | 1'300'000  | 0.00                                     | 0.00         |
| 12.05.2023 | Bought      | EUR     | 625'000    | CHF   | 618'438    | 0.00                                     | 0.00         |
| 12.05.2023 | Bought      | GBP     | 400'000    | CHF   | 451'240    | 0.00                                     | 0.00         |
| 12.05.2023 | Bought      | GBP     | 125'000    | CHF   | 140'290    | 0.00                                     | 0.00         |
| 12.05.2023 | Bought      | GBP     | 170'000    | CHF   | 190'003    | 0.00                                     | 0.00         |
| 12.05.2023 | Bought      | USD     | 400'000    | CHF   | 367'905    | 0.00                                     | 0.00         |
| 12.05.2023 | Bought      | USD     | 500'000    | CHF   | 451'064    | 0.00                                     | 0.00         |
| 12.05.2023 | Bought      | USD     | 250'000    | CHF   | 229'004    | 0.00                                     | 0.00         |
| 12.05.2023 | Bought      | USD     | 300'000    | CHF   | 273'940    | 0.00                                     | 0.00         |
| 12.05.2023 | Bought      | USD     | 1'250'000  | CHF   | 1'111'971  | 0.00                                     | 0.00         |
| 24.05.2023 | Bought      | EUR     | 5'910'300  | CHF   | 5'773'518  | 0.00                                     | 0.00         |
| 24.05.2023 | Bought      | EUR     | 101'600    | CHF   | 99'515     | 0.00                                     | 0.00         |
| 09.06.2023 | Bought      | CHF     | 28'675     | EUR   | 29'500     | 0.00                                     | 0.00         |
| 09.06.2023 | Bought      | EUR     | 500        | CHF   | 485        | 0.00                                     | 0.00         |
| 09.06.2023 | Bought      | EUR     | 200        | CHF   | 194        | 0.00                                     | 0.00         |
| 09.06.2023 | Bought      | EUR     | 9'400      | CHF   | 9'120      | 0.00                                     | 0.00         |
| 09.06.2023 | Bought      | EUR     | 400        | CHF   | 390        | 0.00                                     | 0.00         |
| 09.06.2023 | Bought      | EUR     | 5'877'000  | CHF   | 5'752'284  | 0.00                                     | 0.00         |
| 09.06.2023 | Bought      | EUR     | 67'500     | CHF   | 65'352     | 0.00                                     | 0.00         |
| 09.06.2023 | Bought      | EUR     | 300        | CHF   | 291        | 0.00                                     | 0.00         |
| 09.06.2023 | Bought      | EUR     | 600        | CHF   | 583        | 0.00                                     | 0.00         |
| 26.06.2023 | Bought      | CHF     | 2'718      | EUR   | 2'800      | 0.00                                     | 0.00         |
| 26.06.2023 | Bought      | CHF     | 13'880     | EUR   | 14'300     | 0.00                                     | 0.00         |
| 26.06.2023 | Bought      | CHF     | 37'665     | EUR   | 38'600     | 0.00                                     | 0.00         |
| 26.06.2023 | Bought      | EUR     | 5'944'500  | CHF   | 5'749'984  | 0.00                                     | 0.00         |
| 11.07.2023 | Bought      | CHF     | 91'359     | EUR   | 93'300     | 0.00                                     | 0.00         |

## Aufstellung der Devisentermingeschäfte für die Zeit vom 1. Januar 2023 bis zum 31. Dezember 2023

| Fälligkeit | Transaktion | Währung | Betrag     | Gegen | Gegenwert  | Devisengewinn/-verlust<br>Mandatswährung | in % des GFV |
|------------|-------------|---------|------------|-------|------------|--|--------------|
| 11.07.2023 | Bought      | EUR     | 500        | CHF   | 488        | 0.00                                     | 0.00         |
| 11.07.2023 | Bought      | EUR     | 200        | CHF   | 195        | 0.00                                     | 0.00         |
| 11.07.2023 | Bought      | EUR     | 5'926'400  | CHF   | 5'738'272  | 0.00                                     | 0.00         |
| 11.07.2023 | Bought      | EUR     | 800        | CHF   | 779        | 0.00                                     | 0.00         |
| 25.07.2023 | Bought      | CHF     | 225'736    | EUR   | 231'800    | 0.00                                     | 0.00         |
| 25.07.2023 | Bought      | CHF     | 234'030    | EUR   | 240'100    | 0.00                                     | 0.00         |
| 25.07.2023 | Bought      | CHF     | 87'697     | EUR   | 90'800     | 0.00                                     | 0.00         |
| 25.07.2023 | Bought      | EUR     | 5'888'800  | CHF   | 5'778'662  | 0.00                                     | 0.00         |
| 10.08.2023 | Bought      | AUD     | 800'000    | CHF   | 465'396    | 0.00                                     | 0.00         |
| 10.08.2023 | Bought      | AUD     | 300'000    | CHF   | 178'550    | 0.00                                     | 0.00         |
| 10.08.2023 | Bought      | CHF     | 586'933    | AUD   | 1'000'000  | 0.00                                     | 0.00         |
| 10.08.2023 | Bought      | CHF     | 2'043'036  | AUD   | 3'420'000  | 0.00                                     | 0.00         |
| 10.08.2023 | Bought      | CHF     | 1'437'786  | CAD   | 2'180'000  | 0.00                                     | 0.00         |
| 10.08.2023 | Bought      | CHF     | 203'175    | CAD   | 300'000    | 0.00                                     | 0.00         |
| 10.08.2023 | Bought      | CHF     | 3'369'509  | EUR   | 3'470'000  | 0.00                                     | 0.00         |
| 10.08.2023 | Bought      | CHF     | 1'696'054  | EUR   | 1'750'000  | 0.00                                     | 0.00         |
| 10.08.2023 | Bought      | CHF     | 96'658     | EUR   | 100'000    | 0.00                                     | 0.00         |
| 10.08.2023 | Bought      | CHF     | 588'408    | EUR   | 600'000    | 0.00                                     | 0.00         |
| 10.08.2023 | Bought      | CHF     | 168'503    | EUR   | 175'000    | 0.00                                     | 0.00         |
| 10.08.2023 | Bought      | CHF     | 7'095      | EUR   | 7'400      | 0.00                                     | 0.00         |
| 10.08.2023 | Bought      | CHF     | 6'154      | EUR   | 6'400      | 0.00                                     | 0.00         |
| 10.08.2023 | Bought      | CHF     | 11'120     | EUR   | 11'600     | 0.00                                     | 0.00         |
| 10.08.2023 | Bought      | CHF     | 3'245'322  | GBP   | 2'910'000  | 0.00                                     | 0.00         |
| 10.08.2023 | Bought      | CHF     | 251'590    | NOK   | 3'000'000  | 0.00                                     | 0.00         |
| 10.08.2023 | Bought      | CHF     | 20'453'375 | USD   | 23'200'000 | 0.00                                     | 0.00         |
| 10.08.2023 | Bought      | CHF     | 535'106    | USD   | 600'000    | 0.00                                     | 0.00         |
| 10.08.2023 | Bought      | CHF     | 1'972'010  | USD   | 2'200'000  | 0.00                                     | 0.00         |
| 10.08.2023 | Bought      | CHF     | 1'068'861  | USD   | 1'200'000  | 0.00                                     | 0.00         |
| 10.08.2023 | Bought      | EUR     | 500        | CHF   | 480        | 0.00                                     | 0.00         |
| 10.08.2023 | Bought      | EUR     | 250'000    | CHF   | 239'670    | 0.00                                     | 0.00         |
| 10.08.2023 | Bought      | EUR     | 1'400'000  | CHF   | 1'351'059  | 0.00                                     | 0.00         |
| 10.08.2023 | Bought      | EUR     | 800        | CHF   | 763        | 0.00                                     | 0.00         |
| 10.08.2023 | Bought      | EUR     | 5'834'600  | CHF   | 5'676'867  | 0.00                                     | 0.00         |
| 10.08.2023 | Bought      | EUR     | 252'100    | CHF   | 241'266    | 0.00                                     | 0.00         |
| 10.08.2023 | Bought      | GBP     | 250'000    | CHF   | 284'215    | 0.00                                     | 0.00         |
| 10.08.2023 | Bought      | GBP     | 150'000    | CHF   | 166'796    | 0.00                                     | 0.00         |
| 24.08.2023 | Bought      | CHF     | 145'491    | EUR   | 151'900    | 0.00                                     | 0.00         |
| 24.08.2023 | Bought      | CHF     | 20'214     | EUR   | 21'100     | 0.00                                     | 0.00         |
| 24.08.2023 | Bought      | EUR     | 5'326'100  | CHF   | 5'123'761  | 0.00                                     | 0.00         |
| 24.08.2023 | Bought      | EUR     | 280'800    | CHF   | 269'402    | 0.00                                     | 0.00         |
| 11.09.2023 | Bought      | CHF     | 214'797    | EUR   | 224'300    | 0.00                                     | 0.00         |
| 11.09.2023 | Bought      | CHF     | 45'309     | EUR   | 47'400     | 0.00                                     | 0.00         |
| 11.09.2023 | Bought      | CHF     | 10'345     | EUR   | 10'800     | 0.00                                     | 0.00         |
| 11.09.2023 | Bought      | CHF     | 86'958     | EUR   | 90'900     | 0.00                                     | 0.00         |
| 11.09.2023 | Bought      | EUR     | 500        | CHF   | 477        | 0.00                                     | 0.00         |
| 11.09.2023 | Bought      | EUR     | 200        | CHF   | 191        | 0.00                                     | 0.00         |
| 11.09.2023 | Bought      | EUR     | 5'606'900  | CHF   | 5'373'631  | 0.00                                     | 0.00         |
| 11.09.2023 | Bought      | EUR     | 25'700     | CHF   | 24'582     | 0.00                                     | 0.00         |
| 25.09.2023 | Bought      | EUR     | 5'408'300  | CHF   | 5'168'680  | 0.00                                     | 0.00         |
| 25.09.2023 | Bought      | EUR     | 150'200    | CHF   | 143'400    | 0.00                                     | 0.00         |
| 10.10.2023 | Bought      | CHF     | 125'888    | EUR   | 130'400    | 0.00                                     | 0.00         |
| 10.10.2023 | Bought      | CHF     | 23'512     | EUR   | 24'300     | 0.00                                     | 0.00         |
| 10.10.2023 | Bought      | EUR     | 200        | CHF   | 193        | 0.00                                     | 0.00         |
| 10.10.2023 | Bought      | EUR     | 400        | CHF   | 386        | 0.00                                     | 0.00         |
| 10.10.2023 | Bought      | EUR     | 5'260'100  | CHF   | 5'014'322  | 0.00                                     | 0.00         |
| 10.10.2023 | Bought      | EUR     | 149'200    | CHF   | 143'984    | 0.00                                     | 0.00         |
| 24.10.2023 | Bought      | CHF     | 200'859    | EUR   | 208'700    | 0.00                                     | 0.00         |
| 24.10.2023 | Bought      | CHF     | 28'705     | EUR   | 30'000     | 0.00                                     | 0.00         |
| 24.10.2023 | Bought      | CHF     | 23'116     | EUR   | 24'300     | 0.00                                     | 0.00         |
| 24.10.2023 | Bought      | EUR     | 500        | CHF   | 481        | 0.00                                     | 0.00         |
| 24.10.2023 | Bought      | EUR     | 5'409'300  | CHF   | 5'215'398  | 0.00                                     | 0.00         |
| 09.11.2023 | Bought      | AUD     | 350'000    | CHF   | 198'871    | 0.00                                     | 0.00         |
| 09.11.2023 | Bought      | CHF     | 1'880'206  | AUD   | 3'320'000  | 0.00                                     | 0.00         |
| 09.11.2023 | Bought      | CHF     | 361'555    | AUD   | 630'000    | 0.00                                     | 0.00         |
| 09.11.2023 | Bought      | CHF     | 1'600'361  | CAD   | 2'480'000  | 0.00                                     | 0.00         |
| 09.11.2023 | Bought      | CHF     | 4'076'671  | EUR   | 4'270'000  | 0.00                                     | 0.00         |
| 09.11.2023 | Bought      | CHF     | 267'019    | EUR   | 281'700    | 0.00                                     | 0.00         |
| 09.11.2023 | Bought      | CHF     | 20'010     | EUR   | 21'100     | 0.00                                     | 0.00         |
| 09.11.2023 | Bought      | CHF     | 2'771'208  | GBP   | 2'510'000  | 0.00                                     | 0.00         |

## Aufstellung der Devisentermingeschäfte für die Zeit vom 1. Januar 2023 bis zum 31. Dezember 2023

| Fälligkeit                          | Transaktion | Währung | Betrag     | Gegen | Gegenwert  | Devisengewinn/-verlust<br>Mandatswährung | in % des GFV |
|-------------------------------------|-------------|---------|------------|-------|------------|--|--------------|
| 09.11.2023                          | Bought      | CHF     | 488'043    | GBP   | 440'000    | 0.00                                     | 0.00         |
| 09.11.2023                          | Bought      | CHF     | 554'872    | GBP   | 500'000    | 0.00                                     | 0.00         |
| 09.11.2023                          | Bought      | CHF     | 254'249    | NOK   | 3'000'000  | 0.00                                     | 0.00         |
| 09.11.2023                          | Bought      | CHF     | 23'549'787 | USD   | 27'200'000 | 0.00                                     | 0.00         |
| 09.11.2023                          | Bought      | EUR     | 500        | CHF   | 473        | 0.00                                     | 0.00         |
| 09.11.2023                          | Bought      | EUR     | 200        | CHF   | 189        | 0.00                                     | 0.00         |
| 09.11.2023                          | Bought      | EUR     | 500'000    | CHF   | 475'488    | 0.00                                     | 0.00         |
| 09.11.2023                          | Bought      | EUR     | 250'000    | CHF   | 240'497    | 0.00                                     | 0.00         |
| 09.11.2023                          | Bought      | EUR     | 300'000    | CHF   | 288'310    | 0.00                                     | 0.00         |
| 09.11.2023                          | Bought      | EUR     | 1'500      | CHF   | 1'439      | 0.00                                     | 0.00         |
| 09.11.2023                          | Bought      | EUR     | 400        | CHF   | 384        | 0.00                                     | 0.00         |
| 09.11.2023                          | Bought      | EUR     | 635'000    | CHF   | 603'575    | 0.00                                     | 0.00         |
| 09.11.2023                          | Bought      | EUR     | 5'255'400  | CHF   | 5'051'554  | 0.00                                     | 0.00         |
| 09.11.2023                          | Bought      | USD     | 1'000'000  | CHF   | 900'432    | 0.00                                     | 0.00         |
| 09.11.2023                          | Bought      | USD     | 600'000    | CHF   | 526'759    | 0.00                                     | 0.00         |
| 09.11.2023                          | Bought      | USD     | 450'000    | CHF   | 396'766    | 0.00                                     | 0.00         |
| 09.11.2023                          | Bought      | USD     | 470'000    | CHF   | 425'791    | 0.00                                     | 0.00         |
| 09.11.2023                          | Bought      | USD     | 364'211    | GBP   | 300'000    | 0.00                                     | 0.00         |
| 24.11.2023                          | Bought      | CHF     | 10         | EUR   | 10         | 0.00                                     | 0.00         |
| 24.11.2023                          | Bought      | EUR     | 5'146'800  | CHF   | 4'846'778  | 0.00                                     | 0.00         |
| 24.11.2023                          | Bought      | EUR     | 296'600    | CHF   | 285'723    | 0.00                                     | 0.00         |
| 24.11.2023                          | Bought      | EUR     | 4'400      | CHF   | 4'240      | 0.00                                     | 0.00         |
| 24.11.2023                          | Bought      | EUR     | 30'800     | CHF   | 29'607     | 0.00                                     | 0.00         |
| 08.12.2023                          | Bought      | CHF     | 240'470    | EUR   | 249'600    | 0.00                                     | 0.00         |
| 08.12.2023                          | Bought      | EUR     | 500        | CHF   | 474        | 0.00                                     | 0.00         |
| 08.12.2023                          | Bought      | EUR     | 200        | CHF   | 192        | 0.00                                     | 0.00         |
| 08.12.2023                          | Bought      | EUR     | 400        | CHF   | 378        | 0.00                                     | 0.00         |
| 08.12.2023                          | Bought      | EUR     | 700        | CHF   | 674        | 0.00                                     | 0.00         |
| 08.12.2023                          | Bought      | EUR     | 4'955'200  | CHF   | 4'757'453  | 0.00                                     | 0.00         |
| 08.12.2023                          | Bought      | EUR     | 261'700    | CHF   | 251'976    | 0.00                                     | 0.00         |
| 22.12.2023                          | Bought      | CHF     | 13'279     | EUR   | 14'100     | 0.00                                     | 0.00         |
| 22.12.2023                          | Bought      | CHF     | 20'004     | EUR   | 21'200     | 0.00                                     | 0.00         |
| 22.12.2023                          | Bought      | EUR     | 5'216'900  | CHF   | 5'018'423  | 0.00                                     | 0.00         |
| 04.01.2024                          | Bought      | CHF     | 195        | EUR   | 211        | -0.51                                    | 0.00         |
| 10.01.2024                          | Bought      | EUR     | 200        | CHF   | 185        | 0.49                                     | 0.00         |
| 10.01.2024                          | Bought      | EUR     | 800        | CHF   | 754        | -11.22                                   | 0.00         |
| 10.01.2024                          | Bought      | EUR     | 5'189'400  | CHF   | 4'884'839  | -63'969.73                               | -0.04        |
| 24.01.2024                          | Bought      | EUR     | 5'181'600  | CHF   | 4'882'648  | -73'257.46                               | -0.04        |
| 07.02.2024                          | Bought      | AUD     | 1'500'000  | CHF   | 859'331    | -450.02                                  | 0.00         |
| 07.02.2024                          | Bought      | AUD     | 100'000    | CHF   | 57'095     | 164.15                                   | 0.00         |
| 07.02.2024                          | Bought      | CHF     | 2'064'931  | AUD   | 3'600'000  | 3'626.92                                 | 0.00         |
| 07.02.2024                          | Bought      | CHF     | 1'608'464  | CAD   | 2'480'000  | 31'451.71                                | 0.02         |
| 07.02.2024                          | Bought      | CHF     | 320'448    | CAD   | 500'000    | 2'488.11                                 | 0.00         |
| 07.02.2024                          | Bought      | CHF     | 2'231'924  | EUR   | 2'335'000  | 66'708.47                                | 0.04         |
| 07.02.2024                          | Bought      | CHF     | 4'110'259  | GBP   | 3'750'000  | 103'189.17                               | 0.06         |
| 07.02.2024                          | Bought      | CHF     | 219'590    | GBP   | 200'000    | 5'881.10                                 | 0.00         |
| 07.02.2024                          | Bought      | CHF     | 163'889    | GBP   | 150'000    | 3'604.58                                 | 0.00         |
| 07.02.2024                          | Bought      | CHF     | 239'933    | NOK   | 3'000'000  | -7'918.12                                | 0.00         |
| 07.02.2024                          | Bought      | CHF     | 21'671'228 | USD   | 24'315'789 | 1'296'613.04                             | 0.73         |
| 07.02.2024                          | Bought      | CHF     | 868'776    | USD   | 1'000'000  | 30'765.88                                | 0.02         |
| 07.02.2024                          | Bought      | EUR     | 175'000    | CHF   | 167'970    | -5'682.42                                | 0.00         |
| 07.02.2024                          | Bought      | GBP     | 500'000    | CHF   | 541'578    | -7'247.50                                | 0.00         |
| 07.02.2024                          | Bought      | USD     | 250'000    | CHF   | 219'003    | -9'468.26                                | -0.01        |
| 07.02.2024                          | Bought      | USD     | 200'000    | CHF   | 176'076    | -8'448.81                                | 0.00         |
| <b>Total Devisentermingeschäfte</b> |             |         |            |       |            | <b>1'368'039.57</b>                      | <b>0.77</b>  |

## Ausgeliehene Wertpapierbestände (Lending and Borrowing)

| Titelbezeichnung                       | Agent                      | Lending / Borrowing | 31.12.2023<br>Anzahl/ Nominal |
|--|----------------------------|---------------------|-------------------------------|
| ALGONQUIN POWER & UTILITIES            | Credit Suisse (Schweiz) AG | Lending             | 54'000                        |
| ASIAN DEVELOPMENT BANK 5.8200 16/06/28 | Credit Suisse (Schweiz) AG | Lending             | 49'000                        |
| AT&T INC 4.6000 19/09/28               | Credit Suisse (Schweiz) AG | Lending             | 290'000                       |
| BANK OF NOVA SCOTIA                    | Credit Suisse (Schweiz) AG | Lending             | 9'000                         |
| BAYER AG 4.2500 26/08/29               | Credit Suisse (Schweiz) AG | Lending             | 50'000                        |
| CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE            | Credit Suisse (Schweiz) AG | Lending             | 1                             |
| CANADIAN GOVERNMENT 3.5000 01/03/28    | Credit Suisse (Schweiz) AG | Lending             | 200'000                       |
| CENTRICA PLC 5.2500 10/04/75           | Credit Suisse (Schweiz) AG | Lending             | 100'000                       |
| CREDIT SUISSE REAL EST INTSW           | Credit Suisse (Schweiz) AG | Lending             | 1'260                         |
| CS REAL EST LOGISTICSPLUS-A            | Credit Suisse (Schweiz) AG | Lending             | 1'132                         |



**Ausgeliehene Wertpapierbestände (Lending and Borrowing)**

| Titelbezeichnung                        | Agent                      | Lending / Borrowing | 31.12.2023<br>Anzahl/ Nominal |
|---|----------------------------|---------------------|-------------------------------|
| CS REAL ESTATE FD GREEN PROP            | Credit Suisse (Schweiz) AG | Lending             | 1'170                         |
| CS REAL ESTATE FD HOSPITALIT            | Credit Suisse (Schweiz) AG | Lending             | 1'354                         |
| CS REAL ESTATE LIVINGPLUS               | Credit Suisse (Schweiz) AG | Lending             | 842                           |
| CSIF NAREIT DVLP GREEN BLUE             | Credit Suisse (Schweiz) AG | Lending             | 2'800                         |
| DELL INT LLC / EMC CORP 6.0200 15/06/26 | Credit Suisse (Schweiz) AG | Lending             | 198'000                       |
| HAMMERSON PLC 7.2500 21/04/28           | Credit Suisse (Schweiz) AG | Lending             | 49'000                        |
| IBM CORP 5.8750 29/11/32                | Credit Suisse (Schweiz) AG | Lending             | 200'000                       |
| IGM FINANCIAL INC                       | Credit Suisse (Schweiz) AG | Lending             | 6'576                         |
| KEYERA CORP                             | Credit Suisse (Schweiz) AG | Lending             | 14'330                        |
| KUEHNE + NAGEL INTL AG-REG              | Credit Suisse (Schweiz) AG | Lending             | 1'673                         |
| MERCEDES-BENZ FIN NA 8.5000 18/01/31    | Credit Suisse (Schweiz) AG | Lending             | 99'000                        |
| NATURGY ENERGY GROUP SA                 | Credit Suisse (Schweiz) AG | Lending             | 8'280                         |
| OESTERREICHISCHE POST AG                | Credit Suisse (Schweiz) AG | Lending             | 2'675                         |
| OMV AG 6.2500 //                        | Credit Suisse (Schweiz) AG | Lending             | 49'000                        |
| ORANGE                                  | Credit Suisse (Schweiz) AG | Lending             | 33'080                        |
| PRUDENTIAL FINANCIAL IN 5.7000 15/09/48 | Credit Suisse (Schweiz) AG | Lending             | 700'000                       |
| RANDSTAD NV                             | Credit Suisse (Schweiz) AG | Lending             | 1'043                         |
| REDEIA CORP SA                          | Credit Suisse (Schweiz) AG | Lending             | 15'030                        |
| REPUBLIC OF CYPRUS 4.2500 04/11/25      | Credit Suisse (Schweiz) AG | Lending             | 100'000                       |
| REPUBLICA ORIENT URUGUA 7.8750 15/01/33 | Credit Suisse (Schweiz) AG | Lending             | 50'000                        |
| SCHLUMBERGER HLDGS CORP 4.0000 21/12/25 | Credit Suisse (Schweiz) AG | Lending             | 96'000                        |
| SCHRODER IMMOPLUS                       | Credit Suisse (Schweiz) AG | Lending             | 863                           |
| SPAREBANK 1 OESTLANDET                  | Credit Suisse (Schweiz) AG | Lending             | 8'999                         |
| STELLANTIS NV 4.5000 07/07/28           | Credit Suisse (Schweiz) AG | Lending             | 100'000                       |
| SUN LIFE FINANCIAL INC                  | Credit Suisse (Schweiz) AG | Lending             | 2'300                         |
| TELEFONICA SA                           | Credit Suisse (Schweiz) AG | Lending             | 20'500                        |
| TOTALENERGIES SE                        | Credit Suisse (Schweiz) AG | Lending             | 12'600                        |
| UBS ETF MSCI EMERG. MAR. SRI            | Credit Suisse (Schweiz) AG | Lending             | 9'100                         |
| UBS PRPRTY FD SW COM SW REAL            | Credit Suisse (Schweiz) AG | Lending             | 2'523                         |
| UBS PRPRTY FD SW RESIDTL ANF            | Credit Suisse (Schweiz) AG | Lending             | 579                           |
| UNITED MEXICAN STATES 6.3380 04/05/53   | Credit Suisse (Schweiz) AG | Lending             | 200'000                       |
| UNITED MICROELECTRON-SP ADR             | Credit Suisse (Schweiz) AG | Lending             | 69'000                        |
| WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC            | Credit Suisse (Schweiz) AG | Lending             | 9'400                         |
| WHIRLPOOL CORP                          | Credit Suisse (Schweiz) AG | Lending             | 651                           |

**Ausserbilanzgeschäfte**

|  | 31.12.2023                             |                 | 31.12.2022                             |                 |
|--|--|-----------------|--|-----------------|
|  | Basiswertäquivalent in<br>Fondswährung | in %<br>des NFV | Basiswertäquivalent in<br>Fondswährung | in %<br>des NFV |
| - Marktrisiko (Aktienkursänderungsrisiko)      | 5'773'340.00                           | 3.26%           | 18'869'093.92                          | 8.96%           |
| - Währungsrisiko                               | 43'733'827.08                          | 24.69%          | 59'056'388.39                          | 28.06%          |
| <b>Total engagementerhöhende Positionen</b>    | <b>49'507'167.08</b>                   | <b>27.95%</b>   | <b>77'925'482.31</b>                   | <b>37.02%</b>   |
| - Marktrisiko (Aktienkursänderungsrisiko)      | 5'773'340.00                           | 3.26%           | 18'869'093.92                          | 8.96%           |
| - Währungsrisiko                               | 43'733'827.08                          | 24.69%          | 59'056'388.39                          | 28.06%          |
| <b>Total engagementreduzierende Positionen</b> | <b>49'507'167.08</b>                   | <b>27.95%</b>   | <b>77'925'482.31</b>                   | <b>37.02%</b>   |

**Volumen der verliehenen Wertpapiere und Provisionserträge aus Wertpapiere**

|                                      |              |       |               |       |
|--------------------------------------|--------------|-------|---------------|-------|
| - Volumen der verliehenen Positionen | 7'725'472.39 | 4.36% | 16'664'660.31 | 7.92% |
| - Kommission Einkommen               | 70'524.05    | 0.04% | 110'666.30    | 0.05% |

## Kurze Übersicht

| Kennzahlen                            | Währung | 31.12.2023 | 31.12.2022 | 31.12.2021 |
|---------------------------------------|---------|------------|------------|------------|
| <b>Konsolidierung</b>                 |         |            |            |            |
| Nettofondsvermögen in Mio.            | CHF     | 343.16     | 375.69     | 308.13     |
| <b>Anteilklasse B</b>                 |         |            |            |            |
| Nettofondsvermögen in Mio.            | CHF     | 14.14      | 18.55      | 16.23      |
| Inventarwert pro Anteil               | CHF     | -          | -          | 113.14     |
| Inventarwert pro Anteil (Swung NAV)   | CHF     | 103.39     | 99.38      | -          |
| Inventarwert pro Anteil (Unswung NAV) | CHF     | 103.21     | 99.19      | -          |
| <b>Anteilklasse UA</b>                |         |            |            |            |
| Nettofondsvermögen in Mio.            | CHF     | 129.59     | 144.17     | 159.44     |
| Inventarwert pro Anteil               | CHF     | -          | -          | 113.42     |
| Inventarwert pro Anteil (Swung NAV)   | CHF     | 103.74     | 99.72      | -          |
| Inventarwert pro Anteil (Unswung NAV) | CHF     | 103.56     | 99.53      | -          |
| <b>Anteilklasse UB</b>                |         |            |            |            |
| Nettofondsvermögen in Mio.            | CHF     | 106.00     | 122.32     | 123.67     |
| Inventarwert pro Anteil               | CHF     | -          | -          | 114.09     |
| Inventarwert pro Anteil (Swung NAV)   | CHF     | 104.67     | 100.41     | -          |
| Inventarwert pro Anteil (Unswung NAV) | CHF     | 104.50     | 100.22     | -          |
| <b>Anteilklasse IA25</b>              |         |            |            |            |
| Nettofondsvermögen in Mio.            | CHF     | 83.78      | 80.25      | -          |
| Inventarwert pro Anteil (Swung NAV)   | CHF     | 987.34     | 945.85     | -          |
| Inventarwert pro Anteil (Unswung NAV) | CHF     | 985.67     | 944.06     | -          |
| <b>Anteilklasse EB</b>                |         |            |            |            |
| Nettofondsvermögen in Mio.            | CHF     | 9.66       | 10.41      | 8.78       |
| Inventarwert pro Anteil               | CHF     | -          | -          | 1'080.12   |
| Inventarwert pro Anteil (Swung NAV)   | CHF     | 996.28     | 953.28     | -          |
| Inventarwert pro Anteil (Unswung NAV) | CHF     | 994.60     | 951.47     | -          |

## Verwendung des Erfolges

### Ausschüttung pro Anteil

#### 1. Für in der Schweiz und im Ausland domizilierte Anteilinhaber

| Ausschüttung 2023                        | Anteilklasse UA |              | Anteilklasse IA25 |              |
|--|-----------------|--------------|-------------------|--------------|
| Bruttoausschüttung aus Ertrag            | CHF             | 0.520        | CHF               | 10.880       |
| ./ 35% Eidgenössische Verrechnungssteuer | CHF             | 0.182        | CHF               | 3.808        |
| <b>Nettoausschüttung aus Ertrag</b>      | <b>CHF</b>      | <b>0.338</b> | <b>CHF</b>        | <b>7.072</b> |
| Coupon Nr. Ertrag                        |                 | 10           |                   | 3            |

#### 2. Für in der Schweiz und im Ausland domizilierte Anteilinhaber (verrechnungssteuerbefreite Erträge aus direktem Immobilienbesitz)

| Ausschüttung 2023                   | Anteilklasse UA |              | Anteilklasse IA25 |              |
|-------------------------------------|-----------------|--------------|-------------------|--------------|
| Bruttoausschüttung aus Ertrag       | CHF             | 0.010        | CHF               | 0.260        |
| <b>Nettoausschüttung aus Ertrag</b> | <b>CHF</b>      | <b>0.010</b> | <b>CHF</b>        | <b>0.260</b> |
| Coupon Nr. Ertrag                   |                 | 11           |                   | 4            |

Zahlbar ab 15.02.2024 bei der CREDIT SUISSE (SCHWEIZ) AG und deren sämtlichen Geschäftsstellen in der Schweiz.

### Thesaurierung pro Anteil

#### 1. Für in der Schweiz und im Ausland domizilierte Anteilinhaber

| Thesaurierung 2023                               | Anteilklasse B |              | Anteilklasse UB |              | Anteilklasse EB |              |
|--|----------------|--------------|-----------------|--------------|-----------------|--------------|
| Zur Thesaurierung verfügbarer Erfolg             | CHF            | 0.381        | CHF             | 0.532        | CHF             | 8.379        |
| ./ 35% Eidgenössische Verrechnungssteuer         | CHF            | 0.134        | CHF             | 0.186        | CHF             | 2.932        |
| <b>Zur Thesaurierung zurückbehaltener Erfolg</b> | <b>CHF</b>     | <b>0.248</b> | <b>CHF</b>      | <b>0.346</b> | <b>CHF</b>      | <b>5.446</b> |
| Coupon Nr. Ertrag                                |                | 10           |                 | 11           |                 | 7            |

#### 2. Für in der Schweiz und im Ausland domizilierte Anteilinhaber (verrechnungssteuerbefreite Erträge aus direktem Immobilienbesitz)

| Thesaurierung 2023                               | Anteilklasse B |              | Anteilklasse UB |              | Anteilklasse EB |              |
|--|----------------|--------------|-----------------|--------------|-----------------|--------------|
| Zur Thesaurierung verfügbarer Erfolg             | CHF            | 0.008        | CHF             | 0.013        | CHF             | 0.203        |
| <b>Zur Thesaurierung zurückbehaltener Erfolg</b> | <b>CHF</b>     | <b>0.008</b> | <b>CHF</b>      | <b>0.013</b> | <b>CHF</b>      | <b>0.203</b> |
| Coupon Nr. Ertrag                                |                | 11           |                 | 12           |                 | 8            |

## Wechselkurse

| <b>Wechselkurse per</b> | <b>31.12.2023</b> |
|-------------------------|-------------------|
| AUSTRALISCHER DOLLAR    | 0.574279          |
| ENGLISCHES PFUND        | 1.072875          |
| EURO                    | 0.929700          |
| JAPANISCHER YEN         | 0.005970          |
| KANADISCHER DOLLAR      | 0.638267          |
| SCHWEIZER FRANKEN       | 1.000000          |
| US DOLLAR               | 0.841624          |

## Vermögensrechnung per 31. Dezember 2023

|  | Konsolidierung        |                       |
|--|-----------------------|-----------------------|
|  | 31.12.2023            | 31.12.2022            |
|  | CHF                   | CHF                   |
| <b>Vermögenswerte</b>  |                       |                       |
| Bankguthaben, einschliesslich Treuhandanlagen bei Drittbanken, aufgeteilt in:                      |                       |                       |
| - Sichtguthaben  | 4'229'527.86          | 4'866'819.50          |
| Effekten, einschliesslich ausgeliehene und pensionierte Effekten, aufgeteilt in:                   |                       |                       |
| - Obligationen, Wandelobligationen, Optionsanleihen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte | 184'707'488.17        | 215'285'858.91        |
| - Aktien und sonstige Beteiligungswertpapiere und -rechte  | 59'290'490.32         | 61'017'093.32         |
| - Anteile anderer kollektiver Kapitalanlagen   | 91'171'025.61         | 90'814'785.32         |
| Derivative Finanzinstrumente   | 2'125'811.47          | 1'979'509.55          |
| Sonstige Vermögenswerte  | 1'875'883.33          | 2'003'462.00          |
| <b>Gesamtfondsvermögen abzüglich:</b>  | <b>343'400'226.76</b> | <b>375'967'528.60</b> |
| Andere Verbindlichkeiten   | 235'315.58            | 273'582.39            |
| <b>Nettofondsvermögen</b>  | <b>343'164'911.18</b> | <b>375'693'946.21</b> |
| <b>Veränderung des Nettofondsvermögens</b>   |                       |                       |
|  |                       |                       |
| Nettofondsvermögen zu Beginn der Berichtsperiode   | 375'693'946.21        | 308'129'381.09        |
| Ausschüttungen   | -995'449.91           | -294'235.45           |
| Ablieferung Verrechnungssteuer   | -189'064.04           | -138'179.35           |
| Ausgaben von Anteilen  | 14'849'078.02         | 161'803'150.20        |
| Rücknahmen von Anteilen  | -62'280'456.37        | -48'318'813.23        |
| Sonstiges aus Anteilverkehr  | 1'232'792.59          | 13'142.01             |
| Gesamterfolg   | 14'854'064.68         | -45'500'499.06        |
| <b>Nettofondsvermögen am Ende der Berichtsperiode</b>  | <b>343'164'911.18</b> | <b>375'693'946.21</b> |
| <b>Entwicklung der Anteile im Umlauf</b>   |                       |                       |
|  |                       |                       |
| Bestand zu Beginn der Berichtsperiode  | 2'951'853.010         | 2'641'400.918         |
| Ausgegebene Anteile  | 145'588.456           | 757'919.434           |
| Zurückgenommene Anteile  | -600'081.352          | -447'467.342          |
| <b>Bestand am Ende der Berichtsperiode</b>   | <b>2'497'360.114</b>  | <b>2'951'853.010</b>  |
| <b>Währung Anteilklasse</b>  |                       |                       |
| <b>Inventarwert pro Anteil (Swung NAV)</b>   |                       |                       |
| <b>Inventarwert pro Anteil (Unswung NAV)</b>   |                       |                       |

| Anteilklasse B             |                            | Anteilklasse UA            |                            | Anteilklasse UB            |                            | Anteilklasse IA25          |                            |
|----------------------------|----------------------------|----------------------------|----------------------------|----------------------------|----------------------------|----------------------------|----------------------------|
| 01.01.2023 -<br>31.12.2023 | 01.01.2022 -<br>31.12.2022 | 01.01.2023 -<br>31.12.2023 | 01.01.2022 -<br>31.12.2022 | 01.01.2023 -<br>31.12.2023 | 01.01.2022 -<br>31.12.2022 | 01.01.2023 -<br>31.12.2023 | 01.01.2022 -<br>31.12.2022 |
| CHF                        | CHF                        | CHF                        | CHF                        | CHF                        | CHF                        | CHF                        | CHF                        |
| 18'548'381.52              | 16'232'294.39              | 144'168'008.05             | 159'441'756.66             | 122'318'133.01             | 123'673'296.01             | 80'245'169.50              | 0.00                       |
| 0.00                       | 0.00                       | -479'499.91                | -294'235.45                | 0.00                       | 0.00                       | -515'950.00                | 0.00                       |
| -21'031.22                 | -15'624.08                 | 0.00                       | 0.00                       | -145'739.64                | -109'045.11                | 0.00                       | 0.00                       |
| 1'315'097.86               | 8'750'824.76               | 6'428'328.17               | 32'903'200.79              | 7'105'651.99               | 30'383'266.49              | 0.00                       | 85'000'000.00              |
| -6'348'904.71              | -4'012'826.44              | -26'485'133.37             | -27'197'909.68             | -28'235'658.80             | -15'173'388.55             | 0.00                       | 0.00                       |
| 80'984.25                  | 198'390.27                 | 558'103.03                 | -766'869.10                | 526'967.56                 | 442'786.07                 | 24'059.92                  | -73'477.28                 |
| 563'346.64                 | -2'604'677.38              | 5'398'501.81               | -19'917'935.17             | 4'427'217.18               | -16'898'781.90             | 4'029'059.14               | -4'681'353.22              |
| <b>14'137'874.34</b>       | <b>18'548'381.52</b>       | <b>129'588'307.78</b>      | <b>144'168'008.05</b>      | <b>105'996'571.30</b>      | <b>122'318'133.01</b>      | <b>83'782'338.56</b>       | <b>80'245'169.50</b>       |
| 186'994.207                | 143'465.303                | 1'448'456.534              | 1'405'813.781              | 1'220'456.857              | 1'083'991.223              | 85'000.000                 | 0.000                      |
| 12'947.507                 | 81'655.705                 | 63'413.290                 | 305'666.590                | 69'227.659                 | 280'969.338                | 0.000                      | 85'000.000                 |
| -62'963.878                | -38'126.801                | -260'558.269               | -263'023.837               | -275'326.064               | -144'503.704               | 0.000                      | 0.000                      |
| <b>136'977.836</b>         | <b>186'994.207</b>         | <b>1'251'311.555</b>       | <b>1'448'456.534</b>       | <b>1'014'358.452</b>       | <b>1'220'456.857</b>       | <b>85'000.000</b>          | <b>85'000.000</b>          |
| (CHF)                      | (CHF)                      | (CHF)                      | (CHF)                      | (CHF)                      | (CHF)                      | (CHF)                      | (CHF)                      |
| <b>103.39</b>              | <b>99.38</b>               | <b>103.74</b>              | <b>99.72</b>               | <b>104.67</b>              | <b>100.41</b>              | <b>987.34</b>              | <b>945.85</b>              |
| <b>103.21</b>              | <b>99.19</b>               | <b>103.56</b>              | <b>99.53</b>               | <b>104.50</b>              | <b>100.22</b>              | <b>985.67</b>              | <b>944.06</b>              |

|   | Anteilklasse EB            |                            |
|---|----------------------------|----------------------------|
|   | 01.01.2023 -<br>31.12.2023 | 01.01.2022 -<br>31.12.2022 |
|   | CHF                        | CHF                        |
| <b>Veränderung des Nettofondsvermögens</b>            |                            |                            |
| Nettofondsvermögen zu Beginn der Berichtsperiode      | 10'414'254.32              | 8'782'034.19               |
| Ausschüttungen  | 0.00                       | 0.00                       |
| Ablieferung Verrechnungssteuer                        | -22'293.18                 | -13'510.16                 |
| Ausgaben von Anteilen                                 | 0.00                       | 4'765'858.16               |
| Rücknahmen von Anteilen                               | -1'210'759.49              | -1'934'688.56              |
| Sonstiges aus Anteilverkehr                           | 42'677.84                  | 212'312.08                 |
| Gesamterfolg  | 435'939.91                 | -1'397'751.39              |
| <b>Nettofondsvermögen am Ende der Berichtsperiode</b> | <b>9'659'819.40</b>        | <b>10'414'254.32</b>       |
| <b>Entwicklung der Anteile im Umlauf</b>              |                            |                            |
| Bestand zu Beginn der Berichtsperiode                 | 10'945.412                 | 8'130.611                  |
| Ausgegebene Anteile                                   | 0.000                      | 4'627.801                  |
| Zurückgenommene Anteile                               | -1'233.141                 | -1'813.000                 |
| <b>Bestand am Ende der Berichtsperiode</b>            | <b>9'712.271</b>           | <b>10'945.412</b>          |
| <b>Währung Anteilklasse</b>                           | <b>(CHF)</b>               | <b>(CHF)</b>               |
| <b>Inventarwert pro Anteil (Swung NAV)</b>            | <b>996.28</b>              | <b>953.28</b>              |
| <b>Inventarwert pro Anteil (Unswung NAV)</b>          | <b>994.60</b>              | <b>951.47</b>              |

## Erfolgsrechnung für die Zeit vom 1. Januar 2023 bis zum 31. Dezember 2023

|  | Konsolidierung             |                            |
|--|----------------------------|----------------------------|
|  | 01.01.2023 -<br>31.12.2023 | 01.01.2022 -<br>31.12.2022 |
|  | CHF                        | CHF                        |
| <b>Ertrag</b>  |                            |                            |
| Erträge der Bankguthaben   | 54'787.92                  | 15'297.16                  |
| Negativzinsen  | -106.86                    | -100'473.14                |
| Erträge der Effektenleihen   | 42'319.65                  | 52'262.30                  |
| Erträge der Ausgleichszahlungen  | 164'918.82                 | 293'165.30                 |
| Erträge der Effekten, aufgeteilt in:   |                            |                            |
| - Obligationen, Wandelobligationen, Optionsanleihen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte     | 1'844'115.31               | 1'453'614.75               |
| - Aktien und sonstige Beteiligungswertpapiere und -rechte, einschliesslich Gratisaktien                | 1'830'467.31               | 1'569'613.93               |
| - Anteile anderer kollektiver Kapitalanlagen   | 1'359'239.78               | 1'336'017.84               |
| Erträge aus kollektiven Kapitalanlagen mit Immobilien im Direktbesitz                                  | 130'586.09                 | 59'408.20                  |
| Einkauf in laufende Nettoerträge bei der Ausgabe von Anteilen  | 26'636.20                  | 58'985.07                  |
| <b>Total Erträge</b>   | <b>5'452'964.22</b>        | <b>4'737'891.41</b>        |
| <b>Aufwendungen</b>  |                            |                            |
| Prüfaufwand  | 14'494.70                  | 14'512.48                  |
| Reglementarische Vergütung an:   |                            |                            |
| - die Fondsleitung   | 2'792'948.46               | 3'054'598.51               |
| - die Depotbank  | 152'959.28                 | 160'317.03                 |
| Teilübertrag von Aufwendungen auf kollektiven Kapitalanlagen mit Immobilien im Direktbesitz            | -71'880.77                 | -40'858.73                 |
| Aufwände aus kollektiven Kapitalanlagen mit Immobilien im Direktbesitz                                 | 71'880.77                  | 40'858.73                  |
| Sonstige Aufwendungen  | 13'600.18                  | 13'019.14                  |
| Ausrichtung laufender Nettoerträge bei Rücknahme von Anteilen  | 174'305.21                 | 64'834.10                  |
| <b>Total Aufwendungen</b>  | <b>3'148'307.83</b>        | <b>3'307'281.26</b>        |
| <b>Nettoertrag vor steuerlichen Anpassungen</b>  | <b>2'304'656.39</b>        | <b>1'430'610.15</b>        |
| Steuerliche Anpassungen wegen Erträgen aus Zielfonds   | 7'261.60                   | 273'399.08                 |
| <b>Nettoertrag nach steuerlichen Anpassungen</b>   | <b>2'311'917.99</b>        | <b>1'704'009.23</b>        |
| Realisierte Kapitalgewinne und -verluste   | -3'040'822.98              | -3'479'225.93              |
| Teilübertrag von steuerlichem Ausgleich wegen Erträgen aus Zielfonds                                   | -7'261.60                  | -273'399.08                |
| <b>Realisierter Erfolg</b>   | <b>-736'166.59</b>         | <b>-2'048'615.78</b>       |
| Nicht realisierte Kapitalgewinne und -verluste   | 15'590'231.27              | -43'451'883.28             |
| <b>Gesamterfolg</b>  | <b>14'854'064.68</b>       | <b>-45'500'499.06</b>      |
| <b>Verwendung des Erfolgs</b>  |                            |                            |
| Nettoertrag des Rechnungsjahres  | 2'311'917.99               | 1'704'009.23               |
| Vortrag des Vorjahres aus kollektiven Kapitalanlagen mit Immobilien im Direktbesitz                    | 3'001.56                   | 12'940.45                  |
| Vortrag des Vorjahres  | 311'102.49                 | 143'932.02                 |
| <b>Zur Verteilung verfügbarer Erfolg</b>   | <b>2'626'022.04</b>        | <b>1'860'881.70</b>        |
| Zur Ausschüttung an die Anlegerinnen und Anleger vorgesehener Erfolg                                   | 1'575'482.01               | 970'106.09                 |
| Zur Ausschüttung bestimmter Erfolg aus Kapitalanlagen mit Immobilien im Direktbesitz                   | 34'613.12                  | 23'834.57                  |
| Ablieferung/Ausschüttung der Verrechnungssteuer (35%)  | 235'555.85                 | 191'890.14                 |
| Zur Wiederanlage zurückbehaltener Ertrag (65%)   | 437'463.90                 | 356'369.89                 |
| Zur Wiederanlage zurückbehaltener Ertrag aus kollektiven Kapitalanlagen mit Immobilien im Direktbesitz | 16'601.47                  | 4'576.96                   |
| Vortrag Nettoerträge aus kollektiven Kapitalanlagen mit Immobilien im Direktbesitz                     | 6'916.75                   | 3'001.56                   |
| Vortrag auf neue Rechnung  | 319'388.94                 | 311'102.49                 |



| Anteilklasse B             |                            | Anteilklasse UA            |                            | Anteilklasse UB            |                            | Anteilklasse IA25          |                            |
|----------------------------|----------------------------|----------------------------|----------------------------|----------------------------|----------------------------|----------------------------|----------------------------|
| 01.01.2023 -<br>31.12.2023 | 01.01.2022 -<br>31.12.2022 | 01.01.2023 -<br>31.12.2023 | 01.01.2022 -<br>31.12.2022 | 01.01.2023 -<br>31.12.2023 | 01.01.2022 -<br>31.12.2022 | 01.01.2023 -<br>31.12.2023 | 01.01.2022 -<br>31.12.2022 |
| CHF                        | CHF                        | CHF                        | CHF                        | CHF                        | CHF                        | CHF                        | CHF                        |
| 2'282.69                   | 745.82                     | 20'830.00                  | 5'951.08                   | 17'646.24                  | 4'949.16                   | 12'522.38                  | 3'235.84                   |
| -4.83                      | -4'592.55                  | -41.07                     | -40'075.96                 | -34.54                     | -32'374.82                 | -23.52                     | -21'145.46                 |
| 1'783.03                   | 2'543.68                   | 16'116.50                  | 21'173.02                  | 13'702.34                  | 17'265.17                  | 9'552.58                   | 9'974.52                   |
| 6'869.41                   | 14'191.41                  | 62'620.00                  | 118'098.55                 | 53'356.89                  | 96'536.92                  | 37'593.32                  | 57'014.35                  |
| 77'233.47                  | 71'126.45                  | 702'342.23                 | 594'576.74                 | 594'581.84                 | 485'144.86                 | 419'189.64                 | 266'025.07                 |
| 77'495.77                  | 74'608.76                  | 706'305.31                 | 651'425.98                 | 593'410.98                 | 522'496.39                 | 401'451.99                 | 286'279.67                 |
| 56'171.58                  | 64'889.30                  | 514'938.08                 | 520'833.55                 | 425'961.37                 | 434'153.44                 | 324'128.05                 | 281'303.79                 |
| 5'529.27                   | 2'678.11                   | 49'911.84                  | 23'692.11                  | 42'541.95                  | 19'017.04                  | 29'020.42                  | 12'673.13                  |
| 1'798.10                   | -2'323.96                  | 13'117.00                  | 41'189.08                  | 11'721.10                  | 10'878.24                  | 0.00                       | 0.00                       |
| <b>229'158.49</b>          | <b>223'867.02</b>          | <b>2'086'139.89</b>        | <b>1'936'864.15</b>        | <b>1'752'888.17</b>        | <b>1'558'066.40</b>        | <b>1'233'434.86</b>        | <b>895'360.91</b>          |
| 605.82                     | 713.38                     | 5'517.23                   | 6'001.23                   | 4'674.32                   | 4'886.26                   | 3'299.49                   | 2'543.51                   |
| 169'649.94                 | 207'824.97                 | 1'267'767.84               | 1'436'897.24               | 1'073'667.73               | 1'169'772.70               | 224'938.45                 | 185'449.48                 |
| 6'409.15                   | 7'851.65                   | 58'249.89                  | 66'023.53                  | 49'329.73                  | 53'748.53                  | 34'763.08                  | 28'653.69                  |
| -4'310.18                  | -2'572.14                  | -32'183.56                 | -19'027.44                 | -27'658.07                 | -15'234.63                 | -6'263.44                  | -3'312.45                  |
| 4'310.18                   | 2'572.14                   | 32'183.56                  | 19'027.44                  | 27'658.07                  | 15'234.63                  | 6'263.44                   | 3'312.45                   |
| 566.42                     | 668.84                     | 5'152.71                   | 5'629.02                   | 4'312.31                   | 4'611.90                   | 3'191.41                   | 1'760.83                   |
| 5'814.47                   | -1'470.07                  | 94'397.88                  | 51'783.50                  | 68'004.87                  | 14'636.69                  | 0.00                       | 0.00                       |
| <b>183'045.80</b>          | <b>215'588.77</b>          | <b>1'431'085.55</b>        | <b>1'566'334.52</b>        | <b>1'199'988.96</b>        | <b>1'247'656.08</b>        | <b>266'192.43</b>          | <b>218'407.51</b>          |
| <b>46'112.69</b>           | <b>8'278.25</b>            | <b>655'054.34</b>          | <b>370'529.63</b>          | <b>552'899.21</b>          | <b>310'410.32</b>          | <b>967'242.43</b>          | <b>676'953.40</b>          |
| 7'261.60                   | 56'690.06                  | 0.00                       | 103'689.21                 | 0.00                       | 113'019.81                 | 0.00                       | 0.00                       |
| <b>53'374.29</b>           | <b>64'968.31</b>           | <b>655'054.34</b>          | <b>474'218.84</b>          | <b>552'899.21</b>          | <b>423'430.13</b>          | <b>967'242.43</b>          | <b>676'953.40</b>          |
| -125'207.87                | -174'083.49                | -1'148'297.59              | -1'352'091.79              | -938'650.28                | -1'147'119.41              | -743'100.15                | -708'391.64                |
| -7'261.60                  | -56'690.06                 | 0.00                       | -103'689.21                | 0.00                       | -113'019.81                | 0.00                       | 0.00                       |
| <b>-79'095.18</b>          | <b>-165'805.24</b>         | <b>-493'243.25</b>         | <b>-981'562.16</b>         | <b>-385'751.07</b>         | <b>-836'709.09</b>         | <b>224'142.28</b>          | <b>-31'438.24</b>          |
| 642'441.82                 | -2'438'872.14              | 5'891'745.06               | -18'936'373.01             | 4'812'968.25               | -16'062'072.81             | 3'804'916.86               | -4'649'914.98              |
| <b>563'346.64</b>          | <b>-2'604'677.38</b>       | <b>5'398'501.81</b>        | <b>-19'917'935.17</b>      | <b>4'427'217.18</b>        | <b>-16'898'781.90</b>      | <b>4'029'059.14</b>        | <b>-4'681'353.22</b>       |
| 53'374.29                  | 64'968.31                  | 655'054.34                 | 474'218.84                 | 552'899.21                 | 423'430.13                 | 967'242.43                 | 676'953.40                 |
| 0.00                       | 0.00                       | 2'990.88                   | 12'940.45                  | 0.00                       | 0.00                       | 10.68                      | 0.00                       |
| 0.00                       | 0.00                       | 150'109.77                 | 143'932.02                 | 0.00                       | 0.00                       | 160'992.72                 | 0.00                       |
| <b>53'374.29</b>           | <b>64'968.31</b>           | <b>808'154.99</b>          | <b>631'091.31</b>          | <b>552'899.21</b>          | <b>423'430.13</b>          | <b>1'128'245.83</b>        | <b>676'953.40</b>          |
| 0.00                       | 0.00                       | 650'682.01                 | 463'506.09                 | 0.00                       | 0.00                       | 924'800.00                 | 506'600.00                 |
| 0.00                       | 0.00                       | 12'513.12                  | 14'484.57                  | 0.00                       | 0.00                       | 22'100.00                  | 9'350.00                   |
| 18'288.48                  | 22'705.21                  | 0.00                       | 0.00                       | 188'786.21                 | 146'891.75                 | 0.00                       | 0.00                       |
| 33'964.51                  | 42'167.04                  | 0.00                       | 0.00                       | 350'605.80                 | 272'801.22                 | 0.00                       | 0.00                       |
| 1'121.30                   | 96.06                      | 0.00                       | 0.00                       | 13'507.20                  | 3'737.16                   | 0.00                       | 0.00                       |
| 0.00                       | 0.00                       | 6'249.09                   | 2'990.88                   | 0.00                       | 0.00                       | 667.66                     | 10.68                      |
| 0.00                       | 0.00                       | 138'710.77                 | 150'109.77                 | 0.00                       | 0.00                       | 180'678.17                 | 160'992.72                 |

|  | Anteilklasse EB            |                            |
|--|----------------------------|----------------------------|
|  | 01.01.2023 -<br>31.12.2023 | 01.01.2022 -<br>31.12.2022 |
|  | CHF                        | CHF                        |
| <b>Ertrag</b>  |                            |                            |
| Erträge der Bankguthaben   | 1'506.61                   | 415.26                     |
| Negativzinsen  | -2.90                      | -2'284.35                  |
| Erträge der Effektenleihen   | 1'165.20                   | 1'305.91                   |
| Erträge der Ausgleichszahlungen  | 4'479.20                   | 7'324.07                   |
| Erträge der Effekten, aufgeteilt in:   |                            |                            |
| - Obligationen, Wandelobligationen, Optionsanleihen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte     | 50'768.13                  | 36'741.63                  |
| - Aktien und sonstige Beteiligungswertpapiere und -rechte, einschliesslich Gratisaktien                | 51'803.26                  | 34'803.13                  |
| - Anteile anderer kollektiver Kapitalanlagen   | 38'040.70                  | 34'837.76                  |
| Erträge aus kollektiven Kapitalanlagen mit Immobilien im Direktbesitz                                  | 3'582.61                   | 1'347.81                   |
| Einkauf in laufende Nettoerträge bei der Ausgabe von Anteilen  | 0.00                       | 9'241.71                   |
| <b>Total Erträge</b>   | <b>151'342.81</b>          | <b>123'732.93</b>          |
| <b>Aufwendungen</b>  |                            |                            |
| Prüfaufwand  | 397.84                     | 368.10                     |
| Reglementarische Vergütung an:   |                            |                            |
| - die Fondsleitung   | 56'924.50                  | 54'654.12                  |
| - die Depotbank  | 4'207.43                   | 4'039.63                   |
| Teilübertrag von Aufwendungen auf kollektiven Kapitalanlagen mit Immobilien im Direktbesitz            | -1'465.52                  | -712.07                    |
| Aufwände aus kollektiven Kapitalanlagen mit Immobilien im Direktbesitz                                 | 1'465.52                   | 712.07                     |
| Sonstige Aufwendungen  | 377.33                     | 348.55                     |
| Ausrichtung laufender Nettoerträge bei Rücknahme von Anteilen  | 6'087.99                   | -116.02                    |
| <b>Total Aufwendungen</b>  | <b>67'995.09</b>           | <b>59'294.38</b>           |
| <b>Nettoertrag vor steuerlichen Anpassungen</b>  | <b>83'347.72</b>           | <b>64'438.55</b>           |
| Steuerliche Anpassungen wegen Erträgen aus Zielfonds   | 0.00                       | 0.00                       |
| <b>Nettoertrag nach steuerlichen Anpassungen</b>   | <b>83'347.72</b>           | <b>64'438.55</b>           |
| Realisierte Kapitalgewinne und -verluste   | -85'567.09                 | -97'539.60                 |
| Teilübertrag von steuerlichem Ausgleich wegen Erträgen aus Zielfonds                                   | 0.00                       | 0.00                       |
| <b>Realisierter Erfolg</b>   | <b>-2'219.37</b>           | <b>-33'101.05</b>          |
| Nicht realisierte Kapitalgewinne und -verluste   | 438'159.28                 | -1'364'650.34              |
| <b>Gesamterfolg</b>  | <b>435'939.91</b>          | <b>-1'397'751.39</b>       |
| <b>Verwendung des Erfolgs</b>  |                            |                            |
| Nettoertrag des Rechnungsjahres  | 83'347.72                  | 64'438.55                  |
| Vortrag des Vorjahres aus kollektiven Kapitalanlagen mit Immobilien im Direktbesitz                    | 0.00                       | 0.00                       |
| Vortrag des Vorjahres  | 0.00                       | 0.00                       |
| <b>Zur Verteilung verfügbarer Erfolg</b>   | <b>83'347.72</b>           | <b>64'438.55</b>           |
| Zur Ausschüttung an die Anlegerinnen und Anleger vorgesehener Erfolg                                   | 0.00                       | 0.00                       |
| Zur Ausschüttung bestimmter Erfolg aus Kapitalanlagen mit Immobilien im Direktbesitz                   | 0.00                       | 0.00                       |
| Ablieferung/Ausschüttung der Verrechnungssteuer (35%)  | 28'481.16                  | 22'293.18                  |
| Zur Wiederanlage zurückbehaltener Ertrag (65%)   | 52'893.59                  | 41'401.63                  |
| Zur Wiederanlage zurückbehaltener Ertrag aus kollektiven Kapitalanlagen mit Immobilien im Direktbesitz | 1'972.97                   | 743.74                     |
| Vortrag Nettoerträge aus kollektiven Kapitalanlagen mit Immobilien im Direktbesitz                     | 0.00                       | 0.00                       |
| Vortrag auf neue Rechnung  | 0.00                       | 0.00                       |

## Zusammensetzung des Portefolles und Bestandesveränderungen

| Titelbezeichnung   | Währung  | 31.12.2022<br>Anzahl/<br>Nominal | Käufe (1) | Verkäufe (1) | 31.12.2023<br>Anzahl/<br>Nominal | Kurswert CHF         | in % des<br>Gesamtfonds-<br>vermögens |
|--|--|----------------------------------|-----------|--------------|----------------------------------|----------------------|---------------------------------------|
| <b>Börsennotierte / an einem geregelten Markt gehandelte Wertpapiere; bewertet zu den Kursen, die am Hauptmarkt bezahlt werden</b> |  |                                  |           |              |                                  |                      |                                       |
| <b>Aktien (und aktienähnliche Wertpapiere)</b>   |  |                                  |           |              |                                  |                      |                                       |
| <b>SCHWEIZER FRANKEN</b>   |  |                                  |           |              |                                  |                      |                                       |
| ABB (reg. shares)  | CHF  | 81'091                           | 8'232     | 15'771       | 73'552                           | 2'743'489.60         | 0.80                                  |
| ACCELLERON INDUSTRIES AG   | CHF  | 4'054                            |           | 4'054        |                                  |                      |                                       |
| ADECCO (reg. shares)   | CHF  | 6'866                            | 178       | 931          | 6'113                            | 252'283.51           | 0.07                                  |
| ALCON INC  | CHF  | 21'799                           | 4'440     | 1'687        | 24'552                           | 1'611'593.28         | 0.47                                  |
| BALOISE-HOLDING (reg. shares)  | CHF  | 1'854                            | 274       | 190          | 1'938                            | 255'428.40           | 0.07                                  |
| BANQUE CANTONALE VAUDOISE  | CHF  |                                  | 1'280     | 8            | 1'272                            | 138'012.00           | 0.04                                  |
| BARRY CALLEBAUT (reg. shares)  | CHF  | 138                              | 46        | 15           | 169                              | 239'811.00           | 0.07                                  |
| BKW  | CHF  |                                  | 956       | 42           | 914                              | 136'643.00           | 0.04                                  |
| CIE FINANCIERE RICHEMONT (reg. shares)   | CHF  | 25'179                           | 1'099     | 1'925        | 24'353                           | 2'818'859.75         | 0.82                                  |
| CLARIANT (reg. shares)   | CHF  | 10'245                           |           | 1'210        | 9'035                            | 112'214.70           | 0.03                                  |
| CS GROUP (reg. shares)   | CHF  | 134'960                          | 13'040    | 148'000      |                                  |                      |                                       |
| DUFFRY   | CHF  |                                  | 4'254     | 188          | 4'066                            | 134'503.28           | 0.04                                  |
| EMS-CHEMIE HOLDING   | CHF  |                                  | 241       | 22           | 219                              | 149'139.00           | 0.04                                  |
| GEBERIT  | CHF  | 1'678                            | 9         | 275          | 1'412                            | 761'068.00           | 0.22                                  |
| GIVAUDAN (reg. shares)   | CHF  | 479                              | 15        | 58           | 436                              | 1'519'024.00         | 0.44                                  |
| HELVETIA HOLDING LTD   | CHF  |                                  | 1'500     | 69           | 1'431                            | 165'852.90           | 0.05                                  |
| JULIUS BAER GRUPPE   | CHF  | 9'919                            | 131       | 1'273        | 8'777                            | 413'835.55           | 0.12                                  |
| KUEHNE & NAGEL INTERNATIONAL   | CHF  | 2'419                            | 343       | 247          | 2'515                            | 728'847.00           | 0.21                                  |
| LAFARGEHOLCIM (reg. shares)  | CHF  | 22'780                           | 2'920     | 3'534        | 22'166                           | 1'463'399.32         | 0.43                                  |
| LINDT & SPRUENGLI  | CHF  | 96                               | 3         | 57           | 42                               | 423'780.00           | 0.12                                  |
| LINDT & SPRUENGLI LISN SW  | CHF  |                                  | 6         | 1            | 5                                | 510'000.00           | 0.15                                  |
| LOGITECH INTERNATIONAL (reg. shares)   | CHF  | 7'303                            | 731       | 888          | 7'146                            | 569'964.96           | 0.17                                  |
| LONZA GROUP (reg. shares)  | CHF  | 4'033                            | 166       | 531          | 3'668                            | 1'297'371.60         | 0.38                                  |
| NESTLE (reg. shares)   | CHF  | 128'938                          |           | 12'646       | 116'292                          | 11'339'632.92        | 3.30                                  |
| NOVARTIS (reg. shares)   | CHF  | 97'985                           | 1'437     | 7'481        | 91'941                           | 7'803'032.67         | 2.27                                  |
| PARTNERS GROUP   | CHF  | 926                              | 34        | 88           | 872                              | 1'057'736.00         | 0.31                                  |
| ROCHE HOLDING  | CHF  | 1'460                            |           | 168          | 1'292                            | 337'728.80           | 0.10                                  |
| ROCHE HOLDINGS (cert. shares)  | CHF  | 31'444                           | 140       | 3'057        | 28'527                           | 6'974'851.50         | 2.03                                  |
| SANDOZ GROUP LTD   | CHF  |                                  | 18'376    | 274          | 18'102                           | 489'840.12           | 0.14                                  |
| SCHINDLER HOLDING  | CHF  |                                  | 901       | 88           | 813                              | 162'193.50           | 0.05                                  |
| SCHINDLER HOLDING (part. cert.)  | CHF  | 2'779                            | 46        | 1'413        | 1'412                            | 296'943.60           | 0.09                                  |
| SGS LTD  | CHF  |                                  | 7'975     | 1'107        | 6'868                            | 498'204.72           | 0.15                                  |
| SIG COMBIBLOC SERVICES   | CHF  |                                  | 14'400    | 86           | 14'314                           | 276'975.90           | 0.08                                  |
| SIKA LTD   | CHF  | 6'114                            | 639       | 471          | 6'282                            | 1'719'383.40         | 0.50                                  |
| SOCIETE GENERALE DE SURVEILLANCE HOLDING (reg. shares)   | CHF  | 278                              | 41        | 319          |                                  |                      |                                       |
| SONOVA HOLDING (reg. shares)   | CHF  | 2'408                            | 274       | 336          | 2'346                            | 643'742.40           | 0.19                                  |
| STRAUMANN HOLDING LTD  | CHF  | 4'600                            | 815       | 355          | 5'060                            | 686'136.00           | 0.20                                  |
| SWISS LIFE HOLDING (reg. shares)   | CHF  | 1'913                            |           | 660          | 1'253                            | 731'752.00           | 0.21                                  |
| SWISS PRIME SITE   | CHF  | 2'779                            | 785       | 214          | 3'350                            | 300'997.50           | 0.09                                  |
| SWISS REINSURANCE  | CHF  | 15'356                           |           | 1'440        | 13'916                           | 1'315'896.96         | 0.38                                  |
| SWISSCOM (reg. shares)   | CHF  | 1'139                            | 86        | 92           | 1'133                            | 573'298.00           | 0.17                                  |
| TEMENOS GROUP  | CHF  | 2'747                            | 228       | 211          | 2'764                            | 216'200.08           | 0.06                                  |
| THE SWATCH GROUP   | CHF  | 1'608                            |           | 634          | 974                              | 222'656.40           | 0.06                                  |
| UBS GROUP  | CHF  | 163'491                          |           | 23'344       | 140'147                          | 3'657'836.70         | 1.07                                  |
| VAT GROUP  | CHF  | 995                              | 234       | 76           | 1'153                            | 485'989.50           | 0.14                                  |
| ZURICH INSURANCE GROUP (reg. shares)   | CHF  | 7'009                            | 602       | 663          | 6'948                            | 3'054'340.80         | 0.89                                  |
|  |  |                                  |           |              |                                  | <b>59'290'490.32</b> | <b>17.27</b>                          |
| <b>Total Aktien (und aktienähnliche Wertpapiere)</b>   |  |                                  |           |              |                                  | <b>59'290'490.32</b> | <b>17.27</b>                          |
| <b>Anleihen</b>  |  |                                  |           |              |                                  |                      |                                       |
| <b>SCHWEIZER FRANKEN</b>   |  |                                  |           |              |                                  |                      |                                       |
| 0.010  | AARGAUISCHE KANTONALBANK 0.01%/20-18.02.2030       | CHF                              | 500'000   |              | 500'000                          | 458'000.00           | 0.13                                  |
| 0.010  | AARGAUISCHE KANTONALBANK 0.01%/20-29.06.2028       | CHF                              | 430'000   |              | 430'000                          | 402'695.00           | 0.12                                  |
| 0.150  | AARGAUISCHE KANTONALBANK 0.15%/18-15.11.2024       | CHF                              | 1'000'000 |              | 500'000                          | 493'000.00           | 0.14                                  |
| 0.300  | ABB LTD 0.3%/19-06.08.2024                         | CHF                              | 200'000   |              | 200'000                          | 198'300.00           | 0.06                                  |
| 1.000  | ABB LTD 1%/19-07.05.2029                           | CHF                              | 150'000   |              | 150'000                          | 146'400.00           | 0.04                                  |
| 0.875  | ADECCO GROUP INC 0.875%/18-18.09.2026              | CHF                              | 200'000   |              | 200'000                          |                      |                                       |
| 0.875  | ADECCO GROUP INC. 0.875%/20-27.11.2025             | CHF                              | 500'000   |              | 500'000                          |                      |                                       |
| 1.205  | AFRICA FINANCE CORPORATION 1.205%/20-30.09.2025    | CHF                              | 750'000   |              | 750'000                          |                      |                                       |
| 0.250  | AKADEMISKA HUS 0.25%/15-17.11.2025                 | CHF                              | 1'000'000 |              | 1'000'000                        | 980'000.00           | 0.29                                  |
| 1.993  | AKADEMISKA HUS 1.9925%/23-14.03.2033               | CHF                              |           | 1'000'000    | 1'000'000                        | 1'050'000.00         | 0.31                                  |
| 0.350  | AKADEMISKA HUS AB 0.35%/22-24.03.2027              | CHF                              | 1'500'000 |              | 1'500'000                        | 1'452'750.00         | 0.42                                  |
| 0.410  | AMGEN 0.41%/16-08.03.2023                          | CHF                              | 1'000'000 |              | 1'000'000                        |                      |                                       |
| 0.250  | ANZ NEW ZEALAND (INTL) LIMITED 0.25%/17-22.09.2025 | CHF                              | 250'000   |              | 250'000                          |                      |                                       |
| 0.350  | ANZ NEW ZEALAND (INTL) LIMITED 0.35%/18-22.10.2024 | CHF                              | 150'000   |              | 150'000                          |                      |                                       |
| 0.250  | ANZ NEW ZEALAND INTERNATIONAL 0.25%/16-25.10.2023  | CHF                              | 750'000   |              | 750'000                          |                      |                                       |
| 0.450  | ASB FINANCE LTD 0.45%/19-30.01.2025                | CHF                              | 750'000   |              | 750'000                          | 739'050.00           | 0.22                                  |

| Titelbezeichnung   | Währung | 31.12.2022<br>Anzahl/<br>Nominal | Käufe (1) | Verkäufe (1) | 31.12.2023<br>Anzahl/<br>Nominal | Kurswert CHF | in % des<br>Gesamtfonds-<br>vermögens |
|--|---------|----------------------------------|-----------|--------------|----------------------------------|--------------|---------------------------------------|
| 1.375 AT&T 1.375%/14-04.12.2024  | CHF     | 200'000                          |           | 200'000      |                                  |              |                                       |
| 0.850 ATHENE GLOBAL FUNDING 0.85%/20-14.10.2025                          | CHF     | 500'000                          |           | 500'000      |                                  |              |                                       |
| 0.150 BALOISE HOLDING AG 0.15%/21-17.02.2031                             | CHF     | 680'000                          |           |              | 680'000                          | 610'300.00   | 0.18                                  |
| 0.250 BALOISE HOLDING AG 0.25%/20-16.12.2026                             | CHF     | 500'000                          |           |              | 500'000                          | 481'500.00   | 0.14                                  |
| 0.500 BALOISE HOLDING AG 0.5%/20-16.12.2030                              | CHF     | 500'000                          |           |              | 500'000                          | 462'500.00   | 0.13                                  |
| 2.200 BALOISE HOLDING AG 2.2%/23-30.01.2032                              | CHF     |                                  | 1'000'000 |              | 1'000'000                        | 1'037'000.00 | 0.30                                  |
| 0.125 BALOISE-HOLDING AG 0.125%/21-27.06.2030                            | CHF     | 1'000'000                        |           |              | 1'000'000                        | 909'500.00   | 0.26                                  |
| 0.500 BALOISE-HOLDING AG 0.5%/19-28.11.2025                              | CHF     | 400'000                          |           |              | 400'000                          | 392'000.00   | 0.11                                  |
| 2.408 BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA SA 2.4075%/22-28.11.2025           | CHF     | 1'000'000                        |           |              | 1'000'000                        | 1'012'500.00 | 0.29                                  |
| 0.100 BANCO DE CREDITO E INVERSIONES 0.1%/20-18.09.2026                  | CHF     | 500'000                          |           |              | 500'000                          | 473'500.00   | 0.14                                  |
| 0.400 BANCO DE CREDITO E INVERSIONES 0.4%/19-22.11.2024                  | CHF     | 200'000                          |           | 200'000      |                                  |              |                                       |
| 0.599 BANCO DE CREDITO E INVERSIONES 0.5994%/22-26.04.2027               | CHF     | 1'000'000                        |           |              | 1'000'000                        | 949'500.00   | 0.28                                  |
| 0.240 BANCO DEL ESTADO DE CHILE 0.24%/19-06.06.2025                      | CHF     | 300'000                          |           | 300'000      |                                  |              |                                       |
| 0.330 BANCO SANTANDER CHILE 0.33%/21-22.06.2027                          | CHF     | 1'000'000                        |           |              | 1'000'000                        | 941'500.00   | 0.27                                  |
| 0.200 BANCO SANTANDER SA 0.2%/19-19.11.2027                              | CHF     | 500'000                          |           |              | 500'000                          | 473'250.00   | 0.14                                  |
| 1.000 BANCO SANTANDER SA 1%/18-10.12.2024                                | CHF     | 200'000                          |           | 200'000      |                                  |              |                                       |
| 0.253 BANK OF AMERICA CORP 0.2525%/19-12.06.2026                         | CHF     | 600'000                          |           |              | 600'000                          | 579'600.00   | 0.17                                  |
| 0.278 BANK OF NOVA SCOTIA 0.278%/22-01.04.2027                           | CHF     | 1'500'000                        |           |              | 1'500'000                        | 1'446'000.00 | 0.42                                  |
| 0.385 BANK OF NOVA SCOTIA 0.385%/22-01.02.2029                           | CHF     | 1'500'000                        |           |              | 1'500'000                        | 1'399'500.00 | 0.41                                  |
| 0.100 BANO CANTONALE DU VALAIS 0.1%/21-18.04.2031                        | CHF     | 750'000                          |           |              | 750'000                          | 673'875.00   | 0.20                                  |
| 1.625 BANQUE CANTONALE VAUDOISE 1.625%/11-30.11.2026                     | CHF     | 1'000'000                        |           |              | 1'000'000                        | 999'500.00   | 0.29                                  |
| 0.200 BANQUE FEDERALE CREDIT MUTUEL 0.2%/19-12.06.2026                   | CHF     | 300'000                          |           |              | 300'000                          | 289'650.00   | 0.08                                  |
| 0.200 BANQUE FEDERATIVE DU CREDIT MUTUEL 0.2%/20-03.11.2028              | CHF     | 500'000                          |           |              | 500'000                          | 464'250.00   | 0.14                                  |
| 0.366 BANQUE FEDERATIVE DU CREDIT MUTUEL 0.366%/18-10.10.2024            | CHF     | 150'000                          |           |              | 150'000                          | 148'350.00   | 0.04                                  |
| 0.050 BASELSTADT KANTONALBANK 0.05%/20-28.01.2031                        | CHF     | 500'000                          |           |              | 500'000                          | 452'250.00   | 0.13                                  |
| 0.125 BASLER KANTONALBANK 0.125%/18-11.04.2024                           | CHF     | 150'000                          |           | 150'000      |                                  |              |                                       |
| 0.150 BASLER KANTONALBANK 0.15%/19-02.04.2027                            | CHF     | 750'000                          |           |              | 750'000                          | 717'375.00   | 0.21                                  |
| 1.875 BASLER KANTONALBANK 1.875%/10-26.10.2026                           | CHF     | 240'000                          |           |              | 240'000                          | 242'640.00   | 0.07                                  |
| 0.375 BELL FOOD GROUP AG 0.375%/18-01.02.2024                            | CHF     | 1'000'000                        |           | 500'000      | 500'000                          | 499'350.00   | 0.15                                  |
| 0.625 BELL FOOD GROUP AG 0.625%/16-24.03.2025                            | CHF     | 500'000                          |           |              | 500'000                          | 493'000.00   | 0.14                                  |
| 1.550 BELL FOOD GROUP LTD 1.55%/22-16.05.2029                            | CHF     | 1'000'000                        |           |              | 1'000'000                        | 994'000.00   | 0.29                                  |
| 0.250 BERLIN HYP AG 0.25%/20-11.09.2028                                  | CHF     | 750'000                          |           |              | 750'000                          | 695'625.00   | 0.20                                  |
| 0.250 BERLIN HYP AG 0.25%/21-04.10.2029                                  | CHF     | 750'000                          |           |              | 750'000                          | 687'375.00   | 0.20                                  |
| 0.250 BERLIN HYP AG 0.25%/21-10.03.2031                                  | CHF     | 750'000                          |           |              | 750'000                          | 669'000.00   | 0.19                                  |
| 0.400 BERNER KANTONALBANK 0.4%/18-03.05.2027                             | CHF     | 350'000                          |           |              | 350'000                          | 336'350.00   | 0.10                                  |
| 2.500 BNG 2.5%/05-21.07.2025   | CHF     | 1'000'000                        |           | 500'000      | 500'000                          | 508'250.00   | 0.15                                  |
| 0.111 BNZ INTERNATIONAL FUNDING LTD 0.111%/20-24.07.2028                 | CHF     | 500'000                          |           |              | 500'000                          | 464'500.00   | 0.14                                  |
| 0.500 BOBST GROUP SA 0.5%/20-17.02.2026                                  | CHF     | 500'000                          |           |              | 500'000                          | 483'250.00   | 0.14                                  |
| 1.375 BUCHER INDUSTRIES 1.375%/14-02.10.2024                             | CHF     | 600'000                          |           |              | 600'000                          | 597'180.00   | 0.17                                  |
| 2.500 CAISSE D'AMORTISSEMENT DE LA DETTE SOCIALE 2.5%/11-09.12.2025      | CHF     | 1'000'000                        |           |              | 1'000'000                        | 1'020'500.00 | 0.30                                  |
| 1.750 CAISSE DE REFINANCEMENT DE L'HABITAT 1.75%/13-26.06.2025           | CHF     | 1'000'000                        |           |              | 1'000'000                        | 1'001'100.00 | 0.29                                  |
| 0.477 CAIXABANK S.A. 0.477%/21-01.07.2027                                | CHF     | 600'000                          |           |              | 600'000                          | 569'400.00   | 0.17                                  |
| 0.050 CANADIAN IMPERIAL BANK OF COMMERCE 0.05%/19-15.10.2026             | CHF     | 500'000                          |           |              | 500'000                          | 477'250.00   | 0.14                                  |
| 0.100 CANADIAN IMPERIAL BANK OF COMMERCE 0.1%/20-24.10.2023              | CHF     | 1'500'000                        |           | 1'500'000    |                                  |              |                                       |
| 0.125 CANADIAN IMPERIAL BANK OF COMMERCE 0.125%/15-22.12.2025            | CHF     | 1'000'000                        |           |              | 1'000'000                        | 973'500.00   | 0.28                                  |
| 0.180 CANADIAN IMPERIAL BANK OF COMMERCE 0.18%/21-20.04.2029             | CHF     | 1'000'000                        |           |              | 1'000'000                        | 919'500.00   | 0.27                                  |
| 0.283 CANADIAN IMPERIAL BANK OF COMMERCE 0.2825%/22-03.02.2027           | CHF     | 1'000'000                        |           |              | 1'000'000                        | 954'000.00   | 0.28                                  |
| 0.968 CANADIAN IMPERIAL BANK OF COMMERCE 0.9675%/22-26.04.2029           | CHF     | 1'000'000                        |           |              | 1'000'000                        | 975'500.00   | 0.28                                  |
| 0.500 CANTON OF GENEVA 0.5%/17-28.11.2031                                | CHF     | 500'000                          | 500'000   |              | 1'000'000                        | 941'500.00   | 0.27                                  |
| - CANTON OF TICINO 0%/21-31.03.2026                                      | CHF     | 750'000                          |           |              | 750'000                          | 727'500.00   | 0.21                                  |
| - CEMBRA MONEY BANK AG 0%/19-19.05.2023                                  | CHF     | 400'000                          |           | 400'000      |                                  |              |                                       |
| 0.875 CEMBRA MONEY BANK LTD. 0.875%/18-08.06.2026                        | CHF     | 250'000                          |           | 250'000      |                                  |              |                                       |
| 0.110 CENTRAL AMERICAN BANK FOR ECONOMIC INTEGRATION 0.11%/21-15.12.2028 | CHF     | 1'000'000                        |           |              | 1'000'000                        | 914'500.00   | 0.27                                  |
| 0.010 CHOCOLADEFABRIKEN LINDT & SPRUENGLI AG 0.01%/20-06.10.2028         | CHF     | 500'000                          |           |              | 500'000                          | 466'750.00   | 0.14                                  |
| 0.750 CITIGROUP INC 0.75%/19-02.04.2026                                  | CHF     | 250'000                          |           |              | 250'000                          | 244'875.00   | 0.07                                  |
| 0.250 CITIGROUP INC S. -C- 0.25%/21-30.08.2029                           | CHF     | 1'000'000                        |           |              | 1'000'000                        | 917'000.00   | 0.27                                  |
| 0.750 COOP-GRUPPE GENOSSENSCHAFT 0.75%/18-06.06.2025                     | CHF     | 400'000                          |           |              | 400'000                          | 394'800.00   | 0.11                                  |
| 0.750 COOP-GRUPPE GENOSSENSCHAFT 0.75%/20-05.05.2023                     | CHF     | 1'000'000                        |           | 1'000'000    |                                  |              |                                       |
| 1.000 COOP-GRUPPE GENOSSENSCHAFT 1%/14-29.09.2023                        | CHF     | 1'000'000                        |           | 1'000'000    |                                  |              |                                       |
| 0.450 CORPORACION ANDINA DE FOMENTO 0.45%/22-24.02.2027                  | CHF     | 1'000'000                        |           |              | 1'000'000                        | 953'000.00   | 0.28                                  |
| 0.700 CORPORATION ANDINA DE FOMENTO 0.7%/20-04.09.2025                   | CHF     | 500'000                          |           | 500'000      |                                  |              |                                       |
| 2.000 CORPORATION ANDINA DE FOMENTO 2%/14-05.02.2024                     | CHF     | 500'000                          |           | 500'000      |                                  |              |                                       |
| 0.030 CREDIT AGRICOLE NEXT BANK (SUISSE) SA 0.03%/21-24.09.2031          | CHF     | 1'000'000                        |           | 500'000      | 500'000                          | 438'500.00   | 0.13                                  |
| 0.200 CREDIT AGRICOLE S.A. LONDON BRANCH 0.2%/18-30.10.2023              | CHF     | 200'000                          |           | 200'000      |                                  |              |                                       |
| 0.500 CREDIT AGRICOLE S.A. LONDON BRANCH 0.5%/20-01.10.2026              | CHF     | 600'000                          |           |              | 600'000                          | 578'400.00   | 0.17                                  |
| 0.625 CREDIT AGRICOLE S.A. LONDON BRANCH 0.625%/15-15.09.2023            | CHF     | 200'000                          |           | 200'000      |                                  |              |                                       |
| 0.213 CREDIT AGRICOLE SA 0.2125%/21-21.06.2029                           | CHF     | 1'000'000                        |           |              | 1'000'000                        | 920'500.00   | 0.27                                  |
| - CREDIT SUISSE SCHWEIZ AG 0%/20-17.12.2024                              | CHF     | 500'000                          |           |              | 500'000                          | 491'700.00   | 0.14                                  |

| Titelbezeichnung | Währung   | 31.12.2022<br>Anzahl/<br>Nominal | Käufe (1) | Verkäufe (1) | 31.12.2023<br>Anzahl/<br>Nominal | Kurswert CHF | in % des<br>Gesamtfonds-<br>vermögens |
|------------------|---|----------------------------------|-----------|--------------|----------------------------------|--------------|---------------------------------------|
| -                | CREDIT SUISSE SCHWEIZ AG 0%/20-31.07.2025   | CHF                              | 500'000   |              | 500'000                          | 486'750.00   | 0.14                                  |
| 0.625            | DAETWYLER HOLDING AG 0.625%/18-30.05.2024   | CHF                              | 150'000   |              | 150'000                          | 149'130.00   | 0.04                                  |
| 0.850            | DAIMLER INTERNATIONAL FINANCE BV 0.85%/18-14.11.2025                                      | CHF                              | 200'000   | 200'000      |                                  |              |                                       |
| 1.375            | DEUTSCHE BAHN FINANCE GMBH 1.375%/13-24.07.2023   | CHF                              | 1'000'000 | 1'000'000    |                                  |              |                                       |
| 1.500            | DEUTSCHE BAHN FINANCE GMBH 1.5%/14-26.08.2024   | CHF                              | 1'000'000 | 250'000      | 750'000                          | 749'250.00   | 0.22                                  |
| 0.435            | DEUTSCHE TELEKOM AG 0.435%/20-06.02.2032  | CHF                              | 500'000   |              | 500'000                          | 459'250.00   | 0.13                                  |
| 1.000            | DORMAKABA FINANCE AG 1%/17-13.10.2025   | CHF                              | 750'000   |              | 750'000                          | 736'125.00   | 0.21                                  |
| 1.500            | EIB 1.5%/12-02.08.2024  | CHF                              | 1'000'000 |              | 1'000'000                        | 999'000.00   | 0.29                                  |
| 0.150            | ELI LILLY & CO 0.15%/16-24.05.2024  | CHF                              | 1'000'000 | 1'000'000    |                                  |              |                                       |
| 1.250            | EMISSIONSZENTRALE EGW S. 43 1.25%/12-15.06.2027   | CHF                              | 500'000   |              | 500'000                          | 501'000.00   | 0.15                                  |
| 0.875            | EMISSIONSZENTRALE EGW S. 44 0.875%/12-24.03.2023  | CHF                              | 1'500'000 | 1'500'000    |                                  |              |                                       |
| 3.000            | EUROFIMA BASEL 3%/06-15.05.2026   | CHF                              | 1'500'000 |              | 1'500'000                        | 1'558'500.00 | 0.45                                  |
| 3.000            | EUROFIMA BASEL 3%/07-22.05.2024   | CHF                              | 1'500'000 | 1'000'000    | 500'000                          | 502'350.00   | 0.15                                  |
| -                | EUROFIMA EUROPEAN COMPANY FOR THE FINANCING OF RAILROAD<br>ROLLING STOCK 0%/21-22.12.2031 | CHF                              | 1'000'000 |              | 1'000'000                        | 899'500.00   | 0.26                                  |
| 1.625            | EUROPEAN INVESTMENT BANK 1.625%/14-04.02.2025   | CHF                              | 1'500'000 | 500'000      | 1'000'000                        | 1'001'300.00 | 0.29                                  |
| 1.050            | FERRING HOLDING SA 1.05%/20-09.07.2025  | CHF                              | 500'000   |              | 500'000                          | 491'500.00   | 0.14                                  |
| 3.250            | FERRING HOLDING SA 3.25%/23-21.04.2031  | CHF                              |           | 1'000'000    | 1'000'000                        | 1'068'500.00 | 0.31                                  |
| 1.000            | FIRMENICH INTERNATIONAL 1%/20-19.12.2023  | CHF                              | 500'000   | 500'000      |                                  |              |                                       |
| 0.068            | FIRST ABU DHABI BANK P.J.S.C.   | CHF                              | 750'000   |              | 750'000                          | 709'125.00   | 0.21                                  |
| 0.300            | GEBERIT AG 0.3%/15-17.04.2023   | CHF                              | 200'000   | 200'000      |                                  |              |                                       |
| 0.750            | GEBERIT AG 0.75%/22-29.09.2027  | CHF                              | 720'000   |              | 720'000                          | 705'960.00   | 0.21                                  |
| 2.300            | GEBERIT AG 2.3%/23-27.09.2032   | CHF                              | 700'000   |              | 700'000                          | 745'150.00   | 0.22                                  |
| 0.125            | GENFER KANTONALBANK 0.125%/19-23.04.2026  | CHF                              | 200'000   |              | 200'000                          | 193'100.00   | 0.06                                  |
| 0.150            | GIVAUDAN AG 0.15%/20-10.11.2028   | CHF                              | 180'000   |              | 180'000                          | 169'380.00   | 0.05                                  |
| 0.375            | GIVAUDAN AG 0.375%/18-09.04.2025  | CHF                              | 100'000   |              | 100'000                          | 98'440.00    | 0.03                                  |
| -                | GLARNER KANTONALBANK 0%/20-06.09.2028   | CHF                              | 500'000   |              | 500'000                          | 467'250.00   | 0.14                                  |
| 1.000            | GOLDMAN SACHS GROUP INC 1%/18-24.11.2025  | CHF                              | 200'000   | 200'000      |                                  |              |                                       |
| 1.375            | GRAUBUENDNER KANTONALBANK 1.375%/13-11.03.2025  | CHF                              | 540'000   |              | 540'000                          | 537'948.00   | 0.16                                  |
| 0.100            | GRAUBUENDNER KANTONALBANK 0.1%/21-07.12.2029  | CHF                              | 1'000'000 |              | 1'000'000                        | 921'000.00   | 0.27                                  |
| 0.050            | HILTI AG 0.05%/20-02.07.2025  | CHF                              | 250'000   |              | 250'000                          | 244'375.00   | 0.07                                  |
| 0.125            | HYP0 VORARLBERG BANK AG 0.125%/19-03.09.2029  | CHF                              | 500'000   |              | 500'000                          | 448'250.00   | 0.13                                  |
| 0.125            | HYP0 VORARLBERG BANK AG 0.125%/20-27.03.2030  | CHF                              | 440'000   |              | 440'000                          | 388'300.00   | 0.11                                  |
| 0.450            | HYP0 VORARLBERG BANK AG 0.45%/18-05.03.2024   | CHF                              | 400'000   | 400'000      |                                  |              |                                       |
| 3.033            | HYUNDAI CAPITAL SERVICES INC 3.0325%/23-01.02.2028  | CHF                              | 470'000   | 470'000      |                                  |              |                                       |
| 0.125            | INSELSPIITAL-STIFTUNG 0.125%/21-01.01.2500  | CHF                              | 430'000   |              | 430'000                          | 399'900.00   | 0.12                                  |
| 0.300            | INTERSHOP HOLDING AG 0.3%/21-29.06.2026   | CHF                              | 950'000   |              | 950'000                          | 912'475.00   | 0.27                                  |
| 0.375            | JULIUS BAER GROUP LTD 0.375%/17-06.12.2024  | CHF                              | 500'000   | 500'000      |                                  |              |                                       |
| -                | KANTON BASEL-STADT 0%/16-04.09.2026   | CHF                              | 500'000   |              | 500'000                          | 484'750.00   | 0.14                                  |
| -                | KANTON BASEL-STADT 0%/18-24.09.2025   | CHF                              | 1'000'000 |              | 1'000'000                        | 977'500.00   | 0.28                                  |
| -                | KANTON GENF 0%/19-26.05.2028  | CHF                              | 500'000   |              | 500'000                          | 473'000.00   | 0.14                                  |
| 0.030            | KANTON GENF 0.03%/20-28.06.2030   | CHF                              | 500'000   |              | 500'000                          | 462'500.00   | 0.13                                  |
| 0.050            | KANTON GENF 0.05%/20-15.11.2029   | CHF                              | 500'000   |              | 500'000                          | 467'500.00   | 0.14                                  |
| 0.250            | KANTON GENF 0.25%/17-29.11.2027   | CHF                              | 1'000'000 |              | 1'000'000                        | 962'500.00   | 0.28                                  |
| 1.250            | KANTON GENF 1.25%/13-22.03.2023   | CHF                              | 500'000   | 500'000      |                                  |              |                                       |
| 2.125            | KANTON GENF 2.125%/10-27.10.2028  | CHF                              | 500'000   |              | 500'000                          | 520'750.00   | 0.15                                  |
| -                | KANTON LUZERN 0%/18-15.10.2025  | CHF                              | 200'000   |              | 200'000                          | 195'500.00   | 0.06                                  |
| -                | KANTON SOLOTHURN 0%/17-27.10.2025   | CHF                              | 250'000   |              | 250'000                          | 243'750.00   | 0.07                                  |
| -                | KANTON ZUERICH 0%/18-27.06.2025   | CHF                              | 200'000   |              | 200'000                          | 196'200.00   | 0.06                                  |
| -                | KANTON ZUERICH 0%/20-23.06.2028   | CHF                              | 500'000   |              | 500'000                          | 474'500.00   | 0.14                                  |
| -                | KANTON ZUERICH 0%/21-10.11.2033   | CHF                              | 750'000   |              | 750'000                          | 664'875.00   | 0.19                                  |
| -                | KANTONSSPIITAL WINTERTHUR 0%/21-30.09.2025  | CHF                              | 750'000   | 750'000      |                                  |              |                                       |
| 2.500            | KFW 2.5%/05-25.08.2025  | CHF                              | 500'000   |              | 500'000                          | 509'500.00   | 0.15                                  |
| 0.545            | KOMMUNALBANKEN A/S 0.545%/22-28.04.2028   | CHF                              | 1'000'000 |              | 1'000'000                        | 970'500.00   | 0.28                                  |
| 0.250            | KOREA EXPRESSWAY CORPORATION 0.25%/17-07.06.2024  | CHF                              | 150'000   | 150'000      |                                  |              |                                       |
| -                | KOREA GAS CORPORATION 0%/19-28.11.2023  | CHF                              | 400'000   | 400'000      |                                  |              |                                       |
| -                | KOREA RAILROAD CORPORATION 0%/19-13.06.2025   | CHF                              | 500'000   | 500'000      |                                  |              |                                       |
| 1.000            | LAFARGEHOLCIM LTD 1%/18-11.12.2024  | CHF                              | 1'000'000 | 1'000'000    |                                  |              |                                       |
| 0.200            | LANSFORSKRINGAR HYPOTEK 0.2%/18-17.04.2026  | CHF                              | 100'000   | 100'000      |                                  |              |                                       |
| 0.200            | LGT BANK LTD 0.2%/16-12.10.2026   | CHF                              | 200'000   |              | 200'000                          | 192'800.00   | 0.06                                  |
| 0.200            | LGT BANK LTD 0.2%/20-04.11.2030   | CHF                              | 500'000   |              | 500'000                          | 451'250.00   | 0.13                                  |
| 0.500            | LGT BANK LTD 0.5%/17-12.05.2027   | CHF                              | 500'000   |              | 500'000                          | 483'000.00   | 0.14                                  |
| 0.375            | LGT BANK LTD 0.375%/19-05.07.2028   | CHF                              | 600'000   |              | 600'000                          | 564'000.00   | 0.16                                  |
| 0.125            | LIECHTENSTEIN LANDESBANK 0.125%/19-28.05.2026   | CHF                              | 150'000   |              | 150'000                          | 145'350.00   | 0.04                                  |
| 0.300            | LINDT & SPRUENGLI 0.3%/17-06.10.2027  | CHF                              | 500'000   |              | 500'000                          | 479'000.00   | 0.14                                  |
| 1.000            | LLOYDS BANKING GROUP PLC 1%/18-04.03.2025   | CHF                              | 200'000   | 200'000      |                                  |              |                                       |
| 0.350            | LONZA SWISS FINANZ AG 0.35%/20-22.09.2026   | CHF                              | 120'000   |              | 120'000                          | 115'980.00   | 0.03                                  |
| 1.250            | LONZA SWISS FINANZ AG 1.25%/15-22.09.2023   | CHF                              | 750'000   | 750'000      |                                  |              |                                       |
| 2.100            | LONZA SWISS FINANZ AG 2.1%/23-12.09.2029  | CHF                              |           | 870'000      | 870'000                          | 891'315.00   | 0.26                                  |
| 3.000            | LUZERNER KANTONALBANK 3%/05-11.03.2025  | CHF                              | 1'000'000 |              | 1'000'000                        | 1'015'100.00 | 0.30                                  |
| 0.250            | LUZERNER KANTONALBANK AG 0.25%/22-24.01.2030  | CHF                              | 1'500'000 |              | 1'500'000                        | 1'395'750.00 | 0.41                                  |

| Titelbezeichnung   | Währung | 31.12.2022<br>Anzahl/<br>Nominal | Käufe (1) | Verkäufe (1) | 31.12.2023<br>Anzahl/<br>Nominal | Kurswert CHF | in % des<br>Gesamtfonds-<br>vermögens |
|--|---------|----------------------------------|-----------|--------------|----------------------------------|--------------|---------------------------------------|
| 2.125 LUZERNER KANTONALBANK AG 2.125%/23-30.01.2032  | CHF     |                                  | 1'000'000 |              | 1'000'000                        | 1'048'000.00 | 0.31                                  |
| - LUZERNER KANTONALBK AG 0%/20-07.08.2028  | CHF     | 500'000                          |           |              | 500'000                          | 467'250.00   | 0.14                                  |
| 0.625 MACQUARIE BANK 0.625%/15-04.09.2023  | CHF     | 150'000                          |           | 150'000      |                                  |              |                                       |
| 0.750 MACQUARIE BANK 0.75%/16-05.02.2024   | CHF     | 250'000                          |           | 250'000      |                                  |              |                                       |
| 1.018 MBANK S.A. 1.0183%/19-04.10.2024   | CHF     | 600'000                          |           | 600'000      |                                  |              |                                       |
| 0.170 MCDONALD'S CORP 0.17%/16-04.10.2024  | CHF     | 100'000                          |           | 100'000      |                                  |              |                                       |
| 0.250 MUENCHENER HYPOTHEKENBANK EG 0.25%/20-18.09.2028                                     | CHF     | 750'000                          |           |              | 750'000                          | 706'500.00   | 0.21                                  |
| 0.350 MUENCHENER HYPOTHEKENBANK EG 0.35%/18-12.12.2023                                     | CHF     | 100'000                          |           | 100'000      |                                  |              |                                       |
| 0.001 MUENCHENER HYPOTHEKENBNK EG 0.001%/19-19.02.2024                                     | CHF     | 500'000                          |           |              | 500'000                          | 498'700.00   | 0.15                                  |
| 0.100 MUENCHENER HYPOTHEKENBNK EG 0.1%/20-17.12.2025                                       | CHF     | 1'000'000                        |           |              | 1'000'000                        | 966'500.00   | 0.28                                  |
| 0.500 MUENCHENER HYPOTHEKENBNK EG 0.5%/18-14.06.2028                                       | CHF     | 500'000                          |           |              | 500'000                          | 481'500.00   | 0.14                                  |
| 2.375 MUNICIPALITY FINANCE 2.375%/11-30.03.2026  | CHF     | 500'000                          |           |              | 500'000                          | 511'250.00   | 0.15                                  |
| 0.625 MUNICIPALITY FINANCE PLC 0.625%/17-06.08.2038  | CHF     |                                  | 500'000   |              | 500'000                          | 453'000.00   | 0.13                                  |
| 0.300 NA DEVELOPMENT BANK 0.3%/18-24.07.2026   | CHF     | 250'000                          |           | 250'000      |                                  |              |                                       |
| 0.875 NANT DE DRANCE SA 0.875%/20-23.05.2029   | CHF     | 390'000                          |           |              | 390'000                          | 372'450.00   | 0.11                                  |
| 1.250 NANT DE DRANCE SA 1.25%/20-25.06.2027  | CHF     | 320'000                          |           |              | 320'000                          | 314'880.00   | 0.09                                  |
| 1.550 NANT DE DRANCE SA 1.55%/18-19.08.2025  | CHF     | 50'000                           |           |              | 50'000                           | 49'900.00    | 0.01                                  |
| 0.250 NATIONAL AUSTRALIA BANK 0.25%/16-19.01.2023  | CHF     | 150'000                          |           | 150'000      |                                  |              |                                       |
| 0.065 NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD 0.065%/20-29.01.2029                                     | CHF     | 500'000                          |           |              | 500'000                          | 465'000.00   | 0.14                                  |
| 0.300 NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD 0.3%/17-31.10.2025                                       | CHF     | 500'000                          |           |              | 500'000                          | 488'500.00   | 0.14                                  |
| 1.715 NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD 1.715%/23-03.02.2033                                     | CHF     |                                  | 1'000'000 |              | 1'000'000                        | 1'020'500.00 | 0.30                                  |
| 0.898 NATWEST MARKETS PLC 0.8975%/22-04.04.2025  | CHF     | 1'400'000                        |           | 400'000      | 1'000'000                        | 989'000.00   | 0.29                                  |
| 0.235 NEDER WATERSCHAPSBANK 0.235%/22-14.04.2027   | CHF     | 1'500'000                        |           |              | 1'500'000                        | 1'451'250.00 | 0.42                                  |
| 0.250 NESTLE LTD 0.25%/18-28.06.2024   | CHF     | 1'000'000                        |           | 1'000'000    |                                  |              |                                       |
| 2.250 NESTLE LTD. 2.25%/22-08.11.2029  | CHF     |                                  | 1'000'000 |              | 1'000'000                        | 1'052'500.00 | 0.31                                  |
| 0.350 NEUENBURGER KANTONALBANK 0.35%/18-14.09.2026   | CHF     | 400'000                          |           | 400'000      |                                  |              |                                       |
| 0.125 NORDEA BANK ABP 0.125%/20-02.06.2026   | CHF     | 500'000                          |           |              | 500'000                          | 482'750.00   | 0.14                                  |
| 0.200 NORTH AMERICAN DEVELOPMENT BANK 0.2%/20-28.11.2028                                   | CHF     | 500'000                          |           |              | 500'000                          | 470'500.00   | 0.14                                  |
| 0.550 NORTH AMERICAN DEVELOPMENT BANK 0.55%/20-27.05.2033                                  | CHF     | 500'000                          |           |              | 500'000                          | 456'500.00   | 0.13                                  |
| 2.625 OEKB 2.625%/06-22.11.2024  | CHF     | 1'500'000                        |           | 1'500'000    |                                  |              |                                       |
| 0.050 ONTARIO (PROVINCE OF) 0.05%/21-12.05.2033  | CHF     | 750'000                          |           |              | 750'000                          | 663'750.00   | 0.19                                  |
| 0.200 ORANGE SA 0.2%/19-24.11.2025   | CHF     | 1'000'000                        |           |              | 1'000'000                        | 976'500.00   | 0.28                                  |
| 0.150 PARTNERS GROUP HOLDING A 0.15%/17-07.06.2024   | CHF     | 100'000                          |           | 100'000      |                                  |              |                                       |
| - PFANDBRIEF SCHWEIZ HYPO S. -695- 0%/20-26.10.2029  | CHF     | 1'000'000                        |           |              | 1'000'000                        | 924'000.00   | 0.27                                  |
| 0.125 PFANDBRIEFBANK SCHWEIZERISCHER HYPOTHEKARINSTITUTE AG 0.125%/17-25.03.2024           | CHF     | 590'000                          |           |              | 590'000                          | 587'935.00   | 0.17                                  |
| 0.250 PFANDBRIEFBANK SCHWEIZERISCHER HYPOTHEKARINSTITUTE AG 0.25%/17-12.10.2027            | CHF     | 750'000                          |           |              | 750'000                          | 719'850.00   | 0.21                                  |
| 0.250 PFANDBRIEFBANK SCHWEIZERISCHER HYPOTHEKARINSTITUTE AG 0.25%/17-18.09.2026            | CHF     | 500'000                          |           |              | 500'000                          | 485'200.00   | 0.14                                  |
| 0.250 PFANDBRIEFBANK SCHWEIZERISCHER HYPOTHEKARINSTITUTE AG 0.25%/17-20.10.2026            | CHF     | 500'000                          |           |              | 500'000                          | 484'750.00   | 0.14                                  |
| 0.375 PFANDBRIEFBANK SCHWEIZERISCHER HYPOTHEKARINSTITUTE AG 0.375%/17-21.03.2028           | CHF     | 600'000                          |           |              | 600'000                          | 576'180.00   | 0.17                                  |
| 0.625 PFANDBRIEFBANK SCHWEIZERISCHER HYPOTHEKARINSTITUTE AG 0.625%/18-09.10.2028           | CHF     | 1'000'000                        |           |              | 1'000'000                        | 966'300.00   | 0.28                                  |
| 1.375 PFANDBRIEFBANK SCHWEIZERISCHER HYPOTHEKARINSTITUTE AG S. 574 1.375%/12-20.09.2029    | CHF     | 1'000'000                        |           |              | 1'000'000                        | 1'000'500.00 | 0.29                                  |
| 0.125 PFANDBRIEFBANK SCHWEIZERISCHER HYPOTHEKARINSTITUTE AG S. 609 0.125%/15-04.12.2023    | CHF     | 500'000                          |           | 500'000      |                                  |              |                                       |
| 0.375 PFANDBRIEFBANK SCHWEIZERISCHER HYPOTHEKARINSTITUTE AG S. -628- 0.375%/16-26.01.2032  | CHF     | 1'000'000                        |           |              | 1'000'000                        | 921'000.00   | 0.27                                  |
| - PFANDBRIEFBANK SCHWEIZERISCHER HYPOTHEKARINSTITUTE AG S. -670- 0%/19-29.07.2024          | CHF     | 300'000                          |           |              | 300'000                          | 296'940.00   | 0.09                                  |
| - PFANDBRIEFBANK SCHWEIZERISCHER HYPOTHEKARINSTITUTE AG S. -675- 0%/19-15.06.2027          | CHF     | 1'000'000                        |           |              | 1'000'000                        | 954'700.00   | 0.28                                  |
| - PFANDBRIEFBANK SCHWEIZERISCHER HYPOTHEKARINSTITUTE AG S. -679- 0%/19-16.08.2023          | CHF     | 500'000                          |           | 500'000      |                                  |              |                                       |
| - PFANDBRIEFBANK SCHWEIZERISCHER HYPOTHEKARINSTITUTE AG S. -680- 0%/19-30.03.2026          | CHF     | 500'000                          |           |              | 500'000                          | 484'650.00   | 0.14                                  |
| - PFANDBRIEFBANK SCHWEIZERISCHER HYPOTHEKARINSTITUTE AG S. -683- 0%/20-25.02.2028          | CHF     | 500'000                          |           |              | 500'000                          | 472'950.00   | 0.14                                  |
| 0.125 PFANDBRIEFBANK SCHWEIZERISCHER HYPOTHEKARINSTITUTE AG S. -690- 0.125%/20-02.08.2030  | CHF     | 500'000                          |           |              | 500'000                          | 460'600.00   | 0.13                                  |
| - PFANDBRIEFBANK SCHWEIZERISCHER HYPOTHEKARINSTITUTE AG S. -693- 0%/20-12.08.2025          | CHF     | 1'500'000                        |           |              | 1'500'000                        | 1'464'300.00 | 0.43                                  |
| 0.125 PFANDBRIEFBANK SCHWEIZERISCHER HYPOTHEKARINSTITUTE S. - 627- 0.125%/16-06.09.2028    | CHF     | 750'000                          |           |              | 750'000                          | 708'525.00   | 0.21                                  |
| 0.650 PFANDBRIEFZENTRALE DER SCHWEIZERISCHEN KANTONALBANKEN AG 0.65%/18-15.02.2033         | CHF     |                                  | 1'000'000 |              | 1'000'000                        | 933'100.00   | 0.27                                  |
| 1.625 PFANDBRIEFZENTRALE DER SCHWEIZERISCHEN KANTONALBANKEN AG S. 445 1.625%/14-17.06.2026 | CHF     | 550'000                          |           |              | 550'000                          | 553'080.00   | 0.16                                  |
| - PFANDBRIEFZENTRALE DER SCHWEIZERISCHEN KANTONALBANKEN AG S. -472- 0%/15-25.07.2023       | CHF     | 1'600'000                        |           | 1'600'000    |                                  |              |                                       |

| Titelbezeichnung  | Währung | 31.12.2022<br>Anzahl/<br>Nominal | Käufe (1) | Verkäufe (1) | 31.12.2023<br>Anzahl/<br>Nominal | Kurswert CHF | in % des<br>Gesamtfonds-<br>vermögens |
|---|---------|----------------------------------|-----------|--------------|----------------------------------|--------------|---------------------------------------|
| 0.050 PFANDBRIEFZENTRALE DER SCHWEIZERISCHEN KANTONALBANKEN AG S. -480- 0.05%/16-06.11.2026 | CHF     | 50'000                           |           |              | 50'000                           | 48'180.00    | 0.01                                  |
| - PFANDBRIEFZENTRALE DER SCHWEIZERISCHEN KANTONALBANKEN AG S. -483- 0%/16-27.01.2027        | CHF     | 500'000                          |           |              | 500'000                          | 479'700.00   | 0.14                                  |
| 0.550 PFANDBRIEFZENTRALE DER SCHWEIZERISCHEN KANTONALBANKEN AG S. -508- 0.55%/19-29.01.2031 | CHF     |                                  | 1'500'000 |              | 1'500'000                        | 1'415'100.00 | 0.41                                  |
| 0.350 PFANDBRIEFZENTRALE DER SCHWEIZERISCHEN KANTONALBANKEN AG S. -544- 0.35%/22-02.08.2027 | CHF     | 1'500'000                        |           |              | 1'500'000                        | 1'447'800.00 | 0.42                                  |
| 0.650 PFANDBRIEFZENTRALE DER SCHWEIZERISCHEN KANTONALBANKEN AG S. -545- 0.65%/22-03.10.2031 | CHF     | 1'000'000                        |           |              | 1'000'000                        | 944'800.00   | 0.28                                  |
| - PFANDBRIEFZENTRALE DER SCHWEIZERISCHEN KANTONALBANKEN AG S. -638- 0%/16-16.05.2023        | CHF     | 1'000'000                        |           | 1'000'000    |                                  |              |                                       |
| 0.375 PROVINCE OF ALBERTA 0.375%/19-07.02.2029  | CHF     | 200'000                          |           |              | 200'000                          | 191'000.00   | 0.06                                  |
| 0.250 PROVINCE OF NEW BRUNSWICK 0.25%/17-19.01.2029   | CHF     | 500'000                          |           |              | 500'000                          | 473'500.00   | 0.14                                  |
| 1.500 PROVINCE OF QUEBEC 1.5%/14-05.02.2024   | CHF     | 1'500'000                        |           | 750'000      | 750'000                          | 749'700.00   | 0.22                                  |
| 2.040 PROVINCE OF QUEBEC 2.04%/23-09.05.2033  | CHF     |                                  | 500'000   |              | 500'000                          | 529'500.00   | 0.15                                  |
| - PSP SWISS PROPERTY AG 0%/16-01.09.2023  | CHF     | 100'000                          |           | 100'000      |                                  |              |                                       |
| - PSP SWISS PROPERTY AG 0%/19-06.02.2030  | CHF     | 750'000                          |           |              | 750'000                          | 676'875.00   | 0.20                                  |
| 0.375 PSP SWISS PROPERTY AG 0.375%/16-29.04.2026  | CHF     | 750'000                          |           |              | 750'000                          | 728'250.00   | 0.21                                  |
| 2.000 PSP SWISS PROPERTY AG 2%/23-01.07.2026  | CHF     |                                  | 1'000'000 |              | 1'000'000                        | 1'009'500.00 | 0.29                                  |
| 0.750 QUEBEC 0.75%/14-21.11.2024  | CHF     | 1'000'000                        |           |              | 1'000'000                        | 992'300.00   | 0.29                                  |
| 0.300 RAIFFEISEN SCHWEIZ T. -1- 0.3%/16-22.04.2025  | CHF     | 250'000                          |           |              | 250'000                          | 245'350.00   | 0.07                                  |
| 0.500 RCI BANQUE SA 0.5%/19-18.07.2024  | CHF     | 330'000                          |           | 330'000      |                                  |              |                                       |
| 0.100 ROCHE KAPITALMARKET T. -2- 0.1%/17-23.09.2024   | CHF     | 500'000                          |           | 500'000      |                                  |              |                                       |
| 0.500 ROCHE KAPITALMARKET AG 0.5%/22-25.02.2027   | CHF     | 1'500'000                        |           |              | 1'500'000                        | 1'464'750.00 | 0.43                                  |
| 0.400 ROYAL BANK OF CANADA TORONTO CORPORATE HEADQUARTERS 0.4%/22-05.10.2027                | CHF     | 1'500'000                        |           |              | 1'500'000                        | 1'458'750.00 | 0.42                                  |
| 0.250 SCHINDLER HOLDING LTD. 0.25%/18-05.06.2023  | CHF     | 485'000                          |           | 485'000      |                                  |              |                                       |
| 0.700 SOCIETE GENERALE 0.7%/18-26.02.2025   | CHF     | 1'000'000                        |           | 1'000'000    |                                  |              |                                       |
| 0.250 SOCIETE GENERALE LTD 0.25%/20-25.02.2027  | CHF     | 800'000                          |           |              | 800'000                          | 757'600.00   | 0.22                                  |
| 0.227 SOCIETE NATIONALE SNCF SA 0.227%/20-18.06.2030  | CHF     | 500'000                          |           |              | 500'000                          | 464'000.00   | 0.14                                  |
| 1.950 SONOVA HOLDING AG 1.95%/22-12.12.2030   | CHF     | 500'000                          |           |              | 500'000                          | 513'000.00   | 0.15                                  |
| 0.500 SONOVA HOLDING LTD. 0.5%/20-06.10.2025  | CHF     | 500'000                          |           |              | 500'000                          | 490'500.00   | 0.14                                  |
| 0.750 SONOVA HOLDING LTD. 0.75%/20-06.10.2028   | CHF     | 500'000                          |           |              | 500'000                          | 483'000.00   | 0.14                                  |
| 1.050 SONOVA HOLDING LTD. 1.05%/22-19.02.2029   | CHF     | 510'000                          |           |              | 510'000                          | 497'505.00   | 0.14                                  |
| 0.508 SPAREBANK 1 BOLIGKREDITT 0.5075%/22-06.04.2027  | CHF     | 1'000'000                        |           |              | 1'000'000                        | 970'000.00   | 0.28                                  |
| 0.125 SPAREBANK 1 NORD NORGE 0.125%/19-11.12.2025   | CHF     | 300'000                          |           |              | 300'000                          | 291'450.00   | 0.08                                  |
| 0.125 SPAREBANK 1 NORD-NORGE 0.125%/21-15.09.2028   | CHF     | 1'000'000                        |           |              | 1'000'000                        | 922'000.00   | 0.27                                  |
| 0.350 SPAREBANK 1 SMN 0.35%/16-05.04.2023   | CHF     | 300'000                          |           | 300'000      |                                  |              |                                       |
| 1.500 SPAREBANK 1 SMN 1.5%/22-15.06.2027  | CHF     | 1'000'000                        |           |              | 1'000'000                        | 995'500.00   | 0.29                                  |
| 1.000 ST GALLER KANTONALBANK (subordinated) 1%/17-30.11.2027                                | CHF     | 250'000                          |           |              | 250'000                          | 245'750.00   | 0.07                                  |
| 0.500 ST. GALLER KANTONALBANK 0.5%/15-24.06.2025  | CHF     | 1'000'000                        |           |              | 1'000'000                        | 983'000.00   | 0.29                                  |
| 1.375 STADT BIEL 1.375%/14-24.09.2029   | CHF     | 300'000                          |           |              | 300'000                          | 298'200.00   | 0.09                                  |
| 0.350 STADT LAUSANNE 0.35%/20-06.07.2032  | CHF     | 500'000                          |           |              | 500'000                          | 460'500.00   | 0.13                                  |
| 0.150 STADT WINTERTHUR 0.15%/18-26.03.2025  | CHF     | 150'000                          |           |              | 150'000                          | 147'315.00   | 0.04                                  |
| 0.550 STRAUMANN HOLDING LTD 0.55%/20-03.10.2025   | CHF     | 500'000                          |           |              | 500'000                          | 490'000.00   | 0.14                                  |
| 1.250 SVENSKA HANDELSBANKEN AB 1.25%/22-24.05.2027  | CHF     | 1'500'000                        |           |              | 1'500'000                        | 1'486'500.00 | 0.43                                  |
| 1.250 SWISS CONFEDERATION 1.25%/12-11.06.2024   | CHF     | 2'200'000                        |           | 1'000'000    | 1'200'000                        | 1'198'680.00 | 0.35                                  |
| 1.250 SWISS CONFEDERATION 1.25%/12-27.06.2037   | CHF     |                                  | 1'000'000 |              | 1'000'000                        | 1'073'600.00 | 0.31                                  |
| 1.250 SWISS CONFEDERATION 1.25%/14-28.05.2026   | CHF     | 2'200'000                        |           |              | 2'200'000                        | 2'215'400.00 | 0.65                                  |
| 1.500 SWISS CONFEDERATION 1.5%/13-24.07.2025  | CHF     | 2'200'000                        |           |              | 2'200'000                        | 2'213'200.00 | 0.64                                  |
| 3.250 SWISS CONFEDERATION 3.25%/07-27.06.2027   | CHF     | 2'000'000                        |           |              | 2'000'000                        | 2'164'400.00 | 0.63                                  |
| 4.000 SWISS CONFEDERATION 4%/98-08.04.2028  | CHF     | 1'000'000                        |           |              | 1'000'000                        | 1'133'600.00 | 0.33                                  |
| 4.000 SWISS CONFEDERATION 4%/98-11.02.2023  | CHF     | 1'000'000                        |           | 1'000'000    |                                  |              |                                       |
| - SWISS LIFE HOLDING AG 0%/19-06.06.2025  | CHF     | 1'000'000                        |           |              | 1'000'000                        | 979'000.00   | 0.29                                  |
| 0.250 SWISS LIFE HOLDING AG 0.25%/19-11.10.2023   | CHF     | 500'000                          |           | 500'000      |                                  |              |                                       |
| 0.350 SWISS LIFE HOLDING AG 0.35%/19-06.03.2029   | CHF     | 500'000                          |           |              | 500'000                          | 471'500.00   | 0.14                                  |
| 2.610 SWISS LIFE HOLDING LTD 2.61%/23-26.01.2032  | CHF     |                                  | 1'000'000 |              | 1'000'000                        | 1'069'000.00 | 0.31                                  |
| 0.375 SWISS PRIME SITE FINANCE 0.375%/21-11.02.2028   | CHF     | 750'000                          |           |              | 750'000                          | 708'000.00   | 0.21                                  |
| 0.650 SWISS PRIME SITE FINANCE AG 0.65%/20-18.12.2029                                       | CHF     | 600'000                          |           |              | 600'000                          | 559'800.00   | 0.16                                  |
| 0.130 SWISSCOM AG 0.13%/20-18.09.2031   | CHF     | 600'000                          |           |              | 600'000                          | 544'500.00   | 0.16                                  |
| 0.245 SWISSCOM AG 0.245%/20-20.11.2034  | CHF     |                                  | 500'000   |              | 500'000                          | 439'000.00   | 0.13                                  |
| 0.250 SWISSCOM LTD 0.25%/15-17.04.2023  | CHF     | 2'000'000                        |           | 2'000'000    |                                  |              |                                       |
| 1.500 SWITZERLAND 1.5%/22-26.10.2038  | CHF     |                                  | 2'000'000 |              | 2'000'000                        | 2'231'400.00 | 0.65                                  |
| 1.875 TEMENOS LTD 1.875%/18-30.11.2023  | CHF     | 650'000                          |           | 650'000      |                                  |              |                                       |
| 0.375 TESSINER STAATSBANK 0.375%/18-08.02.2028  | CHF     | 300'000                          |           |              | 300'000                          | 285'450.00   | 0.08                                  |
| 0.303 THE KOREA DEVELOPMENT BANK 0.303%/18-14.06.2023                                       | CHF     | 150'000                          |           | 150'000      |                                  |              |                                       |
| 0.288 TOTAL CAPITAL INTERNATIONAL 0.288%/18-13.07.2026                                      | CHF     | 500'000                          |           | 500'000      |                                  |              |                                       |
| 0.500 TOTAL CAPITAL INTERNATIONAL 0.5%/15-01.06.2027  | CHF     | 250'000                          |           |              | 250'000                          | 243'000.00   | 0.07                                  |
| 1.000 TRANSURBAN QLD FINANCE 1%/18-08.12.2025   | CHF     | 500'000                          |           |              | 500'000                          | 492'750.00   | 0.14                                  |
| 0.150 UBS AG LONDON 0.15%/21-29.06.2028   | CHF     | 1'000'000                        |           |              | 1'000'000                        | 938'000.00   | 0.27                                  |
| 0.125 VALIANT BANK 0.125%/18-23.04.2024   | CHF     | 1'000'000                        |           | 1'000'000    |                                  |              |                                       |



| Titelbezeichnung   | Währung | 31.12.2022<br>Anzahl/<br>Nominal | Käufe (1) | Verkäufe (1) | 31.12.2023<br>Anzahl/<br>Nominal | Kurswert CHF          | in % des<br>Gesamtfonds-<br>vermögens |
|--|---------|----------------------------------|-----------|--------------|----------------------------------|-----------------------|---------------------------------------|
| 0.193 VERIZON COMMUNICATIONS 0.1925%/21-24.03.2028   | CHF     | 1'000'000                        |           |              | 1'000'000                        | 944'000.00            | 0.27                                  |
| 0.375 VERIZON COMMUNICATIONS 0.375%/17-31.05.2023  | CHF     | 150'000                          |           | 150'000      |                                  |                       |                                       |
| 0.555 VERIZON COMMUNICATIONS 0.555%/21-24.03.2031  | CHF     | 750'000                          |           |              | 750'000                          | 694'875.00            | 0.20                                  |
| 0.625 VODAFONE GROUP 0.625%/17-15.03.2027  | CHF     | 1'000'000                        |           |              | 1'000'000                        | 973'500.00            | 0.28                                  |
| - WALLISER KANTONALBANK 0%/20-14.02.2029   | CHF     | 500'000                          |           |              | 500'000                          | 463'750.00            | 0.14                                  |
| 0.300 WALLISER KANTONALBANK 0.3%/22-07.02.2030   | CHF     | 1'000'000                        |           |              | 1'000'000                        | 926'500.00            | 0.27                                  |
| 0.350 WALLISER KANTONALBANK 0.35%/18-07.09.2027  | CHF     | 400'000                          |           |              | 400'000                          | 383'000.00            | 0.11                                  |
| 1.000 WOODSIDE FINANCE LTD 1%/16-11.12.2023  | CHF     | 750'000                          |           | 750'000      |                                  |                       |                                       |
| 0.200 ZUERCHER KANTONALBANK 0.2%/22-31.03.2025   | CHF     | 1'500'000                        |           |              | 1'500'000                        | 1'475'700.00          | 0.43                                  |
| 0.250 ZUERCHER KANTONALBANK 0.25%/18-08.05.2025  | CHF     | 750'000                          |           |              | 750'000                          | 736'875.00            | 0.21                                  |
| 2.000 ZUERCHER KANTONALBANK S. 114 2%/10-08.09.2025  | CHF     | 600'000                          |           |              | 600'000                          | 604'800.00            | 0.18                                  |
| 0.050 ZUERCHER KANTONALBANK S. -148- 0.05%/20-04.11.2032   | CHF     | 1'000'000                        |           |              | 1'000'000                        | 877'500.00            | 0.26                                  |
| 0.100 ZUG ESTATES HOLDING AG 0.1%/19-02.10.2025  | CHF     | 500'000                          |           |              | 500'000                          | 485'000.00            | 0.14                                  |
| 0.750 ZUG ESTATES HOLDING AG 0.75%/22-17.04.2029   | CHF     | 640'000                          |           |              | 640'000                          | 600'960.00            | 0.18                                  |
| 0.100 ZUGER KANTONALBANK 0.1%/20-14.10.2031  | CHF     | 520'000                          |           |              | 520'000                          | 466'180.00            | 0.14                                  |
| 0.100 ZURICH INSURANCE COMPANY LTD 0.1%/20-27.08.2032  | CHF     | 500'000                          |           |              | 500'000                          | 440'000.00            | 0.13                                  |
| 1.000 ZURICH INSURANCE COMPANY LTD 1%/18-30.10.2028  | CHF     | 500'000                          |           |              | 500'000                          | 492'250.00            | 0.14                                  |
|  |         |                                  |           |              |                                  | <b>152'520'853.00</b> | <b>44.41</b>                          |
| <b>Total Anleihen</b>  |         |                                  |           |              |                                  | <b>152'520'853.00</b> | <b>44.41</b>                          |
| <b>Kollektive Kapitalanlagen</b>   |         |                                  |           |              |                                  |                       |                                       |
| <b>EURO</b>  |         |                                  |           |              |                                  |                       |                                       |
| AMUNDI INDEX EURO AGG SRI UCIT -C- EUR   | EUR     |                                  | 23'843    |              | 23'843                           | 975'562.50            | 0.28                                  |
| ISHARES EURO STOXX SUSTAINABILITY 40   | EUR     | 55'000                           |           | 55'000       |                                  |                       |                                       |
|  |         |                                  |           |              |                                  | <b>975'562.50</b>     | <b>0.28</b>                           |
| <b>SCHWEIZER FRANKEN</b>   |         |                                  |           |              |                                  |                       |                                       |
| CREDIT SUISSE REAL ESTATE FUND GREEN PROPERTY  | CHF     | 5'340                            |           |              | 5'340                            | 646'140.00            | 0.19                                  |
| CREDIT SUISSE REAL ESTATE FUND HOSPITALITY   | CHF     | 2'985                            |           |              | 2'985                            | 212'532.00            | 0.06                                  |
| CREDIT SUISSE REAL ESTATE FUND LIVINGPLUS  | CHF     | 5'110                            |           |              | 5'110                            | 733'285.00            | 0.21                                  |
| FIR FONDS IMMOBILIER ROMAND  | CHF     | 1'900                            |           |              | 1'900                            | 402'800.00            | 0.12                                  |
| IMMOFONDS  | CHF     | 981                              |           |              | 981                              | 510'120.00            | 0.15                                  |
| SCHRODER IMMOPLUS  | CHF     | 5'600                            |           |              | 5'600                            | 845'600.00            | 0.25                                  |
| SF SUSTAINABLE PROPERTY FUND   | CHF     | 3'790                            |           | 3'790        |                                  |                       |                                       |
| SWISSINVEST REAL ESTATE INVESTMENT   | CHF     | 2'509                            |           |              | 2'509                            | 461'656.00            | 0.13                                  |
| UBS PROPERTY FUND - SWISS MIXED SIMA   | CHF     | 7'900                            |           |              | 7'900                            | 1'062'550.00          | 0.31                                  |
| UBS PROPERTY SWISS RESIDENTIAL ANFOS   | CHF     | 11'000                           |           |              | 11'000                           | 897'600.00            | 0.26                                  |
|  |         |                                  |           |              |                                  | <b>5'772'283.00</b>   | <b>1.68</b>                           |
| <b>US DOLLAR</b>   |         |                                  |           |              |                                  |                       |                                       |
| CREDIT SUISSE INDEX FUND (IE) ETF ICAV - CSIF (I) MSCI USA ESG LEADERS BLUE UCITS ETF -B- USD  | USD     | 155'331                          | 16'906    | 17'320       | 154'917                          | 24'425'739.90         | 7.11                                  |
| CSIF IE MSCI USA SMALL CAP ESG -B USD- EUR   | USD     | 18'200                           |           | 18'200       |                                  |                       |                                       |
| INVESCO MARKETS PLC - INVESCO -ACC- USD  | USD     | 50'000                           | 8'808     | 6'157        | 52'651                           | 2'892'045.37          | 0.84                                  |
| ISHARES MSCI USA SRI UCITS ETF   | USD     | 1'210'000                        |           | 217'280      | 992'720                          | 11'830'554.27         | 3.45                                  |
|  |         |                                  |           |              |                                  | <b>39'148'339.54</b>  | <b>11.40</b>                          |
| <b>Total Kollektive Kapitalanlagen</b>   |         |                                  |           |              |                                  | <b>45'896'185.04</b>  | <b>13.37</b>                          |
| <b>Total Börsennotierte / an einem geregelten Markt gehandelte Wertpapiere; bewertet zu den Kursen, die am Hauptmarkt bezahlt werden</b> |         |                                  |           |              |                                  | <b>257'707'528.36</b> | <b>75.05</b>                          |
| <b>Wertpapiere bewertet aufgrund von am Markt beobachtbaren Parametern</b>   |         |                                  |           |              |                                  |                       |                                       |
| <b>Anleihen</b>  |         |                                  |           |              |                                  |                       |                                       |
| <b>EURO</b>  |         |                                  |           |              |                                  |                       |                                       |
| 0.500 ABN AMRO BANK N.V. 0.5%/21-23.09.2029  | EUR     | 600'000                          |           |              | 600'000                          | 474'080.06            | 0.14                                  |
| - ACEA SPA/21-28.09.2025   | EUR     | 500'000                          |           | 500'000      |                                  |                       |                                       |
| 1.375 AGENCE FRANCAISE DE DEVELOPPEMENT (reg. -S-) S. 62 1.375%/14-17.09.2024  | EUR     | 600'000                          |           | 300'000      | 300'000                          | 274'606.42            | 0.08                                  |
| 2.124 ASSICURAZIONI GENERALI (subordinated) 2.124%/19-01.10.2030   | EUR     | 500'000                          |           |              | 500'000                          | 410'267.31            | 0.12                                  |
| 1.650 AUSTRIA S. 1 1.65%/14-21.10.2024   | EUR     | 500'000                          |           |              | 500'000                          | 459'095.16            | 0.13                                  |
| 0.300 BANCO SANTANDER SA 0.3%/19-04.10.2026  | EUR     | 500'000                          |           |              | 500'000                          | 431'822.41            | 0.13                                  |
| - BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 0%/21-15.11.2028  | EUR     | 750'000                          | 250'000   |              | 1'000'000                        | 848'667.35            | 0.25                                  |
| 0.500 BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 0.5%/15-15.02.2025  | EUR     | 750'000                          |           |              | 750'000                          | 679'201.63            | 0.20                                  |
| 1.000 BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 1%/14-15.08.2024  | EUR     | 750'000                          |           | 750'000      |                                  |                       |                                       |
| 0.625 DNB BOLIGKREDITT AS S. -188- 0.625%/18-19.06.2025  | EUR     | 600'000                          |           |              | 600'000                          | 538'078.75            | 0.16                                  |
| 1.875 EDP FINANCE BV 1.875%/18-13.10.2025  | EUR     | 700'000                          |           |              | 700'000                          | 636'075.64            | 0.19                                  |
| 0.875 ERG SPA 0.875%/21-15.09.2031   | EUR     |                                  | 300'000   |              | 300'000                          | 223'959.15            | 0.07                                  |
| 0.250 EUROFIMA 0.25%/18-09.02.2024   | EUR     | 500'000                          |           |              | 500'000                          | 463'190.49            | 0.13                                  |
| 1.500 FINNISH GOVERNMENT -144A- 1.5%/22-15.09.2032   | EUR     |                                  | 600'000   |              | 600'000                          | 514'198.48            | 0.15                                  |
| 0.250 GERMANY 0.25%/19-15.02.2029  | EUR     |                                  | 600'000   |              | 600'000                          | 514'064.60            | 0.15                                  |
| 1.000 IBERDROLA FINANZAS S.A.U. 1%/16-04.03.2024   | EUR     | 500'000                          |           | 500'000      |                                  |                       |                                       |
| 1.250 IBERDROLA FINANZAS S.A.U. 1.25%/18-28.10.2026  | EUR     | 500'000                          |           |              | 500'000                          | 446'362.92            | 0.13                                  |
| 1.125 IBERDROLA INTERNATIONAL BV 1.125%/16-21.04.2026  | EUR     | 300'000                          |           |              | 300'000                          | 268'863.66            | 0.08                                  |
| 2.500 ING GROEP NV 2.5%/18-15.11.2030  | EUR     |                                  | 500'000   |              | 500'000                          | 445'084.58            | 0.13                                  |
| 1.250 INNOGY FINANCE BV 1.25%/17-19.10.2027  | EUR     | 500'000                          |           |              | 500'000                          | 437'098.46            | 0.13                                  |



| Titelbezeichnung  | Währung | 31.12.2022<br>Anzahl/<br>Nominal | Käufe (1) | Verkäufe (1) | 31.12.2023<br>Anzahl/<br>Nominal | Kurswert CHF         | in % des<br>Gesamtfonds-<br>vermögens |
|---|---------|----------------------------------|-----------|--------------|----------------------------------|----------------------|---------------------------------------|
| - INSTITUT CREDITO OFICIAL 0%/20-30.04.2026                     | EUR     | 700'000                          |           | 700'000      |                                  |                      |                                       |
| 1.350 IRELAND 1.35% 2031 1.35%/18-18.03.2031                    | EUR     | 400'000                          | 400'000   |              | 800'000                          | 699'937.66           | 0.20                                  |
| 0.500 KONINKLUKE PHILIPS NV 0.5%/19-22.05.2026                  | EUR     | 500'000                          |           | 500'000      |                                  |                      |                                       |
| - KUNTARAHOITUS OYJ 0%/20-14.10.2030                            | EUR     |                                  | 300'000   |              | 300'000                          | 235'692.90           | 0.07                                  |
| 0.980 MITSUBISHI UFJ FIN GRP 0.98%/18-09.10.2023                | EUR     | 400'000                          |           | 400'000      |                                  |                      |                                       |
| 0.875 NATURGY FINANCE 0.875%/17-15.05.2025                      | EUR     | 700'000                          |           |              | 700'000                          | 627'875.68           | 0.18                                  |
| 1.000 NEDER WATERSCHAPSBANK S. -1414- 1%/15-03.09.2025          | EUR     | 400'000                          |           | 400'000      |                                  |                      |                                       |
| 0.500 NETHERLANDS 0.5%/16-15.07.2026                            | EUR     | 500'000                          |           |              | 500'000                          | 445'247.28           | 0.13                                  |
| 1.125 REPUBLIC OF POLAND 1.125%/18-07.08.2026                   | EUR     | 400'000                          |           |              | 400'000                          | 352'943.87           | 0.10                                  |
| 0.875 SCHNEIDER ELECTRIC 0.875%/15-11.03.2025                   | EUR     | 400'000                          |           |              | 400'000                          | 362'248.31           | 0.11                                  |
| 0.500 SPAREBANK 1 BOLIGKREDIT 0.5%/18-30.01.2025                | EUR     | 600'000                          |           |              | 600'000                          | 540'890.16           | 0.16                                  |
| 0.875 SSE PLC 0.875%/17-06.09.2025                              | EUR     | 700'000                          |           |              | 700'000                          | 625'213.95           | 0.18                                  |
| 0.900 VODAFONE GROUP PLC 0.9%/19-24.11.2026                     | EUR     | 700'000                          |           |              | 700'000                          | 617'163.68           | 0.18                                  |
| 0.625 WESTPAC BANKING CORP 0.625%/17-22.11.2024                 | EUR     | 500'000                          |           | 500'000      |                                  |                      |                                       |
|   |         |                                  |           |              |                                  | <b>12'571'930.56</b> | <b>3.66</b>                           |
| <b>SCHWEIZER FRANKEN</b>  |         |                                  |           |              |                                  |                      |                                       |
| 1.625 REGIO EMMENTAL 1.625%/14-17.04.2023                       | CHF     | 500'000                          |           | 500'000      |                                  |                      |                                       |
| 1.500 TEMENOS LTD 1.5%/19-28.11.2025                            | CHF     | 500'000                          |           | 500'000      |                                  |                      |                                       |
| 1.750 TEMENOS LTD 1.75%/17-05.04.2024                           | CHF     | 150'000                          |           | 150'000      |                                  |                      |                                       |
|   |         |                                  |           |              |                                  | <b>0.00</b>          | <b>0.00</b>                           |
| <b>US DOLLAR</b>  |         |                                  |           |              |                                  |                      |                                       |
| 2.950 ANALOG DEVICES INC 2.95%/20-01.04.2025                    | USD     | 1'000'000                        |           | 500'000      | 500'000                          | 411'798.23           | 0.12                                  |
| 2.850 APPLE 2.85%/16-23.02.2023                                 | USD     | 2'000'000                        |           | 2'000'000    |                                  |                      |                                       |
| 3.000 APPLE INC 3%/17-20.06.2027                                | USD     | 1'000'000                        |           | 500'000      | 500'000                          | 404'652.84           | 0.12                                  |
| 2.125 ASIAN DEVELOPMENT BANK 2.125%/15-19.03.2025               | USD     | 500'000                          |           |              | 500'000                          | 408'221.33           | 0.12                                  |
| 3.800 AVANGRID INC 3.8%/19-01.06.2029                           | USD     |                                  | 500'000   |              | 500'000                          | 396'118.77           | 0.12                                  |
| 2.375 BANK OF NOVA SCOTIA 2.375%/19-18.01.2023                  | USD     | 1'000'000                        |           | 1'000'000    |                                  |                      |                                       |
| 1.500 BNG BANK NV 1.5%/19-16.10.2024                            | USD     | 500'000                          |           | 500'000      |                                  |                      |                                       |
| - BNP PARIBAS FIX-TO-FRN FRN/21-30.06.2027                      | USD     | 500'000                          |           |              | 500'000                          | 385'564.81           | 0.11                                  |
| 0.950 CANADIAN IMPERIAL BANK 0.95%/20-23.10.2025                | USD     | 500'000                          |           |              | 500'000                          | 392'659.70           | 0.11                                  |
| - CITIGROUP INC FIX-TO-FRN FRN/20-15.05.2024                    | USD     | 750'000                          |           | 750'000      |                                  |                      |                                       |
| 1.625 EUROPEAN INVESTMENT BANK 1.625%/19-09.10.2029             | USD     | 500'000                          | 500'000   |              | 1'000'000                        | 740'772.23           | 0.22                                  |
| 2.125 EUROPEAN INVESTMENT BANK 2.125%/16-13.04.2026             | USD     | 1'000'000                        |           |              | 1'000'000                        | 803'784.63           | 0.23                                  |
| 2.875 EUROPEAN INVESTMENT BANK 2.875%/18-13.06.2025             | USD     | 1'000'000                        |           |              | 1'000'000                        | 821'955.29           | 0.24                                  |
| 2.125 IBRD T. -371- 2.125%/15-03.03.2025                        | USD     | 1'000'000                        |           | 500'000      | 500'000                          | 408'658.97           | 0.12                                  |
| 1.400 ING GROUP NV 1.4%/20-01.07.2026                           | USD     | 500'000                          |           |              | 500'000                          | 395'920.99           | 0.12                                  |
| 4.625 ING GROUP NV -144A- 4.625%/18-06.01.2026                  | USD     | 500'000                          |           |              | 500'000                          | 418'270.32           | 0.12                                  |
| 2.125 INTERNATIONAL FINANCE CORP IFC 2.125%/16-07.04.2026       | USD     | 600'000                          |           |              | 600'000                          | 482'154.63           | 0.14                                  |
| 3.125 INTL BK RECON & DEVELOP 3.125%/18-20.11.2025              | USD     | 1'000'000                        |           |              | 1'000'000                        | 822'325.60           | 0.24                                  |
| - JPMORGAN CHASE & CO FIX-TO-FRN FRN/21-09.08.2025              | USD     | 1'000'000                        |           |              | 1'000'000                        | 816'383.74           | 0.24                                  |
| 1.750 KFW 1.75%/19-14.09.2029                                   | USD     | 1'000'000                        |           |              | 1'000'000                        | 747'698.80           | 0.22                                  |
| 2.125 KOMMUNALBANKEN AS S. -4901- 2.125%/15-11.02.2025          | USD     | 1'000'000                        |           | 500'000      | 500'000                          | 408'663.18           | 0.12                                  |
| 1.625 KOMMUNINVEST I SVERIGE 1.625%/19-24.04.2023               | USD     | 500'000                          |           | 500'000      |                                  |                      |                                       |
| 0.375 KOMMUNINVEST I SVERIGE -144A- 0.375%/21-19.06.2024        | USD     | 1'000'000                        |           | 500'000      | 500'000                          | 411'339.54           | 0.12                                  |
| 1.625 KOMMUNINVEST I SVERIGE -144A- 1.625%/19-24.04.2023        | USD     | 1'000'000                        |           | 1'000'000    |                                  |                      |                                       |
| 3.875 KOREA WATER RESOURCES 3.875%/18-15.05.2023                | USD     | 250'000                          |           | 250'000      |                                  |                      |                                       |
| 3.625 LG CHEM LTD 3.625%/19-15.04.2029                          | USD     | 250'000                          |           |              | 250'000                          | 197'760.61           | 0.06                                  |
| 4.750 NEDER FINANCIERINGS-MAAT 4.75%/23-15.11.2028              | USD     |                                  | 500'000   |              | 500'000                          | 433'061.86           | 0.13                                  |
| 2.750 NEDER FINANCIERINGS-MAAT S. -2104711- 2.75%/19-20.02.2024 | USD     | 500'000                          |           | 500'000      |                                  |                      |                                       |
| 3.250 NSTAR ELECTRIC CO 3.25%/19-15.05.2029                     | USD     | 500'000                          |           |              | 500'000                          | 395'820.00           | 0.12                                  |
| 3.900 PEPSICO INC 3.9%/22-18.07.2032                            | USD     |                                  | 500'000   |              | 500'000                          | 412'223.25           | 0.12                                  |
| 1.500 PRUDENTIAL FINANCIAL INC S. -E- 1.5%/20-10.03.2026        | USD     | 500'000                          |           |              | 500'000                          | 392'508.21           | 0.11                                  |
| 1.150 ROYAL BANK OF CANADA S. -H- 1.15%/21-14.07.2026           | USD     |                                  | 500'000   |              | 500'000                          | 384'920.96           | 0.11                                  |
| 0.508 SUMITOMO MITSUI FINANCIAL GROUP INC 0.508%/21-12.01.2024  | USD     | 500'000                          |           |              | 500'000                          | 420'269.17           | 0.12                                  |
| 1.625 UNITED STATES OF AMERICA 1.625%/16-15.05.2026             | USD     | 500'000                          |           |              | 500'000                          | 397'141.35           | 0.12                                  |
| 2.250 UNITED STATES OF AMERICA 2.25%/17-15.11.2027              | USD     | 1'100'000                        |           |              | 1'100'000                        | 870'456.25           | 0.25                                  |
| 4.500 UNITED STATES OF AMERICA 4.5%/06-15.02.2036               | USD     |                                  | 4'000'000 |              | 4'000'000                        | 3'590'578.58         | 1.05                                  |
| 2.000 UNITED STATES OF AMERICA -B-2025 2%/15-15.02.2025         | USD     | 1'000'000                        |           | 500'000      | 500'000                          | 408'417.79           | 0.12                                  |
| 2.250 UNITED STATES OF AMERICA F 2024 2.25%/14-15.11.2024       | USD     | 1'000'000                        |           | 1'000'000    |                                  |                      |                                       |
| 2.000 UNITED STATES OF AMERICA S. B-2023 2%/13-15.02.2023       | USD     | 2'000'000                        |           | 2'000'000    |                                  |                      |                                       |
| 2.875 US TREASURY N/B S. -C-2032- 2.875%/22-15.05.2032          | USD     |                                  | 1'000'000 |              | 1'000'000                        | 780'343.29           | 0.23                                  |
| 3.875 VERIZON COMMUNICATIONS 3.875%/19-08.02.2029               | USD     | 500'000                          | 500'000   |              | 1'000'000                        | 816'139.67           | 0.24                                  |
| 5.250 VERIZON COMMUNICATIONS 5.25%/17-16.03.2037                | USD     |                                  | 500'000   |              | 500'000                          | 438'120.02           | 0.13                                  |

| Titelbezeichnung   | Währung | 31.12.2022<br>Anzahl/<br>Nominal | Käufe (1) | Verkäufe (1) | 31.12.2023<br>Anzahl/<br>Nominal | Kurswert CHF         | in % des<br>Gesamtfonds-<br>vermögens |
|--|---------|----------------------------------|-----------|--------------|----------------------------------|----------------------|---------------------------------------|
| 0.250 WI TREASURY N/B 0.25%/21-30.09.2023  | USD     | 2'000'000                        |           | 2'000'000    |                                  | 19'614'704.61        | 5.71                                  |
| <b>Total Anleihen</b>  |         |                                  |           |              |                                  | <b>32'186'635.17</b> | <b>9.37</b>                           |
| <b>Kollektive Kapitalanlagen</b>   |         |                                  |           |              |                                  |                      |                                       |
| <b>ENGLISCHES PFUND</b>  |         |                                  |           |              |                                  |                      |                                       |
| CREDIT SUISSE INDEX FUND (LUX) SICAV - CSIF (LUX) EQUITY UK ESG BLUE -<br>QBX GBP ACC- GBP                         | GBP     | 1'600                            |           | 203          | 1'397                            | 1'913'946.11         | 0.56                                  |
|  |         |                                  |           |              |                                  | <b>1'913'946.11</b>  | <b>0.56</b>                           |
| <b>EURO</b>  |         |                                  |           |              |                                  |                      |                                       |
| CREDIT SUISSE (LUX) EUROPEAN DIVIDEND PLUS EQUITY FUND -EB- EUR  | EUR     | 300                              |           |              | 300                              | 719'757.94           | 0.21                                  |
| CREDIT SUISSE INDEX FUND (LUX) SICAV - CSIF (LUX) EQUITY EMU ESG BLUE<br>-QBX EUR ACC- EUR                         | EUR     | 883                              | 2'555     | 299          | 3'139                            | 3'988'829.49         | 1.16                                  |
| NORDEA 1 SICAV - GLOBAL CLIMATE AND ENVIRONMENT FUND -BI- EUR  | EUR     | 20'000                           |           | 20'000       |                                  |                      |                                       |
|  |         |                                  |           |              |                                  | <b>4'708'587.43</b>  | <b>1.37</b>                           |
| <b>JAPANISCHER YEN</b>   |         |                                  |           |              |                                  |                      |                                       |
| CREDIT SUISSE INDEX FUND (LUX) SICAV - CSIF (LUX) EQUITY JAPAN ESG<br>BLUE -QBX- JPY                               | JPY     | 3'760                            | 359       | 267          | 3'852                            | 3'857'163.33         | 1.12                                  |
|  |         |                                  |           |              |                                  | <b>3'857'163.33</b>  | <b>1.12</b>                           |
| <b>KANADISCHER DOLLAR</b>  |         |                                  |           |              |                                  |                      |                                       |
| CREDIT SUISSE INDEX FUND (LUX) SICAV - CSIF(LUX ) EQUITY CANADA ESG<br>BLUE -QBX CAD ACC- CAD                      | CAD     | 2'260                            |           |              | 2'260                            | 1'797'767.64         | 0.52                                  |
|  |         |                                  |           |              |                                  | <b>1'797'767.64</b>  | <b>0.52</b>                           |
| <b>SCHWEIZER FRANKEN</b>   |         |                                  |           |              |                                  |                      |                                       |
| CREDIT SUISSE INDEX FUND (CH) - CSIF (CH) EQUITY SWITZERLAND TOTAL<br>MARKET ESG BLUE -OB-                         | CHF     | 7'599                            | 1'339     | 5'024        | 3'914                            | 4'191'580.88         | 1.22                                  |
| CREDIT SUISSE INDEX FUND (CH) I - CSIF (CH) I REAL ESTATE SWITZERLAND<br>BLUE -QA-                                 | CHF     | 1'000                            |           |              | 1'000                            | 1'490'790.00         | 0.43                                  |
| CREDIT SUISSE INSTITUTIONAL MASTER FUND UMBRELLA - EMERGING<br>MARKETS -EB-  | CHF     | 1'200                            |           | 1'200        |                                  |                      |                                       |
| CREDIT SUISSE SPECIAL PORTFOLIO SWISS REAL ESTATE SECURITIES -EB-  | CHF     | 5'335                            |           |              | 5'335                            | 9'684'198.70         | 2.82                                  |
| CS REAL ESTATE FUND INTERNATIONAL  | CHF     | 350                              |           |              | 350                              | 274'078.00           | 0.08                                  |
| CS REAL ESTATE SICAV-SIF I SICAV-SIF - CREDIT SUISSE (LUX) MULTI-<br>MANAGER REAL ESTATE GLOBAL -SBPH-I- USD       | CHF     | 325                              |           |              | 325                              | 400'239.52           | 0.12                                  |
| CSIMF INFLATION LINKED BONDS CHF -DB-  | CHF     | 600                              |           | 600          |                                  |                      |                                       |
|  |         |                                  |           |              |                                  | <b>16'040'887.10</b> | <b>4.67</b>                           |
| <b>US DOLLAR</b>   |         |                                  |           |              |                                  |                      |                                       |
| CREDIT SUISSE FUND (LUX) ASIA PACIFIC INCOME EQUITY FUND -DA- USD  | USD     | 660                              |           | 660          |                                  |                      |                                       |
| CREDIT SUISSE INDEX FUND (LUX) SICAV - CSIF (LUX) BOND GOVERNMENT<br>EMERGING MARKETS USD ESG BLUE                 | USD     |                                  | 1'900     | 1'900        |                                  |                      |                                       |
| CREDIT SUISSE INDEX FUND (LUX) SICAV - CSIF (LUX) EQUITY CHINA TOTAL<br>MARKET BLUE -OB- USD                       | USD     |                                  | 1'400     | 700          | 700                              | 516'266.50           | 0.15                                  |
| CREDIT SUISSE INDEX FUND (LUX) SICAV - CSIF (LUX) EQUITY EMERGING<br>MARKETS ESG BLUE -QBX- USD                    | USD     | 3'619                            | 4'407     |              | 8'026                            | 7'057'830.70         | 2.06                                  |
| CREDIT SUISSE INDEX FUND (LUX) SICAV - CSIF (LUX) EQUITY EMERGING<br>MARKETS MINIMUM VOLATILITY ESG BLUE -QBX- USD | USD     | 1'800                            |           | 1'800        |                                  |                      |                                       |
| CREDIT SUISSE INDEX FUND (LUX) SICAV - CSIF (LUX) EQUITY PACIFIC EX<br>JAPAN ESG BLUE -QBX USD ACC- USD            | USD     | 1'170                            |           |              | 1'170                            | 1'242'701.41         | 0.36                                  |
| CREDIT SUISSE INVESTMENT PARTNERS (LUX) GLOBAL BALANCED<br>CONVERTIBLE BOND FUND -EB- USD                          | USD     | 460                              |           | 460          |                                  |                      |                                       |
| CS INVESTMENT FUNDS 4 SICAV - CREDIT SUISSE (LUX) ALTERNATIVE<br>OPPORTUNITIES FUND -EA- USD                       | USD     | 9'900                            |           |              | 9'900                            | 8'139'690.35         | 2.37                                  |
| SIMAG INVESTMENT FUNDS SICAV - SIMAG SYSTEMATIC USA ESG EQUITY<br>FUND -SB- USD                                    | USD     | 11'500                           |           | 11'500       |                                  |                      |                                       |
|  |         |                                  |           |              |                                  | <b>16'956'488.96</b> | <b>4.94</b>                           |
| <b>Total Kollektive Kapitalanlagen</b>   |         |                                  |           |              |                                  | <b>45'274'840.57</b> | <b>13.18</b>                          |
| <b>Total Wertpapiere bewertet aufgrund von am Markt beobachtbaren Parametern</b>                                   |         |                                  |           |              |                                  | <b>77'461'475.74</b> | <b>22.56</b>                          |
| <b>Derivative Finanzinstrumente</b>  |         |                                  |           |              |                                  |                      |                                       |
| <b>Wertpapiere bewertet aufgrund von am Markt beobachtbaren Parametern</b>   |         |                                  |           |              |                                  |                      |                                       |
| <b>Devisentermingeschäfte</b>  |         |                                  |           |              |                                  |                      |                                       |
| Devisentermingeschäfte (siehe Liste)   |         |                                  |           |              |                                  | 2'125'811.47         | 0.62                                  |
| <b>Total Devisentermingeschäfte</b>  |         |                                  |           |              |                                  | <b>2'125'811.47</b>  | <b>0.62</b>                           |
| <b>Total Wertpapiere bewertet aufgrund von am Markt beobachtbaren Parametern</b>                                   |         |                                  |           |              |                                  | <b>2'125'811.47</b>  | <b>0.62</b>                           |

| Titelbezeichnung                          | Währung | 31.12.2022<br>Anzahl/<br>Nominal | Käufe (1) | Verkäufe (1) | 31.12.2023<br>Anzahl/<br>Nominal | Kurswert CHF          | in % des<br>Gesamtfonds-<br>vermögens |
|---|---------|----------------------------------|-----------|--------------|----------------------------------|-----------------------|---------------------------------------|
| <b>Total Derivative Finanzinstrumente</b> |         |                                  |           |              |                                  | <b>2'125'811.47</b>   | <b>0.62</b>                           |
| <b>Total Anlagen</b>                      |         |                                  |           |              |                                  | <b>337'294'815.57</b> | <b>98.22</b>                          |
| Bankguthaben auf Sicht                    |         |                                  |           |              |                                  | 4'229'527.86          | 1.23                                  |
| Bankguthaben auf Zeit                     |         |                                  |           |              |                                  | 0.00                  | 0.00                                  |
| Sonstige Vermögenswerte                   |         |                                  |           |              |                                  | 1'875'883.33          | 0.55                                  |
| <b>Gesamtfondsvermögen (GFV)</b>          |         |                                  |           |              |                                  | <b>343'400'226.76</b> | <b>100.00</b>                         |
| ./. Bankverbindlichkeiten                 |         |                                  |           |              |                                  | 0.00                  | 0.00                                  |
| ./. Andere Verbindlichkeiten              |         |                                  |           |              |                                  | 235'315.58            | 0.07                                  |
| ./. Andere Kredite                        |         |                                  |           |              |                                  | 0.00                  | 0.00                                  |
| <b>Nettofondsvermögen</b>                 |         |                                  |           |              |                                  | <b>343'164'911.18</b> | <b>99.93</b>                          |

(1) Umfassen auch Corporate Actions

**Summarische Gliederung des Portefeuilles gemäss KKV FINMA Art. 84 Absatz 2**

| Anlagekategorien   | Kurswert CHF          | in % des<br>Gesamtfonds-<br>vermögens |
|--|-----------------------|---------------------------------------|
| <b>Börsennotierte / an einem geregelten Markt gehandelte Wertpapiere; bewertet zu den Kursen, die am Hauptmarkt bezahlt werden</b> | <b>257'707'528.36</b> | <b>75.05</b>                          |
| <b>Wertpapiere bewertet aufgrund von am Markt beobachtbaren Parametern</b>   | <b>79'587'287.21</b>  | <b>23.18</b>                          |
| <b>Wertpapiere bewertet aufgrund geeigneten Bewertungsmodellen unter Berücksichtigung der aktuellen Marktgegebenheiten</b>         | <b>0.00</b>           | <b>0.00</b>                           |

**Aufstellung der Devisentermingeschäfte für die Zeit vom 1. Januar 2023 bis zum 31. Dezember 2023**

| Fälligkeit                          | Transaktion | Währung | Betrag     | Gegen | Gegenwert  | Devisengewinn/-verlust<br>Mandatswährung | in % des GFV |
|-------------------------------------|-------------|---------|------------|-------|------------|--|--------------|
| 09.02.2023                          | Bought      | CHF     | 14'776'245 | EUR   | 15'000'000 | 0.00                                     | 0.00         |
| 09.02.2023                          | Bought      | CHF     | 593'992    | EUR   | 600'000    | 0.00                                     | 0.00         |
| 09.02.2023                          | Bought      | CHF     | 2'607'990  | EUR   | 2'600'000  | 0.00                                     | 0.00         |
| 09.02.2023                          | Bought      | CHF     | 34'124'103 | USD   | 34'900'000 | 0.00                                     | 0.00         |
| 09.02.2023                          | Bought      | CHF     | 1'664'561  | USD   | 1'800'000  | 0.00                                     | 0.00         |
| 09.02.2023                          | Bought      | EUR     | 3'100'000  | CHF   | 3'054'734  | 0.00                                     | 0.00         |
| 12.05.2023                          | Bought      | CHF     | 14'921'805 | EUR   | 15'100'000 | 0.00                                     | 0.00         |
| 12.05.2023                          | Bought      | CHF     | 33'639'881 | USD   | 36'700'000 | 0.00                                     | 0.00         |
| 12.05.2023                          | Bought      | USD     | 1'600'000  | CHF   | 1'453'346  | 0.00                                     | 0.00         |
| 10.08.2023                          | Bought      | CHF     | 14'654'928 | EUR   | 15'100'000 | 0.00                                     | 0.00         |
| 10.08.2023                          | Bought      | CHF     | 30'941'352 | USD   | 35'100'000 | 0.00                                     | 0.00         |
| 09.11.2023                          | Bought      | CHF     | 14'417'782 | EUR   | 15'100'000 | 0.00                                     | 0.00         |
| 09.11.2023                          | Bought      | CHF     | 30'394'599 | USD   | 35'100'000 | 0.00                                     | 0.00         |
| 09.11.2023                          | Bought      | EUR     | 1'000'000  | CHF   | 959'800    | 0.00                                     | 0.00         |
| 09.11.2023                          | Bought      | USD     | 1'200'000  | CHF   | 1'087'628  | 0.00                                     | 0.00         |
| 09.11.2023                          | Bought      | USD     | 1'300'000  | CHF   | 1'181'484  | 0.00                                     | 0.00         |
| 07.02.2024                          | Bought      | CHF     | 13'478'402 | EUR   | 14'100'000 | 403'656.01                               | 0.12         |
| 07.02.2024                          | Bought      | CHF     | 29'038'320 | USD   | 32'600'000 | 1'722'155.46                             | 0.50         |
| <b>Total Devisentermingeschäfte</b> |             |         |            |       |            | <b>2'125'811.47</b>                      | <b>0.62</b>  |

**Ausgeliehene Wertpapierbestände (Lending and Borrowing)**

| Titelbezeichnung                        | Agent                      | Lending / Borrowing | 31.12.2023<br>Anzahl/<br>Nominal |
|---|----------------------------|---------------------|----------------------------------|
| AMUNDI INDEX EURO AGG SRI-C             | Credit Suisse (Schweiz) AG | Lending             | 21'458                           |
| ASIAN DEVELOPMENT BANK 2.1250 19/03/25  | Credit Suisse (Schweiz) AG | Lending             | 292'000                          |
| BALOISE HOLDING AG 0.1250 27/06/30      | Credit Suisse (Schweiz) AG | Lending             | 500'000                          |
| BALOISE HOLDING AG 0.5000 28/11/25      | Credit Suisse (Schweiz) AG | Lending             | 200'000                          |
| BANCO SANTANDER SA 0.2000 19/11/27      | Credit Suisse (Schweiz) AG | Lending             | 500'000                          |
| BUNDESREPUB. DEUTSCHLAN 0.5000 15/02/25 | Credit Suisse (Schweiz) AG | Lending             | 750'000                          |
| EDP FINANCE BV 1.8750 13/10/25          | Credit Suisse (Schweiz) AG | Lending             | 600'000                          |
| EUROPEAN INVESTMENT BAN 2.1250 13/04/26 | Credit Suisse (Schweiz) AG | Lending             | 900'000                          |
| GIVAUDAN SA 0.1500 10/11/28             | Credit Suisse (Schweiz) AG | Lending             | 175'000                          |
| IBERDROLA FINANZAS SAU 1.2500 28/10/26  | Credit Suisse (Schweiz) AG | Lending             | 100'000                          |
| ING GROEP NV 4.6250 06/01/26            | Credit Suisse (Schweiz) AG | Lending             | 300'000                          |
| INTL BK RECON & DEVELOP 3.1250 20/11/25 | Credit Suisse (Schweiz) AG | Lending             | 200'000                          |
| INTL FINANCE CORP 2.1250 07/04/26       | Credit Suisse (Schweiz) AG | Lending             | 200'000                          |
| PEPSICO INC 3.9000 18/07/32             | Credit Suisse (Schweiz) AG | Lending             | 500'000                          |
| REPUBLIC OF POLAND 1.1250 07/08/26      | Credit Suisse (Schweiz) AG | Lending             | 399'000                          |
| SONOVA HOLDING AG 1.9500 12/12/30       | Credit Suisse (Schweiz) AG | Lending             | 300'000                          |
| SWISSCOM AG 0.1300 18/09/31             | Credit Suisse (Schweiz) AG | Lending             | 250'000                          |
| SWISSINVEST REAL ESTATE FUND            | Credit Suisse (Schweiz) AG | Lending             | 192                              |
| VERIZON COMMUNICATIONS 3.8750 08/02/29  | Credit Suisse (Schweiz) AG | Lending             | 1'000'000                        |

116 **Credit Suisse (CH) Privilege 35 CHF**  
 Jahresbericht per 31. Dezember 2023

**Ausgeliehene Wertpapierbestände (Lending and Borrowing)**

| Titelbezeichnung                       | Agent                      | Lending / Borrowing | 31.12.2023<br>Anzahl/ Nominal |
|--|----------------------------|---------------------|-------------------------------|
| VERIZON COMMUNICATIONS 5.2500 16/03/37 | Credit Suisse (Schweiz) AG | Lending             | 500'000                       |
| VODAFONE GROUP PLC 0.6250 15/03/27     | Credit Suisse (Schweiz) AG | Lending             | 250'000                       |

**Ausserbilanzgeschäfte**

|   | 31.12.2023                             |                 | 31.12.2022                             |                 |
|---|--|-----------------|--|-----------------|
|   | Basiswertäquivalent in<br>Fondswährung | in %<br>des NFV | Basiswertäquivalent in<br>Fondswährung | in %<br>des NFV |
| <b>Engagement erhöhende Derivatpositionen:</b>    |  |                 |  |                 |
| - Währungsrisiko                                  | 0.00                                   | 0.00%           | 0.00                                   | 0.00%           |
| <b>Total engagement erhöhende Positionen</b>      | <b>0.00</b>                            | <b>0.00%</b>    | <b>0.00</b>                            | <b>0.00%</b>    |
| <b>Engagement reduzierende Derivatpositionen:</b> |  |                 |  |                 |
| - Währungsrisiko                                  | 40'545'713.70                          | 11.82%          | 45'706'536.91                          | 12.17%          |
| <b>Total engagement reduzierende Positionen</b>   | <b>40'545'713.70</b>                   | <b>11.82%</b>   | <b>45'706'536.91</b>                   | <b>12.17%</b>   |

**Volumen der verliehenen Wertpapiere und Provisionserträge aus Wertpapieren**

|                                      | 31.12.2023   |       | 31.12.2022    |       |
|--------------------------------------|--------------|-------|---------------|-------|
| - Volumen der verliehenen Positionen | 7'906'304.07 | 2.30% | 32'631'805.99 | 8.69% |
| - Kommission Einkommen               | 42'319.65    | 0.01% | 52'262.30     | 0.01% |

## Kurze Übersicht

| Kennzahlen                            | Währung | 31.12.2023 | 31.12.2022 | 31.12.2021 |
|---------------------------------------|---------|------------|------------|------------|
| <b>Konsolidierung</b>                 |         |            |            |            |
| Nettofondsvermögen in Mio.            | CHF     | 1'630.76   | 1'775.64   | 2'015.37   |
| <b>Anteilklasse A</b>                 |         |            |            |            |
| Nettofondsvermögen in Mio.            | CHF     | 151.11     | 137.60     | 164.41     |
| Inventarwert pro Anteil               | CHF     | -          | -          | 137.56     |
| Inventarwert pro Anteil (Swung NAV)   | CHF     | 123.94     | 118.99     | -          |
| Inventarwert pro Anteil (Unswung NAV) | CHF     | 124.08     | 119.28     | -          |
| <b>Anteilklasse B</b>                 |         |            |            |            |
| Nettofondsvermögen in Mio.            | CHF     | 56.76      | 60.79      | 72.59      |
| Inventarwert pro Anteil               | CHF     | -          | -          | 130.10     |
| Inventarwert pro Anteil (Swung NAV)   | CHF     | 117.84     | 112.80     | -          |
| Inventarwert pro Anteil (Unswung NAV) | CHF     | 117.97     | 113.08     | -          |
| <b>Anteilklasse IA</b>                |         |            |            |            |
| Nettofondsvermögen in Mio.            | CHF     | 83.01      | 87.03      | 87.58      |
| Inventarwert pro Anteil               | CHF     | -          | -          | 1'456.19   |
| Inventarwert pro Anteil (Swung NAV)   | CHF     | 1'321.25   | 1'264.78   | -          |
| Inventarwert pro Anteil (Unswung NAV) | CHF     | 1'322.75   | 1'267.90   | -          |
| <b>Anteilklasse UA</b>                |         |            |            |            |
| Nettofondsvermögen in Mio.            | CHF     | 670.31     | 767.96     | 901.10     |
| Inventarwert pro Anteil               | CHF     | -          | -          | 128.81     |
| Inventarwert pro Anteil (Swung NAV)   | CHF     | 116.58     | 111.69     | -          |
| Inventarwert pro Anteil (Unswung NAV) | CHF     | 116.71     | 111.97     | -          |
| <b>Anteilklasse UB</b>                |         |            |            |            |
| Nettofondsvermögen in Mio.            | CHF     | 453.02     | 485.38     | 544.09     |
| Inventarwert pro Anteil               | CHF     | -          | -          | 131.62     |
| Inventarwert pro Anteil (Swung NAV)   | CHF     | 119.69     | 114.35     | -          |
| Inventarwert pro Anteil (Unswung NAV) | CHF     | 119.83     | 114.63     | -          |
| <b>Anteilklasse IA25</b>              |         |            |            |            |
| Nettofondsvermögen in Mio.            | CHF     | 202.93     | 205.89     | 208.70     |
| Inventarwert pro Anteil               | CHF     | -          | -          | 1'139.66   |
| Inventarwert pro Anteil (Swung NAV)   | CHF     | 1'035.29   | 990.71     | -          |
| Inventarwert pro Anteil (Unswung NAV) | CHF     | 1'036.46   | 993.16     | -          |
| <b>Anteilklasse EA</b>                |         |            |            |            |
| Nettofondsvermögen in Mio.            | CHF     | 13.63      | 30.98      | 36.90      |
| Inventarwert pro Anteil               | CHF     | -          | -          | 1'129.05   |
| Inventarwert pro Anteil (Swung NAV)   | CHF     | 1'024.79   | 980.65     | -          |
| Inventarwert pro Anteil (Unswung NAV) | CHF     | 1'025.95   | 983.08     | -          |

## Verwendung des Erfolges

### Ausschüttung pro Anteil

#### 1. Für in der Schweiz und im Ausland domizilierte Anteilinhaber

| Ausschüttung 2023                         | Anteilklasse A |              | Anteilklasse IA |              | Anteilklasse UA |              |
|---|----------------|--------------|-----------------|--------------|-----------------|--------------|
| Bruttoausschüttung aus Ertrag             | CHF            | 0.600        | CHF             | 13.000       | CHF             | 0.700        |
| ./. 35% Eidgenössische Verrechnungssteuer | CHF            | 0.210        | CHF             | 4.550        | CHF             | 0.245        |
| <b>Nettoausschüttung aus Ertrag</b>       | <b>CHF</b>     | <b>0.390</b> | <b>CHF</b>      | <b>8.450</b> | <b>CHF</b>      | <b>0.455</b> |
| <b>Coupon Nr. Ertrag</b>                  |                | <b>28</b>    |                 | <b>20</b>    |                 | <b>15</b>    |

#### 2. Für in der Schweiz und im Ausland domizilierte Anteilinhaber (verrechnungssteuerbefreite Erträge aus direktem Immobilienbesitz)

| Ausschüttung 2023                   | Anteilklasse A |              | Anteilklasse IA |              | Anteilklasse UA |              |
|-------------------------------------|----------------|--------------|-----------------|--------------|-----------------|--------------|
| Bruttoausschüttung aus Ertrag       | CHF            | 0.010        | CHF             | 0.290        | CHF             | 0.010        |
| <b>Nettoausschüttung aus Ertrag</b> | <b>CHF</b>     | <b>0.010</b> | <b>CHF</b>      | <b>0.290</b> | <b>CHF</b>      | <b>0.010</b> |
| <b>Coupon Nr. Ertrag</b>            |                | <b>29</b>    |                 | <b>21</b>    |                 | <b>16</b>    |

Zahlbar ab 15.02.2024 bei der CREDIT SUISSE (SCHWEIZ) AG und deren sämtlichen Geschäftsstellen in der Schweiz.

#### 1. Für in der Schweiz und im Ausland domizilierte Anteilinhaber

| Ausschüttung 2023                         | Anteilklasse IA25 |              | Anteilklasse EA |              |
|---|-------------------|--------------|-----------------|--------------|
| Bruttoausschüttung aus Ertrag             | CHF               | 13.000       | CHF             | 10.000       |
| ./. 35% Eidgenössische Verrechnungssteuer | CHF               | 4.550        | CHF             | 3.500        |
| <b>Nettoausschüttung aus Ertrag</b>       | <b>CHF</b>        | <b>8.450</b> | <b>CHF</b>      | <b>6.500</b> |
| <b>Coupon Nr. Ertrag</b>                  |                   | <b>9</b>     |                 | <b>9</b>     |

#### 2. Für in der Schweiz und im Ausland domizilierte Anteilinhaber (verrechnungssteuerbefreite Erträge aus direktem Immobilienbesitz)

| Ausschüttung 2023                   | Anteilklasse IA25 |              | Anteilklasse EA |              |
|-------------------------------------|-------------------|--------------|-----------------|--------------|
| Bruttoausschüttung aus Ertrag       | CHF               | 0.280        | CHF             | 0.190        |
| <b>Nettoausschüttung aus Ertrag</b> | <b>CHF</b>        | <b>0.280</b> | <b>CHF</b>      | <b>0.190</b> |
| <b>Coupon Nr. Ertrag</b>            |                   | <b>10</b>    |                 | <b>10</b>    |

Zahlbar ab 15.02.2024 bei der CREDIT SUISSE (SCHWEIZ) AG und deren sämtlichen Geschäftsstellen in der Schweiz.

### Thesaurierung pro Anteil

#### 1. Für in der Schweiz und im Ausland domizilierte Anteilinhaber

| Thesaurierung 2023                               | Anteilklasse B |              | Anteilklasse UB |              |
|--|----------------|--------------|-----------------|--------------|
| Zur Thesaurierung verfügbarer Erfolg             | CHF            | 0.531        | CHF             | 0.694        |
| ./. 35% Eidgenössische Verrechnungssteuer        | CHF            | 0.186        | CHF             | 0.243        |
| <b>Zur Thesaurierung zurückbehaltener Erfolg</b> | <b>CHF</b>     | <b>0.345</b> | <b>CHF</b>      | <b>0.451</b> |
| <b>Coupon Nr. Ertrag</b>                         |                | <b>16</b>    |                 | <b>17</b>    |

#### 2. Für in der Schweiz und im Ausland domizilierte Anteilinhaber (verrechnungssteuerbefreite Erträge aus direktem Immobilienbesitz)

| Thesaurierung 2023                               | Anteilklasse B |              | Anteilklasse UB |              |
|--|----------------|--------------|-----------------|--------------|
| Zur Thesaurierung verfügbarer Erfolg             | CHF            | 0.010        | CHF             | 0.016        |
| <b>Zur Thesaurierung zurückbehaltener Erfolg</b> | <b>CHF</b>     | <b>0.010</b> | <b>CHF</b>      | <b>0.016</b> |
| <b>Coupon Nr. Ertrag</b>                         |                | <b>17</b>    |                 | <b>18</b>    |

## Wechselkurse

| Wechselkurse per     | 31.12.2023 |
|----------------------|------------|
| AUSTRALISCHER DOLLAR | 0.574279   |
| ENGLISCHES PFUND     | 1.072875   |
| EURO                 | 0.929700   |
| JAPANISCHER YEN      | 0.005970   |
| KANADISCHER DOLLAR   | 0.638267   |
| NORWEGISCHE KRONE    | 0.082872   |
| SCHWEIZER FRANKEN    | 1.000000   |
| US DOLLAR            | 0.841624   |

## Vermögensrechnung per 31. Dezember 2023

|  | Konsolidierung          |                         |
|--|-------------------------|-------------------------|
|  | 31.12.2023              | 31.12.2022              |
|  | CHF                     | CHF                     |
| <b>Vermögenswerte</b>  |                         |                         |
| Bankguthaben, einschliesslich Treuhandanlagen bei Drittbanken, aufgeteilt in:                      |                         |                         |
| - Sichtguthaben  | 20'555'504.05           | 32'246'256.51           |
| Effekten, einschliesslich ausgeliehene und pensionierte Effekten, aufgeteilt in:                   |                         |                         |
| - Obligationen, Wandelobligationen, Optionsanleihen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte | 732'691'904.15          | 840'522'443.87          |
| - Aktien und sonstige Beteiligungswertpapiere und -rechte  | 353'489'920.00          | 395'696'000.00          |
| - Anteile anderer kollektiver Kapitalanlagen   | 509'033'561.40          | 489'817'192.36          |
| Derivative Finanzinstrumente   | 10'800'459.39           | 8'912'973.07            |
| Sonstige Vermögenswerte  | 5'480'731.56            | 9'913'840.98            |
| <b>Gesamtfondsvermögen abzüglich:</b>  | <b>1'632'052'080.55</b> | <b>1'777'108'706.79</b> |
| Andere Verbindlichkeiten   | 1'289'349.95            | 1'471'296.65            |
| <b>Nettofondsvermögen</b>  | <b>1'630'762'730.60</b> | <b>1'775'637'410.14</b> |
| <b>Veränderung des Nettofondsvermögens</b>   |                         |                         |
| Nettofondsvermögen zu Beginn der Berichtsperiode   | 1'775'637'410.14        | 2'015'369'908.95        |
| Ausschüttungen   | -7'210'426.74           | -5'552'594.43           |
| Ablieferung Verrechnungssteuer   | -889'774.98             | -748'368.40             |
| Ausgaben von Anteilen  | 102'969'113.05          | 245'510'478.97          |
| Rücknahmen von Anteilen  | -320'615'776.92         | -217'306'718.52         |
| Sonstiges aus Anteilverkehr  | 6'821'232.73            | -2'131'361.08           |
| Gesamterfolg   | 74'050'953.32           | -259'503'935.35         |
| <b>Nettofondsvermögen am Ende der Berichtsperiode</b>  | <b>1'630'762'730.60</b> | <b>1'775'637'410.14</b> |
| <b>Entwicklung der Anteile im Umlauf</b>   |                         |                         |
| Bestand zu Beginn der Berichtsperiode  | 13'091'565.152          | 13'158'367.425          |
| Ausgegebene Anteile  | 768'329.892             | 1'562'171.637           |
| Zurückgenommene Anteile  | -2'365'333.935          | -1'628'973.910          |
| <b>Bestand am Ende der Berichtsperiode</b>   | <b>11'494'561.109</b>   | <b>13'091'565.152</b>   |
| <b>Währung Anteilklasse</b>  |                         |                         |
| <b>Inventarwert pro Anteil (Swung NAV)</b>   |                         |                         |
| <b>Inventarwert pro Anteil (Unswing NAV)</b>   |                         |                         |



| Anteilklasse A             |                            | Anteilklasse B             |                            | Anteilklasse IA            |                            | Anteilklasse UA            |                            |
|----------------------------|----------------------------|----------------------------|----------------------------|----------------------------|----------------------------|----------------------------|----------------------------|
| 01.01.2023 -<br>31.12.2023 | 01.01.2022 -<br>31.12.2022 | 01.01.2023 -<br>31.12.2023 | 01.01.2022 -<br>31.12.2022 | 01.01.2023 -<br>31.12.2023 | 01.01.2022 -<br>31.12.2022 | 01.01.2023 -<br>31.12.2023 | 01.01.2022 -<br>31.12.2022 |
| CHF                        | CHF                        | CHF                        | CHF                        | CHF                        | CHF                        | CHF                        | CHF                        |
| 137'603'338.33             | 164'408'299.65             | 60'792'762.29              | 72'586'432.85              | 87'030'498.81              | 87'582'527.15              | 767'956'006.41             | 901'102'829.32             |
| -624'847.95                | -572'914.42                | 0.00                       | 0.00                       | -708'010.54                | -467'872.56                | -3'471'424.84              | -2'764'356.87              |
| 0.00                       | 0.00                       | -98'693.13                 | -85'620.78                 | 0.00                       | 0.00                       | 0.00                       | 0.00                       |
| 26'277'573.43              | 10'163'873.23              | 5'075'745.74               | 11'300'274.81              | 3'974'970.40               | 29'149'757.56              | 24'672'033.78              | 74'414'822.06              |
| -18'583'140.02             | -15'323'985.19             | -11'616'943.84             | -13'731'282.58             | -11'629'284.68             | -17'515'673.13             | -152'401'329.26            | -88'917'670.44             |
| -42'277.98                 | -496'376.15                | 182'687.96                 | -195'968.34                | 321'062.62                 | 671'709.68                 | 3'651'488.57               | -2'843'882.20              |
| 6'481'164.67               | -20'575'558.79             | 2'424'021.11               | -9'081'073.67              | 4'018'142.89               | -12'389'949.89             | 29'906'833.07              | -113'035'735.46            |
| <b>151'111'810.48</b>      | <b>137'603'338.33</b>      | <b>56'759'580.13</b>       | <b>60'792'762.29</b>       | <b>83'007'379.50</b>       | <b>87'030'498.81</b>       | <b>670'313'607.73</b>      | <b>767'956'006.41</b>      |
| 1'153'611.993              | 1'195'166.707              | 537'603.812                | 557'932.741                | 68'641.195                 | 60'144.788                 | 6'858'566.530              | 6'995'513.691              |
| 216'945.839                | 80'046.405                 | 43'742.045                 | 93'558.777                 | 3'095.000                  | 22'228.893                 | 215'018.764                | 620'179.004                |
| -152'691.798               | -121'601.119               | -100'226.006               | -113'887.706               | -8'982.460                 | -13'732.486                | -1'330'392.291             | -757'126.165               |
| <b>1'217'866.034</b>       | <b>1'153'611.993</b>       | <b>481'119.851</b>         | <b>537'603.812</b>         | <b>62'753.735</b>          | <b>68'641.195</b>          | <b>5'743'193.003</b>       | <b>6'858'566.530</b>       |
| (CHF)                      | (CHF)                      | (CHF)                      | (CHF)                      | (CHF)                      | (CHF)                      | (CHF)                      | (CHF)                      |
| <b>123.94</b>              | <b>118.99</b>              | <b>117.84</b>              | <b>112.80</b>              | <b>1'321.25</b>            | <b>1'264.78</b>            | <b>116.58</b>              | <b>111.69</b>              |
| <b>124.08</b>              | <b>119.28</b>              | <b>117.97</b>              | <b>113.08</b>              | <b>1'322.75</b>            | <b>1'267.90</b>            | <b>116.71</b>              | <b>111.97</b>              |

|   | <b>Anteilklasse UB</b>             |                                    |
|---|------------------------------------|------------------------------------|
|   | <b>01.01.2023 -<br/>31.12.2023</b> | <b>01.01.2022 -<br/>31.12.2022</b> |
|   | <b>CHF</b>                         | <b>CHF</b>                         |
| <b>Veränderung des Nettofondsvermögens</b>            |                                    |                                    |
| Nettofondsvermögen zu Beginn der Berichtsperiode      | 485'380'117.95                     | 544'091'212.14                     |
| Ausschüttungen  | 0.00                               | 0.00                               |
| Ablieferung Verrechnungssteuer                        | -791'081.85                        | -662'747.62                        |
| Ausgaben von Anteilen                                 | 32'920'989.07                      | 88'639'712.75                      |
| Rücknahmen von Anteilen                               | -86'155'891.39                     | -73'408'759.57                     |
| Sonstiges aus Anteilverkehr                           | 1'480'365.37                       | -1'886'003.93                      |
| Gesamterfolg  | 20'181'419.38                      | -71'393'295.82                     |
| <b>Nettofondsvermögen am Ende der Berichtsperiode</b> | <b>453'015'918.53</b>              | <b>485'380'117.95</b>              |
| <b>Entwicklung der Anteile im Umlauf</b>              |                                    |                                    |
| Bestand zu Beginn der Berichtsperiode                 | 4'234'314.571                      | 4'133'804.199                      |
| Ausgegebene Anteile                                   | 279'579.484                        | 715'254.481                        |
| Zurückgenommene Anteile                               | -733'335.963                       | -614'744.109                       |
| <b>Bestand am Ende der Berichtsperiode</b>            | <b>3'780'558.092</b>               | <b>4'234'314.571</b>               |
| <b>Währung Anteilklasse</b>                           | <b>(CHF)</b>                       | <b>(CHF)</b>                       |
| <b>Inventarwert pro Anteil (Swung NAV)</b>            | <b>119.69</b>                      | <b>114.35</b>                      |
| <b>Inventarwert pro Anteil (Unswung NAV)</b>          | <b>119.83</b>                      | <b>114.63</b>                      |

| Anteilklasse IA25          |                            | Anteilklasse EA            |                            |
|----------------------------|----------------------------|----------------------------|----------------------------|
| 01.01.2023 -<br>31.12.2023 | 01.01.2022 -<br>31.12.2022 | 01.01.2023 -<br>31.12.2023 | 01.01.2022 -<br>31.12.2022 |
| CHF                        | CHF                        | CHF                        | CHF                        |
| 205'890'105.55             | 208'701'930.94             | 30'984'581.03              | 36'896'677.15              |
| -2'174'442.51              | -1'564'453.39              | -231'700.90                | -182'997.19                |
| 0.00                       | 0.00                       | 0.00                       | 0.00                       |
| 6'845'196.90               | 30'690'573.47              | 3'202'603.73               | 1'151'465.09               |
| -18'553'375.73             | -5'850'725.61              | -21'675'812.00             | -2'558'622.00              |
| 500'876.04                 | 2'517'861.18               | 727'030.17                 | 101'298.66                 |
| 10'418'828.33              | -28'605'081.04             | 620'543.87                 | -4'423'240.68              |
| <b>202'927'188.58</b>      | <b>205'890'105.55</b>      | <b>13'627'245.90</b>       | <b>30'984'581.03</b>       |
| 207'309.062                | 183'126.033                | 31'517.989                 | 32'679.266                 |
| 6'768.949                  | 29'758.213                 | 3'179.811                  | 1'145.864                  |
| -18'290.183                | -5'575.184                 | -21'415.234                | -2'307.141                 |
| <b>195'787.828</b>         | <b>207'309.062</b>         | <b>13'282.566</b>          | <b>31'517.989</b>          |
| (CHF)                      | (CHF)                      | (CHF)                      | (CHF)                      |
| <b>1'035.29</b>            | <b>990.71</b>              | <b>1'024.79</b>            | <b>980.65</b>              |
| <b>1'036.46</b>            | <b>993.16</b>              | <b>1'025.95</b>            | <b>983.08</b>              |

## Erfolgsrechnung für die Zeit vom 1. Januar 2023 bis zum 31. Dezember 2023

|  | Konsolidierung             |                            |
|--|----------------------------|----------------------------|
|  | 01.01.2023 -<br>31.12.2023 | 01.01.2022 -<br>31.12.2022 |
|  | CHF                        | CHF                        |
| <b>Ertrag</b>  |                            |                            |
| Erträge der Bankguthaben   | 505'265.23                 | 149'518.69                 |
| Negativzinsen  | -2'630.16                  | -289'455.16                |
| Erträge der Effektleihen   | 89'499.20                  | 181'287.50                 |
| Erträge der Ausgleichszahlungen  | 523'590.75                 | 851'501.66                 |
| Erträge der Effekten, aufgeteilt in:   |                            |                            |
| - Obligationen, Wandelobligationen, Optionsanleihen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte     | 7'720'178.31               | 6'403'267.22               |
| - Aktien und sonstige Beteiligungswertpapiere und -rechte, einschliesslich Gratisaktien                | 11'555'632.77              | 10'212'519.00              |
| - Anteile anderer kollektiver Kapitalanlagen   | 7'811'412.00               | 8'182'716.53               |
| Erträge aus kollektiven Kapitalanlagen mit Immobilien im Direktbesitz                                  | 640'216.68                 | 554'706.80                 |
| Einkauf in laufende Nettoerträge bei der Ausgabe von Anteilen  | 249'972.70                 | 752'976.64                 |
| <b>Total Erträge</b>   | <b>29'093'137.48</b>       | <b>26'999'038.88</b>       |
| <b>Aufwendungen</b>  |                            |                            |
| Passivzinsen   | 3'077.59                   | 3.55                       |
| Prüfaufwand  | 14'494.70                  | 14'512.48                  |
| Reglementarische Vergütung an:   |                            |                            |
| - die Fondsleitung   | 16'196'466.06              | 17'767'178.14              |
| - die Depotbank  | 731'381.27                 | 796'313.33                 |
| Teilübertrag von Aufwendungen auf kollektiven Kapitalanlagen mit Immobilien im Direktbesitz            | -376'885.55                | -395'741.21                |
| Aufwände aus kollektiven Kapitalanlagen mit Immobilien im Direktbesitz                                 | 376'885.55                 | 395'741.21                 |
| Sonstige Aufwendungen  | 17'175.40                  | 15'300.37                  |
| Ausrichtung laufender Nettoerträge bei Rücknahme von Anteilen  | 1'423'486.77               | 546'969.72                 |
| <b>Total Aufwendungen</b>  | <b>18'386'081.79</b>       | <b>19'140'277.59</b>       |
| <b>Nettoertrag vor steuerlichen Anpassungen</b>  | <b>10'707'055.69</b>       | <b>7'858'761.29</b>        |
| Steuerliche Anpassungen wegen Erträgen aus Zielfonds   | 118'421.33                 | 2'121'283.33               |
| <b>Nettoertrag nach steuerlichen Anpassungen</b>   | <b>10'825'477.02</b>       | <b>9'980'044.62</b>        |
| Realisierte Kapitalgewinne und -verluste   | 3'905'266.90               | -14'440'229.42             |
| Teilübertrag von steuerlichem Ausgleich wegen Erträgen aus Zielfonds                                   | -118'421.33                | -2'121'283.33              |
| <b>Realisierter Erfolg</b>   | <b>14'612'322.59</b>       | <b>-6'581'468.13</b>       |
| Nicht realisierte Kapitalgewinne und -verluste   | 59'438'630.73              | -252'922'467.22            |
| <b>Gesamterfolg</b>  | <b>74'050'953.32</b>       | <b>-259'503'935.35</b>     |
| <b>Verwendung des Erfolgs</b>  |                            |                            |
| Nettoertrag des Rechnungsjahres  | 10'825'477.02              | 9'980'044.62               |
| Vortrag des Vorjahres aus kollektiven Kapitalanlagen mit Immobilien im Direktbesitz                    | 20'562.58                  | 41'075.42                  |
| Vortrag des Vorjahres  | 2'491'924.35               | 2'256'366.37               |
| <b>Zur Verteilung verfügbarer Erfolg</b>   | <b>13'337'963.95</b>       | <b>12'277'486.41</b>       |
| Zur Ausschüttung an die Anlegerinnen und Anleger vorgesehener Erfolg                                   | 8'244'820.70               | 7'061'047.93               |
| Zur Ausschüttung bestimmter Erfolg aus Kapitalanlagen mit Immobilien im Direktbesitz                   | 145'153.45                 | 146'573.99                 |
| Ablieferung/Ausschüttung der Verrechnungssteuer (35%)  | 1'007'110.64               | 882'093.57                 |
| Zur Wiederanlage zurückbehaltener Ertrag (65%)   | 1'870'353.26               | 1'638'178.91               |
| Zur Wiederanlage zurückbehaltener Ertrag aus kollektiven Kapitalanlagen mit Immobilien im Direktbesitz | 64'442.41                  | 37'105.08                  |
| Vortrag Nettoerträge aus kollektiven Kapitalanlagen mit Immobilien im Direktbesitz                     | 47'471.34                  | 20'562.58                  |
| Vortrag auf neue Rechnung  | 1'958'612.15               | 2'491'924.35               |

| Anteilklasse A             |                            | Anteilklasse B             |                            | Anteilklasse IA            |                            | Anteilklasse UA            |                            |
|----------------------------|----------------------------|----------------------------|----------------------------|----------------------------|----------------------------|----------------------------|----------------------------|
| 01.01.2023 -<br>31.12.2023 | 01.01.2022 -<br>31.12.2022 | 01.01.2023 -<br>31.12.2023 | 01.01.2022 -<br>31.12.2022 | 01.01.2023 -<br>31.12.2023 | 01.01.2022 -<br>31.12.2022 | 01.01.2023 -<br>31.12.2023 | 01.01.2022 -<br>31.12.2022 |
| CHF                        | CHF                        | CHF                        | CHF                        | CHF                        | CHF                        | CHF                        | CHF                        |
| 45'105.56                  | 11'554.38                  | 17'627.28                  | 5'203.43                   | 26'136.99                  | 7'232.23                   | 212'335.77                 | 65'409.15                  |
| -212.19                    | -22'677.29                 | -91.03                     | -10'348.68                 | -134.71                    | -13'177.64                 | -1'124.20                  | -127'643.61                |
| 7'833.20                   | 14'226.54                  | 3'113.32                   | 6'342.20                   | 4'618.34                   | 8'399.24                   | 37'720.33                  | 79'841.26                  |
| 46'728.83                  | 66'526.31                  | 18'200.57                  | 29'784.30                  | 26'974.16                  | 39'532.65                  | 219'441.98                 | 374'678.84                 |
| 678'315.84                 | 500'912.97                 | 268'620.81                 | 224'252.79                 | 398'186.27                 | 298'695.76                 | 3'249'673.80               | 2'815'710.77               |
| 1'015'520.54               | 807'053.32                 | 400'105.12                 | 364'099.04                 | 595'358.44                 | 448'402.52                 | 4'877'910.98               | 4'518'702.54               |
| 714'665.88                 | 636'681.62                 | 271'407.75                 | 282'128.79                 | 399'036.65                 | 391'379.47                 | 3'230'159.25               | 3'561'124.69               |
| 56'196.39                  | 43'974.53                  | 22'258.61                  | 19'848.40                  | 32'818.27                  | 24'582.44                  | 269'752.26                 | 245'528.01                 |
| 23'147.62                  | 9'432.02                   | 2'453.17                   | 6'006.04                   | 9'424.66                   | 202'295.41                 | 78'433.22                  | 169'987.10                 |
| <b>2'587'301.67</b>        | <b>2'067'684.40</b>        | <b>1'003'695.60</b>        | <b>927'316.31</b>          | <b>1'492'419.07</b>        | <b>1'407'342.08</b>        | <b>12'174'303.39</b>       | <b>11'703'338.75</b>       |
| 85.18                      | 0.31                       | 103.74                     | 0.13                       | 146.00                     | 0.17                       | 1'456.06                   | 1.50                       |
| 1'275.98                   | 1'134.56                   | 504.32                     | 508.11                     | 748.16                     | 678.06                     | 6'096.53                   | 6'380.90                   |
| 1'851'086.57               | 1'796'700.75               | 733'365.65                 | 804'347.80                 | 554'821.42                 | 544'764.47                 | 7'424'406.40               | 8'450'329.80               |
| 64'221.29                  | 62'334.56                  | 25'443.30                  | 27'905.89                  | 37'727.84                  | 37'043.93                  | 307'841.25                 | 350'379.55                 |
| -42'041.01                 | -39'814.00                 | -16'896.35                 | -17'973.36                 | -13'153.93                 | -12'034.17                 | -172'775.18                | -188'308.05                |
| 42'041.01                  | 39'814.00                  | 16'896.35                  | 17'973.36                  | 13'153.93                  | 12'034.17                  | 172'775.18                 | 188'308.05                 |
| 1'543.42                   | 1'200.79                   | 597.09                     | 536.35                     | 876.55                     | 709.12                     | 7'149.19                   | 6'714.57                   |
| 58'612.39                  | 23'081.07                  | 18'855.44                  | 9'416.58                   | 101'392.82                 | 128'691.69                 | 667'069.25                 | 232'930.70                 |
| <b>1'976'824.83</b>        | <b>1'884'452.04</b>        | <b>778'869.54</b>          | <b>842'714.86</b>          | <b>695'712.79</b>          | <b>711'887.44</b>          | <b>8'414'018.68</b>        | <b>9'046'737.02</b>        |
| <b>610'476.84</b>          | <b>183'232.36</b>          | <b>224'826.06</b>          | <b>84'601.45</b>           | <b>796'706.28</b>          | <b>695'454.64</b>          | <b>3'760'284.71</b>        | <b>2'656'601.73</b>        |
| 82'879.65                  | 443'960.74                 | 35'541.68                  | 195'991.84                 | 0.00                       | 0.00                       | 0.00                       | 898'853.32                 |
| <b>693'356.49</b>          | <b>627'193.10</b>          | <b>260'367.74</b>          | <b>280'593.29</b>          | <b>796'706.28</b>          | <b>695'454.64</b>          | <b>3'760'284.71</b>        | <b>3'555'455.05</b>        |
| 364'220.19                 | -1'119'019.54              | 137'062.79                 | -494'671.55                | 196'235.55                 | -707'350.86                | 1'615'057.45               | -6'245'648.10              |
| -82'879.65                 | -443'960.74                | -35'541.68                 | -195'991.84                | 0.00                       | 0.00                       | 0.00                       | -898'853.32                |
| <b>974'697.03</b>          | <b>-935'787.18</b>         | <b>361'888.85</b>          | <b>-410'070.10</b>         | <b>992'941.83</b>          | <b>-11'896.22</b>          | <b>5'375'342.16</b>        | <b>-3'589'046.37</b>       |
| 5'506'467.64               | -19'639'771.61             | 2'062'132.26               | -8'671'003.57              | 3'025'201.06               | -12'378'053.67             | 24'531'490.91              | -109'446'689.09            |
| <b>6'481'164.67</b>        | <b>-20'575'558.79</b>      | <b>2'424'021.11</b>        | <b>-9'081'073.67</b>       | <b>4'018'142.89</b>        | <b>-12'389'949.89</b>      | <b>29'906'833.07</b>       | <b>-113'035'735.46</b>     |
| 693'356.49                 | 627'193.10                 | 260'367.74                 | 280'593.29                 | 796'706.28                 | 695'454.64                 | 3'760'284.71               | 3'555'455.05               |
| 1'707.71                   | 9'371.74                   | 0.00                       | 0.00                       | 643.89                     | 338.61                     | 17'163.19                  | 29'800.50                  |
| 219'174.29                 | 218'803.76                 | 0.00                       | 0.00                       | 211'440.64                 | 194'466.29                 | 1'207'948.73               | 1'137'725.31               |
| <b>914'238.49</b>          | <b>855'368.60</b>          | <b>260'367.74</b>          | <b>280'593.29</b>          | <b>1'008'790.81</b>        | <b>890'259.54</b>          | <b>4'985'396.63</b>        | <b>4'722'980.86</b>        |
| 730'719.62                 | 622'950.48                 | 0.00                       | 0.00                       | 815'798.56                 | 664'446.77                 | 4'020'235.10               | 3'429'283.27               |
| 12'178.66                  | 11'536.12                  | 0.00                       | 0.00                       | 18'198.58                  | 13'728.24                  | 57'431.93                  | 68'585.67                  |
| 0.00                       | 0.00                       | 89'379.41                  | 97'576.70                  | 0.00                       | 0.00                       | 0.00                       | 0.00                       |
| 0.00                       | 0.00                       | 165'991.42                 | 181'214.21                 | 0.00                       | 0.00                       | 0.00                       | 0.00                       |
| 0.00                       | 0.00                       | 4'996.91                   | 1'802.38                   | 0.00                       | 0.00                       | 0.00                       | 0.00                       |
| 2'907.24                   | 1'707.71                   | 0.00                       | 0.00                       | 74.60                      | 643.89                     | 43'582.28                  | 17'163.19                  |
| 168'432.97                 | 219'174.29                 | 0.00                       | 0.00                       | 174'719.07                 | 211'440.64                 | 864'147.32                 | 1'207'948.73               |

|  | Anteilklasse UB            |                            |
|--|----------------------------|----------------------------|
|  | 01.01.2023 -<br>31.12.2023 | 01.01.2022 -<br>31.12.2022 |
|  | CHF                        | CHF                        |
| <b>Ertrag</b>  |                            |                            |
| Erträge der Bankguthaben   | 138'616.51                 | 41'731.26                  |
| Negativzinsen  | -721.60                    | -80'480.54                 |
| Erträge der Effektenleihen   | 24'538.75                  | 50'235.89                  |
| Erträge der Ausgleichszahlungen  | 143'503.74                 | 237'175.45                 |
| Erträge der Effekten, aufgeteilt in:   |                            |                            |
| - Obligationen, Wandelobligationen, Optionsanleihen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte     | 2'117'387.31               | 1'775'521.13               |
| - Aktien und sonstige Beteiligungswertpapiere und -rechte, einschliesslich Gratisaktien                | 3'149'264.54               | 2'833'410.33               |
| - Anteile anderer kollektiver Kapitalanlagen   | 2'159'214.92               | 2'250'678.84               |
| Erträge aus kollektiven Kapitalanlagen mit Immobilien im Direktbesitz                                  | 175'309.14                 | 152'972.72                 |
| Einkauf in laufende Nettoerträge bei der Ausgabe von Anteilen  | 60'124.08                  | 92'529.41                  |
| <b>Total Erträge</b>   | <b>7'967'237.39</b>        | <b>7'353'774.49</b>        |
| <b>Aufwendungen</b>  |                            |                            |
| Passivzinsen   | 850.22                     | 0.99                       |
| Prüfaufwand  | 3'973.19                   | 4'028.72                   |
| Reglementarische Vergütung an:   |                            |                            |
| - die Fondsleitung   | 4'836'273.52               | 5'328'365.75               |
| - die Depotbank  | 200'528.43                 | 220'932.17                 |
| Teilübertrag von Aufwendungen auf kollektiven Kapitalanlagen mit Immobilien im Direktbesitz            | -111'889.19                | -117'474.31                |
| Aufwände aus kollektiven Kapitalanlagen mit Immobilien im Direktbesitz                                 | 111'889.19                 | 117'474.31                 |
| Sonstige Aufwendungen  | 4'744.37                   | 4'217.63                   |
| Ausrichtung laufender Nettoerträge bei Rücknahme von Anteilen  | 239'329.09                 | 101'922.39                 |
| <b>Total Aufwendungen</b>  | <b>5'285'698.82</b>        | <b>5'659'467.65</b>        |
| <b>Nettoertrag vor steuerlichen Anpassungen</b>  | <b>2'681'538.57</b>        | <b>1'694'306.84</b>        |
| Steuerliche Anpassungen wegen Erträgen aus Zielfonds   | 0.00                       | 582'477.43                 |
| <b>Nettoertrag nach steuerlichen Anpassungen</b>   | <b>2'681'538.57</b>        | <b>2'276'784.27</b>        |
| Realisierte Kapitalgewinne und -verluste   | 1'085'895.43               | -3'949'331.12              |
| Teilübertrag von steuerlichem Ausgleich wegen Erträgen aus Zielfonds                                   | 0.00                       | -582'477.43                |
| <b>Realisierter Erfolg</b>   | <b>3'767'434.00</b>        | <b>-2'255'024.28</b>       |
| Nicht realisierte Kapitalgewinne und -verluste   | 16'413'985.38              | -69'138'271.54             |
| <b>Gesamterfolg</b>  | <b>20'181'419.38</b>       | <b>-71'393'295.82</b>      |
| <b>Verwendung des Erfolgs</b>  |                            |                            |
| Nettoertrag des Rechnungsjahres  | 2'681'538.57               | 2'276'784.27               |
| Vortrag des Vorjahres aus kollektiven Kapitalanlagen mit Immobilien im Direktbesitz                    | 0.00                       | 0.00                       |
| Vortrag des Vorjahres  | 0.00                       | 0.00                       |
| <b>Zur Verteilung verfügbarer Erfolg</b>   | <b>2'681'538.57</b>        | <b>2'276'784.27</b>        |
| Zur Ausschüttung an die Anlegerinnen und Anleger vorgesehener Erfolg                                   | 0.00                       | 0.00                       |
| Zur Ausschüttung bestimmter Erfolg aus Kapitalanlagen mit Immobilien im Direktbesitz                   | 0.00                       | 0.00                       |
| Ablieferung/Ausschüttung der Verrechnungssteuer (35%)  | 917'731.23                 | 784'516.87                 |
| Zur Wiederanlage zurückbehaltener Ertrag (65%)   | 1'704'361.84               | 1'456'964.70               |
| Zur Wiederanlage zurückbehaltener Ertrag aus kollektiven Kapitalanlagen mit Immobilien im Direktbesitz | 59'445.50                  | 35'302.70                  |
| Vortrag Nettoerträge aus kollektiven Kapitalanlagen mit Immobilien im Direktbesitz                     | 0.00                       | 0.00                       |
| Vortrag auf neue Rechnung  | 0.00                       | 0.00                       |

| Anteilklasse IA25          |                            | Anteilklasse EA            |                            |
|----------------------------|----------------------------|----------------------------|----------------------------|
| 01.01.2023 -<br>31.12.2023 | 01.01.2022 -<br>31.12.2022 | 01.01.2023 -<br>31.12.2023 | 01.01.2022 -<br>31.12.2022 |
| CHF                        | CHF                        | CHF                        | CHF                        |
| 59'926.97                  | 15'856.11                  | 5'516.15                   | 2'532.13                   |
| -306.43                    | -30'271.52                 | -40.00                     | -4'855.88                  |
| 10'533.03                  | 19'168.41                  | 1'142.23                   | 3'073.96                   |
| 62'102.18                  | 89'427.70                  | 6'639.29                   | 14'376.41                  |
| 912'133.55                 | 679'325.89                 | 95'860.73                  | 108'847.91                 |
| 1'318'875.50               | 1'068'983.73               | 198'597.65                 | 171'867.52                 |
| 955'039.62                 | 919'417.23                 | 81'887.93                  | 141'305.89                 |
| 73'010.16                  | 58'388.88                  | 10'871.85                  | 9'411.82                   |
| 51'853.33                  | 265'416.60                 | 24'536.62                  | 7'310.06                   |
| <b>3'443'167.91</b>        | <b>3'085'713.03</b>        | <b>425'012.45</b>          | <b>453'869.82</b>          |
| 384.40                     | 0.39                       | 51.99                      | 0.06                       |
| 1'713.14                   | 1'536.12                   | 183.38                     | 246.01                     |
| 660'455.59                 | 643'878.50                 | 136'056.91                 | 198'791.07                 |
| 86'367.22                  | 84'199.48                  | 9'251.94                   | 13'517.75                  |
| -16'173.32                 | -15'598.94                 | -3'956.57                  | -4'538.38                  |
| 16'173.32                  | 15'598.94                  | 3'956.57                   | 4'538.38                   |
| 2'090.08                   | 1'660.11                   | 174.70                     | 261.80                     |
| 151'367.75                 | 45'301.89                  | 186'860.03                 | 5'625.40                   |
| <b>902'378.18</b>          | <b>776'576.49</b>          | <b>332'578.95</b>          | <b>218'442.09</b>          |
| <b>2'540'789.73</b>        | <b>2'309'136.54</b>        | <b>92'433.50</b>           | <b>235'427.73</b>          |
| 0.00                       | 0.00                       | 0.00                       | 0.00                       |
| <b>2'540'789.73</b>        | <b>2'309'136.54</b>        | <b>92'433.50</b>           | <b>235'427.73</b>          |
| 474'611.22                 | -1'672'377.78              | 32'184.27                  | -251'830.47                |
| 0.00                       | 0.00                       | 0.00                       | 0.00                       |
| <b>3'015'400.95</b>        | <b>636'758.76</b>          | <b>124'617.77</b>          | <b>-16'402.74</b>          |
| 7'403'427.38               | -29'241'839.80             | 495'926.10                 | -4'406'837.94              |
| <b>10'418'828.33</b>       | <b>-28'605'081.04</b>      | <b>620'543.87</b>          | <b>-4'423'240.68</b>       |
| 2'540'789.73               | 2'309'136.54               | 92'433.50                  | 235'427.73                 |
| 933.68                     | 1'316.15                   | 114.11                     | 248.42                     |
| 781'932.96                 | 638'793.64                 | 71'427.73                  | 66'577.37                  |
| <b>3'323'656.37</b>        | <b>2'949'246.33</b>        | <b>163'975.34</b>          | <b>302'253.52</b>          |
| 2'545'241.76               | 2'118'698.61               | 132'825.66                 | 225'668.80                 |
| 54'820.59                  | 47'681.08                  | 2'523.69                   | 5'042.88                   |
| 0.00                       | 0.00                       | 0.00                       | 0.00                       |
| 0.00                       | 0.00                       | 0.00                       | 0.00                       |
| 0.00                       | 0.00                       | 0.00                       | 0.00                       |
| 807.72                     | 933.68                     | 99.50                      | 114.11                     |
| 722'786.30                 | 781'932.96                 | 28'526.49                  | 71'427.73                  |

## Zusammensetzung des Portefolles und Bestandesveränderungen

| Titelbezeichnung   | Währung  | 31.12.2022<br>Anzahl/<br>Nominal | Käufe (1) | Verkäufe (1) | 31.12.2023<br>Anzahl/<br>Nominal | Kurswert CHF          | in % des<br>Gesamtfonds-<br>vermögens |
|--|--|----------------------------------|-----------|--------------|----------------------------------|-----------------------|---------------------------------------|
| <b>Börsennotierte / an einem geregelten Markt gehandelte Wertpapiere; bewertet zu den Kursen, die am Hauptmarkt bezahlt werden</b> |  |                                  |           |              |                                  |                       |                                       |
| <b>Aktien (und aktienähnliche Wertpapiere)</b>   |  |                                  |           |              |                                  |                       |                                       |
| <b>SCHWEIZER FRANKEN</b>   |  |                                  |           |              |                                  |                       |                                       |
| ABB (reg. shares)  | CHF  | 510'000                          | 45'000    | 115'000      | 440'000                          | 16'412'000.00         | 1.01                                  |
| ACCELLERON INDUSTRIES AG   | CHF  | 24'000                           |           | 24'000       |                                  |                       |                                       |
| ADECCO (reg. shares)   | CHF  | 50'000                           |           | 15'000       | 35'000                           | 1'444'450.00          | 0.09                                  |
| ALCON INC  | CHF  | 140'000                          | 30'000    | 20'000       | 150'000                          | 9'846'000.00          | 0.60                                  |
| BALOISE-HOLDING (reg. shares)  | CHF  | 13'000                           |           | 2'000        | 11'000                           | 1'449'800.00          | 0.09                                  |
| BANQUE CANTONALE VAUDOISE  | CHF  |                                  | 8'000     |              | 8'000                            | 868'000.00            | 0.05                                  |
| BARRY CALLEBAUT (reg. shares)  | CHF  | 1'000                            |           |              | 1'000                            | 1'419'000.00          | 0.09                                  |
| BKW  | CHF  |                                  | 6'000     |              | 6'000                            | 897'000.00            | 0.05                                  |
| CIE FINANCIERE RICHEMONT (reg. shares)   | CHF  | 170'000                          | 10'000    | 33'000       | 147'000                          | 17'015'250.00         | 1.04                                  |
| CLARIANT (reg. shares)   | CHF  | 70'000                           |           | 20'000       | 50'000                           | 621'000.00            | 0.04                                  |
| CS GROUP (reg. shares)   | CHF  | 855'000                          |           | 855'000      |                                  |                       |                                       |
| DUFFRY   | CHF  |                                  | 25'000    |              | 25'000                           | 827'000.00            | 0.05                                  |
| EMS-CHEMIE HOLDING   | CHF  |                                  | 1'800     | 600          | 1'200                            | 817'200.00            | 0.05                                  |
| GEBERIT  | CHF  | 10'000                           | 1'000     | 3'000        | 8'000                            | 4'312'000.00          | 0.26                                  |
| GIVAUDAN (reg. shares)   | CHF  | 3'200                            | 200       | 800          | 2'600                            | 9'058'400.00          | 0.56                                  |
| HELVETIA HOLDING LTD   | CHF  |                                  | 10'000    | 2'000        | 8'000                            | 927'200.00            | 0.06                                  |
| JULIUS BAER GRUPPE   | CHF  | 60'000                           |           | 8'000        | 52'000                           | 2'451'800.00          | 0.15                                  |
| KUEHNE & NAGEL INTERNATIONAL   | CHF  | 18'000                           |           | 3'000        | 15'000                           | 4'347'000.00          | 0.27                                  |
| LAFARGEHOLCIM (reg. shares)  | CHF  | 150'000                          | 15'000    | 30'000       | 135'000                          | 8'912'700.00          | 0.55                                  |
| LINDT & SPRUENGLI  | CHF  | 330                              |           | 80           | 250                              | 2'522'500.00          | 0.15                                  |
| LINDT & SPRUENGLI LISN SW  | CHF  | 25                               | 5         | 3            | 27                               | 2'754'000.00          | 0.17                                  |
| LOGITECH INTERNATIONAL (reg. shares)   | CHF  | 60'000                           |           | 18'000       | 42'000                           | 3'349'920.00          | 0.21                                  |
| LONZA GROUP (reg. shares)  | CHF  | 26'000                           | 2'000     | 6'000        | 22'000                           | 7'781'400.00          | 0.48                                  |
| NESTLE (reg. shares)   | CHF  | 840'000                          | 39'000    | 184'000      | 695'000                          | 67'769'450.00         | 4.15                                  |
| NOVARTIS (reg. shares)   | CHF  | 680'000                          | 35'000    | 160'000      | 555'000                          | 47'102'850.00         | 2.89                                  |
| PARTNERS GROUP   | CHF  | 6'000                            |           | 900          | 5'100                            | 6'186'300.00          | 0.38                                  |
| ROCHE HOLDING  | CHF  | 9'000                            |           | 2'000        | 7'000                            | 1'829'800.00          | 0.11                                  |
| ROCHE HOLDINGS (cert. shares)  | CHF  | 195'000                          | 8'000     | 31'000       | 172'000                          | 42'054'000.00         | 2.58                                  |
| SANDOZ GROUP LTD   | CHF  |                                  | 109'000   | 24'000       | 85'000                           | 2'300'100.00          | 0.14                                  |
| SCHINDLER HOLDING  | CHF  | 5'000                            |           |              | 5'000                            | 997'500.00            | 0.06                                  |
| SCHINDLER HOLDING (part. cert.)  | CHF  | 10'000                           |           | 2'000        | 8'000                            | 1'682'400.00          | 0.10                                  |
| SGS LTD  | CHF  |                                  | 50'000    | 10'000       | 40'000                           | 2'901'600.00          | 0.18                                  |
| SIG COMBIBLOC SERVICES   | CHF  |                                  | 100'000   | 20'000       | 80'000                           | 1'548'000.00          | 0.09                                  |
| SIKA LTD   | CHF  | 40'000                           | 3'000     | 6'000        | 37'000                           | 10'126'900.00         | 0.62                                  |
| SOCIETE GENERALE DE SURVEILLANCE HOLDING (reg. shares)   | CHF  |                                  |           | 2'000        |                                  |                       |                                       |
| SONOVA HOLDING (reg. shares)   | CHF  | 17'000                           |           | 3'000        | 14'000                           | 3'841'600.00          | 0.24                                  |
| STRAUMANN HOLDING LTD  | CHF  | 30'000                           |           |              | 30'000                           | 4'068'000.00          | 0.25                                  |
| SWISS LIFE HOLDING (reg. shares)   | CHF  | 9'000                            |           | 1'500        | 7'500                            | 4'380'000.00          | 0.27                                  |
| SWISS PRIME SITE   | CHF  | 20'000                           |           |              | 20'000                           | 1'797'000.00          | 0.11                                  |
| SWISS REINSURANCE  | CHF  | 100'000                          | 5'000     | 20'000       | 85'000                           | 8'037'600.00          | 0.49                                  |
| SWISSCOM (reg. shares)   | CHF  | 7'000                            | 1'000     | 1'300        | 6'700                            | 3'390'200.00          | 0.21                                  |
| TEMENOS GROUP  | CHF  | 15'000                           | 5'000     | 5'000        | 15'000                           | 1'173'300.00          | 0.07                                  |
| THE SWATCH GROUP   | CHF  | 7'000                            |           | 1'000        | 6'000                            | 1'371'600.00          | 0.08                                  |
| UBS GROUP  | CHF  | 1'000'000                        | 118'033   | 278'033      | 840'000                          | 21'924'000.00         | 1.34                                  |
| VAT GROUP  | CHF  | 7'000                            | 1'000     | 1'000        | 7'000                            | 2'950'500.00          | 0.18                                  |
| ZURICH INSURANCE GROUP (reg. shares)   | CHF  | 47'000                           | 2'500     | 8'500        | 41'000                           | 18'023'600.00         | 1.10                                  |
|  |  |                                  |           |              |                                  | <b>353'489'920.00</b> | <b>21.66</b>                          |
| <b>Total Aktien (und aktienähnliche Wertpapiere)</b>   |  |                                  |           |              |                                  | <b>353'489'920.00</b> | <b>21.66</b>                          |
| <b>Anleihen</b>  |  |                                  |           |              |                                  |                       |                                       |
| <b>SCHWEIZER FRANKEN</b>   |  |                                  |           |              |                                  |                       |                                       |
| 0.010  | AARGAUISCHE KANTONALBANK 0.01%/20-29.06.2028       | CHF                              | 3'000'000 |              | 3'000'000                        | 2'809'500.00          | 0.17                                  |
| 0.020  | AARGAUISCHE KANTONALBANK 0.02%/16-17.10.2024       | CHF                              | 2'500'000 |              | 2'500'000                        | 2'467'000.00          | 0.15                                  |
| 0.625  | AARGAUISCHE KANTONALBANK 0.625%/15-13.04.2028      | CHF                              | 2'500'000 |              | 2'500'000                        | 2'411'250.00          | 0.15                                  |
| 0.300  | ABB LTD 0.3%/19-06.08.2024                         | CHF                              | 2'000'000 |              | 2'000'000                        | 1'983'000.00          | 0.12                                  |
| 0.300  | ABN AMRO BANK 0.3%/16-18.12.2024                   | CHF                              | 3'000'000 |              | 3'000'000                        |                       |                                       |
| 0.523  | AFRICA FINANCE CORPORATION 0.5225%/19-20.12.2023   | CHF                              | 5'090'000 |              | 5'090'000                        |                       |                                       |
| 1.205  | AFRICA FINANCE CORPORATION 1.205%/20-30.09.2025    | CHF                              | 8'000'000 |              | 8'000'000                        | 7'760'000.00          | 0.48                                  |
| 0.250  | AKADEMISKA HUS 0.25%/15-17.11.2025                 | CHF                              | 7'000'000 |              | 7'000'000                        | 6'860'000.00          | 0.42                                  |
| 0.750  | ALLREAL HOLDING AG 0.75%/17-19.06.2026             | CHF                              | 1'000'000 |              | 1'000'000                        |                       |                                       |
| 0.625  | ALLREAL HOLDING LTD 0.625%/16-10.05.2024           | CHF                              | 1'340'000 |              | 1'340'000                        |                       |                                       |
| 1.375  | ALLREAL HOLDING LTD 1.375%/15-31.03.2025           | CHF                              | 1'500'000 |              | 1'500'000                        | 1'488'750.00          | 0.09                                  |
| 0.410  | AMGEN 0.41%/16-08.03.2023                          | CHF                              | 3'000'000 |              | 3'000'000                        |                       |                                       |
| 0.800  | AMP GROUP FINANCE SERVICES LTD 0.8%/19-18.07.2023  | CHF                              | 7'000'000 |              | 7'000'000                        |                       |                                       |
| 0.250  | ANZ NEW ZEALAND (INTL) LIMITED 0.25%/17-22.09.2025 | CHF                              | 4'000'000 |              | 4'000'000                        | 3'904'000.00          | 0.24                                  |
| 0.350  | ANZ NEW ZEALAND (INTL) LIMITED 0.35%/18-22.10.2024 | CHF                              | 4'000'000 |              | 4'000'000                        |                       |                                       |
| 1.375  | AT&T 1.375%/14-04.12.2024                          | CHF                              | 5'500'000 |              | 5'500'000                        |                       |                                       |



| Titelbezeichnung | Wahrung   | 31.12.2022<br>Anzahl/<br>Nominal | Kaufe (1) | Verkaufe (1) | 31.12.2023<br>Anzahl/<br>Nominal | Kurswert CHF | in % des<br>Gesamtfonds-<br>vermogens |
|------------------|--|----------------------------------|------------|---------------|----------------------------------|--------------|--|
| 0.850            | ATHENE GLOBAL FUNDING 0.85%/20-14.10.2025                  | CHF                              | 4'700'000  |               | 2'700'000                        | 2'641'950.00 | 0.16                                   |
| 0.150            | BALOISE HOLDING AG 0.15%/21-17.02.2031                     | CHF                              | 3'090'000  |               | 3'090'000                        | 2'773'275.00 | 0.17                                   |
| 0.250            | BALOISE HOLDING AG 0.25%/20-16.12.2026                     | CHF                              | 6'000'000  |               | 6'000'000                        | 5'778'000.00 | 0.35                                   |
| 0.125            | BALOISE-HOLDING AG 0.125%/21-27.06.2030                    | CHF                              | 8'000'000  |               | 8'000'000                        | 7'276'000.00 | 0.45                                   |
| 2.408            | BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA SA 2.4075%/22-28.11.2025   | CHF                              | 8'000'000  |               | 8'000'000                        | 8'100'000.00 | 0.50                                   |
| 0.250            | BANCO DE CREDITO E INVERSIONES 0.25%/19-24.09.2029         | CHF                              | 1'500'000  |               | 1'500'000                        | 1'338'750.00 | 0.08                                   |
| 0.400            | BANCO DE CREDITO E INVERSIONES 0.4%/19-22.11.2024          | CHF                              | 5'200'000  |               | 5'200'000                        | 5'127'720.00 | 0.31                                   |
| 0.575            | BANCO DEL ESTADO DE CHILE 0.575%/17-07.04.2027             | CHF                              | 3'000'000  | 3'000'000     |                                  |              |  |
| 0.200            | BANCO SANTANDER SA 0.2%/19-19.11.2027                      | CHF                              | 7'000'000  |               | 7'000'000                        | 6'625'500.00 | 0.41                                   |
| 0.253            | BANK OF AMERICA CORP 0.2525%/19-12.06.2026                 | CHF                              | 3'000'000  |               | 3'000'000                        | 2'898'000.00 | 0.18                                   |
| 0.200            | BANK OF NOVA SCOTIA 0.2%/18-19.11.2025                     | CHF                              | 1'000'000  |               | 1'000'000                        | 976'000.00   | 0.06                                   |
| 0.100            | BANQ CANTONALE DU VALAIS 0.1%/21-18.04.2031                | CHF                              | 8'000'000  |               | 8'000'000                        | 7'188'000.00 | 0.44                                   |
| 0.600            | BANQUE FEDERALE CREDIT MUTUEL 0.6%/17-05.04.2027           | CHF                              | 1'000'000  |               | 1'000'000                        | 961'500.00   | 0.06                                   |
| 0.200            | BANQUE FEDERATIVE DU CREDIT MUTUEL 0.2%/20-03.11.2028      | CHF                              | 4'000'000  |               | 4'000'000                        | 3'714'000.00 | 0.23                                   |
| 0.250            | BANQUE FEDERATIVE DU CREDIT MUTUEL 0.25%/19-10.07.2025     | CHF                              | 5'000'000  | 5'000'000     |                                  |              |  |
| 0.125            | BASLER KANTONALBANK 0.125%/20-10.09.2032                   | CHF                              | 6'000'000  |               | 6'000'000                        | 5'295'000.00 | 0.32                                   |
| 0.375            | BELL FOOD GROUP AG 0.375%/18-01.02.2024                    | CHF                              | 2'700'000  | 2'700'000     |                                  |              |  |
| 0.625            | BELL FOOD GROUP AG 0.625%/16-24.03.2025                    | CHF                              | 3'000'000  |               | 3'000'000                        | 2'958'000.00 | 0.18                                   |
| 0.750            | BELL FOOD GROUP AG 0.75%/18-01.02.2028                     | CHF                              | 1'500'000  | 1'500'000     |                                  |              |  |
| 0.250            | BERLIN HYP AG 0.25%/21-10.03.2031                          | CHF                              | 8'000'000  |               | 8'000'000                        | 7'136'000.00 | 0.44                                   |
| 0.750            | BERNER KANTONALBANK 0.75%/15-14.07.2025                    | CHF                              | 1'450'000  |               | 1'450'000                        | 1'427'525.00 | 0.09                                   |
| 1.125            | BOBST GROUP SA 1.125%/18-27.09.2024                        | CHF                              | 1'000'000  |               | 1'000'000                        | 988'000.00   | 0.06                                   |
| 1.375            | BUCHER INDUSTRIES 1.375%/14-02.10.2024                     | CHF                              | 2'500'000  |               | 2'500'000                        | 2'488'250.00 | 0.15                                   |
| 0.050            | CANADIAN IMPERIAL BANK OF COMMERCE 0.05%/19-15.10.2026     | CHF                              | 6'000'000  |               | 6'000'000                        | 5'727'000.00 | 0.35                                   |
| 0.283            | CANADIAN IMPERIAL BANK OF COMMERCE 0.2825%/22-03.02.2027   | CHF                              | 10'000'000 |               | 10'000'000                       | 9'540'000.00 | 0.58                                   |
| 1.400            | CANTON OF BASEL-STADT 1.4%/22-24.11.2027                   | CHF                              | 9'000'000  |               | 9'000'000                        | 9'067'500.00 | 0.56                                   |
| 1.625            | CANTON OF TICINO 1.625%/22-19.09.2030                      | CHF                              | 7'000'000  |               | 7'000'000                        | 7'147'000.00 | 0.44                                   |
| -                | CEMBRA MONEY BANK AG 0%/19-19.05.2023                      | CHF                              | 4'000'000  | 4'000'000     |                                  |              |  |
| 0.180            | CEMBRA MONEY BANK AG 0.18%/16-05.10.2023                   | CHF                              | 2'000'000  | 2'000'000     |                                  |              |  |
| 0.250            | CEMBRA MONEY BANK AG 0.25%/17-23.05.2024                   | CHF                              | 2'500'000  | 2'500'000     |                                  |              |  |
| 0.010            | CHOCOLADEFABRIKEN LINDT & SPRUENGLI AG 0.01%/20-06.10.2028 | CHF                              | 10'000'000 |               | 10'000'000                       | 9'335'000.00 | 0.57                                   |
| 2.125            | CLARIANT 2.125%/14-17.10.2024                              | CHF                              | 1'000'000  |               | 1'000'000                        | 998'600.00   | 0.06                                   |
| 0.250            | COOPERATIVE RABOBANK UA 0.25%/19-25.11.2027                | CHF                              | 1'600'000  |               | 1'600'000                        | 1'511'200.00 | 0.09                                   |
| 0.500            | COOP-GRUPPE GENOSSENSCHAFT 0.5%/17-29.09.2027              | CHF                              | 1'000'000  |               | 1'000'000                        | 962'000.00   | 0.06                                   |
| 1.000            | COOP-GRUPPE GENOSSENSCHAFT 1%/14-29.09.2023                | CHF                              | 2'000'000  | 2'000'000     |                                  |              |  |
| 0.450            | CORPORACION ANDINA DE FOMENTO 0.45%/15-07.09.2023          | CHF                              | 650'000    | 650'000       |                                  |              |  |
| 0.450            | CORPORACION ANDINA DE FOMENTO 0.45%/22-24.02.2027          | CHF                              | 10'000'000 |               | 10'000'000                       | 9'530'000.00 | 0.58                                   |
| 0.700            | CORPORATION ANDINA DE FOMENTO 0.7%/20-04.09.2025           | CHF                              | 5'000'000  |               | 5'000'000                        |              |  |
| 0.200            | CREDIT AGRICOLE S.A. LONDON BRANCH 0.2%/18-30.10.2023      | CHF                              | 4'000'000  | 4'000'000     |                                  |              |  |
| 0.500            | CREDIT AGRICOLE S.A. LONDON BRANCH 0.5%/20-01.10.2026      | CHF                              | 6'000'000  |               | 6'000'000                        | 5'784'000.00 | 0.35                                   |
| 0.100            | DEUTSCHE BAHN FINANCE GMBH 0.1%/15-01.12.2025              | CHF                              | 4'000'000  | 4'000'000     |                                  |              |  |
| 0.450            | DEUTSCHE BAHN FINANCE GMBH 0.45%/17-08.11.2030             | CHF                              | 1'000'000  |               | 1'000'000                        | 940'000.00   | 0.06                                   |
| 1.000            | DORMAKABA FINANCE AG 1%/17-13.10.2025                      | CHF                              | 1'700'000  |               | 1'700'000                        | 1'668'550.00 | 0.10                                   |
| 1.625            | EIB 1.625%/11-23.11.2023                                   | CHF                              | 1'000'000  | 1'000'000     |                                  |              |  |
| 0.150            | ELI LILLY & CO 0.15%/16-24.05.2024                         | CHF                              | 980'000    |               | 980'000                          | 974'022.00   | 0.06                                   |
| 1.625            | EMMI FINANZ AG 1.625%/13-12.07.2023                        | CHF                              | 895'000    | 895'000       |                                  |              |  |
| 1.625            | ENGADINER KRAFTWERKE 1.625%/14-25.04.2024                  | CHF                              | 1'000'000  |               | 1'000'000                        | 999'000.00   | 0.06                                   |
| 3.000            | EUROFIMA BASEL 3%/07-22.05.2024                            | CHF                              | 3'000'000  | 3'000'000     |                                  |              |  |
| 1.050            | FERRING HOLDING SA 1.05%/20-09.07.2025                     | CHF                              | 3'000'000  |               | 3'000'000                        | 2'949'000.00 | 0.18                                   |
| 1.500            | FLUGHAFEN ZUERICH AG 1.5%/13-17.04.2023                    | CHF                              | 210'000    |               | 210'000                          |              |  |
| 0.300            | GEBERIT AG 0.3%/15-17.04.2023                              | CHF                              | 3'000'000  | 3'000'000     |                                  |              |  |
| 0.125            | GENFER KANTONALBANK 0.125%/19-23.04.2026                   | CHF                              | 2'900'000  |               | 2'900'000                        | 2'799'950.00 | 0.17                                   |
| 0.150            | GIVAUDAN AG 0.15%/20-10.11.2028                            | CHF                              | 1'880'000  |               | 1'880'000                        | 1'769'080.00 | 0.11                                   |
| 1.750            | GIVAUDAN AG 1.75%/14-19.03.2024                            | CHF                              | 2'465'000  |               | 2'465'000                        | 2'463'521.00 | 0.15                                   |
| -                | GLARNER KANTONALBANK 0%/20-06.09.2028                      | CHF                              | 5'000'000  |               | 5'000'000                        | 4'672'500.00 | 0.29                                   |
| 0.375            | GLARNER KANTONALBANK 0.375%/15-26.02.2027                  | CHF                              | 1'135'000  |               | 1'135'000                        | 1'096'410.00 | 0.07                                   |
| 0.956            | GRAND CITY PROPERTIES SA 0.956%/18-01.09.2026              | CHF                              | 3'000'000  |               | 3'000'000                        | 2'773'500.00 | 0.17                                   |
| 0.100            | GRAUBUNDNER KANTONALBANK 0.1%/21-07.05.2031                | CHF                              | 10'000'000 |               | 10'000'000                       | 9'030'000.00 | 0.55                                   |
| 0.450            | HEATHROW FUNDING LIMITED 0.45%/19-15.10.2026               | CHF                              | 1'000'000  |               | 1'000'000                        | 963'500.00   | 0.06                                   |
| 0.500            | HEATHROW FUNDING LIMITED 0.5%/16-17.05.2026                | CHF                              | 3'000'000  | 3'000'000     |                                  |              |  |
| 1.800            | HEATHROW FUNDING LIMITED 1.8%/22-27.05.2029                | CHF                              | 6'000'000  |               | 6'000'000                        | 5'997'000.00 | 0.37                                   |
| 1.500            | HELVETIA SWISS INSURANCE COMPANY 1.5%/14-28.04.2025        | CHF                              | 775'000    | 775'000       |                                  |              |  |
| 0.200            | HILTI AG T. -2024- 0.2%/17-08.11.2024                      | CHF                              | 600'000    |               | 600'000                          | 592'440.00   | 0.04                                   |
| 0.813            | HSBC HOLDINGS PLC 0.8125%/21-03.11.2031                    | CHF                              | 10'000'000 |               | 10'000'000                       | 9'020'000.00 | 0.55                                   |
| 0.125            | HYPOTHEKARER BANK AG 0.125%/20-27.03.2030                  | CHF                              | 5'320'000  |               | 5'320'000                        | 4'694'900.00 | 0.29                                   |
| 0.125            | HYPOTHEKARER BANK AG 0.125%/21-23.08.2028                  | CHF                              | 6'000'000  |               | 6'000'000                        | 5'481'000.00 | 0.34                                   |
| 0.450            | HYPOTHEKARER BANK AG 0.45%/18-05.03.2024                   | CHF                              | 3'000'000  |               | 3'000'000                        | 2'990'700.00 | 0.18                                   |
| 0.500            | HYPOTHEKARER BANK AG 0.5%/22-07.04.2027                    | CHF                              | 6'300'000  |               | 6'300'000                        | 6'101'550.00 | 0.37                                   |
| 0.125            | INSELSPITAL-STIFTUNG 0.125%/21-01.01.2500                  | CHF                              | 7'740'000  |               | 7'740'000                        | 7'198'200.00 | 0.44                                   |
| 0.450            | JP MORGAN CHASE (reg. -S-) -144A- 0.45%/16-11.11.2026      | CHF                              | 3'000'000  | 3'000'000     |                                  |              |  |

| Titelbezeichnung   | Währung | 31.12.2022<br>Anzahl/<br>Nominal | Käufe (1)  | Verkäufe (1) | 31.12.2023<br>Anzahl/<br>Nominal | Kurswert CHF  | in % des<br>Gesamtfonds-<br>vermögens |
|--|---------|----------------------------------|------------|--------------|----------------------------------|---------------|---------------------------------------|
| - KANTON BASEL-STADT 0%/19-22.02.2023  | CHF     | 1'000'000                        |            | 1'000'000    |                                  |               |                                       |
| - KANTON GENÈVE 0%/19-26.05.2028   | CHF     | 4'160'000                        |            |              | 4'160'000                        | 3'935'360.00  | 0.24                                  |
| 0.250 KANTON GENÈVE 0.25%/17-29.11.2027  | CHF     | 1'000'000                        |            |              | 1'000'000                        | 962'500.00    | 0.06                                  |
| - KANTON LUZERN 0%/18-15.10.2025   | CHF     | 3'000'000                        |            |              | 3'000'000                        | 2'932'500.00  | 0.18                                  |
| - KANTON SOLOTHURN 0%/17-27.10.2025  | CHF     | 3'000'000                        |            |              | 3'000'000                        | 2'925'000.00  | 0.18                                  |
| - KANTON ZÜRICH 0%/21-10.11.2033   | CHF     | 10'000'000                       |            |              | 10'000'000                       | 8'865'000.00  | 0.54                                  |
| 1.450 KANTON ZÜRICH 1.45%/22-14.12.2029  | CHF     | 8'000'000                        |            |              | 8'000'000                        | 8'116'000.00  | 0.50                                  |
| 0.250 KINDERSPITAL ZÜRICH 0.25%/16-28.07.2028  | CHF     | 1'850'000                        |            |              | 1'850'000                        | 1'755'650.00  | 0.11                                  |
| - KOREA GAS CORPORATION 0%/19-28.11.2023   | CHF     | 4'600'000                        |            | 4'600'000    |                                  |               |                                       |
| 1.250 KW LINTH-LIMMERN 1.25%/14-11.09.2024   | CHF     | 1'200'000                        |            | 1'200'000    |                                  |               |                                       |
| 1.000 LAFARGEHOLCIM LTD 1%/18-11.12.2024   | CHF     | 9'000'000                        |            | 2'000'000    | 7'000'000                        | 6'949'600.00  | 0.43                                  |
| 0.200 LANSFORSKRINGAR HYPOTEK 0.2%/18-17.04.2026   | CHF     | 2'100'000                        |            |              | 2'100'000                        | 2'039'100.00  | 0.12                                  |
| 0.500 LGT BANK LTD 0.5%/17-12.05.2027  | CHF     | 1'000'000                        |            |              | 1'000'000                        | 966'000.00    | 0.06                                  |
| 0.125 LIECHTENSTEIN LANDESBANK 0.125%/19-28.05.2026  | CHF     | 2'250'000                        |            |              | 2'250'000                        | 2'180'250.00  | 0.13                                  |
| 0.300 LINDT & SPRUENGLI 0.3%/17-06.10.2027   | CHF     | 10'600'000                       |            | 5'600'000    | 5'000'000                        | 4'790'000.00  | 0.29                                  |
| 1.000 LINDT & SPRUENGLI 1%/14-08.10.2024   | CHF     | 1'000'000                        |            |              | 1'000'000                        | 995'100.00    | 0.06                                  |
| 1.000 LLOYDS BANKING GROUP PLC 1%/18-04.03.2025  | CHF     | 4'000'000                        |            |              | 4'000'000                        | 3'955'200.00  | 0.24                                  |
| 1.250 LONZA SWISS FINANZ AG 1.25%/15-22.09.2023  | CHF     | 1'000'000                        |            | 1'000'000    |                                  |               |                                       |
| - LUZERNER KANTONALBK AG 0%/20-07.08.2028  | CHF     | 5'000'000                        |            |              | 5'000'000                        | 4'672'500.00  | 0.29                                  |
| 0.750 MACQUARIE BANK 0.75%/16-05.02.2024   | CHF     | 3'000'000                        |            |              | 3'000'000                        | 2'996'400.00  | 0.18                                  |
| 1.018 MBANK S.A. 1.0183%/19-04.10.2024   | CHF     | 4'800'000                        |            | 4'800'000    |                                  |               |                                       |
| 1.875 MOBIMO HOLDING 1.875%/14-16.09.2024  | CHF     | 1'000'000                        |            | 1'000'000    |                                  |               |                                       |
| 0.250 MUENCHENER HYPOTHEKENBANK EG 0.25%/20-18.09.2028                                     | CHF     | 9'200'000                        |            |              | 9'200'000                        | 8'666'400.00  | 0.53                                  |
| 0.001 MUENCHENER HYPOTHEKENBANK EG 0.001%/19-19.02.2024                                    | CHF     | 1'000'000                        |            | 1'000'000    |                                  |               |                                       |
| 0.100 MUENCHENER HYPOTHEKENBANK EG 0.1%/20-17.12.2025                                      | CHF     | 5'000'000                        |            |              | 5'000'000                        | 4'832'500.00  | 0.30                                  |
| 0.300 NA DEVELOPMENT BANK 0.3%/18-24.07.2026   | CHF     | 1'500'000                        |            |              | 1'500'000                        | 1'454'250.00  | 0.09                                  |
| 1.550 NANT DE DRANCE SA 1.55%/18-19.08.2025  | CHF     | 2'000'000                        |            |              | 2'000'000                        | 1'996'000.00  | 0.12                                  |
| 0.250 NATIONAL AUSTRALIA BANK 0.25%/16-19.01.2023  | CHF     | 2'000'000                        |            | 2'000'000    |                                  |               |                                       |
| 1.500 NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD 1.5%/14-07.02.2024                                       | CHF     | 500'000                          |            | 500'000      |                                  |               |                                       |
| 1.715 NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD 1.715%/23-03.02.2033                                     | CHF     |                                  | 5'000'000  |              | 5'000'000                        | 5'102'500.00  | 0.31                                  |
| 0.235 NEDER WATERSCHAPSBANK 0.235%/22-14.04.2027   | CHF     | 10'000'000                       |            |              | 10'000'000                       | 9'675'000.00  | 0.59                                  |
| 0.250 NESTLE HOLDINGS INC 0.25%/17-04.10.2027  | CHF     | 2'000'000                        |            |              | 2'000'000                        | 1'926'000.00  | 0.12                                  |
| 0.250 NESTLE LTD 0.25%/18-28.06.2024   | CHF     | 2'000'000                        |            | 2'000'000    |                                  |               |                                       |
| 0.350 NEUBURGER KANTONALBANK 0.35%/18-14.09.2026   | CHF     | 2'200'000                        |            | 2'200'000    |                                  |               |                                       |
| 2.625 OEKB 2.625%/06-22.11.2024  | CHF     | 1'000'000                        |            |              | 1'000'000                        | 1'009'100.00  | 0.06                                  |
| 0.050 ONTARIO (PROVINCE OF) 0.05%/21-12.05.2033  | CHF     | 8'000'000                        |            |              | 8'000'000                        | 7'080'000.00  | 0.43                                  |
| 0.150 PARTNERS GROUP HOLDING A 0.15%/17-07.06.2024   | CHF     | 2'000'000                        |            | 2'000'000    |                                  |               |                                       |
| 1.375 PFANDBRIEF SCHWEIZ HYPO S. -718- 1.375%/22-09.04.2032                                | CHF     | 9'400'000                        |            |              | 9'400'000                        | 9'367'100.00  | 0.57                                  |
| 2.125 PFANDBRIEF SCHWEIZ HYPO S. -736- 2.125%/23-15.11.2030                                | CHF     |                                  | 10'000'000 |              | 10'000'000                       | 10'474'000.00 | 0.64                                  |
| - PFANDBRIEFBANK SCHWEIZERISCHER HYPOTHEKARINSTITUTE AG 0%/20-26.02.2030                   | CHF     | 5'000'000                        |            |              | 5'000'000                        | 4'596'500.00  | 0.28                                  |
| 0.625 PFANDBRIEFBANK SCHWEIZERISCHER HYPOTHEKARINSTITUTE AG 603 0.625%/14-19.03.2025       | CHF     | 3'000'000                        |            |              | 3'000'000                        | 2'965'800.00  | 0.18                                  |
| 1.125 PFANDBRIEFBANK SCHWEIZERISCHER HYPOTHEKARINSTITUTE AG S. 576 1.125%/12-16.11.2023    | CHF     | 1'500'000                        |            | 1'500'000    |                                  |               |                                       |
| 1.500 PFANDBRIEFBANK SCHWEIZERISCHER HYPOTHEKARINSTITUTE AG S. 586 1.5%/13-16.01.2023      | CHF     | 2'000'000                        |            | 2'000'000    |                                  |               |                                       |
| 0.375 PFANDBRIEFBANK SCHWEIZERISCHER HYPOTHEKARINSTITUTE AG S. -616- 0.375%/15-26.01.2026  | CHF     | 4'000'000                        |            | 4'000'000    |                                  |               |                                       |
| 0.250 PFANDBRIEFBANK SCHWEIZERISCHER HYPOTHEKARINSTITUTE AG S. -625- 0.25%/16-05.08.2026   | CHF     | 6'000'000                        |            |              | 6'000'000                        | 5'829'600.00  | 0.36                                  |
| 0.125 PFANDBRIEFBANK SCHWEIZERISCHER HYPOTHEKARINSTITUTE AG S. -631- 0.125%/16-15.12.2027  | CHF     | 1'000'000                        |            | 1'000'000    |                                  |               |                                       |
| 0.250 PFANDBRIEFBANK SCHWEIZERISCHER HYPOTHEKARINSTITUTE AG S. -647- 0.25%/17-18.01.2027   | CHF     | 8'000'000                        |            |              | 8'000'000                        | 7'741'600.00  | 0.47                                  |
| - PFANDBRIEFBANK SCHWEIZERISCHER HYPOTHEKARINSTITUTE AG S. -683- 0%/20-25.02.2028          | CHF     | 7'000'000                        |            |              | 7'000'000                        | 6'621'300.00  | 0.41                                  |
| 0.125 PFANDBRIEFBANK SCHWEIZERISCHER HYPOTHEKARINSTITUTE S. -627- 0.125%/16-06.09.2028     | CHF     | 8'000'000                        |            |              | 8'000'000                        | 7'557'600.00  | 0.46                                  |
| 1.500 PFANDBRIEFZENTRALE DER SCHWEIZERISCHEN KANTONALBANKEN AG S. 433 1.5%/13-21.06.2028   | CHF     | 8'000'000                        |            |              | 8'000'000                        | 8'050'400.00  | 0.49                                  |
| 0.750 PFANDBRIEFZENTRALE DER SCHWEIZERISCHEN KANTONALBANKEN AG S. 456 0.75%/14-23.09.2024  | CHF     | 250'000                          |            |              | 250'000                          | 248'225.00    | 0.02                                  |
| - PFANDBRIEFZENTRALE DER SCHWEIZERISCHEN KANTONALBANKEN AG S. -472- 0%/15-25.07.2023       | CHF     | 2'000'000                        |            | 2'000'000    |                                  |               |                                       |
| 0.300 PFANDBRIEFZENTRALE DER SCHWEIZERISCHEN KANTONALBANKEN AG S. -509- 0.3%/19-09.04.2029 | CHF     | 5'000'000                        |            |              | 5'000'000                        | 4'735'500.00  | 0.29                                  |
| 0.250 PROVINCE OF MANITOBA 0.25%/19-15.03.2029   | CHF     | 1'000'000                        |            |              | 1'000'000                        | 941'000.00    | 0.06                                  |
| 0.250 PROVINCE OF NEW BRUNSWICK 0.25%/17-19.01.2029  | CHF     | 3'000'000                        |            |              | 3'000'000                        | 2'841'000.00  | 0.17                                  |
| - PSP SWISS PROPERTY AG 0%/16-01.09.2023   | CHF     | 3'000'000                        |            | 3'000'000    |                                  |               |                                       |
| 0.375 PSP SWISS PROPERTY AG 0.375%/16-29.04.2026   | CHF     | 5'200'000                        |            | 5'200'000    |                                  |               |                                       |
| 0.500 RCI BANQUE SA 0.5%/19-18.07.2024   | CHF     | 5'000'000                        |            | 5'000'000    |                                  |               |                                       |
| 1.875 RHAETISCHE BAHN AG (RHB) 1.875%/22-21.07.2034  | CHF     | 10'000'000                       |            |              | 10'000'000                       | 10'570'000.00 | 0.65                                  |
| - RHAETISCHE BAHN TR. -1- 0%/16-01.09.2025   | CHF     | 6'000'000                        |            |              | 6'000'000                        | 5'865'000.00  | 0.36                                  |

| Titelbezeichnung   | Währung | 31.12.2022<br>Anzahl/<br>Nominal | Käufe (1) | Verkäufe (1) | 31.12.2023<br>Anzahl/<br>Nominal | Kurswert CHF            | in % des<br>Gesamtfonds-<br>vermögens |
|--|---------|----------------------------------|-----------|--------------|----------------------------------|-------------------------|---------------------------------------|
| 0.100 ROCHE KAPITALMARKET T. -2- 0.1%/17-23.09.2024  | CHF     | 5'000'000                        |           |              | 5'000'000                        | 4'948'000.00            | 0.30                                  |
| 0.750 ROCHE KAPITALMARKT AG 0.75%/18-24.09.2030  | CHF     | 5'000'000                        |           |              | 5'000'000                        | 4'817'500.00            | 0.30                                  |
| 0.950 SGS LTD 0.95%/20-06.11.2026  | CHF     | 6'000'000                        |           |              | 6'000'000                        | 5'910'000.00            | 0.36                                  |
| 1.750 SGS LTD 1.75%/14-27.02.2024  | CHF     | 2'500'000                        |           |              | 2'500'000                        | 2'500'000.00            | 0.15                                  |
| 2.350 SIKA LTD 2.35%/22-28.11.2028   | CHF     | 9'550'000                        |           |              | 9'550'000                        | 9'889'025.00            | 0.61                                  |
| 0.750 SONOVA HOLDING LTD. 0.75%/20-06.10.2028  | CHF     | 7'000'000                        |           |              | 7'000'000                        | 6'762'000.00            | 0.41                                  |
| 1.400 SONOVA HOLDING LTD. 1.4%/22-19.02.2032   | CHF     | 6'450'000                        |           |              | 6'450'000                        | 6'353'250.00            | 0.39                                  |
| 0.125 SPAREBANK 1 NORD NORGE 0.125%/19-11.12.2025  | CHF     | 3'500'000                        |           |              | 3'500'000                        | 3'400'250.00            | 0.21                                  |
| 0.125 SPAREBANK 1 NORD-NORGE 0.125%/21-15.09.2028  | CHF     | 4'200'000                        |           |              | 4'200'000                        | 3'872'400.00            | 0.24                                  |
| 0.350 SPAREBANK 1 SMN 0.35%/16-05.04.2023  | CHF     | 3'000'000                        |           | 3'000'000    |                                  |                         |                                       |
| 0.350 STADT LAUSANNE 0.35%/20-06.07.2032   | CHF     | 5'500'000                        |           |              | 5'500'000                        | 5'065'500.00            | 0.31                                  |
| 0.150 STADT WINTERHUR 0.15%/18-26.03.2025  | CHF     | 3'000'000                        |           |              | 3'000'000                        | 2'946'300.00            | 0.18                                  |
| 2.750 STADT ZUERICH 2.75%/05-14.02.2025  | CHF     | 2'000'000                        |           |              | 2'000'000                        | 2'027'400.00            | 0.12                                  |
| 1.375 STATD LAUSANNE 1.375%/13-27.11.2023  | CHF     | 3'000'000                        |           | 3'000'000    |                                  |                         |                                       |
| 0.350 STATE OF LOWER AUSTRIA 0.35%/15-22.09.2023   | CHF     | 2'000'000                        |           | 2'000'000    |                                  |                         |                                       |
| - SWISS CONFEDERATION 0%/16-22.06.2029   | CHF     | 10'000'000                       |           |              | 10'000'000                       | 9'606'000.00            | 0.59                                  |
| 0.500 SWISS CONFEDERATION 0.5%/15-27.05.2030   | CHF     | 6'000'000                        |           |              | 6'000'000                        | 5'917'800.00            | 0.36                                  |
| 1.250 SWISS CONFEDERATION 1.25%/12-11.06.2024  | CHF     | 4'000'000                        |           | 4'000'000    |                                  |                         |                                       |
| 1.250 SWISS CONFEDERATION 1.25%/14-28.05.2026  | CHF     | 8'500'000                        |           |              | 8'500'000                        | 8'559'500.00            | 0.52                                  |
| 1.500 SWISS CONFEDERATION 1.5%/13-24.07.2025   | CHF     | 3'000'000                        |           |              | 3'000'000                        | 3'018'000.00            | 0.18                                  |
| 0.250 SWISS LIFE HOLDING AG 0.25%/19-11.10.2023  | CHF     | 800'000                          |           | 800'000      |                                  |                         |                                       |
| 0.750 SWISS REINSURANCE 0.75%/15-21.01.2027  | CHF     | 1'700'000                        |           |              | 1'700'000                        | 1'669'400.00            | 0.10                                  |
| 0.250 SWISSCOM LTD 0.25%/15-17.04.2023   | CHF     | 2'000'000                        |           | 2'000'000    |                                  |                         |                                       |
| 1.500 SWISSCOM LTD 1.5%/14-14.07.2026  | CHF     | 1'000'000                        |           |              | 1'000'000                        | 1'004'000.00            | 0.06                                  |
| 1.750 SWISSCOM LTD 1.75%/12-10.07.2024   | CHF     | 1'000'000                        |           |              | 1'000'000                        | 999'400.00              | 0.06                                  |
| 2.125 SYNGENTA FINANCE 2.125%/14-01.11.2029  | CHF     | 6'300'000                        |           | 6'300'000    |                                  |                         |                                       |
| 0.050 TESSINER STAATSBANK 0.05%/19-10.07.2029  | CHF     | 8'000'000                        |           |              | 8'000'000                        | 7'328'000.00            | 0.45                                  |
| 0.303 THE KOREA DEVELOPMENT BANK 0.303%/18-14.06.2023  | CHF     | 2'000'000                        |           | 2'000'000    |                                  |                         |                                       |
| 1.000 TRANSURBAN QLD FINANCE 1%/18-08.12.2025  | CHF     | 4'000'000                        |           |              | 4'000'000                        | 3'942'000.00            | 0.24                                  |
| 0.125 VALIANT BANK 0.125%/18-23.04.2024  | CHF     | 10'000'000                       |           | 10'000'000   |                                  |                         |                                       |
| - VALIANT BANK S. -8- 0%/21-20.01.2026   | CHF     | 8'000'000                        |           |              | 8'000'000                        | 7'740'000.00            | 0.47                                  |
| 0.193 VERIZON COMMUNICATIONS 0.1925%/21-24.03.2028   | CHF     | 10'000'000                       |           | 3'000'000    | 7'000'000                        | 6'608'000.00            | 0.40                                  |
| - WALLISER KANTONALBANK 0%/20-14.02.2029   | CHF     | 3'000'000                        |           |              | 3'000'000                        | 2'782'500.00            | 0.17                                  |
| 0.500 WESTPAC BANKING CORP 0.5%/18-16.05.2028  | CHF     | 1'000'000                        |           | 1'000'000    |                                  |                         |                                       |
| 0.250 ZUERCHER KANTONALBANK 0.25%/18-08.05.2025  | CHF     | 1'000'000                        |           |              | 1'000'000                        | 982'500.00              | 0.06                                  |
| 0.125 ZUERCHER KANTONALBANK S. -145- 0.125%/19-06.06.2029  | CHF     | 1'000'000                        |           |              | 1'000'000                        | 931'000.00              | 0.06                                  |
| 0.100 ZUG ESTATES HOLDING AG 0.1%/19-02.10.2025  | CHF     | 2'640'000                        |           |              | 2'640'000                        | 2'560'800.00            | 0.16                                  |
| 1.500 ZUGER KANTONALBANK 1.5%/11-28.11.2023  | CHF     | 1'000'000                        |           | 1'000'000    |                                  |                         |                                       |
| 0.750 ZURICH INSURANCE COMPANY LTD 0.75%/19-22.10.2027   | CHF     | 1'000'000                        |           |              | 1'000'000                        | 980'000.00              | 0.06                                  |
|  |         |                                  |           |              |                                  | <b>552'455'153.00</b>   | <b>33.85</b>                          |
| <b>Total Anleihen</b>  |         |                                  |           |              |                                  | <b>552'455'153.00</b>   | <b>33.85</b>                          |
| <b>Kollektive Kapitalanlagen</b>   |         |                                  |           |              |                                  |                         |                                       |
| <b>EURO</b>  |         |                                  |           |              |                                  |                         |                                       |
| AMUNDI INDEX EURO AGG SRI UCIT -C- EUR   | EUR     |                                  | 120'000   |              | 120'000                          | 4'909'931.64            | 0.30                                  |
|  |         |                                  |           |              |                                  | <b>4'909'931.64</b>     | <b>0.30</b>                           |
| <b>SCHWEIZER FRANKEN</b>   |         |                                  |           |              |                                  |                         |                                       |
| CREDIT SUISSE REAL ESTATE FUND GREEN PROPERTY  | CHF     | 8'000                            | 3'000     |              | 11'000                           | 1'331'000.00            | 0.08                                  |
| CREDIT SUISSE REAL ESTATE FUND HOSPITALITY   | CHF     | 139'200                          |           | 3'200        | 136'000                          | 9'683'200.00            | 0.59                                  |
| CREDIT SUISSE REAL ESTATE FUND LIVINGPLUS  | CHF     | 5'000                            |           |              | 5'000                            | 7'17'500.00             | 0.04                                  |
| CREDIT SUISSE REAL ESTATE FUND LOGISTICS PLUS  | CHF     | 9'142                            | 2'858     |              | 12'000                           | 1'135'200.00            | 0.07                                  |
| CREDIT SUISSE REAL ESTATE SIAT   | CHF     | 8'000                            | 5'000     |              | 13'000                           | 2'756'000.00            | 0.17                                  |
| FIR FONDS IMMOBILIER ROMAND  | CHF     | 8'000                            | 3'000     |              | 11'000                           | 2'332'000.00            | 0.14                                  |
| IMMOFONDS  | CHF     | 5'657                            |           |              | 5'657                            | 2'941'640.00            | 0.18                                  |
| SCHRODER IMMOPLUS  | CHF     | 7'000                            | 8'000     |              | 15'000                           | 2'265'000.00            | 0.14                                  |
| SF SUSTAINABLE PROPERTY FUND   | CHF     | 11'845                           |           |              | 11'845                           | 1'462'857.50            | 0.09                                  |
| SWISSINVEST REAL ESTATE INVESTMENT   | CHF     | 10'949                           | 3'051     |              | 14'000                           | 2'576'000.00            | 0.16                                  |
| UBS PROPERTY FUND - SWISS MIXED SIMA   | CHF     | 120'000                          | 3'500     |              | 123'500                          | 16'610'750.00           | 1.02                                  |
| UBS PROPERTY SWISS RESIDENTIAL ANFOS   | CHF     | 15'000                           | 5'000     |              | 20'000                           | 1'632'000.00            | 0.10                                  |
|  |         |                                  |           |              |                                  | <b>45'443'147.50</b>    | <b>2.78</b>                           |
| <b>US DOLLAR</b>   |         |                                  |           |              |                                  |                         |                                       |
| CREDIT SUISSE INDEX FUND (IE) ETF ICAV - CSIF (I) MSCI USA ESG LEADERS BLUE UCITS ETF -B- USD  | USD     | 1'000'000                        | 150'000   | 250'000      | 900'000                          | 141'401'423.93          | 8.66                                  |
| CSIF IE MSCI USA SMALL CAP ESG -B USD- EUR   | USD     | 100'000                          |           | 100'000      |                                  |                         |                                       |
| INVESCO MARKETS PLC - INVESCO -ACC- USD  | USD     | 300'000                          | 40'000    | 90'000       | 250'000                          | 13'732'148.30           | 0.84                                  |
| ISHARES MSCI USA SRI UCITS ETF   | USD     | 7'300'000                        | 600'000   | 900'000      | 7'000'000                        | 83'421'186.09           | 5.11                                  |
|  |         |                                  |           |              |                                  | <b>238'554'758.32</b>   | <b>14.62</b>                          |
| <b>Total Kollektive Kapitalanlagen</b>   |         |                                  |           |              |                                  | <b>288'907'837.46</b>   | <b>17.70</b>                          |
| <b>Total Börsennotierte / an einem geregelten Markt gehandelte Wertpapiere; bewertet zu den Kursen, die am Hauptmarkt bezahlt werden</b> |         |                                  |           |              |                                  | <b>1'194'852'910.46</b> | <b>73.21</b>                          |

| Titelbezeichnung   | Währung   | 31.12.2022<br>Anzahl/<br>Nominal | Käufe (1) | Verkäufe (1) | 31.12.2023<br>Anzahl/<br>Nominal | Kurswert CHF         | in % des<br>Gesamtfonds-<br>vermögens |
|--|---|----------------------------------|-----------|--------------|----------------------------------|----------------------|---------------------------------------|
| <b>Wertpapiere bewertet aufgrund von am Markt beobachtbaren Parametern</b> |   |                                  |           |              |                                  |                      |                                       |
| <b>Anleihen</b>  |   |                                  |           |              |                                  |                      |                                       |
| <b>EURO</b>  |   |                                  |           |              |                                  |                      |                                       |
| 2.500  | ABN AMRO BANK (reg. -S-) S. 117 2.5%/13-29.11.2023                      | EUR                              | 3'000'000 |              |                                  |                      |                                       |
| 0.500  | ABN AMRO BANK N.V. 0.5%/21-23.09.2029                                   | EUR                              | 3'700'000 |              | 3'700'000                        | 2'923'493.71         | 0.18                                  |
| 1.375  | AGENCE FRANCAISE DE DEVELOPPEMENT (reg. -S-) S. 62 1.375%/14-17.09.2024 | EUR                              | 1'000'000 |              | 1'000'000                        | 915'354.73           | 0.06                                  |
| 1.250  | BELGIUM KINGDOM 1.25%/18-22.04.2033                                     | EUR                              | 3'000'000 | 2'000'000    | 5'000'000                        | 4'163'150.12         | 0.26                                  |
| 1.000  | BNP PARIBAS 1%/18-17.04.2024  | EUR                              | 1'000'000 |              | 1'000'000                        | 921'871.93           | 0.06                                  |
| 3.625  | BNP PARIBAS 3.625%/22-01.09.2029  | EUR                              | 4'000'000 |              | 4'000'000                        | 3'733'266.13         | 0.23                                  |
| -  | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 0%/21-15.08.2031                               | EUR                              |           | 5'000'000    | 5'000'000                        | 4'025'693.97         | 0.25                                  |
| 1.125  | EASYJET 1.125%/16-18.10.2023  | EUR                              | 3'000'000 |              |                                  |                      |                                       |
| 1.875  | EDP FINANCE BV 1.875%/18-13.10.2025                                     | EUR                              | 3'000'000 |              | 3'000'000                        | 2'726'038.45         | 0.17                                  |
| -  | EUROPEAN UNION 0%/20-04.10.2030   | EUR                              |           | 5'000'000    | 5'000'000                        | 3'949'969.91         | 0.24                                  |
| 0.750  | FRANCE (GOVT OF) 0.75%/22-25.02.2028                                    | EUR                              | 5'000'000 |              | 5'000'000                        | 4'381'304.22         | 0.27                                  |
| -  | FRANCE 0%/20-25.11.2030   | EUR                              | 5'000'000 |              | 5'000'000                        | 3'974'235.08         | 0.24                                  |
| 0.010  | FREIE HANSESTADT HAMBURG 0.01%/20-03.06.2030                            | EUR                              |           | 5'000'000    | 5'000'000                        | 3'977'442.54         | 0.24                                  |
| 5.625  | GERMANY 5.625%/98-04.01.2028  | EUR                              | 3'000'000 | 2'000'000    | 5'000'000                        | 5'290'783.25         | 0.32                                  |
| 1.250  | IBERDROLA FINANZAS S.A.U. 1.25%/18-28.10.2026                           | EUR                              | 3'000'000 |              | 3'000'000                        | 2'678'177.49         | 0.16                                  |
| 1.125  | IBERDROLA INTERNATIONAL BV 1.125%/16-21.04.2026                         | EUR                              | 1'000'000 |              | 1'000'000                        | 896'212.21           | 0.05                                  |
| 1.250  | INNOGY FINANCE BV 1.25%/17-19.10.2027                                   | EUR                              | 2'000'000 |              | 2'000'000                        | 1'748'393.82         | 0.11                                  |
| 0.750  | KOMMUNEKREDIT 0.75%/18-05.07.2028                                       | EUR                              |           | 5'000'000    | 5'000'000                        | 4'319'432.69         | 0.26                                  |
| 0.625  | KUNTARAOHITUS OYJ S. -12/2017- 0.625%/17-26.11.2026                     | EUR                              |           | 5'000'000    | 5'000'000                        | 4'411'705.41         | 0.27                                  |
| 0.980  | MITSUBISHI UFJ FIN GRP 0.98%/18-09.10.2023                              | EUR                              | 1'000'000 |              |                                  |                      |                                       |
| 0.625  | NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD 0.625%/18-30.08.2023                        | EUR                              | 7'000'000 |              |                                  |                      |                                       |
| 0.875  | NATURGY FINANCE 0.875%/17-15.05.2025                                    | EUR                              | 1'000'000 |              | 1'000'000                        | 896'965.26           | 0.05                                  |
| 1.000  | NEDER WATERSCHAPSBANK S. -1414- 1%/15-03.09.2025                        | EUR                              | 1'000'000 |              | 1'000'000                        | 901'697.44           | 0.06                                  |
| 1.125  | REPUBLIC OF POLAND 1.125%/18-07.08.2026                                 | EUR                              | 1'000'000 |              | 1'000'000                        | 882'359.68           | 0.05                                  |
| 0.875  | SCHNEIDER ELECTRIC 0.875%/15-11.03.2025                                 | EUR                              | 1'000'000 |              | 1'000'000                        | 905'620.77           | 0.06                                  |
| 1.250  | SEGRO CAPITAL SARL 1.25%/22-23.03.2026                                  | EUR                              | 3'000'000 |              | 3'000'000                        | 2'667'495.24         | 0.16                                  |
| 0.500  | SPAREBANK 1 BOLIGKREDDIT 0.5%/18-30.01.2025                             | EUR                              | 1'000'000 |              | 1'000'000                        | 901'483.61           | 0.06                                  |
| 0.875  | SSE PLC 0.875%/17-06.09.2025  | EUR                              | 1'000'000 |              | 1'000'000                        | 893'162.79           | 0.05                                  |
| 0.934  | SUMITOMO MITSUI FINL GRP 0.934%/17-11.10.2024                           | EUR                              | 3'000'000 |              | 3'000'000                        | 2'727'014.63         | 0.17                                  |
| 0.750  | TENNET HOLDING BV 0.75%/17-26.06.2025                                   | EUR                              | 2'000'000 |              | 2'000'000                        | 1'805'086.93         | 0.11                                  |
|  |   |                                  |           |              |                                  | <b>67'617'412.01</b> | <b>4.14</b>                           |
| <b>US DOLLAR</b>   |   |                                  |           |              |                                  |                      |                                       |
| 2.150  | ADOBE INC 2.15%/20-01.02.2027   | USD                              | 5'000'000 |              | 5'000'000                        | 3'947'511.33         | 0.24                                  |
| 1.650  | AMAZON.COM INC 1.65%/21-12.05.2028                                      | USD                              | 4'000'000 |              | 4'000'000                        | 3'031'125.83         | 0.19                                  |
| 5.450  | ANHEUSER-BUSCH INBEV WOR 5.45%/19-23.01.2039                            | USD                              |           | 5'000'000    | 5'000'000                        | 4'439'903.48         | 0.27                                  |
| 3.000  | APPLE INC 3%/17-20.06.2027  | USD                              | 5'000'000 |              | 5'000'000                        | 4'046'528.40         | 0.25                                  |
| 2.125  | ASIAN DEVELOPMENT BANK 2.125%/15-19.03.2025                             | USD                              | 3'000'000 |              | 3'000'000                        | 2'449'327.96         | 0.15                                  |
| 3.125  | ASIAN DEVELOPMENT BANK 3.125%/18-26.09.2028                             | USD                              | 1'000'000 |              | 1'000'000                        | 810'197.80           | 0.05                                  |
| 4.500  | AT&T 4.5%/15-15.05.2035   | USD                              |           | 3'000'000    | 3'000'000                        |                      |                                       |
| 3.650  | BARCLAYS 3.65%/15-16.03.2025  | USD                              | 5'000'000 |              | 5'000'000                        |                      |                                       |
| 1.500  | BNG BANK NV 1.5%/19-16.10.2024  | USD                              | 6'500'000 |              | 6'500'000                        |                      |                                       |
| 3.550  | BOOKING HOLDINGS INC 3.55%/17-15.03.2028                                | USD                              | 3'000'000 |              | 3'000'000                        | 2'437'233.82         | 0.15                                  |
| 6.087  | BROOKFIELD CAPITAL FIN 6.087%/23-14.06.2033                             | USD                              |           | 3'000'000    | 3'000'000                        | 2'635'284.79         | 0.16                                  |
| 3.950  | CAMPBELL SOUP CO 3.95%/18-15.03.2025                                    | USD                              | 5'000'000 |              | 5'000'000                        |                      |                                       |
| 3.500  | CISCO SYSTEMS 3.5%/15-15.06.2025  | USD                              | 900'000   |              | 900'000                          | 747'326.80           | 0.05                                  |
| 3.900  | COMMONWEALTH BANK AUST 3.9%/18-16.03.2028                               | USD                              | 1'000'000 |              | 1'000'000                        | 819'177.93           | 0.05                                  |
| 1.250  | EUROPEAN INVESTMENT BANK 1.25%/21-14.02.2031                            | USD                              |           | 5'000'000    | 5'000'000                        | 3'516'768.15         | 0.22                                  |
| 2.125  | EUROPEAN INVESTMENT BANK 2.125%/16-13.04.2026                           | USD                              | 3'000'000 |              | 3'000'000                        | 2'411'353.88         | 0.15                                  |
| 2.375  | EUROPEAN INVESTMENT BANK 2.375%/17-24.05.2027                           | USD                              | 3'000'000 |              | 3'000'000                        | 2'392'341.59         | 0.15                                  |
| 3.625  | GOLDMAN SACHS GROUP INC 3.625%/19-20.02.2024                            | USD                              | 5'000'000 |              | 5'000'000                        | 4'195'495.86         | 0.26                                  |
| 1.950  | IBM CORP 1.95%/20-15.05.2030  | USD                              | 3'000'000 |              | 3'000'000                        | 2'171'213.29         | 0.13                                  |
| 4.750  | IBRD S. 1312 4.75%/05-15.02.2035  | USD                              | 1'000'000 |              | 1'000'000                        | 877'494.06           | 0.05                                  |
| 2.125  | IBRD T. -371- 2.125%/15-03.03.2025                                      | USD                              | 3'000'000 |              | 3'000'000                        | 2'451'953.82         | 0.15                                  |
| 3.500  | ILLINOIS TOOL WORKS 3.5%/14-01.03.2024                                  | USD                              | 4'000'000 |              | 4'000'000                        |                      |                                       |
| 2.125  | INTERNATIONAL FINANCE CORP IFC 2.125%/16-07.04.2026                     | USD                              | 1'500'000 |              | 1'500'000                        | 1'205'386.58         | 0.07                                  |
| 2.125  | KOMMUNALBANKEN AS S. -4901- 2.125%/15-11.02.2025                        | USD                              | 3'000'000 |              | 3'000'000                        | 2'451'979.07         | 0.15                                  |
| 3.875  | KOREA WATER RESOURCES 3.875%/18-15.05.2023                              | USD                              | 1'000'000 |              | 1'000'000                        |                      |                                       |
| 2.250  | LAND NORDRHEIN-WESTFALEN 2.25%/15-16.04.2025                            | USD                              | 5'000'000 |              | 5'000'000                        | 4'072'787.07         | 0.25                                  |
| 5.700  | METLIFE 5.7%/05-15.06.2035  | USD                              |           | 5'000'000    | 5'000'000                        | 4'525'117.92         | 0.28                                  |
| 3.125  | MICROSOFT 3.125%/15-03.11.2025  | USD                              | 4'000'000 |              | 4'000'000                        | 3'288'629.12         | 0.20                                  |
| 2.875  | ORACLE CORP 2.875%/21-25.03.2031  | USD                              |           | 5'000'000    | 5'000'000                        | 3'726'627.10         | 0.23                                  |
| 2.050  | PROVINCE OF ALBERTA S. -PAGM06- 2.05%/16-17.08.2026                     | USD                              | 3'000'000 |              | 3'000'000                        | 2'383'125.81         | 0.15                                  |
| 4.500  | PROVINCE OF QUEBEC S. -RD- 4.5%/23-08.09.2033                           | USD                              |           | 7'000'000    | 7'000'000                        | 5'964'892.58         | 0.37                                  |
| 3.125  | PRUDENTIAL FUNDING (ASIA) PLC 3.125%/20-14.04.2030                      | USD                              |           | 3'000'000    | 3'000'000                        | 2'269'632.81         | 0.14                                  |
| 3.125  | PRUDENTIAL PLC 3.125%/20-14.04.2030                                     | USD                              | 3'000'000 |              | 3'000'000                        |                      |                                       |

| Titelbezeichnung  | Währung | 31.12.2022<br>Anzahl/<br>Nominal | Käufe (1) | Verkäufe (1) | 31.12.2023<br>Anzahl/<br>Nominal | Kurswert CHF          | in % des<br>Gesamtfonds-<br>vermögens |
|---|---------|----------------------------------|-----------|--------------|----------------------------------|-----------------------|---------------------------------------|
| 3.250 SIEMENS FINANCIERINGSMAATSCHAPPIJ (reg. -S-) 3.25%/15-27.05.2025  | USD     | 3'000'000                        |           |              | 3'000'000                        | 2'472'203.30          | 0.15                                  |
| 4.050 STANDARD CHARTERED (reg. -S-) 4.05%/16-12.04.2026   | USD     | 1'000'000                        |           |              | 1'000'000                        | 820'288.87            | 0.05                                  |
| 3.500 SWIRE PROPERT MTN FIN 3.5%/18-10.01.2028  | USD     | 1'000'000                        |           |              | 1'000'000                        | 799'096.78            | 0.05                                  |
| 3.100 UNILEVER CAPITAL 3.1%/15-30.07.2025   | USD     | 1'000'000                        |           |              | 1'000'000                        | 826'348.57            | 0.05                                  |
| 2.000 UNITED STATES OF AMERICA 2%/17-30.04.2024   | USD     | 5'000'000                        |           | 5'000'000    |                                  |                       |                                       |
| 4.500 UNITED STATES OF AMERICA 4.5%/06-15.02.2036   | USD     |                                  | 7'000'000 |              | 7'000'000                        | 6'283'512.51          | 0.39                                  |
| 6.250 UNITED STATES OF AMERICA 6.25%/00-15.05.2030  | USD     | 5'000'000                        | 3'000'000 |              | 8'000'000                        | 7'614'593.54          | 0.47                                  |
| 2.875 UNITED STATES OF AMERICA S. -C-2028- 2.875%/18-15.05.2028   | USD     | 10'000'000                       |           | 10'000'000   |                                  |                       |                                       |
| 2.125 UNITED STATES OF AMERICA -T-2022- 2.125%/15-31.12.2022  | USD     | 1'000'000                        |           | 1'000'000    |                                  |                       |                                       |
| 2.875 US TREASURY N/B S. -C-2032- 2.875%/22-15.05.2032  | USD     | 7'000'000                        | 3'000'000 |              | 10'000'000                       | 7'803'432.93          | 0.48                                  |
| 0.500 US TREASURY N/B S. -V-2026- 0.5%/21-28.02.2026  | USD     |                                  | 5'000'000 |              | 5'000'000                        | 3'888'894.87          | 0.24                                  |
| 3.875 VERIZON COMMUNICATIONS 3.875%/19-08.02.2029   | USD     | 1'500'000                        |           |              | 1'500'000                        | 1'224'209.50          | 0.08                                  |
| 0.750 WI TREASURY N/B 0.75%/21-31.01.2028   | USD     | 5'000'000                        |           |              | 5'000'000                        | 3'710'378.50          | 0.23                                  |
| 2.375 WI TREASURY N/B 2.375%/22-31.03.2029  | USD     |                                  | 5'000'000 |              | 5'000'000                        | 3'907'962.92          | 0.24                                  |
|   |         |                                  |           |              |                                  | <b>112'619'339.14</b> | <b>6.90</b>                           |
| <b>Total Anleihen</b>   |         |                                  |           |              |                                  | <b>180'236'751.15</b> | <b>11.04</b>                          |
| <b>Kollektive Kapitalanlagen</b>  |         |                                  |           |              |                                  |                       |                                       |
| <b>ENGLISCHES PFUND</b>   |         |                                  |           |              |                                  |                       |                                       |
| CREDIT SUISSE INDEX FUND (LUX) SICAV - CSIF (LUX) EQUITY UK ESG BLUE - GBX GBP ACC- GBP                         | GBP     | 12'000                           |           | 7'500        | 4'500                            | 6'165'180.75          | 0.38                                  |
|   |         |                                  |           |              |                                  | <b>6'165'180.75</b>   | <b>0.38</b>                           |
| <b>EURO</b>   |         |                                  |           |              |                                  |                       |                                       |
| CREDIT SUISSE (LUX) EUROPEAN DIVIDEND PLUS EQUITY FUND -EB- EUR   | EUR     | 2'500                            |           | 700          | 1'800                            | 4'318'547.61          | 0.26                                  |
| CREDIT SUISSE INDEX FUND (LUX) SICAV - CSIF (LUX) EQUITY EMU ESG BLUE -OBX EUR ACC- EUR                         | EUR     | 13'500                           | 13'500    | 7'000        | 20'000                           | 25'414'651.08         | 1.56                                  |
| NORDEA 1 SICAV - GLOBAL CLIMATE AND ENVIRONMENT FUND -BI- EUR   | EUR     | 150'000                          |           | 150'000      |                                  |                       |                                       |
|   |         |                                  |           |              |                                  | <b>29'733'198.69</b>  | <b>1.82</b>                           |
| <b>JAPANISCHER YEN</b>  |         |                                  |           |              |                                  |                       |                                       |
| CREDIT SUISSE INDEX FUND (LUX) SICAV - CSIF (LUX) EQUITY JAPAN ESG BLUE -OBX- JPY                               | JPY     | 25'000                           | 18'000    | 20'000       | 23'000                           | 23'030'829.87         | 1.41                                  |
|   |         |                                  |           |              |                                  | <b>23'030'829.87</b>  | <b>1.41</b>                           |
| <b>KANADISCHER DOLLAR</b>   |         |                                  |           |              |                                  |                       |                                       |
| CREDIT SUISSE INDEX FUND (LUX) SICAV - CSIF(LUX ) EQUITY CANADA ESG BLUE -OBX CAD ACC- CAD                      | CAD     | 15'000                           |           |              | 15'000                           | 11'932'086.13         | 0.73                                  |
|   |         |                                  |           |              |                                  | <b>11'932'086.13</b>  | <b>0.73</b>                           |
| <b>SCHWEIZER FRANKEN</b>  |         |                                  |           |              |                                  |                       |                                       |
| CREDIT SUISSE INDEX FUND (CH) - CSIF (CH) EQUITY SWITZERLAND TOTAL MARKET ESG BLUE -OB-                         | CHF     | 26'000                           | 2'000     |              | 28'000                           | 29'985'760.00         | 1.84                                  |
| CREDIT SUISSE INDEX FUND (CH) I - CSIF (CH) I REAL ESTATE SWITZERLAND BLUE -QA-                                 | CHF     | 5'000                            |           |              | 5'000                            | 7'453'950.00          | 0.46                                  |
| CREDIT SUISSE INSTITUTIONAL MASTER FUND UMBRELLA - EMERGING MARKETS -EB-  | CHF     | 15'000                           |           | 15'000       |                                  |                       |                                       |
| CREDIT SUISSE SPECIAL PORTFOLIO SWISS REAL ESTATE SECURITIES -EB- CS REAL ESTATE FUND INTERNATIONAL             | CHF     | 7'000                            | 1'000     |              | 8'000                            | 14'521'760.00         | 0.89                                  |
| CS REAL ESTATE SICAV-SIF I SICAV-SIF - CREDIT SUISSE (LUX) MULTI-MANAGER REAL ESTATE GLOBAL -SBPH-I- USD        | CHF     | 6'000                            |           |              | 6'000                            | 4'698'480.00          | 0.29                                  |
| CS REAL ESTATE SICAV-SIF I SICAV-SIF - CREDIT SUISSE (LUX) MULTI-MANAGER REAL ESTATE GLOBAL -SBPH-I- USD        | CHF     | 5'000                            |           |              | 5'000                            | 6'157'548.77          | 0.38                                  |
| CSIMF EMERGING MARKETS BONDS -DB-   | CHF     | 10'000                           |           | 10'000       |                                  |                       |                                       |
|   |         |                                  |           |              |                                  | <b>62'817'498.77</b>  | <b>3.85</b>                           |
| <b>US DOLLAR</b>  |         |                                  |           |              |                                  |                       |                                       |
| CREDIT SUISSE FUND (LUX) ASIA PACIFIC INCOME EQUITY FUND -DA- USD   | USD     | 5'000                            |           | 5'000        |                                  |                       |                                       |
| CREDIT SUISSE INDEX FUND (LUX) SICAV - CSIF (LUX) BOND GOVERNMENT EMERGING MARKETS USD ESG BLUE                 | USD     |                                  | 12'000    | 12'000       |                                  |                       |                                       |
| CREDIT SUISSE INDEX FUND (LUX) SICAV - CSIF (LUX) EQUITY CHINA TOTAL MARKET BLUE -OB- USD                       | USD     |                                  | 8'000     | 5'000        | 3'000                            | 2'212'570.70          | 0.14                                  |
| CREDIT SUISSE INDEX FUND (LUX) SICAV - CSIF (LUX) EQUITY EMERGING MARKETS ESG BLUE -OBX- USD                    | USD     | 8'000                            | 48'000    | 4'000        | 52'000                           | 45'727'285.87         | 2.80                                  |
| CREDIT SUISSE INDEX FUND (LUX) SICAV - CSIF (LUX) EQUITY EMERGING MARKETS MINIMUM VOLATILITY ESG BLUE -OBX- USD | USD     | 4'000                            |           | 4'000        |                                  |                       |                                       |
| CREDIT SUISSE INDEX FUND (LUX) SICAV - CSIF (LUX) EQUITY PACIFIC EX JAPAN ESG BLUE -OBX USD ACC- USD            | USD     | 9'000                            | 2'000     | 3'000        | 8'000                            | 8'497'103.68          | 0.52                                  |
| CS INVESTMENT FUNDS 4 SICAV - CREDIT SUISSE (LUX) ALTERNATIVE OPPORTUNITIES FUND -EA- USD                       | USD     | 46'000                           |           | 9'500        | 36'500                           | 30'009'969.48         | 1.84                                  |
| SIMAG INVESTMENT FUNDS SICAV - SIMAG SYSTEMATIC USA ESG EQUITY FUND -SB- USD                                    | USD     | 117'000                          |           | 117'000      |                                  |                       |                                       |
|   |         |                                  |           |              |                                  | <b>86'446'929.73</b>  | <b>5.30</b>                           |
| <b>Total Kollektive Kapitalanlagen</b>  |         |                                  |           |              |                                  | <b>220'125'723.94</b> | <b>13.49</b>                          |
| <b>Total Wertpapiere bewertet aufgrund von am Markt beobachtbaren Parametern</b>                                |         |                                  |           |              |                                  | <b>400'362'475.09</b> | <b>24.53</b>                          |

| Titelbezeichnung   | Währung | 31.12.2022<br>Anzahl/<br>Nominal | Käufe (1) | Verkäufe (1) | 31.12.2023<br>Anzahl/<br>Nominal | Kurswert CHF            | in % des<br>Gesamtfonds-<br>vermögens |
|--|---------|----------------------------------|-----------|--------------|----------------------------------|-------------------------|---------------------------------------|
| <b>Derivative Finanzinstrumente</b>  |         |                                  |           |              |                                  |                         |                                       |
| <b>Wertpapiere bewertet aufgrund von am Markt beobachtbaren Parametern</b>       |         |                                  |           |              |                                  |                         |                                       |
| <b>Devisentermingeschäfte</b>  |         |                                  |           |              |                                  |                         |                                       |
| Devisentermingeschäfte (siehe Liste)   |         |                                  |           |              |                                  | 10'800'459.39           | 0.66                                  |
| <b>Total Devisentermingeschäfte</b>  |         |                                  |           |              |                                  | <b>10'800'459.39</b>    | <b>0.66</b>                           |
| <b>Total Wertpapiere bewertet aufgrund von am Markt beobachtbaren Parametern</b> |         |                                  |           |              |                                  | <b>10'800'459.39</b>    | <b>0.66</b>                           |
| <b>Total Derivative Finanzinstrumente</b>  |         |                                  |           |              |                                  | <b>10'800'459.39</b>    | <b>0.66</b>                           |
| <b>Total Anlagen</b>   |         |                                  |           |              |                                  | <b>1'606'015'844.94</b> | <b>98.40</b>                          |
| Bankguthaben auf Sicht   |         |                                  |           |              |                                  | 20'555'504.05           | 1.26                                  |
| Bankguthaben auf Zeit  |         |                                  |           |              |                                  | 0.00                    | 0.00                                  |
| Sonstige Vermögenswerte  |         |                                  |           |              |                                  | 5'480'731.56            | 0.34                                  |
| <b>Gesamtfondsvermögen (GFV)</b>   |         |                                  |           |              |                                  | <b>1'632'052'080.55</b> | <b>100.00</b>                         |
| ./. Bankverbindlichkeiten  |         |                                  |           |              |                                  | 0.00                    | 0.00                                  |
| ./. Andere Verbindlichkeiten   |         |                                  |           |              |                                  | 1'289'349.95            | 0.08                                  |
| ./. Andere Kredite   |         |                                  |           |              |                                  | 0.00                    | 0.00                                  |
| <b>Nettofondsvermögen</b>  |         |                                  |           |              |                                  | <b>1'630'762'730.60</b> | <b>99.92</b>                          |

(1) Umfassen auch Corporate Actions

**Summarische Gliederung des Portefeuilles gemäss KKV FINMA Art. 84 Absatz 2**

| Anlagekategorien  | Kurswert CHF     | in % des<br>Gesamtfonds-<br>vermögens |
|---|------------------|---------------------------------------|
| Börsennotierte / an einem geregelten Markt gehandelte Wertpapiere; bewertet zu den Kursen, die am Hauptmarkt bezahlt werden | 1'194'852'910.46 | 73.21                                 |
| Wertpapiere bewertet aufgrund von am Markt beobachtbaren Parametern   | 411'162'934.48   | 25.19                                 |
| Wertpapiere bewertet aufgrund geeigneten Bewertungsmodellen unter Berücksichtigung der aktuellen Marktgegebenheiten         | 0.00             | 0.00                                  |

**Aufstellung der Devisentermingeschäfte für die Zeit vom 1. Januar 2023 bis zum 31. Dezember 2023**

| Fälligkeit                          | Transaktion | Währung | Betrag        | Gegen | Gegenwert     | Devisengewinn/-verlust<br>Mandatswährung | in % des GFV |
|-------------------------------------|-------------|---------|---------------|-------|---------------|--|--------------|
| 09.02.2023                          | Bought      | CHF     | 25'598'066    | EUR   | 26'000'000    | 0.00                                     | 0.00         |
| 09.02.2023                          | Bought      | CHF     | 9'880'870     | EUR   | 10'000'000    | 0.00                                     | 0.00         |
| 09.02.2023                          | Bought      | CHF     | 9'008'559     | EUR   | 9'000'000     | 0.00                                     | 0.00         |
| 09.02.2023                          | Bought      | CHF     | 10'023'350    | EUR   | 10'000'000    | 0.00                                     | 0.00         |
| 09.02.2023                          | Bought      | CHF     | 18'043'776    | EUR   | 18'000'000    | 0.00                                     | 0.00         |
| 09.02.2023                          | Bought      | CHF     | 11'009'856    | EUR   | 11'000'000    | 0.00                                     | 0.00         |
| 09.02.2023                          | Bought      | CHF     | 151'668'740   | USD   | 155'000'000   | 0.00                                     | 0.00         |
| 09.02.2023                          | Bought      | CHF     | 4'605'040     | USD   | 5'000'000     | 0.00                                     | 0.00         |
| 12.05.2023                          | Bought      | CHF     | 83'008'716    | EUR   | 84'000'000    | 0.00                                     | 0.00         |
| 12.05.2023                          | Bought      | CHF     | 142'075'790   | USD   | 155'000'000   | 0.00                                     | 0.00         |
| 12.05.2023                          | Bought      | CHF     | 9'323'240     | USD   | 10'000'000    | 0.00                                     | 0.00         |
| 12.05.2023                          | Bought      | JPY     | 2'000'000'000 | CHF   | 14'095'883    | 0.00                                     | 0.00         |
| 12.05.2023                          | Bought      | USD     | 11'000'000    | CHF   | 10'005'688    | 0.00                                     | 0.00         |
| 10.08.2023                          | Bought      | CHF     | 84'463'515    | EUR   | 87'000'000    | 0.00                                     | 0.00         |
| 10.08.2023                          | Bought      | CHF     | 15'724'932    | JPY   | 2'500'000'000 | 0.00                                     | 0.00         |
| 10.08.2023                          | Bought      | CHF     | 135'795'352   | USD   | 154'000'000   | 0.00                                     | 0.00         |
| 10.08.2023                          | Bought      | CHF     | 10'793'304    | USD   | 12'000'000    | 0.00                                     | 0.00         |
| 10.08.2023                          | Bought      | CHF     | 17'865'120    | USD   | 20'000'000    | 0.00                                     | 0.00         |
| 10.08.2023                          | Bought      | GBP     | 3'000'000     | CHF   | 3'345'615     | 0.00                                     | 0.00         |
| 10.08.2023                          | Bought      | JPY     | 2'500'000'000 | CHF   | 16'528'412    | 0.00                                     | 0.00         |
| 09.11.2023                          | Bought      | CHF     | 83'082'999    | EUR   | 87'000'000    | 0.00                                     | 0.00         |
| 09.11.2023                          | Bought      | CHF     | 160'975'746   | USD   | 186'000'000   | 0.00                                     | 0.00         |
| 09.11.2023                          | Bought      | EUR     | 5'000'000     | CHF   | 4'763'605     | 0.00                                     | 0.00         |
| 09.11.2023                          | Bought      | EUR     | 10'000'000    | CHF   | 9'658'090     | 0.00                                     | 0.00         |
| 09.11.2023                          | Bought      | GBP     | 3'000'000     | CHF   | 3'312'060     | 0.00                                     | 0.00         |
| 09.11.2023                          | Bought      | USD     | 18'000'000    | CHF   | 16'054'074    | 0.00                                     | 0.00         |
| 07.02.2024                          | Bought      | CHF     | 68'825'880    | EUR   | 72'000'000    | 2'061'222.20                             | 0.13         |
| 07.02.2024                          | Bought      | CHF     | 6'718'754     | EUR   | 7'000'000     | 227'814.65                               | 0.01         |
| 07.02.2024                          | Bought      | CHF     | 140'737'868   | USD   | 158'000'000   | 8'346'643.02                             | 0.51         |
| 07.02.2024                          | Bought      | CHF     | 8'598'270     | USD   | 10'000'000    | 217'792.52                               | 0.01         |
| 07.02.2024                          | Bought      | EUR     | 3'000'000     | CHF   | 2'835'090     | -53'013.00                               | 0.00         |
| <b>Total Devisentermingeschäfte</b> |             |         |               |       |               | <b>10'800'459.39</b>                     | <b>0.66</b>  |

## Ausgeliehene Wertpapierbestände (Lending and Borrowing)

| Titelbezeichnung                        | Agent                      | Lending / Borrowing | 31.12.2023<br>Anzahl/ Nominal |
|---|----------------------------|---------------------|-------------------------------|
| AMUNDI INDEX EURO AGG SRI-C             | Credit Suisse (Schweiz) AG | Lending             | 1'542                         |
| ASIAN DEVELOPMENT BANK 2.1250 19/03/25  | Credit Suisse (Schweiz) AG | Lending             | 1'908'000                     |
| ASIAN DEVELOPMENT BANK 3.1250 26/09/28  | Credit Suisse (Schweiz) AG | Lending             | 999'000                       |
| BALOISE HOLDING AG 0.1250 27/06/30      | Credit Suisse (Schweiz) AG | Lending             | 2'200'000                     |
| BANCO SANTANDER SA 0.2000 19/11/27      | Credit Suisse (Schweiz) AG | Lending             | 2'000'000                     |
| BUNDESREPUB. DEUTSCHLAN 5.6250 04/01/28 | Credit Suisse (Schweiz) AG | Lending             | 5'000'000                     |
| COMMONWEALTH BANK AUST 3.9000 16/03/28  | Credit Suisse (Schweiz) AG | Lending             | 144'000                       |
| COOP-GRUPPE 0.5000 29/09/27             | Credit Suisse (Schweiz) AG | Lending             | 500'000                       |
| EDP FINANCE BV 1.8750 13/10/25          | Credit Suisse (Schweiz) AG | Lending             | 400'000                       |
| EUROPEAN INVESTMENT BAN 2.1250 13/04/26 | Credit Suisse (Schweiz) AG | Lending             | 200'000                       |
| EUROPEAN INVESTMENT BAN 2.3750 24/05/27 | Credit Suisse (Schweiz) AG | Lending             | 200'000                       |
| FRANCE (GOVT OF) 0.7500 25/02/28        | Credit Suisse (Schweiz) AG | Lending             | 760'000                       |
| GIVAUDAN SA 0.1500 10/11/28             | Credit Suisse (Schweiz) AG | Lending             | 825'000                       |
| IBERDROLA FINANZAS SAU 1.2500 28/10/26  | Credit Suisse (Schweiz) AG | Lending             | 2'700'000                     |
| IBERDROLA INTL BV 1.1250 21/04/26       | Credit Suisse (Schweiz) AG | Lending             | 500'000                       |
| KOMMUNALBANKEN AS 2.1250 11/02/25       | Credit Suisse (Schweiz) AG | Lending             | 302'000                       |
| KUEHNE + NAGEL INTL AG-REG              | Credit Suisse (Schweiz) AG | Lending             | 1'053                         |
| PROVINCE OF ALBERTA 2.0500 17/08/26     | Credit Suisse (Schweiz) AG | Lending             | 800'000                       |
| PRUDENTIAL FUNDING ASIA 3.1250 14/04/30 | Credit Suisse (Schweiz) AG | Lending             | 2'600'000                     |
| REPUBLIC OF POLAND 1.1250 07/08/26      | Credit Suisse (Schweiz) AG | Lending             | 1'000'000                     |
| SF SUSTAINABLE PROPERTY FUND            | Credit Suisse (Schweiz) AG | Lending             | 8'173                         |
| SWIRE PROPERT MTN FIN 3.5000 10/01/28   | Credit Suisse (Schweiz) AG | Lending             | 600'000                       |
| SWISSINVEST REAL ESTATE FUND            | Credit Suisse (Schweiz) AG | Lending             | 362                           |
| US TREASURY N/B 0.7500 31/01/28         | Credit Suisse (Schweiz) AG | Lending             | 4'999'900                     |
| VERIZON COMMUNICATIONS 3.8750 08/02/29  | Credit Suisse (Schweiz) AG | Lending             | 1'398'000                     |

## Ausserbilanzgeschäfte

|  | 31.12.2023                             |                 | 31.12.2022                             |                 |
|--|--|-----------------|--|-----------------|
|  | Basiswertäquivalent in<br>Fondswährung | in %<br>des NFV | Basiswertäquivalent in<br>Fondswährung | in %<br>des NFV |
| <b>Engagement erhöhende Derivatpositionen:</b>                                   |  |                 |  |                 |
| - Währungsrisiko   | 0.00                                   | 0.00%           | 0.00                                   | 0.00%           |
| <b>Total engagement erhöhende Positionen</b>                                     | <b>0.00</b>                            | <b>0.00%</b>    | <b>0.00</b>                            | <b>0.00%</b>    |
| <b>Engagement reduzierende Derivatpositionen:</b>                                |  |                 |  |                 |
| - Währungsrisiko   | 212'050'038.72                         | 13.00%          | 178'958'600.45                         | 10.08%          |
| <b>Total engagement reduzierende Positionen</b>                                  | <b>212'050'038.72</b>                  | <b>13.00%</b>   | <b>178'958'600.45</b>                  | <b>10.08%</b>   |
| <b>Volumen der verliehenen Wertpapiere und Provisionserträge aus Wertpapiere</b> |  |                 |  |                 |
| - Volumen der verliehenen Positionen   | 28'045'799.26                          | 1.72%           | 52'894'434.22                          | 2.98%           |
| - Kommission Einkommen   | 89'499.20                              | 0.01%           | 181'287.50                             | 0.01%           |

## Kurze Übersicht

| Kennzahlen                            | Währung | 31.12.2023 | 31.12.2022 | 31.12.2021 |
|---------------------------------------|---------|------------|------------|------------|
| <b>Konsolidierung</b>                 |         |            |            |            |
| Nettofondsvermögen in Mio.            | CHF     | 100.51     | 121.77     | 119.32     |
| <b>Anteilklasse A</b>                 |         |            |            |            |
| Nettofondsvermögen in Mio.            | CHF     | 0.59       | 0.77       | 0.90       |
| Inventarwert pro Anteil               | CHF     | -          | -          | 121.57     |
| Inventarwert pro Anteil (Swung NAV)   | CHF     | 106.96     | 101.66     | -          |
| Inventarwert pro Anteil (Unswung NAV) | CHF     | 107.10     | 101.41     | -          |
| <b>Anteilklasse B</b>                 |         |            |            |            |
| Nettofondsvermögen in Mio.            | CHF     | 6.67       | 6.34       | 6.47       |
| Inventarwert pro Anteil               | CHF     | -          | -          | 121.57     |
| Inventarwert pro Anteil (Swung NAV)   | CHF     | 107.55     | 101.82     | -          |
| Inventarwert pro Anteil (Unswung NAV) | CHF     | 107.70     | 101.57     | -          |
| <b>Anteilklasse UA</b>                |         |            |            |            |
| Nettofondsvermögen in Mio.            | CHF     | 32.91      | 46.68      | 43.17      |
| Inventarwert pro Anteil               | CHF     | -          | -          | 122.05     |
| Inventarwert pro Anteil (Swung NAV)   | CHF     | 108.07     | 102.37     | -          |
| Inventarwert pro Anteil (Unswung NAV) | CHF     | 108.22     | 102.12     | -          |
| <b>Anteilklasse UB</b>                |         |            |            |            |
| Nettofondsvermögen in Mio.            | CHF     | 58.98      | 66.71      | 67.74      |
| Inventarwert pro Anteil               | CHF     | -          | -          | 122.05     |
| Inventarwert pro Anteil (Swung NAV)   | CHF     | 108.64     | 102.54     | -          |
| Inventarwert pro Anteil (Unswung NAV) | CHF     | 108.79     | 102.29     | -          |
| <b>Anteilklasse EB</b>                |         |            |            |            |
| Nettofondsvermögen in Mio.            | CHF     | 1.37       | 1.28       | 1.03       |
| Inventarwert pro Anteil               | CHF     | -          | -          | 1'043.31   |
| Inventarwert pro Anteil (Swung NAV)   | CHF     | 936.96     | 881.14     | -          |
| Inventarwert pro Anteil (Unswung NAV) | CHF     | 938.25     | 878.99     | -          |



## Verwendung des Erfolges

### Ausschüttung pro Anteil

#### 1. Für in der Schweiz und im Ausland domizilierte Anteilinhaber

| Ausschüttung 2023                          |            | Anteilklasse A |            | Anteilklasse UA |  |
|--|------------|----------------|------------|-----------------|--|
| Bruttoausschüttung aus Ertrag              | CHF        | 0.760          | CHF        | 0.980           |  |
| ./.. 35% Eidgenössische Verrechnungssteuer | CHF        | 0.266          | CHF        | 0.343           |  |
| <b>Nettoausschüttung aus Ertrag</b>        | <b>CHF</b> | <b>0.494</b>   | <b>CHF</b> | <b>0.637</b>    |  |
| <b>Coupon Nr. Ertrag</b>                   |            | <b>3</b>       |            | <b>3</b>        |  |

#### 2. Für in der Schweiz und im Ausland domizilierte Anteilinhaber (verrechnungssteuerbefreite Erträge aus direktem Immobilienbesitz)

| Ausschüttung 2023                   |            | Anteilklasse A |            | Anteilklasse UA |  |
|-------------------------------------|------------|----------------|------------|-----------------|--|
| Bruttoausschüttung aus Ertrag       | CHF        | 0.010          | CHF        | 0.020           |  |
| <b>Nettoausschüttung aus Ertrag</b> | <b>CHF</b> | <b>0.010</b>   | <b>CHF</b> | <b>0.020</b>    |  |
| <b>Coupon Nr. Ertrag</b>            |            | <b>4</b>       |            | <b>4</b>        |  |

Zahlbar ab 15.02.2024 bei der CREDIT SUISSE (SCHWEIZ) AG und deren sämtlichen Geschäftsstellen in der Schweiz.

### Thesaurierung pro Anteil

#### 1. Für in der Schweiz und im Ausland domizilierte Anteilinhaber

| Thesaurierung 2023                               |            | Anteilklasse B |            | Anteilklasse UB |            | Anteilklasse EB |  |
|--|------------|----------------|------------|-----------------|------------|-----------------|--|
| Zur Thesaurierung verfügbarer Erfolg             | CHF        | 0.740          | CHF        | 0.950           | CHF        | 12.690          |  |
| ./.. 35% Eidgenössische Verrechnungssteuer       | CHF        | 0.259          | CHF        | 0.332           | CHF        | 4.442           |  |
| <b>Zur Thesaurierung zurückbehaltener Erfolg</b> | <b>CHF</b> | <b>0.481</b>   | <b>CHF</b> | <b>0.617</b>    | <b>CHF</b> | <b>8.249</b>    |  |
| <b>Coupon Nr. Ertrag</b>                         |            | <b>4</b>       |            | <b>4</b>        |            | <b>5</b>        |  |

#### 2. Für in der Schweiz und im Ausland domizilierte Anteilinhaber (verrechnungssteuerbefreite Erträge aus direktem Immobilienbesitz)

| Thesaurierung 2023                               |            | Anteilklasse B |            | Anteilklasse UB |            | Anteilklasse EB |  |
|--|------------|----------------|------------|-----------------|------------|-----------------|--|
| Zur Thesaurierung verfügbarer Erfolg             | CHF        | 0.007          | CHF        | 0.012           | CHF        | 0.152           |  |
| <b>Zur Thesaurierung zurückbehaltener Erfolg</b> | <b>CHF</b> | <b>0.007</b>   | <b>CHF</b> | <b>0.012</b>    | <b>CHF</b> | <b>0.152</b>    |  |
| <b>Coupon Nr. Ertrag</b>                         |            | <b>5</b>       |            | <b>5</b>        |            | <b>6</b>        |  |

**Wechselkurse**

| <b>Wechselkurse per</b> | <b>31.12.2023</b> |
|-------------------------|-------------------|
| ENGLISCHES PFUND        | 1.072875          |
| EURO                    | 0.929700          |
| JAPANISCHER YEN         | 0.005970          |
| KANADISCHER DOLLAR      | 0.638267          |
| SCHWEIZER FRANKEN       | 1.000000          |
| US DOLLAR               | 0.841624          |

## Vermögensrechnung per 31. Dezember 2023

|  | Konsolidierung        |                       |
|--|-----------------------|-----------------------|
|  | 31.12.2023            | 31.12.2022            |
|  | CHF                   | CHF                   |
| <b>Vermögenswerte</b>  |                       |                       |
| Bankguthaben, einschliesslich Treuhandanlagen bei Drittbanken, aufgeteilt in:                      |                       |                       |
| - Sichtguthaben  | 956'006.19            | 1'296'642.58          |
| Effekten, einschliesslich ausgeliehene und pensionierte Effekten, aufgeteilt in:                   |                       |                       |
| - Obligationen, Wandelobligationen, Optionsanleihen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte | 13'682'699.85         | 20'909'741.07         |
| - Aktien und sonstige Beteiligungswertpapiere und -rechte  | 36'975'976.00         | 45'948'979.23         |
| - Anteile anderer kollektiver Kapitalanlagen   | 47'364'920.21         | 51'895'436.47         |
| Derivative Finanzinstrumente   | 1'029'327.48          | 1'022'819.65          |
| Sonstige Vermögenswerte  | 610'566.17            | 828'331.83            |
| <b>Gesamtfondsvermögen abzüglich:</b>  | <b>100'619'495.90</b> | <b>121'901'950.83</b> |
| Andere Verbindlichkeiten   | 108'354.09            | 134'175.52            |
| Bankverbindlichkeiten  | 37.19                 | 0.00                  |
| <b>Nettofondsvermögen</b>  | <b>100'511'104.62</b> | <b>121'767'775.31</b> |
| <b>Veränderung des Nettofondsvermögens</b>   |                       |                       |
|  | 01.01.2023 -          | 01.01.2022 -          |
|  | 31.12.2023            | 31.12.2022            |
|  | CHF                   | CHF                   |
| Nettofondsvermögen zu Beginn der Berichtsperiode   | 121'767'775.31        | 119'316'411.45        |
| Ausschüttungen   | -298'443.86           | -148'372.83           |
| Ablieferung Verrechnungssteuer   | -191'736.46           | -127'166.24           |
| Ausgaben von Anteilen  | 8'935'190.49          | 54'307'422.83         |
| Rücknahmen von Anteilen  | -37'159'820.35        | -28'249'641.20        |
| Sonstiges aus Anteilverkehr  | 1'324'182.72          | 97'249.60             |
| Gesamterfolg   | 6'133'956.77          | -23'428'128.30        |
| <b>Nettofondsvermögen am Ende der Berichtsperiode</b>  | <b>100'511'104.62</b> | <b>121'767'775.31</b> |
| <b>Entwicklung der Anteile im Umlauf</b>   |                       |                       |
| Bestand zu Beginn der Berichtsperiode  | 1'180'615.532         | 970'408.014           |
| Ausgegebene Anteile  | 84'311.289            | 479'108.150           |
| Zurückgenommene Anteile  | -349'821.625          | -268'900.632          |
| <b>Bestand am Ende der Berichtsperiode</b>   | <b>915'105.196</b>    | <b>1'180'615.532</b>  |
| <b>Währung Anteilklasse</b>  |                       |                       |
| <b>Inventarwert pro Anteil (Swung NAV)</b>   |                       |                       |
| <b>Inventarwert pro Anteil (Unswung NAV)</b>   |                       |                       |

| Anteilklasse A             |                            | Anteilklasse B             |                            | Anteilklasse UA            |                            | Anteilklasse UB            |                            |
|----------------------------|----------------------------|----------------------------|----------------------------|----------------------------|----------------------------|----------------------------|----------------------------|
| 01.01.2023 -<br>31.12.2023 | 01.01.2022 -<br>31.12.2022 | 01.01.2023 -<br>31.12.2023 | 01.01.2022 -<br>31.12.2022 | 01.01.2023 -<br>31.12.2023 | 01.01.2022 -<br>31.12.2022 | 01.01.2023 -<br>31.12.2023 | 01.01.2022 -<br>31.12.2022 |
| CHF                        | CHF                        | CHF                        | CHF                        | CHF                        | CHF                        | CHF                        | CHF                        |
| 766'901.75                 | 904'534.77                 | 6'335'491.88               | 6'473'699.97               | 46'676'543.44              | 43'169'838.35              | 66'707'186.09              | 67'740'796.08              |
| -5'142.26                  | -2'854.61                  | 0.00                       | 0.00                       | -293'301.60                | -145'518.22                | 0.00                       | 0.00                       |
| 0.00                       | 0.00                       | -15'904.16                 | -11'917.85                 | 0.00                       | 0.00                       | -170'792.41                | -113'364.54                |
| 0.00                       | 13'294.56                  | 1'931'643.80               | 3'779'644.82               | 2'156'989.26               | 17'650'513.35              | 4'846'557.43               | 32'368'880.91              |
| -212'442.60                | 0.00                       | -1'984'280.53              | -2'692'570.14              | -18'417'459.38             | -5'793'231.64              | -16'545'637.84             | -19'763'839.42             |
| 10'227.05                  | 2'229.47                   | 8'367.76                   | 27'909.16                  | 789'026.78                 | 761'507.44                 | 515'647.70                 | -694'200.58                |
| 34'487.81                  | -150'302.44                | 390'288.91                 | -1'241'274.08              | 1'994'207.50               | -8'966'565.84              | 3'624'440.70               | -12'831'086.36             |
| <b>594'031.75</b>          | <b>766'901.75</b>          | <b>6'665'607.66</b>        | <b>6'335'491.88</b>        | <b>32'906'006.00</b>       | <b>46'676'543.44</b>       | <b>58'977'401.67</b>       | <b>66'707'186.09</b>       |
| 7'562.143                  | 7'440.143                  | 62'376.792                 | 53'251.301                 | 457'086.731                | 353'699.590                | 652'131.777                | 555'032.090                |
| 0.000                      | 122.000                    | 18'328.134                 | 34'021.028                 | 20'323.824                 | 157'624.425                | 45'659.331                 | 286'867.498                |
| -2'015.787                 | 0.000                      | -18'814.941                | -24'895.537                | -173'333.536               | -54'237.284                | -155'657.361               | -189'767.811               |
| <b>5'546.356</b>           | <b>7'562.143</b>           | <b>61'889.985</b>          | <b>62'376.792</b>          | <b>304'077.019</b>         | <b>457'086.731</b>         | <b>542'133.747</b>         | <b>652'131.777</b>         |
| (CHF)                      | (CHF)                      | (CHF)                      | (CHF)                      | (CHF)                      | (CHF)                      | (CHF)                      | (CHF)                      |
| <b>106.96</b>              | <b>101.66</b>              | <b>107.55</b>              | <b>101.82</b>              | <b>108.07</b>              | <b>102.37</b>              | <b>108.64</b>              | <b>102.54</b>              |
| <b>107.10</b>              | <b>101.41</b>              | <b>107.70</b>              | <b>101.57</b>              | <b>108.22</b>              | <b>102.12</b>              | <b>108.79</b>              | <b>102.29</b>              |

|   | Anteilklasse EB            |                            |
|---|----------------------------|----------------------------|
|   | 01.01.2023 -<br>31.12.2023 | 01.01.2022 -<br>31.12.2022 |
|   | CHF                        | CHF                        |
| <b>Veränderung des Nettofondsvermögens</b>            |                            |                            |
| Nettofondsvermögen zu Beginn der Berichtsperiode      | 1'281'651.77               | 1'027'541.87               |
| Ausschüttungen  | 0.00                       | 0.00                       |
| Ablieferung Verrechnungssteuer                        | -5'039.89                  | -1'883.85                  |
| Ausgaben von Anteilen                                 | 0.00                       | 495'089.19                 |
| Rücknahmen von Anteilen                               | 0.00                       | 0.00                       |
| Sonstiges aus Anteilverkehr                           | 913.42                     | -195.86                    |
| Gesamterfolg  | 90'531.85                  | -238'899.58                |
| <b>Nettofondsvermögen am Ende der Berichtsperiode</b> | <b>1'368'057.15</b>        | <b>1'281'651.77</b>        |
| <b>Entwicklung der Anteile im Umlauf</b>              |                            |                            |
| Bestand zu Beginn der Berichtsperiode                 | 1'458.089                  | 984.890                    |
| Ausgegebene Anteile                                   | 0.000                      | 473.199                    |
| Zurückgenommene Anteile                               | 0.000                      | 0.000                      |
| <b>Bestand am Ende der Berichtsperiode</b>            | <b>1'458.089</b>           | <b>1'458.089</b>           |
| <b>Währung Anteilklasse</b>                           | <b>(CHF)</b>               | <b>(CHF)</b>               |
| <b>Inventarwert pro Anteil (Swung NAV)</b>            | <b>936.96</b>              | <b>881.14</b>              |
| <b>Inventarwert pro Anteil (Unswung NAV)</b>          | <b>938.25</b>              | <b>878.99</b>              |

## Erfolgsrechnung für die Zeit vom 1. Januar 2023 bis zum 31. Dezember 2023

|  | Konsolidierung             |                            |
|--|----------------------------|----------------------------|
|  | 01.01.2023 -<br>31.12.2023 | 01.01.2022 -<br>31.12.2022 |
|  | CHF                        | CHF                        |
| <b>Ertrag</b>  |                            |                            |
| Erträge der Bankguthaben   | 32'017.42                  | 9'335.13                   |
| Negativzinsen  | -313.26                    | -33'694.20                 |
| Erträge der Effekten, aufgeteilt in:   |                            |                            |
| - Obligationen, Wandelobligationen, Optionsanleihen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte     | 252'555.39                 | 194'013.39                 |
| - Aktien und sonstige Beteiligungswertpapiere und -rechte, einschliesslich Gratisaktien                | 1'317'586.18               | 1'158'820.90               |
| - Anteile anderer kollektiver Kapitalanlagen   | 732'146.98                 | 880'009.23                 |
| Erträge aus kollektiven Kapitalanlagen mit Immobilien im Direktbesitz                                  | 29'040.42                  | 22'909.59                  |
| Einkauf in laufende Nettoerträge bei der Ausgabe von Anteilen  | 28'236.02                  | 103'336.77                 |
| <b>Total Erträge</b>   | <b>2'391'269.15</b>        | <b>2'334'730.81</b>        |
| <b>Aufwendungen</b>  |                            |                            |
| Passivzinsen   | 53.30                      | 263.03                     |
| Prüfaufwand  | 14'494.70                  | 14'512.48                  |
| Reglementarische Vergütung an:   |                            |                            |
| - die Fondsleitung   | 1'292'907.23               | 1'472'481.43               |
| - die Depotbank  | 48'297.56                  | 55'058.29                  |
| Teilübertrag von Aufwendungen auf realisierte Kapitalverluste  | 0.00                       | -400.00                    |
| Teilübertrag von Aufwendungen auf kollektiven Kapitalanlagen mit Immobilien im Direktbesitz            | -16'700.68                 | -15'983.00                 |
| Aufwände aus kollektiven Kapitalanlagen mit Immobilien im Direktbesitz                                 | 16'700.68                  | 15'983.00                  |
| Sonstige Aufwendungen  | 3'469.85                   | 4'947.56                   |
| Ausrichtung laufender Nettoerträge bei Rücknahme von Anteilen  | 192'293.04                 | 49'775.97                  |
| <b>Total Aufwendungen</b>  | <b>1'551'515.68</b>        | <b>1'596'638.76</b>        |
| <b>Nettoertrag vor steuerlichen Anpassungen</b>  | <b>839'753.47</b>          | <b>738'092.05</b>          |
| Steuerliche Anpassungen wegen Erträgen aus Zielfonds   | 7'073.99                   | 155'063.78                 |
| <b>Nettoertrag nach steuerlichen Anpassungen</b>   | <b>846'827.46</b>          | <b>893'155.83</b>          |
| Realisierte Kapitalgewinne und -verluste   | -590'519.30                | -3'767'551.07              |
| Teilübertrag von Aufwendungen auf realisierte Kapitalverluste  | 0.00                       | -400.00                    |
| Teilübertrag von steuerlichem Ausgleich wegen Erträgen aus Zielfonds                                   | -7'073.99                  | -155'063.78                |
| <b>Realisierter Erfolg</b>   | <b>249'234.17</b>          | <b>-3'029'859.02</b>       |
| Nicht realisierte Kapitalgewinne und -verluste   | 5'884'722.60               | -20'398'269.28             |
| <b>Gesamterfolg</b>  | <b>6'133'956.77</b>        | <b>-23'428'128.30</b>      |
| <b>Verwendung des Erfolgs</b>  |                            |                            |
| Nettoertrag des Rechnungsjahres  | 846'827.46                 | 893'155.83                 |
| Vortrag des Vorjahres aus kollektiven Kapitalanlagen mit Immobilien im Direktbesitz                    | 3'005.85                   | 0.00                       |
| Vortrag des Vorjahres  | 97'779.67                  | 56'060.50                  |
| <b>Zur Verteilung verfügbarer Erfolg</b>   | <b>947'612.98</b>          | <b>949'216.33</b>          |
| Zur Ausschüttung an die Anlegerinnen und Anleger vorgesehener Erfolg                                   | 302'210.71                 | 297'677.77                 |
| Zur Ausschüttung bestimmter Erfolg aus Kapitalanlagen mit Immobilien im Direktbesitz                   | 6'137.00                   | 0.00                       |
| Ablieferung/Ausschüttung der Verrechnungssteuer (35%)  | 202'687.99                 | 191'203.34                 |
| Zur Wiederanlage zurückbehaltener Ertrag (65%)   | 376'421.48                 | 355'092.02                 |
| Zur Wiederanlage zurückbehaltener Ertrag aus kollektiven Kapitalanlagen mit Immobilien im Direktbesitz | 6'973.29                   | 4'457.68                   |
| Vortrag Nettoerträge aus kollektiven Kapitalanlagen mit Immobilien im Direktbesitz                     | 179.68                     | 3'005.85                   |
| Vortrag auf neue Rechnung  | 53'002.83                  | 97'779.67                  |

| Anteilklasse A             |                            | Anteilklasse B             |                            | Anteilklasse UA            |                            | Anteilklasse UB            |                            |
|----------------------------|----------------------------|----------------------------|----------------------------|----------------------------|----------------------------|----------------------------|----------------------------|
| 01.01.2023 -<br>31.12.2023 | 01.01.2022 -<br>31.12.2022 | 01.01.2023 -<br>31.12.2023 | 01.01.2022 -<br>31.12.2022 | 01.01.2023 -<br>31.12.2023 | 01.01.2022 -<br>31.12.2022 | 01.01.2023 -<br>31.12.2023 | 01.01.2022 -<br>31.12.2022 |
| CHF                        | CHF                        | CHF                        | CHF                        | CHF                        | CHF                        | CHF                        | CHF                        |
| 195.03                     | 54.97                      | 1'792.54                   | 445.98                     | 11'998.93                  | 3'397.73                   | 17'650.74                  | 5'344.51                   |
| -1.95                      | -210.69                    | -16.73                     | -1'645.94                  | -119.90                    | -11'996.17                 | -171.27                    | -19'488.96                 |
| 1'541.84                   | 1'207.43                   | 14'140.80                  | 9'665.54                   | 94'268.75                  | 70'875.06                  | 139'629.66                 | 110'251.22                 |
| 8'253.06                   | 7'502.96                   | 70'154.71                  | 56'320.21                  | 512'217.47                 | 410'331.84                 | 712'446.47                 | 672'128.13                 |
| 4'376.56                   | 5'546.19                   | 46'814.11                  | 45'340.14                  | 247'446.27                 | 333'682.77                 | 423'868.07                 | 486'216.02                 |
| 183.00                     | 144.64                     | 1'567.85                   | 1'118.30                   | 11'147.54                  | 8'255.51                   | 15'812.61                  | 13'149.11                  |
| 0.00                       | 11.64                      | 4'566.05                   | 2'527.21                   | 9'746.55                   | 57'977.65                  | 13'923.42                  | 42'791.16                  |
| <b>14'547.54</b>           | <b>14'257.14</b>           | <b>139'019.33</b>          | <b>113'771.44</b>          | <b>886'705.61</b>          | <b>872'524.39</b>          | <b>1'323'159.70</b>        | <b>1'310'391.19</b>        |
| 0.38                       | 1.71                       | 2.18                       | 12.91                      | 13.89                      | 95.88                      | 36.58                      | 149.70                     |
| 88.66                      | 90.60                      | 812.60                     | 723.86                     | 5'408.28                   | 5'278.60                   | 8'013.94                   | 8'267.77                   |
| 9'930.21                   | 11'565.71                  | 90'317.48                  | 92'109.85                  | 478'388.47                 | 529'848.11                 | 705'938.43                 | 830'499.23                 |
| 296.07                     | 344.91                     | 2'693.63                   | 2'747.13                   | 18'072.46                  | 20'016.48                  | 26'668.78                  | 31'374.47                  |
| 0.00                       | -100.00                    | 0.00                       | -300.00                    | 0.00                       | 0.00                       | 0.00                       | 0.00                       |
| -130.04                    | -121.52                    | -1'096.46                  | -962.81                    | -6'396.54                  | -5'683.89                  | -8'969.78                  | -9'118.48                  |
| 130.04                     | 121.52                     | 1'096.46                   | 962.81                     | 6'396.54                   | 5'683.89                   | 8'969.78                   | 9'118.48                   |
| 21.38                      | 31.46                      | 197.20                     | 253.31                     | 1'270.86                   | 1'836.18                   | 1'939.22                   | 2'773.99                   |
| 1'153.81                   | 0.00                       | 5'565.49                   | -286.08                    | 126'082.66                 | 16'829.98                  | 59'491.08                  | 33'232.07                  |
| <b>11'490.51</b>           | <b>11'934.39</b>           | <b>99'588.58</b>           | <b>95'260.98</b>           | <b>629'236.62</b>          | <b>573'905.23</b>          | <b>802'088.03</b>          | <b>906'297.23</b>          |
| <b>3'057.03</b>            | <b>2'322.75</b>            | <b>39'430.75</b>           | <b>18'510.46</b>           | <b>257'468.99</b>          | <b>298'619.16</b>          | <b>521'071.67</b>          | <b>404'093.96</b>          |
| 218.68                     | 3'246.56                   | 6'855.31                   | 27'013.05                  | 0.00                       | 38'214.32                  | 0.00                       | 86'589.85                  |
| <b>3'275.71</b>            | <b>5'569.31</b>            | <b>46'286.06</b>           | <b>45'523.51</b>           | <b>257'468.99</b>          | <b>336'833.48</b>          | <b>521'071.67</b>          | <b>490'683.81</b>          |
| -3'486.08                  | -23'748.08                 | -39'138.11                 | -196'171.92                | -193'565.48                | -1'444'212.06              | -346'257.02                | -2'063'820.34              |
| 0.00                       | -100.00                    | 0.00                       | -300.00                    | 0.00                       | 0.00                       | 0.00                       | 0.00                       |
| -218.68                    | -3'246.56                  | -6'855.31                  | -27'013.05                 | 0.00                       | -38'214.32                 | 0.00                       | -86'589.85                 |
| <b>-429.05</b>             | <b>-21'525.33</b>          | <b>292.64</b>              | <b>-177'961.46</b>         | <b>63'903.51</b>           | <b>-1'145'592.90</b>       | <b>174'814.65</b>          | <b>-1'659'726.38</b>       |
| 34'916.86                  | -128'777.11                | 389'996.27                 | -1'063'312.62              | 1'930'303.99               | -7'820'972.94              | 3'449'626.05               | -11'171'359.98             |
| <b>34'487.81</b>           | <b>-150'302.44</b>         | <b>390'288.91</b>          | <b>-1'241'274.08</b>       | <b>1'994'207.50</b>        | <b>-8'966'565.84</b>       | <b>3'624'440.70</b>        | <b>-12'831'086.36</b>      |
| 3'275.71                   | 5'569.31                   | 46'286.06                  | 45'523.51                  | 257'468.99                 | 336'833.48                 | 521'071.67                 | 490'683.81                 |
| 23.24                      | 0.00                       | 0.00                       | 0.00                       | 2'982.61                   | 0.00                       | 0.00                       | 0.00                       |
| 1'675.92                   | 1'272.11                   | 0.00                       | 0.00                       | 96'103.75                  | 54'788.39                  | 0.00                       | 0.00                       |
| <b>4'974.87</b>            | <b>6'841.42</b>            | <b>46'286.06</b>           | <b>45'523.51</b>           | <b>356'555.35</b>          | <b>391'621.87</b>          | <b>521'071.67</b>          | <b>490'683.81</b>          |
| 4'215.23                   | 5'142.26                   | 0.00                       | 0.00                       | 297'995.48                 | 292'535.51                 | 0.00                       | 0.00                       |
| 55.46                      | 0.00                       | 0.00                       | 0.00                       | 6'081.54                   | 0.00                       | 0.00                       | 0.00                       |
| 0.00                       | 0.00                       | 16'039.21                  | 15'869.02                  | 0.00                       | 0.00                       | 180'172.57                 | 170'294.43                 |
| 0.00                       | 0.00                       | 29'787.13                  | 29'471.12                  | 0.00                       | 0.00                       | 334'607.10                 | 316'261.09                 |
| 0.00                       | 0.00                       | 459.72                     | 183.37                     | 0.00                       | 0.00                       | 6'292.00                   | 4'128.29                   |
| 6.22                       | 23.24                      | 0.00                       | 0.00                       | 173.46                     | 2'982.61                   | 0.00                       | 0.00                       |
| 697.96                     | 1'675.92                   | 0.00                       | 0.00                       | 52'304.87                  | 96'103.75                  | 0.00                       | 0.00                       |

|  | Anteilkategorie EB         |                            |
|--|----------------------------|----------------------------|
|  | 01.01.2023 -<br>31.12.2023 | 01.01.2022 -<br>31.12.2022 |
|  | CHF                        | CHF                        |
| <b>Ertrag</b>  |                            |                            |
| Erträge der Bankguthaben   | 380.18                     | 91.94                      |
| Negativzinsen  | -3.41                      | -352.44                    |
| Erträge der Effekten, aufgeteilt in:   |                            |                            |
| - Obligationen, Wandelobligationen, Optionsanleihen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte     | 2'974.34                   | 2'014.14                   |
| - Aktien und sonstige Beteiligungswertpapiere und -rechte, einschliesslich Gratisaktien                | 14'514.47                  | 12'537.76                  |
| - Anteile anderer kollektiver Kapitalanlagen   | 9'641.97                   | 9'224.11                   |
| Erträge aus kollektiven Kapitalanlagen mit Immobilien im Direktbesitz                                  | 329.42                     | 242.03                     |
| Einkauf in laufende Nettoerträge bei der Ausgabe von Anteilen  | 0.00                       | 29.11                      |
| <b>Total Erträge</b>   | <b>27'836.97</b>           | <b>23'786.65</b>           |
| <b>Aufwendungen</b>  |                            |                            |
| Passivzinsen   | 0.27                       | 2.83                       |
| Prüfaufwand  | 171.22                     | 151.65                     |
| Reglementarische Vergütung an:   |                            |                            |
| - die Fondsleitung   | 8'332.64                   | 8'458.53                   |
| - die Depotbank  | 566.62                     | 575.30                     |
| Teilübertrag von Aufwendungen auf realisierte Kapitalverluste  | 0.00                       | 0.00                       |
| Teilübertrag von Aufwendungen auf kollektiven Kapitalanlagen mit Immobilien im Direktbesitz            | -107.86                    | -96.30                     |
| Aufwände aus kollektiven Kapitalanlagen mit Immobilien im Direktbesitz                                 | 107.86                     | 96.30                      |
| Sonstige Aufwendungen  | 41.19                      | 52.62                      |
| Ausrichtung laufender Nettoerträge bei Rücknahme von Anteilen  | 0.00                       | 0.00                       |
| <b>Total Aufwendungen</b>  | <b>9'111.94</b>            | <b>9'240.93</b>            |
| <b>Nettoertrag vor steuerlichen Anpassungen</b>  | <b>18'725.03</b>           | <b>14'545.72</b>           |
| Steuerliche Anpassungen wegen Erträgen aus Zielfonds   | 0.00                       | 0.00                       |
| <b>Nettoertrag nach steuerlichen Anpassungen</b>   | <b>18'725.03</b>           | <b>14'545.72</b>           |
| Realisierte Kapitalgewinne und -verluste   | -8'072.61                  | -39'598.67                 |
| Teilübertrag von Aufwendungen auf realisierte Kapitalverluste  | 0.00                       | 0.00                       |
| Teilübertrag von steuerlichem Ausgleich wegen Erträgen aus Zielfonds                                   | 0.00                       | 0.00                       |
| <b>Realisierter Erfolg</b>   | <b>10'652.42</b>           | <b>-25'052.95</b>          |
| Nicht realisierte Kapitalgewinne und -verluste   | 79'879.43                  | -213'846.63                |
| <b>Gesamterfolg</b>  | <b>90'531.85</b>           | <b>-238'899.58</b>         |
| <b>Verwendung des Erfolgs</b>  |                            |                            |
| Nettoertrag des Rechnungsjahres  | 18'725.03                  | 14'545.72                  |
| Vortrag des Vorjahres aus kollektiven Kapitalanlagen mit Immobilien im Direktbesitz                    | 0.00                       | 0.00                       |
| Vortrag des Vorjahres  | 0.00                       | 0.00                       |
| <b>Zur Verteilung verfügbarer Erfolg</b>   | <b>18'725.03</b>           | <b>14'545.72</b>           |
| Zur Ausschüttung an die Anlegerinnen und Anleger vorgesehener Erfolg                                   | 0.00                       | 0.00                       |
| Zur Ausschüttung bestimmter Erfolg aus Kapitalanlagen mit Immobilien im Direktbesitz                   | 0.00                       | 0.00                       |
| Ablieferung/Ausschüttung der Verrechnungssteuer (35%)  | 6'476.21                   | 5'039.89                   |
| Zur Wiederanlage zurückbehaltener Ertrag (65%)   | 12'027.25                  | 9'359.81                   |
| Zur Wiederanlage zurückbehaltener Ertrag aus kollektiven Kapitalanlagen mit Immobilien im Direktbesitz | 221.57                     | 146.02                     |
| Vortrag Nettoerträge aus kollektiven Kapitalanlagen mit Immobilien im Direktbesitz                     | 0.00                       | 0.00                       |
| Vortrag auf neue Rechnung  | 0.00                       | 0.00                       |



## Zusammensetzung des Portefolles und Bestandesveränderungen

| Titelbezeichnung   | Währung   | 31.12.2022<br>Anzahl/<br>Nominal | Käufe (1) | Verkäufe (1) | 31.12.2023<br>Anzahl/<br>Nominal | Kurswert CHF         | in % des<br>Gesamtfonds-<br>vermögens |
|--|---|----------------------------------|-----------|--------------|----------------------------------|----------------------|---------------------------------------|
| <b>Börsennotierte / an einem geregelten Markt gehandelte Wertpapiere; bewertet zu den Kursen, die am Hauptmarkt bezahlt werden</b> |   |                                  |           |              |                                  |                      |                                       |
| <b>Aktien (und aktienähnliche Wertpapiere)</b>   |   |                                  |           |              |                                  |                      |                                       |
| <b>SCHWEIZER FRANKEN</b>   |   |                                  |           |              |                                  |                      |                                       |
| ABB (reg. shares)  | CHF   | 57'000                           | 2'000     | 13'000       | 46'000                           | 1'715'800.00         | 1.71                                  |
| ACCELLERON INDUSTRIES AG   | CHF   | 2'850                            |           | 2'850        |                                  |                      |                                       |
| ADECCO (reg. shares)   | CHF   | 5'500                            |           | 1'500        | 4'000                            | 165'080.00           | 0.16                                  |
| ALCON INC  | CHF   | 16'100                           | 2'500     | 3'100        | 15'500                           | 1'017'420.00         | 1.01                                  |
| BALOISE-HOLDING (reg. shares)  | CHF   | 1'500                            |           | 300          | 1'200                            | 158'160.00           | 0.16                                  |
| BANQUE CANTONALE VAUDOISE  | CHF   |                                  | 800       |              | 800                              | 86'800.00            | 0.09                                  |
| BARRY CALLEBAUT (reg. shares)  | CHF   | 130                              |           | 40           | 90                               | 127'710.00           | 0.13                                  |
| BKW  | CHF   |                                  | 600       |              | 600                              | 89'700.00            | 0.09                                  |
| CIE FINANCIERE RICHEMONT (reg. shares)   | CHF   | 19'500                           |           | 4'300        | 15'200                           | 1'759'400.00         | 1.75                                  |
| CLARIANT (reg. shares)   | CHF   | 7'500                            |           | 1'500        | 6'000                            | 74'520.00            | 0.07                                  |
| CS GROUP (reg. shares)   | CHF   | 109'284                          |           | 109'284      |                                  |                      |                                       |
| DUFREY   | CHF   |                                  | 3'000     | 800          | 2'200                            | 72'776.00            | 0.07                                  |
| EMS-CHEMIE HOLDING   | CHF   |                                  | 150       |              | 150                              | 102'150.00           | 0.10                                  |
| GEBERIT  | CHF   | 1'200                            |           | 320          | 880                              | 474'320.00           | 0.47                                  |
| GIVAUDAN (reg. shares)   | CHF   | 350                              |           | 80           | 270                              | 940'680.00           | 0.93                                  |
| HELVETIA HOLDING LTD   | CHF   |                                  | 1'000     | 300          | 700                              | 81'130.00            | 0.08                                  |
| JULIUS BAER GRUPPE   | CHF   | 7'000                            |           | 1'700        | 5'300                            | 249'895.00           | 0.25                                  |
| KUEHNE & NAGEL INTERNATIONAL   | CHF   | 2'100                            |           | 500          | 1'600                            | 463'680.00           | 0.46                                  |
| LAFARGEHOLCIM (reg. shares)  | CHF   | 18'000                           |           | 4'000        | 14'000                           | 924'280.00           | 0.92                                  |
| LINDT & SPRUENGLI  | CHF   | 30                               |           | 5            | 25                               | 252'250.00           | 0.25                                  |
| LINDT & SPRUENGLI LISN SW  | CHF   | 4                                |           | 1            | 3                                | 306'000.00           | 0.30                                  |
| LOGITECH INTERNATIONAL (reg. shares)   | CHF   | 6'000                            |           | 1'500        | 4'500                            | 358'920.00           | 0.36                                  |
| LONZA GROUP (reg. shares)  | CHF   | 3'000                            |           | 700          | 2'300                            | 813'510.00           | 0.81                                  |
| NESTLE (reg. shares)   | CHF   | 97'000                           |           | 24'500       | 72'500                           | 7'069'475.00         | 7.03                                  |
| NOVARTIS (reg. shares)   | CHF   | 78'500                           |           | 20'800       | 57'700                           | 4'896'999.00         | 4.87                                  |
| PARTNERS GROUP   | CHF   | 700                              |           | 150          | 550                              | 667'150.00           | 0.66                                  |
| ROCHE HOLDING  | CHF   | 800                              |           |              | 800                              | 209'120.00           | 0.21                                  |
| ROCHE HOLDINGS (cert. shares)  | CHF   | 23'000                           |           | 5'000        | 18'000                           | 4'401'000.00         | 4.37                                  |
| SANDOZ GROUP LTD   | CHF   |                                  | 12'000    | 3'000        | 9'000                            | 243'540.00           | 0.24                                  |
| SCHINDLER HOLDING  | CHF   | 800                              |           | 300          | 500                              | 99'750.00            | 0.10                                  |
| SCHINDLER HOLDING (part. cert.)  | CHF   | 1'000                            |           | 200          | 800                              | 168'240.00           | 0.17                                  |
| SGS LTD  | CHF   |                                  | 5'750     | 1'250        | 4'500                            | 326'430.00           | 0.32                                  |
| SIG COMBIBLOC SERVICES   | CHF   |                                  | 10'000    | 1'500        | 8'500                            | 164'475.00           | 0.16                                  |
| SIKA LTD   | CHF   | 4'800                            | 200       | 1'100        | 3'900                            | 1'067'430.00         | 1.06                                  |
| SOCIETE GENERALE DE SURVEILLANCE HOLDING (reg. shares)   | CHF   | 230                              |           | 230          |                                  |                      |                                       |
| SONOVA HOLDING (reg. shares)   | CHF   | 1'900                            |           | 400          | 1'500                            | 411'600.00           | 0.41                                  |
| STRAUMANN HOLDING LTD  | CHF   | 3'500                            |           | 300          | 3'200                            | 433'920.00           | 0.43                                  |
| SWISS LIFE HOLDING (reg. shares)   | CHF   | 1'100                            |           | 320          | 780                              | 455'520.00           | 0.45                                  |
| SWISS PRIME SITE   | CHF   | 2'500                            |           | 300          | 2'200                            | 197'670.00           | 0.20                                  |
| SWISS REINSURANCE  | CHF   | 11'000                           |           | 2'500        | 8'500                            | 803'760.00           | 0.80                                  |
| SWISSCOM (reg. shares)   | CHF   | 850                              |           | 150          | 700                              | 354'200.00           | 0.35                                  |
| TEMENOS GROUP  | CHF   | 2'300                            |           | 500          | 1'800                            | 140'796.00           | 0.14                                  |
| THE SWATCH GROUP   | CHF   | 760                              |           | 110          | 650                              | 148'590.00           | 0.15                                  |
| UBS GROUP  | CHF   | 120'000                          | 6'861     | 38'861       | 88'000                           | 2'296'800.00         | 2.28                                  |
| VAT GROUP  | CHF   | 900                              |           | 200          | 700                              | 295'050.00           | 0.29                                  |
| ZURICH INSURANCE GROUP (reg. shares)   | CHF   | 5'600                            |           | 1'300        | 4'300                            | 1'890'280.00         | 1.88                                  |
|  |   |                                  |           |              |                                  | <b>36'975'976.00</b> | <b>36.75</b>                          |
| <b>Total Aktien (und aktienähnliche Wertpapiere)</b>   |   |                                  |           |              |                                  | <b>36'975'976.00</b> | <b>36.75</b>                          |
| <b>Anleihen</b>  |   |                                  |           |              |                                  |                      |                                       |
| <b>SCHWEIZER FRANKEN</b>   |   |                                  |           |              |                                  |                      |                                       |
| 1.205  | AFRICA FINANCE CORPORATION 1.205%/20-30.09.2025                     | CHF                              | 60'000    |              | 60'000                           | 58'200.00            | 0.06                                  |
| 0.850  | ATHENE GLOBAL FUNDING 0.85%/20-14.10.2025                           | CHF                              | 445'000   |              | 195'000                          | 244'625.00           | 0.24                                  |
| 0.150  | BALOISE HOLDING AG 0.15%/21-17.02.2031                              | CHF                              | 100'000   |              | 100'000                          | 89'750.00            | 0.09                                  |
| 2.200  | BALOISE HOLDING AG 2.2%/23-30.01.2032                               | CHF                              |           | 300'000      | 300'000                          | 311'100.00           | 0.31                                  |
| 2.408  | BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA SA 2.4075%/22-28.11.2025            | CHF                              | 500'000   |              | 200'000                          | 303'750.00           | 0.30                                  |
| 0.200  | BANCO SANTANDER SA 0.2%/19-19.11.2027                               | CHF                              | 500'000   |              | 500'000                          | 473'250.00           | 0.47                                  |
| 0.100  | BANQ CANTONALE DU VALAIS 0.1%/21-18.04.2031                         | CHF                              | 300'000   |              | 300'000                          | 269'550.00           | 0.27                                  |
| 1.625  | BANQUE CANTONALE VAUDOISE 1.625%/11-30.11.2026                      | CHF                              | 400'000   |              | 400'000                          | 399'800.00           | 0.40                                  |
| 0.625  | BELL FOOD GROUP AG 0.625%/16-24.03.2025                             | CHF                              | 100'000   |              | 100'000                          | 98'600.00            | 0.10                                  |
| 1.550  | BELL FOOD GROUP LTD 1.55%/22-16.05.2029                             | CHF                              | 500'000   |              | 300'000                          | 198'800.00           | 0.20                                  |
| 0.283  | CANADIAN IMPERIAL BANK OF COMMERCE 0.2825%/22-03.02.2027            | CHF                              | 600'000   |              | 600'000                          |                      |                                       |
| 0.180  | CEMBRA MONEY BANK AG 0.18%/16-05.10.2023                            | CHF                              | 100'000   |              | 100'000                          |                      |                                       |
| 1.183  | CEMBRA MONEY BANK LTD. 1.1833%/22-27.11.2025                        | CHF                              | 600'000   |              | 600'000                          |                      |                                       |
| 0.405  | CENTRAL AMERICAN BANK FOR ECONOMIC INTEGRATION 0.405%/20-25.06.2025 | CHF                              | 600'000   |              | 600'000                          |                      |                                       |

| Titelbezeichnung  | Währung | 31.12.2022<br>Anzahl/<br>Nominal | Käufe (1) | Verkäufe (1) | 31.12.2023<br>Anzahl/<br>Nominal | Kurswert CHF        | in % des<br>Gesamtfonds-<br>vermögens |
|---|---------|----------------------------------|-----------|--------------|----------------------------------|---------------------|---------------------------------------|
| 0.010 CHOCOLADEFABRIKEN LINDT & SPRUENGLI AG 0.01%/20-06.10.2028                              | CHF     | 560'000                          |           | 560'000      |                                  |                     |                                       |
| 0.450 CORPORACION ANDINA DE FOMENTO 0.45%/22-24.02.2027                                       | CHF     | 600'000                          |           | 600'000      |                                  |                     |                                       |
| 0.500 DH SWITZERLAND FINANCE 0.5%/15-08.12.2023   | CHF     | 400'000                          |           | 400'000      |                                  |                     |                                       |
| 0.100 FCA CAPITAL SUISSE SA 0.1%/19-23.10.2023  | CHF     | 600'000                          |           | 600'000      |                                  |                     |                                       |
| 0.150 GIVAUDAN AG 0.15%/20-10.11.2028   | CHF     | 30'000                           |           |              | 30'000                           | 28'230.00           | 0.03                                  |
| 1.800 HEATHROW FUNDING LIMITED 1.8%/22-27.05.2029   | CHF     | 500'000                          |           | 500'000      |                                  |                     |                                       |
| 0.125 HYPO VORARLBERG BANK AG 0.125%/19-03.09.2029  | CHF     | 500'000                          |           | 200'000      | 300'000                          | 268'950.00          | 0.27                                  |
| 0.125 HYPO VORARLBERG BANK AG 0.125%/21-23.08.2028  | CHF     | 200'000                          |           |              | 200'000                          | 182'700.00          | 0.18                                  |
| 0.500 HYPO VORARLBERG BANK AG 0.5%/22-07.04.2027  | CHF     | 500'000                          |           | 200'000      | 300'000                          | 290'550.00          | 0.29                                  |
| 0.125 KANTON GENÈVE 0.125%/19-28.05.2032  | CHF     | 50'000                           |           |              | 50'000                           | 45'625.00           | 0.05                                  |
| 0.250 KANTON GENÈVE 0.25%/17-29.11.2027   | CHF     | 50'000                           |           |              | 50'000                           | 48'125.00           | 0.05                                  |
| 1.450 KANTON ZÜRICH 1.45%/22-14.12.2029   | CHF     | 500'000                          |           |              | 500'000                          | 507'250.00          | 0.50                                  |
| 0.545 KOMMUNALBANKEN A/S 0.545%/22-28.04.2028   | CHF     | 700'000                          |           |              | 700'000                          | 679'350.00          | 0.68                                  |
| 1.000 LAFARGEHOLCIM LTD 1%/18-11.12.2024  | CHF     | 250'000                          |           |              | 250'000                          | 248'200.00          | 0.25                                  |
| 0.200 LGT BANK LTD 0.2%/20-04.11.2030   | CHF     | 100'000                          |           |              | 100'000                          | 90'250.00           | 0.09                                  |
| 0.300 LINDT & SPRUENGLI 0.3%/17-06.10.2027  | CHF     | 400'000                          |           | 200'000      | 200'000                          | 191'600.00          | 0.19                                  |
| 0.250 MÜNCHENER HYPOTHEKENBANK EG 0.25%/20-18.09.2028   | CHF     | 650'000                          |           | 650'000      |                                  |                     |                                       |
| 0.250 NIDWALDNER KANTONALBANK 0.25%/16-27.05.2026   | CHF     | 50'000                           |           |              | 50'000                           | 48'375.00           | 0.05                                  |
| 1.375 PFANDBRIEFBANK SCHWEIZERISCHER HYPOTHEKARINSTITUTE AG S. 574 1.375%/12-20.09.2029       | CHF     | 500'000                          |           | 100'000      | 400'000                          | 400'200.00          | 0.40                                  |
| - PFANDBRIEFBANK SCHWEIZERISCHER HYPOTHEKARINSTITUTE AG S. -693- 0%/20-12.08.2025             | CHF     | 150'000                          |           |              | 150'000                          | 146'430.00          | 0.15                                  |
| 0.625 PFANDBRIEFZENTRALE DER SCHWEIZERISCHEN KANTONALBANKEN S. -466- 0.625%/15-30.06.2027     | CHF     | 300'000                          |           |              | 300'000                          | 292'620.00          | 0.29                                  |
| - PSP SWISS PROPERTY AG 0%/16-01.09.2023  | CHF     | 70'000                           |           | 70'000       |                                  |                     |                                       |
| 0.375 PSP SWISS PROPERTY AG 0.375%/16-29.04.2026  | CHF     | 200'000                          |           | 200'000      |                                  |                     |                                       |
| 1.875 RHAETISCHE BAHN AG (RHB) 1.875%/22-21.07.2034   | CHF     | 500'000                          |           |              | 500'000                          | 528'500.00          | 0.53                                  |
| 0.100 ROCHE KAPITALMARKET T. -2- 0.1%/17-23.09.2024   | CHF     | 90'000                           |           | 90'000       |                                  |                     |                                       |
| 0.125 SPAREBANK 1 NORD-NORGE 0.125%/21-15.09.2028   | CHF     | 200'000                          |           |              | 200'000                          | 184'400.00          | 0.18                                  |
| 0.150 STADT WINTERTHUR 0.15%/18-26.03.2025  | CHF     | 40'000                           |           |              | 40'000                           | 39'284.00           | 0.04                                  |
| - SWISS CONFEDERATION 0%/16-22.06.2029  | CHF     | 500'000                          |           |              | 500'000                          | 480'300.00          | 0.48                                  |
| 1.250 SWISS CONFEDERATION 1.25%/12-11.06.2024   | CHF     | 110'000                          |           |              | 110'000                          | 109'879.00          | 0.11                                  |
| 1.250 SWISS CONFEDERATION 1.25%/14-28.05.2026   | CHF     | 500'000                          |           |              | 500'000                          | 503'500.00          | 0.50                                  |
| 2.125 SYNGENTA FINANCE 2.125%/14-01.11.2029   | CHF     | 300'000                          |           | 300'000      |                                  |                     |                                       |
| 1.875 TEMENOS LTD 1.875%/18-30.11.2023  | CHF     | 50'000                           |           | 50'000       |                                  |                     |                                       |
| 0.288 TOTAL CAPITAL INTERNATIONAL 0.288%/18-13.07.2026  | CHF     | 300'000                          |           | 300'000      |                                  |                     |                                       |
| 0.125 VALIANT BANK 0.125%/18-23.04.2024   | CHF     | 600'000                          |           | 600'000      |                                  |                     |                                       |
| - VALIANT BANK S. -8- 0%/21-20.01.2026  | CHF     | 250'000                          |           |              | 250'000                          | 241'875.00          | 0.24                                  |
| 0.375 VERIZON COMMUNICATIONS 0.375%/17-31.05.2023   | CHF     | 40'000                           |           | 40'000       |                                  |                     |                                       |
| 0.125 ZÜRCHER KANTONALBANK S. -145- 0.125%/19-06.06.2029                                      | CHF     | 50'000                           |           |              | 50'000                           | 46'550.00           | 0.05                                  |
| 0.100 ZUG ESTATES HOLDING AG 0.1%/19-02.10.2025   | CHF     | 30'000                           |           |              | 30'000                           | 29'100.00           | 0.03                                  |
| 1.000 ZÜRICH INSURANCE COMPANY LTD 1%/18-30.10.2028   | CHF     | 30'000                           |           |              | 30'000                           | 29'535.00           | 0.03                                  |
| <b>Total Anleihen</b>   |         |                                  |           |              |                                  | <b>8'108'803.00</b> | <b>8.06</b>                           |
| <b>Kollektive Kapitalanlagen</b>  |         |                                  |           |              |                                  | <b>8'108'803.00</b> | <b>8.06</b>                           |
| <b>EURO</b>   |         |                                  |           |              |                                  |                     |                                       |
| AMUNDI INDEX EURO AGG SRI UCIT -C- EUR  | EUR     |                                  | 5'000     |              | 5'000                            | 204'580.49          | 0.20                                  |
|   |         |                                  |           |              |                                  | <b>204'580.49</b>   | <b>0.20</b>                           |
| <b>SCHWEIZER FRANKEN</b>  |         |                                  |           |              |                                  |                     |                                       |
| CREDIT SUISSE REAL ESTATE FUND GREEN PROPERTY   | CHF     | 1'000                            |           |              | 1'000                            | 121'000.00          | 0.12                                  |
| CREDIT SUISSE REAL ESTATE FUND HOSPITALITY  | CHF     | 2'000                            | 3'000     |              | 5'000                            | 356'000.00          | 0.35                                  |
| CREDIT SUISSE REAL ESTATE FUND LOGISTICS PLUS   | CHF     | 914                              |           |              | 914                              | 86'464.40           | 0.09                                  |
| CREDIT SUISSE REAL ESTATE SIAT  | CHF     | 1'200                            | 400       |              | 1'600                            | 339'200.00          | 0.34                                  |
| FIR FONDS IMMOBILIER ROMAND   | CHF     | 2'000                            |           |              | 2'000                            | 424'000.00          | 0.42                                  |
| IMMOFONDS   | CHF     | 600                              |           |              | 600                              | 312'000.00          | 0.31                                  |
| SCHRODER IMMOPLUS   | CHF     | 2'000                            |           |              | 2'000                            | 302'000.00          | 0.30                                  |
| SF SUSTAINABLE PROPERTY FUND  | CHF     | 1'183                            |           | 1'183        |                                  |                     |                                       |
| SWISSINVEST REAL ESTATE INVESTMENT  | CHF     | 2'000                            |           |              | 2'000                            | 368'000.00          | 0.37                                  |
| UBS PROPERTY FUND - SWISS MIXED SIMA  | CHF     | 5'000                            |           |              | 5'000                            | 672'500.00          | 0.67                                  |
| UBS PROPERTY SWISS RESIDENTIAL ANFOS  | CHF     | 2'500                            |           |              | 2'500                            | 204'000.00          | 0.20                                  |
|   |         |                                  |           |              |                                  | <b>3'185'164.40</b> | <b>3.17</b>                           |
| <b>US DOLLAR</b>  |         |                                  |           |              |                                  |                     |                                       |
| CREDIT SUISSE INDEX FUND (IE) ETF ICAV - CSIF (I) MSCI USA ESG LEADERS BLUE UCITS ETF -B- USD | USD     | 115'000                          | 18'600    | 43'600       | 90'000                           | 14'190'286.35       | 14.10                                 |
| CSIF IE MSCI USA SMALL CAP ESG -B USD- EUR  | USD     | 10'000                           | 1'000     | 11'000       |                                  |                     |                                       |
| INVESCO MARKETS PLC - INVESCO -ACC- USD   | USD     | 30'000                           | 7'000     | 12'000       | 25'000                           | 1'373'214.83        | 1.36                                  |

| Titelbezeichnung   | Währung | 31.12.2022<br>Anzahl/<br>Nominal | Käufe (1) | Verkäufe (1) | 31.12.2023<br>Anzahl/<br>Nominal | Kurswert CHF         | in % des<br>Gesamtfonds-<br>vermögens |
|--|---------|----------------------------------|-----------|--------------|----------------------------------|----------------------|---------------------------------------|
| ISHARES MSCI USA SRI UCITS ETF   | USD     | 820'000                          | 50'000    | 165'000      | 705'000                          | 8'401'705.17         | 8.35                                  |
|  |         |                                  |           |              |                                  | <b>23'965'206.35</b> | <b>23.82</b>                          |
| <b>Total Kollektive Kapitalanlagen</b>   |         |                                  |           |              |                                  | <b>27'354'951.24</b> | <b>27.19</b>                          |
| <b>Total Börsennotierte / an einem geregelten Markt gehandelte Wertpapiere; bewertet zu den Kursen, die am Hauptmarkt bezahlt werden</b> |         |                                  |           |              |                                  | <b>72'439'730.24</b> | <b>71.99</b>                          |
| <b>Wertpapiere bewertet aufgrund von am Markt beobachtbaren Parametern</b>   |         |                                  |           |              |                                  |                      |                                       |
| <b>Anleihen</b>  |         |                                  |           |              |                                  |                      |                                       |
| <b>EURO</b>  |         |                                  |           |              |                                  |                      |                                       |
| 0.500 ABN AMRO BANK N.V. 0.5%/21-23.09.2029  | EUR     | 400'000                          |           |              | 400'000                          | 316'053.37           | 0.31                                  |
| 1.375 BANCO SANTANDER SA 1.375%/20-05.01.2026  | EUR     | 200'000                          |           | 200'000      |                                  |                      |                                       |
| 1.250 BELGIUM KINGDOM 1.25%/18-22.04.2033  | EUR     |                                  | 100'000   |              | 100'000                          | 83'263.00            | 0.08                                  |
| 1.000 E.ON SE 1%/20-07.10.2025   | EUR     | 300'000                          |           |              | 300'000                          | 269'201.14           | 0.27                                  |
| - FRANCE 0%/20-25.11.2030  | EUR     |                                  | 150'000   |              | 150'000                          | 119'227.05           | 0.12                                  |
| 5.625 GERMANY 5.625%/98-04.01.2028   | EUR     | 250'000                          | 150'000   | 200'000      | 200'000                          | 211'631.33           | 0.21                                  |
| 0.750 KOMMUNEKREDIT 0.75%/18-05.07.2028  | EUR     |                                  | 400'000   |              | 400'000                          | 345'554.61           | 0.34                                  |
| 0.625 KUNTARAHOITUS OYJ S. -12/2017- 0.625%/17-26.11.2026  | EUR     |                                  | 400'000   |              | 400'000                          | 352'936.43           | 0.35                                  |
| 0.625 NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD 0.625%/18-30.08.2023   | EUR     | 100'000                          |           | 100'000      |                                  |                      |                                       |
| 1.125 REPUBLIC OF POLAND 1.125%/18-07.08.2026  | EUR     | 40'000                           |           | 40'000       |                                  |                      |                                       |
| 1.250 SEGRO CAPITAL SARL 1.25%/22-23.03.2026   | EUR     | 200'000                          |           |              | 200'000                          | 177'833.02           | 0.18                                  |
|  |         |                                  |           |              |                                  | <b>1'875'699.95</b>  | <b>1.86</b>                           |
| <b>US DOLLAR</b>   |         |                                  |           |              |                                  |                      |                                       |
| 2.150 ADOBE INC 2.15%/20-01.02.2027  | USD     | 300'000                          |           |              | 300'000                          | 236'850.68           | 0.24                                  |
| 2.850 APPLE 2.85%/16-23.02.2023  | USD     | 200'000                          |           | 200'000      |                                  |                      |                                       |
| 3.650 BARCLAYS 3.65%/15-16.03.2025   | USD     | 200'000                          |           |              | 200'000                          | 164'562.75           | 0.16                                  |
| 3.950 CAMPBELL SOUP CO 3.95%/18-15.03.2025   | USD     | 250'000                          |           | 250'000      |                                  |                      |                                       |
| 1.250 EUROPEAN INVESTMENT BANK 1.25%/21-14.02.2031   | USD     |                                  | 400'000   |              | 400'000                          | 281'341.45           | 0.28                                  |
| 3.500 GOLDMAN SACHS GROUP 3.5%/15-23.01.2025   | USD     | 50'000                           |           |              | 50'000                           | 41'272.82            | 0.04                                  |
| 4.750 IBRD S. 1312 4.75%/05-15.02.2035   | USD     | 100'000                          |           |              | 100'000                          | 87'749.41            | 0.09                                  |
| 2.125 IBRD T. -371- 2.125%/15-03.03.2025   | USD     | 200'000                          |           |              | 200'000                          | 163'463.59           | 0.16                                  |
| 5.700 METLIFE 5.7%/05-15.06.2035   | USD     |                                  | 250'000   |              | 250'000                          | 226'255.90           | 0.22                                  |
| 2.527 MITSUBISHI UFJ FINANCIAL GROUP 2.527%/16-13.09.2023  | USD     | 200'000                          |           | 200'000      |                                  |                      |                                       |
| 3.625 NATIONAL AUSTRALIA BK/NY 3.625%/18-20.06.2023  | USD     | 250'000                          |           | 250'000      |                                  |                      |                                       |
| 2.875 ORACLE CORP 2.875%/21-25.03.2031   | USD     |                                  | 250'000   |              | 250'000                          | 186'331.36           | 0.19                                  |
| 7.625 SPRINT CORP 7.625%/18-01.03.2026   | USD     |                                  | 250'000   |              | 250'000                          | 219'745.93           | 0.22                                  |
| 2.000 UNITED STATES OF AMERICA 2%/17-30.04.2024  | USD     | 700'000                          |           | 700'000      |                                  |                      |                                       |
| 2.875 UNITED STATES OF AMERICA S. -C-2028- 2.875%/18-15.05.2028  | USD     | 700'000                          |           |              | 700'000                          | 564'973.02           | 0.56                                  |
| 2.250 UNITED STATES OF AMERICA -T-2023- 2.25%/16-31.12.2023  | USD     | 100'000                          |           | 100'000      |                                  |                      |                                       |
| 2.875 US TREASURY N/B S. -C-2032- 2.875%/22-15.05.2032   | USD     | 500'000                          |           |              | 500'000                          | 390'171.65           | 0.39                                  |
| 2.750 US TREASURY N/B S. -L-2029- 2.75%/22-31.05.2029  | USD     | 500'000                          |           |              | 500'000                          | 397'535.86           | 0.40                                  |
| 0.500 US TREASURY N/B S. -V-2026- 0.5%/21-28.02.2026   | USD     |                                  | 300'000   |              | 300'000                          | 233'333.69           | 0.23                                  |
| 5.250 VERIZON COMMUNICATIONS 5.25%/17-16.03.2037   | USD     |                                  | 300'000   |              | 300'000                          | 262'872.01           | 0.26                                  |
| 2.200 WALT DISNEY COMPANY/THE 2.2%/20-13.01.2028   | USD     | 300'000                          |           | 300'000      |                                  |                      |                                       |
| 0.750 WI TREASURY N/B 0.75%/21-31.01.2028  | USD     | 400'000                          |           | 400'000      |                                  |                      |                                       |
| 2.625 WI TREASURY N/B 2.625%/22-31.05.2027   | USD     |                                  | 300'000   |              | 300'000                          | 241'736.78           | 0.24                                  |
|  |         |                                  |           |              |                                  | <b>3'698'196.90</b>  | <b>3.68</b>                           |
| <b>Total Anleihen</b>  |         |                                  |           |              |                                  | <b>5'573'896.85</b>  | <b>5.54</b>                           |
| <b>Kollektive Kapitalanlagen</b>   |         |                                  |           |              |                                  |                      |                                       |
| <b>ENGLISCHES PFUND</b>  |         |                                  |           |              |                                  |                      |                                       |
| CREDIT SUISSE INDEX FUND (LUX) SICAV - CSIF (LUX) EQUITY UK ESG BLUE - QBX GBP ACC- GBP  | GBP     | 1'300                            |           | 600          | 700                              | 959'028.12           | 0.95                                  |
|  |         |                                  |           |              |                                  | <b>959'028.12</b>    | <b>0.95</b>                           |
| <b>EURO</b>  |         |                                  |           |              |                                  |                      |                                       |
| CREDIT SUISSE (LUX) EUROPEAN DIVIDEND PLUS EQUITY FUND -EB- EUR  | EUR     | 300                              |           | 200          | 100                              | 239'919.31           | 0.24                                  |
| CREDIT SUISSE INDEX FUND (LUX) SICAV - CSIF (LUX) EQUITY EMU ESG BLUE -OBX EUR ACC- EUR  | EUR     | 2'200                            | 700       | 800          | 2'100                            | 2'668'538.36         | 2.65                                  |
| NORDEA 1 SICAV - GLOBAL CLIMATE AND ENVIRONMENT FUND -BI- EUR  | EUR     | 8'000                            |           | 8'000        |                                  |                      |                                       |
|  |         |                                  |           |              |                                  | <b>2'908'457.67</b>  | <b>2.89</b>                           |
| <b>JAPANISCHER YEN</b>   |         |                                  |           |              |                                  |                      |                                       |
| CREDIT SUISSE INDEX FUND (LUX) SICAV - CSIF (LUX) EQUITY JAPAN ESG BLUE -OBX- JPY  | JPY     | 2'800                            | 1'300     | 1'800        | 2'300                            | 2'303'082.99         | 2.29                                  |
|  |         |                                  |           |              |                                  | <b>2'303'082.99</b>  | <b>2.29</b>                           |
| <b>KANADISCHER DOLLAR</b>  |         |                                  |           |              |                                  |                      |                                       |
| CREDIT SUISSE INDEX FUND (LUX) SICAV - CSIF(LUX ) EQUITY CANADA ESG BLUE -OBX CAD ACC- CAD   | CAD     | 1'900                            |           | 400          | 1'500                            | 1'193'208.61         | 1.19                                  |
|  |         |                                  |           |              |                                  | <b>1'193'208.61</b>  | <b>1.19</b>                           |
| <b>SCHWEIZER FRANKEN</b>   |         |                                  |           |              |                                  |                      |                                       |
| CREDIT SUISSE INDEX FUND (CH) - CSIF (CH) EQUITY SWITZERLAND TOTAL MARKET ESG BLUE -QB-  | CHF     | 1'400                            | 200       |              | 1'600                            | 1'713'472.00         | 1.70                                  |
| CREDIT SUISSE INDEX FUND (CH) I - CSIF (CH) I REAL ESTATE SWITZERLAND BLUE -QA-  | CHF     | 500                              |           | 100          | 400                              | 596'316.00           | 0.59                                  |

| Titelbezeichnung  | Währung | 31.12.2022<br>Anzahl/<br>Nominal | Käufe (1) | Verkäufe (1) | 31.12.2023<br>Anzahl/<br>Nominal | Kurswert CHF          | in % des<br>Gesamtfonds-<br>vermögens |
|---|---------|----------------------------------|-----------|--------------|----------------------------------|-----------------------|---------------------------------------|
| CREDIT SUISSE INSTITUTIONAL MASTER FUND UMBRELLA - EMERGING MARKETS -EB-  | CHF     | 500                              |           | 500          |                                  |                       |                                       |
| CREDIT SUISSE SPECIAL PORTFOLIO SWISS REAL ESTATE SECURITIES -EB-   | CHF     | 500                              |           |              | 500                              | 907'610.00            | 0.90                                  |
| CS REAL ESTATE FUND INTERNATIONAL   | CHF     | 800                              |           |              | 800                              | 626'464.00            | 0.62                                  |
| CSIMF EMERGING MARKETS BONDS -DB-   | CHF     | 1'200                            |           | 1'200        |                                  |                       |                                       |
|   |         |                                  |           |              |                                  | <b>3'843'862.00</b>   | <b>3.82</b>                           |
| <b>US DOLLAR</b>  |         |                                  |           |              |                                  |                       |                                       |
| CREDIT SUISSE FUND (LUX) ASIA PACIFIC INCOME EQUITY FUND -DA- USD   | USD     | 600                              |           | 600          |                                  |                       |                                       |
| CREDIT SUISSE INDEX FUND (LUX) SICAV - CSIF (LUX) BOND GOVERNMENT EMERGING MARKETS USD ESG BLUE                 | USD     |                                  | 800       | 800          |                                  |                       |                                       |
| CREDIT SUISSE INDEX FUND (LUX) SICAV - CSIF (LUX) EQUITY CHINA TOTAL MARKET BLUE -QB- USD                       | USD     |                                  | 1'100     | 800          | 300                              | 221'257.07            | 0.22                                  |
| CREDIT SUISSE INDEX FUND (LUX) SICAV - CSIF (LUX) EQUITY EMERGING MARKETS ESG BLUE -QBX- USD                    | USD     | 3'000                            | 3'200     | 400          | 5'800                            | 5'100'351.12          | 5.07                                  |
| CREDIT SUISSE INDEX FUND (LUX) SICAV - CSIF (LUX) EQUITY EMERGING MARKETS MINIMUM VOLATILITY ESG BLUE -QBX- USD | USD     | 1'500                            |           | 1'500        |                                  |                       |                                       |
| CREDIT SUISSE INDEX FUND (LUX) SICAV - CSIF (LUX) EQUITY PACIFIC EX JAPAN ESG BLUE -QBX USD ACC- USD            | USD     | 1'100                            |           | 300          | 800                              | 849'710.37            | 0.84                                  |
| CS INVESTMENT FUNDS 4 SICAV - CREDIT SUISSE (LUX) ALTERNATIVE OPPORTUNITIES FUND -EA- USD                       | USD     | 3'200                            |           |              | 3'200                            | 2'631'011.02          | 2.61                                  |
|   |         |                                  |           |              |                                  | <b>8'802'329.58</b>   | <b>8.75</b>                           |
| <b>Total Kollektive Kapitalanlagen</b>  |         |                                  |           |              |                                  | <b>20'009'968.97</b>  | <b>19.89</b>                          |
| <b>Total Wertpapiere bewertet aufgrund von am Markt beobachtbaren Parametern</b>                                |         |                                  |           |              |                                  | <b>25'583'865.82</b>  | <b>25.43</b>                          |
| <b>Derivative Finanzinstrumente</b>   |         |                                  |           |              |                                  |                       |                                       |
| <b>Wertpapiere bewertet aufgrund von am Markt beobachtbaren Parametern</b>                                      |         |                                  |           |              |                                  |                       |                                       |
| <b>Devisentermingeschäfte</b>   |         |                                  |           |              |                                  |                       |                                       |
| Devisentermingeschäfte (siehe Liste)  |         |                                  |           |              |                                  | 1'029'327.48          | 1.02                                  |
| <b>Total Devisentermingeschäfte</b>   |         |                                  |           |              |                                  | <b>1'029'327.48</b>   | <b>1.02</b>                           |
| <b>Total Wertpapiere bewertet aufgrund von am Markt beobachtbaren Parametern</b>                                |         |                                  |           |              |                                  | <b>1'029'327.48</b>   | <b>1.02</b>                           |
| <b>Total Derivative Finanzinstrumente</b>   |         |                                  |           |              |                                  | <b>1'029'327.48</b>   | <b>1.02</b>                           |
| <b>Total Anlagen</b>  |         |                                  |           |              |                                  | <b>99'052'923.54</b>  | <b>98.44</b>                          |
| Bankguthaben auf Sicht  |         |                                  |           |              |                                  | 956'006.19            | 0.95                                  |
| Bankguthaben auf Zeit   |         |                                  |           |              |                                  | 0.00                  | 0.00                                  |
| Sonstige Vermögenswerte   |         |                                  |           |              |                                  | 610'566.17            | 0.61                                  |
| <b>Gesamtfondsvermögen (GFV)</b>  |         |                                  |           |              |                                  | <b>100'619'495.90</b> | <b>100.00</b>                         |
| ./. Bankverbindlichkeiten   |         |                                  |           |              |                                  | 37.19                 | 0.00                                  |
| ./. Andere Verbindlichkeiten  |         |                                  |           |              |                                  | 108'354.09            | 0.11                                  |
| ./. Andere Kredite  |         |                                  |           |              |                                  | 0.00                  | 0.00                                  |
| <b>Nettobondsvermögen</b>   |         |                                  |           |              |                                  | <b>100'511'104.62</b> | <b>99.89</b>                          |

(1) Umfassen auch Corporate Actions

**Summarische Gliederung des Portefeuilles gemäss KKV FINMA Art. 84 Absatz 2**

| Anlagekategorien   | Kurswert CHF         | in % des<br>Gesamtfonds-<br>vermögens |
|--|----------------------|---------------------------------------|
| <b>Börsennotierte / an einem geregelten Markt gehandelte Wertpapiere; bewertet zu den Kursen, die am Hauptmarkt bezahlt werden</b> | <b>72'439'730.24</b> | <b>71.99</b>                          |
| <b>Wertpapiere bewertet aufgrund von am Markt beobachtbaren Parametern</b>   | <b>26'613'193.30</b> | <b>26.45</b>                          |
| <b>Wertpapiere bewertet aufgrund geeigneten Bewertungsmodellen unter Berücksichtigung der aktuellen Marktgegebenheiten</b>         | <b>0.00</b>          | <b>0.00</b>                           |

**Aufstellung der Devisentermingeschäfte für die Zeit vom 1. Januar 2023 bis zum 31. Dezember 2023**

| Fälligkeit | Transaktion | Währung | Betrag     | Gegen | Gegenwert   | Devisengewinn/-verlust<br>Mandatswährung | in % des GFV |
|------------|-------------|---------|------------|-------|-------------|--|--------------|
| 09.02.2023 | Bought      | CHF     | 652'370    | CAD   | 900'000     | 0.00                                     | 0.00         |
| 09.02.2023 | Bought      | CHF     | 492'270    | EUR   | 500'000     | 0.00                                     | 0.00         |
| 09.02.2023 | Bought      | CHF     | 782'750    | EUR   | 800'000     | 0.00                                     | 0.00         |
| 09.02.2023 | Bought      | CHF     | 691'661    | EUR   | 700'000     | 0.00                                     | 0.00         |
| 09.02.2023 | Bought      | CHF     | 400'352    | EUR   | 400'000     | 0.00                                     | 0.00         |
| 09.02.2023 | Bought      | CHF     | 902'180    | EUR   | 900'000     | 0.00                                     | 0.00         |
| 09.02.2023 | Bought      | CHF     | 800'717    | EUR   | 800'000     | 0.00                                     | 0.00         |
| 09.02.2023 | Bought      | CHF     | 618'638    | GBP   | 550'000     | 0.00                                     | 0.00         |
| 09.02.2023 | Bought      | CHF     | 946'921    | JPY   | 140'000'000 | 0.00                                     | 0.00         |
| 09.02.2023 | Bought      | CHF     | 17'123'890 | USD   | 17'500'000  | 0.00                                     | 0.00         |
| 09.02.2023 | Bought      | CHF     | 651'351    | USD   | 700'000     | 0.00                                     | 0.00         |
| 09.02.2023 | Bought      | CHF     | 920'968    | USD   | 1'000'000   | 0.00                                     | 0.00         |

Aufstellung der Devisentermingeschäfte für die Zeit vom 1. Januar 2023 bis zum 31. Dezember 2023

| Fälligkeit                          | Transaktion | Währung | Betrag     | Gegen | Gegenwert   | Devisengewinn/-verlust<br>Mandatswährung | in % des GFV |
|-------------------------------------|-------------|---------|------------|-------|-------------|--|--------------|
| 09.02.2023                          | Bought      | CHF     | 553'408    | USD   | 600'000     | 0.00                                     | 0.00         |
| 12.05.2023                          | Bought      | CHF     | 615'545    | CAD   | 900'000     | 0.00                                     | 0.00         |
| 12.05.2023                          | Bought      | CHF     | 4'051'616  | EUR   | 4'100'000   | 0.00                                     | 0.00         |
| 12.05.2023                          | Bought      | CHF     | 607'304    | GBP   | 550'000     | 0.00                                     | 0.00         |
| 12.05.2023                          | Bought      | CHF     | 18'149'036 | USD   | 19'800'000  | 0.00                                     | 0.00         |
| 12.05.2023                          | Bought      | USD     | 900'000    | CHF   | 818'872     | 0.00                                     | 0.00         |
| 12.05.2023                          | Bought      | USD     | 600'000    | CHF   | 534'016     | 0.00                                     | 0.00         |
| 10.08.2023                          | Bought      | CHF     | 593'618    | CAD   | 900'000     | 0.00                                     | 0.00         |
| 10.08.2023                          | Bought      | CHF     | 3'980'518  | EUR   | 4'100'000   | 0.00                                     | 0.00         |
| 10.08.2023                          | Bought      | CHF     | 195'568    | EUR   | 200'000     | 0.00                                     | 0.00         |
| 10.08.2023                          | Bought      | CHF     | 445'988    | GBP   | 400'000     | 0.00                                     | 0.00         |
| 10.08.2023                          | Bought      | CHF     | 1'069'295  | JPY   | 170'000'000 | 0.00                                     | 0.00         |
| 10.08.2023                          | Bought      | CHF     | 16'490'913 | USD   | 18'700'000  | 0.00                                     | 0.00         |
| 10.08.2023                          | Bought      | CHF     | 1'618'996  | USD   | 1'800'000   | 0.00                                     | 0.00         |
| 10.08.2023                          | Bought      | CHF     | 267'992    | USD   | 300'000     | 0.00                                     | 0.00         |
| 10.08.2023                          | Bought      | EUR     | 200'000    | CHF   | 191'897     | 0.00                                     | 0.00         |
| 09.11.2023                          | Bought      | CHF     | 580'779    | CAD   | 900'000     | 0.00                                     | 0.00         |
| 09.11.2023                          | Bought      | CHF     | 3'914'545  | EUR   | 4'100'000   | 0.00                                     | 0.00         |
| 09.11.2023                          | Bought      | CHF     | 441'450    | GBP   | 400'000     | 0.00                                     | 0.00         |
| 09.11.2023                          | Bought      | CHF     | 1'043'281  | JPY   | 170'000'000 | 0.00                                     | 0.00         |
| 09.11.2023                          | Bought      | CHF     | 17'998'115 | USD   | 20'800'000  | 0.00                                     | 0.00         |
| 09.11.2023                          | Bought      | EUR     | 800'000    | CHF   | 772'599     | 0.00                                     | 0.00         |
| 09.11.2023                          | Bought      | USD     | 800'000    | CHF   | 713'570     | 0.00                                     | 0.00         |
| 09.11.2023                          | Bought      | USD     | 800'000    | CHF   | 720'822     | 0.00                                     | 0.00         |
| 09.11.2023                          | Bought      | USD     | 500'000    | CHF   | 437'242     | 0.00                                     | 0.00         |
| 09.11.2023                          | Bought      | USD     | 500'000    | CHF   | 456'338     | 0.00                                     | 0.00         |
| 09.11.2023                          | Bought      | USD     | 500'000    | CHF   | 445'938     | 0.00                                     | 0.00         |
| 09.11.2023                          | Bought      | USD     | 1'500'000  | CHF   | 1'312'132   | 0.00                                     | 0.00         |
| 07.02.2024                          | Bought      | CHF     | 583'952    | CAD   | 900'000     | 11'650.59                                | 0.01         |
| 07.02.2024                          | Bought      | CHF     | 2'676'562  | EUR   | 2'800'000   | 80'158.64                                | 0.08         |
| 07.02.2024                          | Bought      | CHF     | 479'930    | EUR   | 500'000     | 16'292.03                                | 0.02         |
| 07.02.2024                          | Bought      | CHF     | 438'662    | GBP   | 400'000     | 11'241.77                                | 0.01         |
| 07.02.2024                          | Bought      | CHF     | 1'021'907  | JPY   | 170'000'000 | 4'878.89                                 | 0.00         |
| 07.02.2024                          | Bought      | CHF     | 14'786'384 | USD   | 16'600'000  | 876'925.79                               | 0.87         |
| 07.02.2024                          | Bought      | CHF     | 325'475    | USD   | 370'000     | 15'427.80                                | 0.02         |
| 07.02.2024                          | Bought      | CHF     | 601'879    | USD   | 700'000     | 15'245.48                                | 0.02         |
| 07.02.2024                          | Bought      | JPY     | 25'000'000 | CHF   | 152'055     | -2'493.51                                | 0.00         |
| <b>Total Devisentermingeschäfte</b> |             |         |            |       |             | <b>1'029'327.48</b>                      | <b>1.02</b>  |

| Ausserbilanzgeschäfte                             | 31.12.2023                             |                 | 31.12.2022                             |                 |
|---|--|-----------------|--|-----------------|
|   | Basiswertäquivalent in<br>Fondswährung | in %<br>des NFV | Basiswertäquivalent in<br>Fondswährung | in %<br>des NFV |
| <b>Engagement erhöhende Derivatpositionen:</b>    |  |                 |  |                 |
| - Währungsrisiko                                  | 0.00                                   | 0.00%           | 0.00                                   | 0.00%           |
| <b>Total engagement erhöhende Positionen</b>      | <b>0.00</b>                            | <b>0.00%</b>    | <b>0.00</b>                            | <b>0.00%</b>    |
| <b>Engagement reduzierende Derivatpositionen:</b> |  |                 |  |                 |
| - Währungsrisiko                                  | 19'808'719.80                          | 19.71%          | 21'022'456.36                          | 17.26%          |
| <b>Total engagement reduzierende Positionen</b>   | <b>19'808'719.80</b>                   | <b>19.71%</b>   | <b>21'022'456.36</b>                   | <b>17.26%</b>   |

## Kurze Übersicht

| Kennzahlen                            | Währung | 31.12.2023 | 31.12.2022 | 31.12.2021 |
|---------------------------------------|---------|------------|------------|------------|
| <b>Konsolidierung</b>                 |         |            |            |            |
| Nettofondsvermögen in Mio.            | CHF     | 615.85     | 693.17     | 823.01     |
| <b>Anteilklasse A</b>                 |         |            |            |            |
| Nettofondsvermögen in Mio.            | CHF     | 70.53      | 80.32      | 103.99     |
| Inventarwert pro Anteil               | CHF     | -          | -          | 106.22     |
| Inventarwert pro Anteil (Swung NAV)   | CHF     | 98.88      | 95.16      | -          |
| Inventarwert pro Anteil (Unswung NAV) | CHF     | 99.04      | 95.36      | -          |
| <b>Anteilklasse B</b>                 |         |            |            |            |
| Nettofondsvermögen in Mio.            | CHF     | 14.16      | 16.80      | 19.79      |
| Inventarwert pro Anteil               | CHF     | -          | -          | 107.96     |
| Inventarwert pro Anteil (Swung NAV)   | CHF     | 100.51     | 96.72      | -          |
| Inventarwert pro Anteil (Unswung NAV) | CHF     | 100.67     | 96.93      | -          |
| <b>Anteilklasse IA</b>                |         |            |            |            |
| Nettofondsvermögen in Mio.            | CHF     | 23.99      | 25.92      | 32.26      |
| Inventarwert pro Anteil               | CHF     | -          | -          | 1'033.84   |
| Inventarwert pro Anteil (Swung NAV)   | CHF     | 965.94     | 928.57     | -          |
| Inventarwert pro Anteil (Unswung NAV) | CHF     | 967.47     | 930.55     | -          |
| <b>Anteilklasse UA</b>                |         |            |            |            |
| Nettofondsvermögen in Mio.            | CHF     | 351.93     | 414.30     | 514.80     |
| Inventarwert pro Anteil               | CHF     | -          | -          | 108.71     |
| Inventarwert pro Anteil (Swung NAV)   | CHF     | 101.48     | 97.55      | -          |
| Inventarwert pro Anteil (Unswung NAV) | CHF     | 101.64     | 97.76      | -          |
| <b>Anteilklasse UB</b>                |         |            |            |            |
| Nettofondsvermögen in Mio.            | CHF     | 125.31     | 142.67     | 139.07     |
| Inventarwert pro Anteil               | CHF     | -          | -          | 109.59     |
| Inventarwert pro Anteil (Swung NAV)   | CHF     | 102.74     | 98.53      | -          |
| Inventarwert pro Anteil (Unswung NAV) | CHF     | 102.90     | 98.74      | -          |
| <b>Anteilklasse EB</b>                |         |            |            |            |
| Nettofondsvermögen in Mio.            | CHF     | 29.93      | 13.17      | 13.11      |
| Inventarwert pro Anteil               | CHF     | -          | -          | 1'137.96   |
| Inventarwert pro Anteil (Swung NAV)   | CHF     | 1'067.48   | 1'023.43   | -          |
| Inventarwert pro Anteil (Unswung NAV) | CHF     | 1'069.17   | 1'025.60   | -          |

## Verwendung des Erfolges

### Ausschüttung pro Anteil

#### Für in der Schweiz und im Ausland domizilierte Anteilinhaber

| Ausschüttung 2023                          |            | Anteilklasse A |            | Anteilklasse IA |            | Anteilklasse UA |
|--|------------|----------------|------------|-----------------|------------|-----------------|
| Bruttoausschüttung aus Ertrag              | CHF        | 0.060          | CHF        | 4.700           | CHF        | 0.420           |
| ./.. 35% Eidgenössische Verrechnungssteuer | CHF        | 0.021          | CHF        | 1.645           | CHF        | 0.147           |
| <b>Nettoausschüttung aus Ertrag</b>        | <b>CHF</b> | <b>0.039</b>   | <b>CHF</b> | <b>3.055</b>    | <b>CHF</b> | <b>0.273</b>    |
| <b>Coupon Nr. Ertrag</b>                   |            | <b>26</b>      |            | <b>5</b>        |            | <b>5</b>        |

Zahlbar ab 15.02.2024 bei der CREDIT SUISSE (SCHWEIZ) AG und deren sämtlichen Geschäftsstellen in der Schweiz.

### Thesaurierung pro Anteil

#### Für in der Schweiz und im Ausland domizilierte Anteilinhaber

| Thesaurierung 2023                               |            | Anteilklasse B |            | Anteilklasse UB |            | Anteilklasse EB |
|--|------------|----------------|------------|-----------------|------------|-----------------|
| Zur Thesaurierung verfügbarer Erfolg             | CHF        | 0.000          | CHF        | 0.418           | CHF        | 4.866           |
| ./.. 35% Eidgenössische Verrechnungssteuer       | CHF        | 0.000          | CHF        | 0.146           | CHF        | 1.703           |
| <b>Zur Thesaurierung zurückbehaltener Erfolg</b> | <b>CHF</b> | <b>0.000</b>   | <b>CHF</b> | <b>0.272</b>    | <b>CHF</b> | <b>3.163</b>    |
| <b>Coupon Nr. Ertrag</b>                         |            | <b>8</b>       |            | <b>9</b>        |            | <b>10</b>       |

## Vermögensrechnung per 31. Dezember 2023

|  | Konsolidierung        |                       |
|--|-----------------------|-----------------------|
|  | 31.12.2023            | 31.12.2022            |
|  | CHF                   | CHF                   |
| <b>Vermögenswerte</b>  |                       |                       |
| Bankguthaben, einschliesslich Treuhandanlagen bei Drittbanken, aufgeteilt in:                      |                       |                       |
| - Sichtguthaben  | 6'529'825.45          | 10'015'186.37         |
| Effekten, einschliesslich ausgeliehene und pensionierte Effekten, aufgeteilt in:                   |                       |                       |
| - Obligationen, Wandelobligationen, Optionsanleihen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte | 475'637'259.00        | 550'614'558.00        |
| - Aktien und sonstige Beteiligungswertpapiere und -rechte  | 131'619'767.95        | 129'005'061.13        |
| Sonstige Vermögenswerte  | 2'437'018.35          | 3'974'249.10          |
| <b>Gesamtfondsvermögen abzüglich:</b>  | <b>616'223'870.75</b> | <b>693'609'054.60</b> |
| Andere Verbindlichkeiten   | 370'876.86            | 435'511.05            |
| <b>Nettofondsvermögen</b>  | <b>615'852'993.89</b> | <b>693'173'543.55</b> |
| <b>Veränderung des Nettofondsvermögens</b>   |                       |                       |
|  | 01.01.2023 -          | 01.01.2022 -          |
|  | 31.12.2023            | 31.12.2022            |
|  | CHF                   | CHF                   |
| Nettofondsvermögen zu Beginn der Berichtsperiode   | 693'173'543.55        | 823'011'579.60        |
| Ausschüttungen   | -1'493'489.01         | -1'516'660.66         |
| Ablieferung Verrechnungssteuer   | -168'293.99           | -159'676.64           |
| Ausgaben von Anteilen  | 34'722'647.13         | 98'964'502.95         |
| Rücknahmen von Anteilen  | -137'724'326.05       | -145'883'342.64       |
| Sonstiges aus Anteilverkehr  | 2'451'308.42          | -5'011'021.84         |
| Gesamterfolg   | 24'891'603.84         | -76'231'837.22        |
| <b>Nettofondsvermögen am Ende der Berichtsperiode</b>  | <b>615'852'993.89</b> | <b>693'173'543.55</b> |
| <b>Entwicklung der Anteile im Umlauf</b>   |                       |                       |
| Bestand zu Beginn der Berichtsperiode  | 6'739'149.180         | 7'209'702.422         |
| Ausgegebene Anteile  | 203'758.198           | 804'649.927           |
| Zurückgenommene Anteile  | -1'356'916.720        | -1'275'203.169        |
| <b>Bestand am Ende der Berichtsperiode</b>   | <b>5'585'990.658</b>  | <b>6'739'149.180</b>  |
| <b>Währung Anteilklasse</b>  |                       |                       |
| <b>Inventarwert pro Anteil (Swung NAV)</b>   |                       |                       |
| <b>Inventarwert pro Anteil (Unswung NAV)</b>   |                       |                       |

| Anteilklasse A             |                            | Anteilklasse B             |                            | Anteilklasse IA            |                            | Anteilklasse UA            |                            |
|----------------------------|----------------------------|----------------------------|----------------------------|----------------------------|----------------------------|----------------------------|----------------------------|
| 01.01.2023 -<br>31.12.2023 | 01.01.2022 -<br>31.12.2022 | 01.01.2023 -<br>31.12.2023 | 01.01.2022 -<br>31.12.2022 | 01.01.2023 -<br>31.12.2023 | 01.01.2022 -<br>31.12.2022 | 01.01.2023 -<br>31.12.2023 | 01.01.2022 -<br>31.12.2022 |
| CHF                        | CHF                        | CHF                        | CHF                        | CHF                        | CHF                        | CHF                        | CHF                        |
| 80'316'903.07              | 103'989'458.03             | 16'795'429.65              | 19'789'344.00              | 25'917'113.87              | 32'255'268.88              | 414'304'947.77             | 514'797'374.78             |
| 0.00                       | 0.00                       | 0.00                       | 0.00                       | -96'834.69                 | -87'415.90                 | -1'396'654.32              | -1'429'244.76              |
| 0.00                       | 0.00                       | 0.00                       | 0.00                       | 0.00                       | 0.00                       | 0.00                       | 0.00                       |
| 2'624'844.17               | 6'631'455.59               | 769'327.79                 | 2'667'274.86               | 0.00                       | 14'379'253.92              | 8'005'035.55               | 34'568'382.23              |
| -15'297'567.01             | -20'191'823.00             | -3'993'938.07              | -3'533'204.40              | -2'906'735.94              | -17'818'553.08             | -85'180'202.54             | -84'162'373.17             |
| 306'482.84                 | -937'656.23                | 63'868.68                  | -211'116.67                | 84'241.38                  | -6'052.44                  | 1'792'445.74               | -4'140'839.75              |
| 2'580'313.77               | -9'174'531.32              | 520'614.03                 | -1'916'868.14              | 994'494.02                 | -2'805'387.51              | 14'405'017.96              | -45'328'351.56             |
| <b>70'530'976.84</b>       | <b>80'316'903.07</b>       | <b>14'155'302.08</b>       | <b>16'795'429.65</b>       | <b>23'992'278.64</b>       | <b>25'917'113.87</b>       | <b>351'930'590.16</b>      | <b>414'304'947.77</b>      |
| 842'226.550                | 979'044.520                | 173'276.290                | 183'303.813                | 27'851.391                 | 31'199.370                 | 4'237'978.344              | 4'735'614.187              |
| 26'961.844                 | 66'696.158                 | 7'786.646                  | 25'900.201                 | 0.000                      | 15'278.083                 | 80'287.284                 | 331'793.872                |
| -157'039.763               | -203'514.128               | -40'446.390                | -35'927.724                | -3'052.327                 | -18'626.062                | -855'671.224               | -829'429.715               |
| <b>712'148.631</b>         | <b>842'226.550</b>         | <b>140'616.546</b>         | <b>173'276.290</b>         | <b>24'799.064</b>          | <b>27'851.391</b>          | <b>3'462'594.404</b>       | <b>4'237'978.344</b>       |
| (CHF)                      | (CHF)                      | (CHF)                      | (CHF)                      | (CHF)                      | (CHF)                      | (CHF)                      | (CHF)                      |
| <b>98.88</b>               | <b>95.16</b>               | <b>100.51</b>              | <b>96.72</b>               | <b>965.94</b>              | <b>928.57</b>              | <b>101.48</b>              | <b>97.55</b>               |
| <b>99.04</b>               | <b>95.36</b>               | <b>100.67</b>              | <b>96.93</b>               | <b>967.47</b>              | <b>930.55</b>              | <b>101.64</b>              | <b>97.76</b>               |



|   | Anteilklasse UB            |                            |
|---|----------------------------|----------------------------|
|   | 01.01.2023 -<br>31.12.2023 | 01.01.2022 -<br>31.12.2022 |
|   | CHF                        | CHF                        |
| <b>Veränderung des Nettofondsvermögens</b>            |                            |                            |
| Nettofondsvermögen zu Beginn der Berichtsperiode      | 142'673'799.80             | 139'071'835.82             |
| Ausschüttungen  | 0.00                       | 0.00                       |
| Ablieferung Verrechnungssteuer                        | -151'921.27                | -142'703.79                |
| Ausgaben von Anteilen                                 | 7'398'484.32               | 37'952'254.82              |
| Rücknahmen von Anteilen                               | -30'345'882.49             | -18'954'654.39             |
| Sonstiges aus Anteilverkehr                           | 592'279.21                 | 323'632.68                 |
| Gesamterfolg  | 5'147'360.66               | -15'576'565.34             |
| <b>Nettofondsvermögen am Ende der Berichtsperiode</b> | <b>125'314'120.23</b>      | <b>142'673'799.80</b>      |
| <b>Entwicklung der Anteile im Umlauf</b>              |                            |                            |
| Bestand zu Beginn der Berichtsperiode                 | 1'444'979.921              | 1'269'021.429              |
| Ausgegebene Anteile                                   | 73'565.760                 | 362'495.360                |
| Zurückgenommene Anteile                               | -300'707.016               | -186'536.868               |
| <b>Bestand am Ende der Berichtsperiode</b>            | <b>1'217'838.665</b>       | <b>1'444'979.921</b>       |
| <b>Währung Anteilklasse</b>                           | <b>(CHF)</b>               | <b>(CHF)</b>               |
| <b>Inventarwert pro Anteil (Swung NAV)</b>            | <b>102.74</b>              | <b>98.53</b>               |
| <b>Inventarwert pro Anteil (Unswung NAV)</b>          | <b>102.90</b>              | <b>98.74</b>               |

| <b>Anteilklasse EB</b>             |                                    |
|------------------------------------|------------------------------------|
| <b>01.01.2023 -<br/>31.12.2023</b> | <b>01.01.2022 -<br/>31.12.2022</b> |
| <b>CHF</b>                         | <b>CHF</b>                         |
| 13'165'349.38                      | 13'108'298.09                      |
| 0.00                               | 0.00                               |
| -16'372.72                         | -16'972.85                         |
| 15'924'955.30                      | 2'765'881.53                       |
| 0.00                               | -1'222'734.60                      |
| -388'009.44                        | -38'989.44                         |
| 1'243'803.40                       | -1'430'133.35                      |
| <b>29'929'725.92</b>               | <b>13'165'349.38</b>               |
| 12'836.684                         | 11'519.103                         |
| 15'156.664                         | 2'486.253                          |
| 0.000                              | -1'168.672                         |
| <b>27'993.348</b>                  | <b>12'836.684</b>                  |
| <b>(CHF)</b>                       | <b>(CHF)</b>                       |
| <b>1'067.48</b>                    | <b>1'023.43</b>                    |
| <b>1'069.17</b>                    | <b>1'025.60</b>                    |

## Erfolgsrechnung für die Zeit vom 1. Januar 2023 bis zum 31. Dezember 2023

|  | Konsolidierung             |                            |
|--|----------------------------|----------------------------|
|  | 01.01.2023 -<br>31.12.2023 | 01.01.2022 -<br>31.12.2022 |
|  | CHF                        | CHF                        |
| <b>Ertrag</b>  |                            |                            |
| Erträge der Bankguthaben   | 76'757.73                  | 999.06                     |
| Negativzinsen  | -146.34                    | -188'181.62                |
| Erträge der Effekten, aufgeteilt in:   |                            |                            |
| - Obligationen, Wandelobligationen, Optionsanleihen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte | 3'306'334.75               | 3'450'291.96               |
| - Aktien und sonstige Beteiligungswertpapiere und -rechte, einschliesslich Gratisaktien            | 3'737'972.99               | 4'114'791.39               |
| Einkauf in laufende Nettoerträge bei der Ausgabe von Anteilen                                      | 124'336.19                 | 200'254.48                 |
| <b>Total Erträge</b>   | <b>7'245'255.32</b>        | <b>7'578'155.27</b>        |
| <b>Aufwendungen</b>  |                            |                            |
| Prüfaufwand  | 14'494.70                  | 14'512.48                  |
| Reglementarische Vergütung an:   |                            |                            |
| - die Fondsleitung   | 4'420'434.87               | 5'172'075.08               |
| - die Depotbank  | 274'535.35                 | 320'896.30                 |
| Sonstige Aufwendungen  | 11'168.76                  | 19'093.21                  |
| Ausrichtung laufender Nettoerträge bei Rücknahme von Anteilen                                      | 456'106.61                 | 444'596.94                 |
| <b>Total Aufwendungen</b>  | <b>5'176'740.29</b>        | <b>5'971'174.01</b>        |
| <b>Nettoertrag</b>   | <b>2'068'515.03</b>        | <b>1'606'981.26</b>        |
| Realisierte Kapitalgewinne und -verluste   | -4'351'750.80              | -1'632'877.88              |
| <b>Realisierter Erfolg</b>   | <b>-2'283'235.77</b>       | <b>-25'896.62</b>          |
| Nicht realisierte Kapitalgewinne und -verluste   | 27'174'839.61              | -76'205'940.60             |
| <b>Gesamterfolg</b>  | <b>24'891'603.84</b>       | <b>-76'231'837.22</b>      |
| <b>Verwendung des Erfolgs</b>  |                            |                            |
| Nettoertrag des Rechnungsjahres  | 2'068'515.03               | 1'606'981.26               |
| Verlustverrechnung mit angesammelten Kapitalgewinnen/ -verlusten                                   | 36'693.57                  | 164'113.04                 |
| Vortrag des Vorjahres  | 503'456.00                 | 756'549.57                 |
| <b>Zur Verteilung verfügbarer Erfolg</b>   | <b>2'608'664.60</b>        | <b>2'527'643.87</b>        |
| Zur Ausschüttung an die Anlegerinnen und Anleger vorgesehener Erfolg                               | 1'613'574.17               | 1'543'962.79               |
| Ablieferung/Ausschüttung der Verrechnungssteuer (35%)  | 225'941.09                 | 168'078.42                 |
| Zur Wiederanlage zurückbehaltener Ertrag (65%)   | 419'607.21                 | 312'146.66                 |
| Vortrag auf neue Rechnung  | 349'542.13                 | 503'456.00                 |

| Anteilklasse A             |                            | Anteilklasse B             |                            | Anteilklasse IA            |                            | Anteilklasse UA            |                            |
|----------------------------|----------------------------|----------------------------|----------------------------|----------------------------|----------------------------|----------------------------|----------------------------|
| 01.01.2023 -<br>31.12.2023 | 01.01.2022 -<br>31.12.2022 | 01.01.2023 -<br>31.12.2023 | 01.01.2022 -<br>31.12.2022 | 01.01.2023 -<br>31.12.2023 | 01.01.2022 -<br>31.12.2022 | 01.01.2023 -<br>31.12.2023 | 01.01.2022 -<br>31.12.2022 |
| CHF                        | CHF                        | CHF                        | CHF                        | CHF                        | CHF                        | CHF                        | CHF                        |
| 8'839.79                   | 115.54                     | 1'852.48                   | 24.43                      | 2'915.32                   | 37.19                      | 44'384.45                  | 597.63                     |
| -16.96                     | -22'200.15                 | -3.54                      | -4'774.33                  | -5.48                      | -6'380.87                  | -87.42                     | -114'570.75                |
| 381'866.30                 | 407'732.66                 | 80'066.75                  | 86'685.07                  | 124'848.33                 | 121'708.37                 | 1'920'261.91               | 2'093'754.24               |
| 438'303.53                 | 491'826.67                 | 92'569.86                  | 103'028.88                 | 138'983.71                 | 139'634.40                 | 2'193'013.11               | 2'520'817.24               |
| 2'924.78                   | 3'560.65                   | 639.85                     | 1'065.22                   | 0.00                       | 68'576.41                  | 31'060.48                  | 71'602.69                  |
| <b>831'917.44</b>          | <b>881'035.37</b>          | <b>175'125.40</b>          | <b>186'029.27</b>          | <b>266'741.88</b>          | <b>323'575.50</b>          | <b>4'188'632.53</b>        | <b>4'572'201.05</b>        |
| 1'674.94                   | 1'712.84                   | 350.87                     | 365.05                     | 548.20                     | 510.14                     | 8'420.59                   | 8'802.23                   |
| 802'133.15                 | 960'560.61                 | 168'192.07                 | 203'878.08                 | 140'251.07                 | 138'754.07                 | 2'345'424.51               | 2'866'219.06               |
| 31'712.28                  | 37'975.64                  | 6'649.45                   | 8'060.28                   | 10'366.44                  | 11'297.63                  | 159'488.85                 | 194'902.92                 |
| 1'283.04                   | 2'276.08                   | 265.99                     | 474.00                     | 425.43                     | 663.86                     | 6'468.82                   | 11'619.73                  |
| 27'135.99                  | 15'598.89                  | 4'338.63                   | 276.21                     | 9'648.72                   | 69'947.03                  | 314'671.48                 | 302'190.66                 |
| <b>863'939.40</b>          | <b>1'018'124.06</b>        | <b>179'797.01</b>          | <b>213'053.62</b>          | <b>161'239.86</b>          | <b>221'172.73</b>          | <b>2'834'474.25</b>        | <b>3'383'734.60</b>        |
| <b>-32'021.96</b>          | <b>-137'088.69</b>         | <b>-4'671.61</b>           | <b>-27'024.35</b>          | <b>105'502.02</b>          | <b>102'402.77</b>          | <b>1'354'158.28</b>        | <b>1'188'466.45</b>        |
| -499'427.84                | -189'505.89                | -100'212.80                | -39'627.03                 | -169'411.14                | -61'004.01                 | -2'485'523.43              | -975'956.06                |
| <b>-531'449.80</b>         | <b>-326'594.58</b>         | <b>-104'884.41</b>         | <b>-66'651.38</b>          | <b>-63'909.12</b>          | <b>41'398.76</b>           | <b>-1'131'365.15</b>       | <b>212'510.39</b>          |
| 3'111'763.57               | -8'847'936.74              | 625'498.44                 | -1'850'216.76              | 1'058'403.14               | -2'846'786.27              | 15'536'383.11              | -45'540'861.95             |
| <b>2'580'313.77</b>        | <b>-9'174'531.32</b>       | <b>520'614.03</b>          | <b>-1'916'868.14</b>       | <b>994'494.02</b>          | <b>-2'805'387.51</b>       | <b>14'405'017.96</b>       | <b>-45'328'351.56</b>      |
| -32'021.96                 | -137'088.69                | -4'671.61                  | -27'024.35                 | 105'502.02                 | 102'402.77                 | 1'354'158.28               | 1'188'466.45               |
| 32'021.96                  | 137'088.69                 | 4'671.61                   | 27'024.35                  | 0.00                       | 0.00                       | 0.00                       | 0.00                       |
| 56'252.62                  | 56'252.62                  | 0.00                       | 0.00                       | 33'699.59                  | 34'346.97                  | 413'503.79                 | 665'949.98                 |
| <b>56'252.62</b>           | <b>56'252.62</b>           | <b>0.00</b>                | <b>0.00</b>                | <b>139'201.61</b>          | <b>136'749.74</b>          | <b>1'767'662.07</b>        | <b>1'854'416.43</b>        |
| 42'728.92                  | 0.00                       | 0.00                       | 0.00                       | 116'555.60                 | 103'050.15                 | 1'454'289.65               | 1'440'912.64               |
| 0.00                       | 0.00                       | 0.00                       | 0.00                       | 0.00                       | 0.00                       | 0.00                       | 0.00                       |
| 0.00                       | 0.00                       | 0.00                       | 0.00                       | 0.00                       | 0.00                       | 0.00                       | 0.00                       |
| 13'523.70                  | 56'252.62                  | 0.00                       | 0.00                       | 22'646.01                  | 33'699.59                  | 313'372.42                 | 413'503.79                 |

|  | Anteilklasse UB            |                            |
|--|----------------------------|----------------------------|
|  | 01.01.2023 -<br>31.12.2023 | 01.01.2022 -<br>31.12.2022 |
|  | CHF                        | CHF                        |
| <b>Ertrag</b>  |                            |                            |
| Erträge der Bankguthaben   | 15'893.40                  | 205.47                     |
| Negativzinsen  | -30.16                     | -36'720.35                 |
| Erträge der Effekten, aufgeteilt in:   |                            |                            |
| - Obligationen, Wandelobligationen, Optionsanleihen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte | 687'779.70                 | 675'995.47                 |
| - Aktien und sonstige Beteiligungswertpapiere und -rechte, einschliesslich Gratisaktien            | 794'426.97                 | 783'863.19                 |
| Einkauf in laufende Nettoerträge bei der Ausgabe von Anteilen                                      | 13'814.69                  | 53'107.97                  |
| <b>Total Erträge</b>   | <b>1'511'884.60</b>        | <b>1'476'451.75</b>        |
| <b>Aufwendungen</b>  |                            |                            |
| Prüfaufwand  | 3'013.60                   | 2'850.31                   |
| Reglementarische Vergütung an:   |                            |                            |
| - die Fondsleitung   | 839'820.74                 | 921'699.06                 |
| - die Depotbank  | 57'107.80                  | 62'675.54                  |
| Sonstige Aufwendungen  | 2'306.33                   | 3'703.68                   |
| Ausrichtung laufender Nettoerträge bei Rücknahme von Anteilen                                      | 100'311.79                 | 52'077.31                  |
| <b>Total Aufwendungen</b>  | <b>1'002'560.26</b>        | <b>1'043'005.90</b>        |
| <b>Nettoertrag</b>   | <b>509'324.34</b>          | <b>433'445.85</b>          |
| Realisierte Kapitalgewinne und -verluste   | -885'685.92                | -335'806.22                |
| <b>Realisierter Erfolg</b>   | <b>-376'361.58</b>         | <b>97'639.63</b>           |
| Nicht realisierte Kapitalgewinne und -verluste   | 5'523'722.24               | -15'674'204.97             |
| <b>Gesamterfolg</b>  | <b>5'147'360.66</b>        | <b>-15'576'565.34</b>      |
| <b>Verwendung des Erfolgs</b>  |                            |                            |
| Nettoertrag des Rechnungsjahres  | 509'324.34                 | 433'445.85                 |
| Verlustverrechnung mit angesammelten Kapitalgewinnen/ -verlusten                                   | 0.00                       | 0.00                       |
| Vortrag des Vorjahres  | 0.00                       | 0.00                       |
| <b>Zur Verteilung verfügbarer Erfolg</b>   | <b>509'324.34</b>          | <b>433'445.85</b>          |
| Zur Ausschüttung an die Anlegerinnen und Anleger vorgesehener Erfolg                               | 0.00                       | 0.00                       |
| Ablieferung/Ausschüttung der Verrechnungssteuer (35%)  | 178'262.72                 | 151'705.70                 |
| Zur Wiederanlage zurückbehaltener Ertrag (65%)   | 331'061.62                 | 281'740.15                 |
| Vortrag auf neue Rechnung  | 0.00                       | 0.00                       |

| Anteilklasse EB            |                            |
|----------------------------|----------------------------|
| 01.01.2023 -<br>31.12.2023 | 01.01.2022 -<br>31.12.2022 |
| CHF                        | CHF                        |
| 2'872.29                   | 18.80                      |
| -2.78                      | -3'535.17                  |
| 111'511.76                 | 64'416.15                  |
| 80'675.81                  | 75'621.01                  |
| 75'896.39                  | 2'341.54                   |
| <b>270'953.47</b>          | <b>138'862.33</b>          |
| 486.50                     | 271.91                     |
| 124'613.33                 | 80'964.20                  |
| 9'210.53                   | 5'984.29                   |
| 419.15                     | 355.86                     |
| 0.00                       | 4'506.84                   |
| <b>134'729.51</b>          | <b>92'083.10</b>           |
| <b>136'223.96</b>          | <b>46'779.23</b>           |
| -211'489.67                | -30'978.67                 |
| <b>-75'265.71</b>          | <b>15'800.56</b>           |
| 1'319'069.11               | -1'445'933.91              |
| <b>1'243'803.40</b>        | <b>-1'430'133.35</b>       |
| 136'223.96                 | 46'779.23                  |
| 0.00                       | 0.00                       |
| 0.00                       | 0.00                       |
| <b>136'223.96</b>          | <b>46'779.23</b>           |
| 0.00                       | 0.00                       |
| 47'678.37                  | 16'372.72                  |
| 88'545.59                  | 30'406.51                  |
| 0.00                       | 0.00                       |

## Zusammensetzung des Portefeuilles und Bestandesveränderungen

| Titelbezeichnung   | Währung  | 31.12.2022<br>Anzahl/<br>Nominal | Käufe (1) | Verkäufe (1) | 31.12.2023<br>Anzahl/<br>Nominal | Kurswert CHF          | in % des<br>Gesamtfonds-<br>vermögens |              |
|--|--|----------------------------------|-----------|--------------|----------------------------------|-----------------------|---------------------------------------|--------------|
| <b>Börsennotierte / an einem geregelten Markt gehandelte Wertpapiere; bewertet zu den Kursen, die am Hauptmarkt bezahlt werden</b> |  |                                  |           |              |                                  |                       |                                       |              |
| <b>Aktien (und aktienähnliche Wertpapiere)</b>   |  |                                  |           |              |                                  |                       |                                       |              |
| <b>SCHWEIZER FRANKEN</b>   |  |                                  |           |              |                                  |                       |                                       |              |
| ABB (reg. shares)  | CHF  | 156'319                          | 31'056    | 23'425       | 163'950                          | 6'115'335.00          | 0.99                                  |              |
| ACCELLERON INDUSTRIES AG   | CHF  | 7'815                            | 212       | 8'027        |                                  |                       |                                       |              |
| ADECCO (reg. shares)   | CHF  | 16'075                           | 1'580     | 3'993        | 13'662                           | 563'830.74            | 0.09                                  |              |
| ALCON INC  | CHF  | 47'073                           | 14'910    | 7'123        | 54'860                           | 3'601'010.40          | 0.58                                  |              |
| BALOISE-HOLDING (reg. shares)  | CHF  | 4'064                            | 545       | 300          | 4'309                            | 567'926.20            | 0.09                                  |              |
| BANQUE CANTONALE VAUDOISE  | CHF  |                                  | 2'848     |              | 2'848                            | 309'008.00            | 0.05                                  |              |
| BARRY CALLEBAUT (reg. shares)  | CHF  | 353                              | 75        | 50           | 378                              | 536'382.00            | 0.09                                  |              |
| BKW  | CHF  |                                  | 2'161     | 112          | 2'049                            | 306'325.50            | 0.05                                  |              |
| CIE FINANCIERE RICHEMONT (reg. shares)   | CHF  | 53'696                           | 8'036     | 7'502        | 54'230                           | 6'277'122.50          | 1.02                                  |              |
| CLARIANT (reg. shares)   | CHF  | 26'495                           | 2'483     | 8'800        | 20'178                           | 250'610.76            | 0.04                                  |              |
| CS GROUP (reg. shares)   | CHF  | 290'684                          | 7'896     | 298'580      |                                  |                       |                                       |              |
| DUFFRY   | CHF  |                                  | 9'506     | 436          | 9'070                            | 300'035.60            | 0.05                                  |              |
| EMS-CHEMIE HOLDING   | CHF  |                                  | 529       | 42           | 487                              | 331'647.00            | 0.05                                  |              |
| GEBERIT  | CHF  | 3'401                            | 356       | 604          | 3'153                            | 1'699'467.00          | 0.28                                  |              |
| GIVAUDAN (reg. shares)   | CHF  | 1'026                            | 113       | 168          | 971                              | 3'382'964.00          | 0.55                                  |              |
| HELVETIA HOLDING LTD   | CHF  |                                  | 3'441     | 246          | 3'195                            | 370'300.50            | 0.06                                  |              |
| JULIUS BAER GRUPPE   | CHF  | 17'488                           | 3'979     | 1'919        | 19'548                           | 921'688.20            | 0.15                                  |              |
| KUEHNE & NAGEL INTERNATIONAL   | CHF  | 5'830                            | 618       | 857          | 5'591                            | 1'620'271.80          | 0.26                                  |              |
| LAFARGEHOLCIM (reg. shares)  | CHF  | 45'219                           | 12'046    | 7'975        | 49'290                           | 3'254'125.80          | 0.53                                  |              |
| LINDT & SPRUENGLI  | CHF  | 222                              | 16        | 144          | 94                               | 948'460.00            | 0.15                                  |              |
| LINDT & SPRUENGLI LISN SW  | CHF  |                                  | 11        |              | 11                               | 1'122'000.00          | 0.18                                  |              |
| LOGITECH INTERNATIONAL (reg. shares)   | CHF  | 18'548                           | 1'786     | 4'254        | 16'080                           | 1'282'540.80          | 0.21                                  |              |
| LONZA GROUP (reg. shares)  | CHF  | 8'611                            | 1'236     | 1'597        | 8'250                            | 2'918'025.00          | 0.47                                  |              |
| NESTLE (reg. shares)   | CHF  | 274'661                          | 33'582    | 48'656       | 259'587                          | 25'312'328.37         | 4.11                                  |              |
| NOVARTIS (reg. shares)   | CHF  | 208'425                          | 23'442    | 26'930       | 204'937                          | 17'393'003.19         | 2.82                                  |              |
| PARTNERS GROUP   | CHF  | 1'980                            | 246       | 282          | 1'944                            | 2'358'072.00          | 0.38                                  |              |
| ROCHE HOLDING  | CHF  | 2'033                            | 1'062     | 194          | 2'901                            | 758'321.40            | 0.12                                  |              |
| ROCHE HOLDINGS (cert. shares)  | CHF  | 68'886                           | 8'271     | 13'469       | 63'688                           | 15'571'716.00         | 2.53                                  |              |
| SANDOZ GROUP LTD   | CHF  |                                  | 40'846    |              | 40'846                           | 1'105'292.76          | 0.18                                  |              |
| SCHINDLER HOLDING  | CHF  |                                  | 1'969     | 161          | 1'808                            | 360'696.00            | 0.06                                  |              |
| SCHINDLER HOLDING (part. cert.)  | CHF  | 6'183                            | 356       | 3'397        | 3'142                            | 660'762.60            | 0.11                                  |              |
| SGS LTD  | CHF  |                                  | 17'680    | 2'441        | 15'239                           | 1'105'437.06          | 0.18                                  |              |
| SIG COMBIBLOC SERVICES   | CHF  |                                  | 31'949    |              | 31'949                           | 618'213.15            | 0.10                                  |              |
| SIKA LTD   | CHF  | 12'542                           | 2'734     | 1'193        | 14'083                           | 3'854'517.10          | 0.63                                  |              |
| SOCIETE GENERALE DE SURVEILLANCE HOLDING (reg. shares)   | CHF  | 619                              | 37        | 656          |                                  |                       |                                       |              |
| SONOVA HOLDING (reg. shares)   | CHF  | 5'794                            | 660       | 1'231        | 5'223                            | 1'433'191.20          | 0.23                                  |              |
| STRAUMANN HOLDING LTD  | CHF  | 9'539                            | 2'560     | 749          | 11'350                           | 1'539'060.00          | 0.25                                  |              |
| SWISS LIFE HOLDING (reg. shares)   | CHF  | 2'995                            | 312       | 522          | 2'785                            | 1'626'440.00          | 0.26                                  |              |
| SWISS REINSURANCE  | CHF  | 32'678                           | 3'489     | 5'059        | 31'108                           | 2'941'572.48          | 0.48                                  |              |
| SWISSCOM (reg. shares)   | CHF  | 2'650                            | 326       | 454          | 2'522                            | 1'276'132.00          | 0.21                                  |              |
| TEMENOS GROUP  | CHF  | 7'596                            | 879       | 2'253        | 6'222                            | 486'684.84            | 0.08                                  |              |
| THE SWATCH GROUP   | CHF  | 2'827                            | 256       | 908          | 2'175                            | 497'205.00            | 0.08                                  |              |
| UBS GROUP  | CHF  | 346'197                          | 34'496    | 67'507       | 313'186                          | 8'174'154.60          | 1.33                                  |              |
| VAT GROUP  | CHF  | 2'324                            | 400       | 170          | 2'554                            | 1'076'511.00          | 0.17                                  |              |
| ZURICH INSURANCE GROUP (reg. shares)   | CHF  | 14'485                           | 2'049     | 1'085        | 15'449                           | 6'791'380.40          | 1.10                                  |              |
|  |  |                                  |           |              |                                  | <b>131'619'767.95</b> | <b>21.36</b>                          |              |
| <b>Total Aktien (und aktienähnliche Wertpapiere)</b>   |  |                                  |           |              |                                  |                       | <b>131'619'767.95</b>                 | <b>21.36</b> |
| <b>Anleihen</b>  |  |                                  |           |              |                                  |                       |                                       |              |
| <b>SCHWEIZER FRANKEN</b>   |  |                                  |           |              |                                  |                       |                                       |              |
| 0.010  | AARGAUISCHE KANTONALBANK 0.01%/20-18.02.2030       | CHF                              | 3'000'000 |              | 3'000'000                        | 2'748'000.00          | 0.45                                  |              |
| 0.010  | AARGAUISCHE KANTONALBANK 0.01%/20-29.06.2028       | CHF                              | 4'120'000 |              | 4'120'000                        | 3'858'380.00          | 0.63                                  |              |
| 0.020  | AARGAUISCHE KANTONALBANK 0.02%/16-17.10.2024       | CHF                              | 2'500'000 |              | 2'000'000                        | 1'973'600.00          | 0.32                                  |              |
| 0.300  | ABN AMRO BANK 0.3%/16-18.12.2024                   | CHF                              | 3'000'000 |              | 1'000'000                        | 1'974'400.00          | 0.32                                  |              |
| 1.205  | AFRICA FINANCE CORPORATION 1.205%/20-30.09.2025    | CHF                              | 2'000'000 |              | 2'000'000                        |                       |                                       |              |
| 0.250  | AKADEMISKA HUS 0.25%/15-17.11.2025                 | CHF                              | 3'020'000 |              | 3'020'000                        | 2'959'600.00          | 0.48                                  |              |
| 0.300  | AKADEMISKA HUS 0.3%/17-08.10.2029                  | CHF                              | 3'000'000 |              | 3'000'000                        | 2'827'500.00          | 0.46                                  |              |
| 1.993  | AKADEMISKA HUS 1.9925%/23-14.03.2033               | CHF                              |           | 3'000'000    | 3'000'000                        | 3'150'000.00          | 0.51                                  |              |
| 0.350  | ANZ NEW ZEALAND (INTL) LIMITED 0.35%/18-22.10.2024 | CHF                              | 3'000'000 |              | 500'000                          | 2'500'000             | 0.40                                  |              |
| 0.250  | ANZ NEW ZEALAND INTERNATIONAL 0.25%/16-25.10.2023  | CHF                              | 3'000'000 |              | 3'000'000                        |                       |                                       |              |
| 0.375  | APPLE INC 0.375%/15-25.11.2024                     | CHF                              | 3'000'000 |              | 1'500'000                        | 1'483'500.00          | 0.24                                  |              |
| 0.450  | ASB FINANCE LTD 0.45%/19-30.01.2025                | CHF                              | 5'000'000 |              | 3'000'000                        | 1'970'800.00          | 0.32                                  |              |
| 2.750  | ASIAN DEVELOPMENT BANK 2.75%/10-12.02.2030         | CHF                              | 3'075'000 |              | 3'075'000                        | 3'371'737.50          | 0.55                                  |              |
| 1.660  | AUCKLAND COUNCIL 1.66%/22-18.10.2027               | CHF                              |           | 1'000'000    | 1'000'000                        | 1'011'500.00          | 0.16                                  |              |
| 0.250  | BALOISE HOLDING AG 0.25%/20-16.12.2026             | CHF                              | 3'000'000 |              | 3'000'000                        | 2'889'000.00          | 0.47                                  |              |
| 0.500  | BALOISE HOLDING AG 0.5%/20-16.12.2030              | CHF                              | 1'400'000 |              | 1'400'000                        | 1'295'000.00          | 0.21                                  |              |
| 2.200  | BALOISE HOLDING AG 2.2%/23-30.01.2032              | CHF                              |           | 3'000'000    | 3'000'000                        | 3'111'000.00          | 0.50                                  |              |

| Titelbezeichnung   | Währung | 31.12.2022<br>Anzahl/<br>Nominal | Käufe (1) | Verkäufe (1) | 31.12.2023<br>Anzahl/<br>Nominal | Kurswert CHF | in % des<br>Gesamtfonds-<br>vermögens |
|--|---------|----------------------------------|-----------|--------------|----------------------------------|--------------|---------------------------------------|
| 0.125 BALOISE-HOLDING AG 0.125%/21-27.06.2030                            | CHF     | 5'000'000                        |           |              | 5'000'000                        | 4'547'500.00 | 0.74                                  |
| 0.100 BANCO DE CREDITO E INVERSIONES 0.1%/20-18.09.2026                  | CHF     | 2'000'000                        |           | 1'000'000    | 1'000'000                        | 947'000.00   | 0.15                                  |
| 0.400 BANCO DE CREDITO E INVERSIONES 0.4%/19-22.11.2024                  | CHF     | 500'000                          |           | 500'000      |                                  |              |                                       |
| 0.200 BANCO SANTANDER SA 0.2%/19-19.11.2027                              | CHF     | 3'000'000                        |           |              | 3'000'000                        | 2'839'500.00 | 0.46                                  |
| 0.278 BANK OF NOVA SCOTIA 0.278%/22-01.04.2027                           | CHF     | 3'000'000                        |           |              | 3'000'000                        | 2'892'000.00 | 0.47                                  |
| 0.385 BANK OF NOVA SCOTIA 0.385%/22-01.02.2029                           | CHF     | 3'000'000                        |           |              | 3'000'000                        | 2'799'000.00 | 0.45                                  |
| 0.300 BANQ CANTONALE DU VALAIS 0.3%/19-01.02.2027                        | CHF     | 1'750'000                        |           |              | 1'750'000                        | 1'684'375.00 | 0.27                                  |
| 1.625 BANQUE CANTONALE VAUDOISE 1.625%/11-30.11.2026                     | CHF     | 2'420'000                        |           |              | 2'420'000                        | 2'418'790.00 | 0.39                                  |
| 0.600 BANQUE FEDERALE CREDIT MUTUEL 0.6%/17-05.04.2027                   | CHF     | 3'000'000                        |           |              | 3'000'000                        | 2'884'500.00 | 0.47                                  |
| 0.200 BANQUE FEDERATIVE DU CREDIT MUTUEL 0.2%/20-03.11.2028              | CHF     | 3'000'000                        |           |              | 3'000'000                        | 2'785'500.00 | 0.45                                  |
| 0.250 BANQUE FEDERATIVE DU CREDIT MUTUEL 0.25%/19-10.07.2025             | CHF     | 2'000'000                        |           |              | 2'000'000                        | 1'957'000.00 | 0.32                                  |
| 0.366 BANQUE FEDERATIVE DU CREDIT MUTUEL 0.366%/18-10.10.2024            | CHF     | 2'000'000                        |           |              | 2'000'000                        | 1'978'000.00 | 0.32                                  |
| 0.050 BASELLANDSCHAFTLICHE KANTONALBANK 0.05%/20-28.01.2031              | CHF     | 3'000'000                        |           |              | 3'000'000                        | 2'713'500.00 | 0.44                                  |
| 0.375 BASELLANDSCHAFTLICHE KANTONALBANK 0.375%/19-13.05.2030             | CHF     | 2'000'000                        |           |              | 2'000'000                        | 1'865'000.00 | 0.30                                  |
| 0.150 BASLER KANTONALBANK 0.15%/19-02.04.2027                            | CHF     | 3'000'000                        |           |              | 3'000'000                        | 2'869'500.00 | 0.47                                  |
| 0.250 BERLIN HYP AG 0.25%/20-11.09.2028                                  | CHF     | 1'000'000                        |           |              | 1'000'000                        | 927'500.00   | 0.15                                  |
| 0.250 BERLIN HYP AG 0.25%/21-04.10.2029                                  | CHF     | 2'000'000                        |           |              | 2'000'000                        | 1'833'000.00 | 0.30                                  |
| 1.125 BNG BANK 1.125%/13-19.04.2023                                      | CHF     | 1'000'000                        |           | 1'000'000    |                                  |              |                                       |
| 2.630 BNP PARIBAS 2.63%/23-07.06.2029                                    | CHF     |                                  | 2'000'000 |              | 2'000'000                        | 2'083'000.00 | 0.34                                  |
| 0.111 BNZ INTERNATIONAL FUNDING LTD 0.111%/20-24.07.2028                 | CHF     | 3'000'000                        |           |              | 3'000'000                        | 2'787'000.00 | 0.45                                  |
| 2.375 CAISSE D'AMORTISSEMENT DE LA DETTE SOCIALE 2.375%/11-19.04.2023    | CHF     | 1'000'000                        |           | 1'000'000    |                                  |              |                                       |
| 1.750 CAISSE DE REFINANCEMENT DE L'HABITAT 1.75%/13-26.06.2025           | CHF     | 5'000'000                        |           | 2'200'000    | 2'800'000                        | 2'803'080.00 | 0.45                                  |
| 0.050 CANADIAN IMPERIAL BANK OF COMMERCE 0.05%/19-15.10.2026             | CHF     | 3'000'000                        |           |              | 3'000'000                        | 2'863'500.00 | 0.46                                  |
| 0.100 CANADIAN IMPERIAL BANK OF COMMERCE 0.1%/20-24.10.2023              | CHF     | 5'000'000                        |           | 5'000'000    |                                  |              |                                       |
| 0.180 CANADIAN IMPERIAL BANK OF COMMERCE 0.18%/21-20.04.2029             | CHF     | 3'000'000                        |           |              | 3'000'000                        | 2'758'500.00 | 0.45                                  |
| 0.283 CANADIAN IMPERIAL BANK OF COMMERCE 0.2825%/22-03.02.2027           | CHF     | 3'000'000                        |           |              | 3'000'000                        | 2'862'000.00 | 0.46                                  |
| - CANTON OF TICINO 0%/21-31.03.2026                                      | CHF     | 3'000'000                        |           |              | 3'000'000                        | 2'910'000.00 | 0.47                                  |
| 0.250 CEMBRA MONEY BANK AG 0.25%/17-23.05.2024                           | CHF     | 2'000'000                        |           | 2'000'000    |                                  |              |                                       |
| 0.375 CEMBRA MONEY BANK AG 0.375%/17-27.06.2025                          | CHF     | 3'650'000                        |           | 1'150'000    | 2'500'000                        | 2'447'500.00 | 0.40                                  |
| 0.110 CENTRAL AMERICAN BANK FOR ECONOMIC INTEGRATION 0.11%/21-15.12.2028 | CHF     | 3'000'000                        |           | 1'000'000    | 2'000'000                        | 1'829'000.00 | 0.30                                  |
| 0.010 CHOCOLADEFABRIKEN LINDT & SPRUENGLI AG 0.01%/20-06.10.2028         | CHF     | 3'000'000                        |           |              | 3'000'000                        | 2'800'500.00 | 0.45                                  |
| 1.625 CITY OF ZURICH 1.625%/23-26.01.2037                                | CHF     |                                  | 2'000'000 |              | 2'000'000                        | 2'075'000.00 | 0.34                                  |
| 1.000 COCA-COLA (reg. -S-) 1%/15-02.10.2028                              | CHF     | 2'255'000                        |           |              | 2'255'000                        | 2'234'705.00 | 0.36                                  |
| 1.940 COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA 1.94%/23-26.06.2030                 | CHF     |                                  | 2'000'000 |              | 2'000'000                        | 2'063'000.00 | 0.33                                  |
| 0.250 COOPERATIEVE RABOBANK UA 0.25%/19-25.11.2027                       | CHF     | 2'000'000                        |           |              | 2'000'000                        | 1'889'000.00 | 0.31                                  |
| 3.125 COOPERATIEVE RABOBANK UA 3.125%/06-15.09.2026                      | CHF     | 4'000'000                        |           | 2'000'000    | 2'000'000                        | 2'083'000.00 | 0.34                                  |
| 0.450 CORPORACION ANDINA DE FOMENTO 0.45%/22-24.02.2027                  | CHF     | 3'000'000                        |           | 1'000'000    | 2'000'000                        | 1'906'000.00 | 0.31                                  |
| 0.500 CORPORACION ANDINA DE FOMENTO 0.5%/15-26.02.2026                   | CHF     | 2'000'000                        |           | 1'500'000    | 500'000                          | 483'750.00   | 0.08                                  |
| 0.700 CORPORACION ANDINA DE FOMENTO 0.7%/20-04.09.2025                   | CHF     | 3'250'000                        |           | 2'000'000    | 1'250'000                        | 1'222'500.00 | 0.20                                  |
| 0.250 CREDIT AGRICOLE HOME LOAN SFH 0.25%/17-27.07.2027                  | CHF     | 5'000'000                        |           |              | 5'000'000                        | 4'807'500.00 | 0.78                                  |
| 0.450 CREDIT AGRICOLE HOME LOAN SFH 0.45%/19-24.01.2029                  | CHF     | 3'000'000                        |           |              | 3'000'000                        | 2'859'000.00 | 0.46                                  |
| 0.030 CREDIT AGRICOLE NEXT BANK (SUISSE) SA 0.03%/21-24.09.2031          | CHF     | 4'000'000                        |           | 1'000'000    | 3'000'000                        | 2'631'000.00 | 0.43                                  |
| 0.200 CREDIT AGRICOLE S.A. LONDON BRANCH 0.2%/18-30.10.2023              | CHF     | 2'800'000                        |           | 2'800'000    |                                  |              |                                       |
| 0.300 CREDIT AGRICOLE S.A. LONDON BRANCH 0.3%/17-18.04.2024              | CHF     | 3'000'000                        |           | 1'000'000    | 2'000'000                        | 1'990'000.00 | 0.32                                  |
| - CREDIT SUISSE SCHWEIZ AG 0%/20-31.07.2025                              | CHF     | 3'000'000                        |           |              | 3'000'000                        | 2'920'500.00 | 0.47                                  |
| - CREDIT SUISSE SCHWEIZ AG 0%/20-31.10.2030                              | CHF     | 3'000'000                        |           |              | 3'000'000                        | 2'679'000.00 | 0.43                                  |
| 0.100 DEUTSCHE BAHN FINANCE GMBH 0.1%/15-01.12.2025                      | CHF     | 2'000'000                        |           |              | 2'000'000                        | 1'952'000.00 | 0.32                                  |
| 0.450 DEUTSCHE BAHN FINANCE GMBH 0.45%/17-08.11.2030                     | CHF     | 3'000'000                        |           |              | 3'000'000                        | 2'820'000.00 | 0.46                                  |
| 1.375 DEUTSCHE BAHN FINANCE GMBH 1.375%/13-24.07.2023                    | CHF     | 2'000'000                        |           | 2'000'000    |                                  |              |                                       |
| 1.500 DEUTSCHE BAHN FINANCE GMBH 1.5%/14-26.08.2024                      | CHF     | 4'000'000                        |           | 2'000'000    | 2'000'000                        | 1'998'000.00 | 0.32                                  |
| 0.150 ELI LILLY & CO 0.15%/16-24.05.2024                                 | CHF     | 2'980'000                        |           | 1'980'000    | 1'000'000                        | 993'900.00   | 0.16                                  |
| 1.375 EMIS FUER GEM WOHNBAUT S. -46- 1.375%/13-24.07.2023                | CHF     | 430'000                          |           | 430'000      |                                  |              |                                       |
| 1.750 EMISSIONSZ EGW S. 42 1.75%/11-14.09.2026                           | CHF     | 2'000'000                        |           |              | 2'000'000                        | 2'028'000.00 | 0.33                                  |
| 1.250 EMISSIONSZENTRALE EGW S. 43 1.25%/12-15.06.2027                    | CHF     | 3'000'000                        |           |              | 3'000'000                        | 3'006'000.00 | 0.49                                  |
| 0.500 EMMI FINANZ AG 0.5%/17-21.06.2029                                  | CHF     | 3'000'000                        |           |              | 3'000'000                        | 2'860'500.00 | 0.46                                  |
| 1.625 EMMI FINANZ AG 1.625%/13-12.07.2023                                | CHF     | 3'000'000                        |           | 3'000'000    |                                  |              |                                       |
| 3.000 EUROFIMA BASEL 3%/06-15.05.2026                                    | CHF     | 4'800'000                        |           |              | 4'800'000                        | 4'987'200.00 | 0.81                                  |
| 1.625 EUROPEAN INVESTMENT BANK 1.625%/14-04.02.2025                      | CHF     | 1'000'000                        |           |              | 1'000'000                        | 1'001'300.00 | 0.16                                  |
| 0.068 FIRST ABU DHABI BANK P.J.S.C.                                      | CHF     | 2'000'000                        |           |              | 2'000'000                        | 1'891'000.00 | 0.31                                  |
| 0.300 GEBERIT AG 0.3%/15-17.04.2023                                      | CHF     | 2'250'000                        |           | 2'250'000    |                                  |              |                                       |
| 2.300 GEBERIT AG 2.3%/23-27.09.2032                                      | CHF     |                                  | 2'120'000 |              | 2'120'000                        | 2'256'740.00 | 0.37                                  |
| - GLARNER KANTONALBANK 0%/20-06.09.2028                                  | CHF     | 3'000'000                        |           |              | 3'000'000                        | 2'803'500.00 | 0.45                                  |
| 0.100 GRAUBUNDNER KANTONALBANK 0.1%/21-07.12.2029                        | CHF     | 4'000'000                        |           |              | 4'000'000                        | 3'684'000.00 | 0.60                                  |
| 0.375 GRAUBUNDNER KANTONALBANK 0.375%/19-28.05.2032                      | CHF     | 5'500'000                        |           |              | 5'500'000                        | 4'994'000.00 | 0.81                                  |
| 0.050 HILTI AG 0.05%/20-02.07.2025                                       | CHF     | 1'500'000                        |           |              | 1'500'000                        | 1'466'250.00 | 0.24                                  |
| 0.200 HILTI AG T. -2024- 0.2%/17-08.11.2024                              | CHF     | 1'800'000                        |           |              | 1'800'000                        | 1'777'320.00 | 0.29                                  |
| 0.125 HYPO VORARLBERG BANK AG 0.125%/19-03.09.2029                       | CHF     | 2'000'000                        |           |              | 2'000'000                        | 1'793'000.00 | 0.29                                  |
| 0.125 HYPO VORARLBERG BANK AG 0.125%/20-27.03.2030                       | CHF     | 2'660'000                        |           |              | 2'660'000                        | 2'347'450.00 | 0.38                                  |



| Titelbezeichnung  | Währung | 31.12.2022<br>Anzahl/<br>Nominal | Käufe (1) | Verkäufe (1) | 31.12.2023<br>Anzahl/<br>Nominal | Kurswert CHF | in % des<br>Gesamtfonds-<br>vermögens |
|---|---------|----------------------------------|-----------|--------------|----------------------------------|--------------|---------------------------------------|
| 0.125 INSELSPITAL-STIFTUNG 0.125%/21-01.01.2500   | CHF     | 1'720'000                        |           |              | 1'720'000                        | 1'599'600.00 | 0.26                                  |
| 0.450 JP MORGAN CHASE (reg. -S-) -144A- 0.45%/16-11.11.2026                               | CHF     | 2'000'000                        |           |              | 2'000'000                        | 1'936'000.00 | 0.31                                  |
| 0.500 JP MORGAN CHASE 0.5%/15-04.12.2023  | CHF     | 2'000'000                        |           | 2'000'000    |                                  |              |                                       |
| - KANTON APPENZELL 0%/19-16.07.2029   | CHF     | 3'000'000                        |           |              | 3'000'000                        | 2'779'500.00 | 0.45                                  |
| 0.125 KANTON BASEL-LANDSCHAFT 0.125%/15-26.02.2026  | CHF     | 2'000'000                        |           |              | 2'000'000                        | 1'953'000.00 | 0.32                                  |
| - KANTON BASEL-STADT 0%/16-04.09.2026   | CHF     | 2'440'000                        |           |              | 2'440'000                        | 2'365'580.00 | 0.38                                  |
| - KANTON BASEL-STADT 0%/16-05.09.2029   | CHF     |                                  | 2'000'000 |              | 2'000'000                        | 1'877'000.00 | 0.30                                  |
| 0.050 KANTON BERN 0.05%/16-18.11.2031   | CHF     | 3'000'000                        |           |              | 3'000'000                        | 2'733'000.00 | 0.44                                  |
| - KANTON GENÈVE 0%/19-26.05.2028  | CHF     | 3'000'000                        |           |              | 3'000'000                        | 2'838'000.00 | 0.46                                  |
| 0.125 KANTON GENÈVE 0.125%/19-28.05.2032  | CHF     | 3'000'000                        |           |              | 3'000'000                        | 2'737'500.00 | 0.44                                  |
| 0.250 KANTON GENÈVE 0.25%/17-29.11.2027   | CHF     | 2'000'000                        |           |              | 2'000'000                        | 1'925'000.00 | 0.31                                  |
| 1.250 KANTON GENÈVE 1.25%/13-22.03.2023   | CHF     | 2'000'000                        |           | 2'000'000    |                                  |              |                                       |
| 1.500 KANTON GENÈVE 1.5%/11-14.10.2024  | CHF     | 2'500'000                        |           |              | 2'500'000                        | 2'497'500.00 | 0.41                                  |
| 2.000 KANTON GENÈVE 2%/13-20.03.2026  | CHF     | 1'500'000                        |           |              | 1'500'000                        | 1'521'750.00 | 0.25                                  |
| - KANTON ZÜRICH 0%/20-23.06.2028  | CHF     | 3'000'000                        |           |              | 3'000'000                        | 2'847'000.00 | 0.46                                  |
| - KANTON ZÜRICH 0%/21-10.11.2033  | CHF     | 3'000'000                        |           |              | 3'000'000                        | 2'659'500.00 | 0.43                                  |
| 1.625 KANTON ZÜRICH 1.625%/13-29.07.2026  | CHF     | 750'000                          |           |              | 750'000                          | 758'250.00   | 0.12                                  |
| 2.500 KFW 2.5%/05-25.08.2025  | CHF     | 2'000'000                        |           |              | 2'000'000                        | 2'038'000.00 | 0.33                                  |
| 0.250 KINDERSPITAL ZÜRICH 0.25%/16-28.07.2028   | CHF     | 1'500'000                        |           |              | 1'500'000                        | 1'423'500.00 | 0.23                                  |
| 0.545 KOMMUNALBANKEN A/S 0.545%/22-28.04.2028   | CHF     | 3'000'000                        |           |              | 3'000'000                        | 2'911'500.00 | 0.47                                  |
| 0.200 LANSFORSÄKRINGAR HYPOTEK 0.2%/18-17.04.2026   | CHF     | 3'000'000                        |           |              | 3'000'000                        | 2'913'000.00 | 0.47                                  |
| 0.375 LGT BANK 0.375%/19-15.11.2029   | CHF     | 3'000'000                        |           |              | 3'000'000                        | 2'731'500.00 | 0.44                                  |
| 0.200 LGT BANK LTD 0.2%/20-04.11.2030   | CHF     | 3'000'000                        |           |              | 3'000'000                        | 2'707'500.00 | 0.44                                  |
| 0.500 LGT BANK LTD 0.5%/17-12.05.2027   | CHF     | 1'000'000                        |           |              | 1'000'000                        | 966'000.00   | 0.16                                  |
| 0.125 LIECHTENSTEIN LANDESBANK 0.125%/19-28.05.2026                                       | CHF     | 1'500'000                        |           |              | 1'500'000                        | 1'453'500.00 | 0.24                                  |
| 0.300 LINDT & SPRUENGLI 0.3%/17-06.10.2027  | CHF     | 2'600'000                        |           |              | 2'600'000                        | 2'490'800.00 | 0.40                                  |
| 1.000 LINDT & SPRUENGLI 1%/14-08.10.2024  | CHF     | 4'000'000                        |           | 2'000'000    | 2'000'000                        | 1'990'200.00 | 0.32                                  |
| 0.250 LUZERNER KANTONALBANK AG 0.25%/22-24.01.2030  | CHF     | 3'000'000                        |           |              | 3'000'000                        | 2'791'500.00 | 0.45                                  |
| 2.125 LUZERNER KANTONALBANK AG 2.125%/23-30.01.2032                                       | CHF     |                                  | 3'000'000 |              | 3'000'000                        | 3'144'000.00 | 0.51                                  |
| 0.625 MACQUARIE BANK 0.625%/15-04.09.2023   | CHF     | 2'500'000                        |           | 2'500'000    |                                  |              |                                       |
| 0.750 MACQUARIE BANK 0.75%/16-05.02.2024  | CHF     | 3'000'000                        |           | 1'000'000    | 2'000'000                        | 1'997'600.00 | 0.32                                  |
| 1.125 MATERIELLSKAPET 1.125%/13-02.05.2023  | CHF     | 1'000'000                        |           | 1'000'000    |                                  |              |                                       |
| 0.125 MET LIFE GLOB FUNDING I 0.125%/19-11.06.2027  | CHF     | 3'000'000                        |           |              | 3'000'000                        | 2'856'000.00 | 0.46                                  |
| 0.250 MUENCHENER HYPOTHEKENBANK EG 0.25%/20-18.09.2028                                    | CHF     | 5'000'000                        |           |              | 5'000'000                        | 4'710'000.00 | 0.76                                  |
| 0.100 MUENCHENER HYPOTHEKENBANK EG 0.1%/20-17.12.2025                                     | CHF     | 5'000'000                        |           | 2'000'000    | 3'000'000                        | 2'899'500.00 | 0.47                                  |
| 0.500 MUENCHENER HYPOTHEKENBANK EG 0.5%/18-14.06.2028                                     | CHF     | 5'000'000                        |           |              | 5'000'000                        | 4'815'000.00 | 0.78                                  |
| 2.375 MUNICIPALITY FINANCE 2.375%/11-30.03.2026   | CHF     | 3'000'000                        |           |              | 3'000'000                        | 3'067'500.00 | 0.50                                  |
| 0.250 NATIONAL AUSTRALIA BANK 0.25%/16-19.01.2023   | CHF     | 2'000'000                        |           | 2'000'000    |                                  |              |                                       |
| 0.065 NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD 0.065%/20-29.01.2029                                    | CHF     | 3'000'000                        |           |              | 3'000'000                        | 2'790'000.00 | 0.45                                  |
| 0.300 NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD 0.3%/17-31.10.2025                                      | CHF     | 3'500'000                        |           | 500'000      | 3'000'000                        | 2'931'000.00 | 0.48                                  |
| 1.715 NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD 1.715%/23-03.02.2033                                    | CHF     |                                  | 2'000'000 |              | 2'000'000                        | 2'041'000.00 | 0.33                                  |
| 0.250 NESTLE HOLDINGS INC 0.25%/17-04.10.2027   | CHF     | 3'500'000                        |           |              | 3'500'000                        | 3'370'500.00 | 0.55                                  |
| 0.350 NEUENBURGER KANTONALBANK 0.35%/18-14.09.2026  | CHF     | 1'970'000                        |           |              | 1'970'000                        | 1'910'900.00 | 0.31                                  |
| 0.500 NEUENBURGER KANTONALBANK 0.5%/17-30.09.2027   | CHF     | 500'000                          |           | 500'000      |                                  |              |                                       |
| 0.125 NORDEA BANK ABP 0.125%/20-02.06.2026  | CHF     | 4'000'000                        |           |              | 4'000'000                        | 3'862'000.00 | 0.63                                  |
| 0.250 NORDEA BANK ABP 0.25%/15-27.11.2023   | CHF     | 3'000'000                        |           | 3'000'000    |                                  |              |                                       |
| 0.200 NORTH AMERICAN DEVELOPMENT BANK 0.2%/20-28.11.2028                                  | CHF     | 3'000'000                        |           |              | 3'000'000                        | 2'823'000.00 | 0.46                                  |
| 0.250 NORTH AMERICAN DEVELOPMENT BANK 0.25%/15-30.04.2025                                 | CHF     | 600'000                          |           | 600'000      |                                  |              |                                       |
| 0.550 NORTH AMERICAN DEVELOPMENT BANK 0.55%/20-27.05.2033                                 | CHF     | 1'230'000                        |           |              | 1'230'000                        | 1'122'990.00 | 0.18                                  |
| 2.625 OEKB 2.625%/06-22.11.2024   | CHF     | 2'000'000                        |           |              | 2'000'000                        | 2'018'200.00 | 0.33                                  |
| 0.150 PARTNERS GROUP HOLDING A 0.15%/17-07.06.2024  | CHF     | 5'000'000                        |           | 5'000'000    |                                  |              |                                       |
| 0.100 PFANDBRIEF SCHW KANTBK S. -535- 0.1%/21-25.05.2032                                  | CHF     |                                  | 3'000'000 |              | 3'000'000                        | 2'686'500.00 | 0.44                                  |
| - PFANDBRIEF SCHWEIZ HYPO S. -695- 0%/20-26.10.2029                                       | CHF     | 4'000'000                        |           |              | 4'000'000                        | 3'696'000.00 | 0.60                                  |
| 0.250 PFANDBRIEFBANK SCHWEIZERISCHER HYPOTHEKARINSTITUTE AG 0.25%/17-12.10.2027           | CHF     | 4'000'000                        |           |              | 4'000'000                        | 3'839'200.00 | 0.62                                  |
| 0.250 PFANDBRIEFBANK SCHWEIZERISCHER HYPOTHEKARINSTITUTE AG 0.25%/17-18.09.2026           | CHF     | 1'500'000                        |           |              | 1'500'000                        | 1'455'600.00 | 0.24                                  |
| 0.625 PFANDBRIEFBANK SCHWEIZERISCHER HYPOTHEKARINSTITUTE AG 603 0.625%/14-19.03.2025      | CHF     | 3'000'000                        |           |              | 3'000'000                        | 2'965'800.00 | 0.48                                  |
| 2.125 PFANDBRIEFBANK SCHWEIZERISCHER HYPOTHEKARINSTITUTE AG S. 514 2.125%/10-28.06.2023   | CHF     | 5'000'000                        |           | 5'000'000    |                                  |              |                                       |
| 1.250 PFANDBRIEFBANK SCHWEIZERISCHER HYPOTHEKARINSTITUTE AG S. 580 1.25%/13-29.09.2023    | CHF     | 3'000'000                        |           | 3'000'000    |                                  |              |                                       |
| 1.500 PFANDBRIEFBANK SCHWEIZERISCHER HYPOTHEKARINSTITUTE AG S. 586 1.5%/13-16.01.2023     | CHF     | 3'000'000                        |           | 3'000'000    |                                  |              |                                       |
| 0.375 PFANDBRIEFBANK SCHWEIZERISCHER HYPOTHEKARINSTITUTE AG S. -618- 0.375%/15-15.10.2025 | CHF     | 5'000'000                        |           |              | 5'000'000                        | 4'904'000.00 | 0.80                                  |
| 0.250 PFANDBRIEFBANK SCHWEIZERISCHER HYPOTHEKARINSTITUTE AG S. -625- 0.25%/16-05.08.2026  | CHF     | 7'000'000                        |           | 1'000'000    | 6'000'000                        | 5'829'600.00 | 0.95                                  |
| - PFANDBRIEFBANK SCHWEIZERISCHER HYPOTHEKARINSTITUTE AG S. -680- 0%/19-30.03.2026         | CHF     | 8'000'000                        |           | 1'000'000    | 7'000'000                        | 6'785'100.00 | 1.10                                  |
| - PFANDBRIEFBANK SCHWEIZERISCHER HYPOTHEKARINSTITUTE AG S. -683- 0%/20-25.02.2028         | CHF     | 3'000'000                        |           |              | 3'000'000                        | 2'837'700.00 | 0.46                                  |

| Titelbezeichnung   | Währung | 31.12.2022<br>Anzahl/<br>Nominal | Käufe (1) | Verkäufe (1) | 31.12.2023<br>Anzahl/<br>Nominal | Kurswert CHF  | in % des<br>Gesamtfonds-<br>vermögens |
|--|---------|----------------------------------|-----------|--------------|----------------------------------|---------------|---------------------------------------|
| 2.250 PFANDBRIEFBANK SCHWEIZERISCHER HYPOTHEKARINSTITUTE AG S. -731- 2.25%/22-25.09.2037     | CHF     | 2'000'000                        |           |              | 2'000'000                        | 2'208'000.00  | 0.36                                  |
| 0.125 PFANDBRIEFBANK SCHWEIZERISCHER HYPOTHEKARINSTITUTE S. - 627- 0.125%/16-06.09.2028      | CHF     | 3'000'000                        |           |              | 3'000'000                        | 2'834'100.00  | 0.46                                  |
| 0.125 PFANDBRIEFBANK SCHWEIZERISCHER HYPOTHEKARINSTITUTE S. - 639- 0.125%/16-23.09.2032      | CHF     | 5'000'000                        |           |              | 5'000'000                        | 4'465'500.00  | 0.72                                  |
| 1.750 PFANDBRIEFZENTRALE DER SCHWEIZERISCHEN KANTONALBANKEN AG S. 413 1.75%/11-02.09.2026    | CHF     | 2'690'000                        |           |              | 2'690'000                        | 2'715'824.00  | 0.44                                  |
| 1.000 PFANDBRIEFZENTRALE DER SCHWEIZERISCHEN KANTONALBANKEN AG S. 459 1%/14-22.09.2028       | CHF     | 10'250'000                       |           |              | 10'250'000                       | 10'082'925.00 | 1.64                                  |
| - PFANDBRIEFZENTRALE DER SCHWEIZERISCHEN KANTONALBANKEN AG S. -472- 0%/15-25.07.2023         | CHF     | 8'000'000                        |           | 8'000'000    |                                  |               |                                       |
| 0.375 PFANDBRIEFZENTRALE DER SCHWEIZERISCHEN KANTONALBANKEN AG S. -489- 0.375%/17-21.09.2027 | CHF     | 1'550'000                        |           |              | 1'550'000                        | 1'495'595.00  | 0.24                                  |
| 0.350 PFANDBRIEFZENTRALE DER SCHWEIZERISCHEN KANTONALBANKEN AG S. -544- 0.35%/22-02.08.2027  | CHF     | 3'000'000                        |           |              | 3'000'000                        | 2'895'600.00  | 0.47                                  |
| 0.650 PFANDBRIEFZENTRALE DER SCHWEIZERISCHEN KANTONALBANKEN AG S. -545- 0.65%/22-03.10.2031  | CHF     | 3'000'000                        |           |              | 3'000'000                        | 2'834'400.00  | 0.46                                  |
| - PFANDBRIEFZENTRALE DER SCHWEIZERISCHEN KANTONALBANKEN AG S. -638- 0%/16-16.05.2023         | CHF     | 1'000'000                        |           | 1'000'000    |                                  |               |                                       |
| 0.375 PFANDBRIEFZENTRALE DER SCHWEIZERISCHER KANTONALBANKEN AG S. -487- 0.375%/16-24.10.2028 | CHF     | 3'000'000                        |           |              | 3'000'000                        | 2'864'400.00  | 0.46                                  |
| 0.375 PROVINCE OF ALBERTA 0.375%/19-07.02.2029   | CHF     | 1'750'000                        |           |              | 1'750'000                        | 1'671'250.00  | 0.27                                  |
| 0.250 PROVINCE OF MANITOBA 0.25%/19-15.03.2029   | CHF     | 3'000'000                        |           |              | 3'000'000                        | 2'823'000.00  | 0.46                                  |
| 0.250 PROVINCE OF NEW BRUNSWICK 0.25%/17-19.01.2029  | CHF     | 3'000'000                        |           |              | 3'000'000                        | 2'841'000.00  | 0.46                                  |
| 0.250 PROVINCE OF ONTARIO 0.25%/17-28.06.2029  | CHF     | 2'000'000                        |           |              | 2'000'000                        | 1'896'000.00  | 0.31                                  |
| 1.500 PROVINCE OF QUEBEC 1.5%/14-05.02.2024  | CHF     | 3'125'000                        |           | 1'000'000    | 2'125'000                        | 2'124'150.00  | 0.34                                  |
| 2.040 PROVINCE OF QUEBEC 2.04%/23-09.05.2033   | CHF     |                                  | 2'000'000 |              | 2'000'000                        | 2'118'000.00  | 0.34                                  |
| - PSP SWISS PROPERTY AG 0%/16-01.09.2023   | CHF     | 3'320'000                        |           | 3'320'000    |                                  |               |                                       |
| - PSP SWISS PROPERTY AG 0%/19-06.02.2030   | CHF     | 3'000'000                        |           |              | 3'000'000                        | 2'707'500.00  | 0.44                                  |
| 0.375 PSP SWISS PROPERTY AG 0.375%/16-29.04.2026   | CHF     | 3'000'000                        |           |              | 3'000'000                        | 2'913'000.00  | 0.47                                  |
| 0.500 PSP SWISS PROPERTY AG 0.5%/16-16.02.2024   | CHF     | 3'200'000                        |           | 700'000      | 2'500'000                        | 2'495'250.00  | 0.40                                  |
| 2.000 PSP SWISS PROPERTY AG 2%/23-01.07.2026   | CHF     |                                  | 3'000'000 |              | 3'000'000                        | 3'028'500.00  | 0.49                                  |
| - RHAETISCHE BAHN TR. -1- 0%/16-01.09.2025   | CHF     | 4'000'000                        |           |              | 4'000'000                        | 3'910'000.00  | 0.63                                  |
| 0.100 ROCHE KAPITALMARKET T. -2- 0.1%/17-23.09.2024  | CHF     | 1'000'000                        |           |              | 1'000'000                        | 989'600.00    | 0.16                                  |
| 0.500 ROCHE KAPITALMARKT AG 0.5%/22-25.02.2027   | CHF     | 3'000'000                        |           |              | 3'000'000                        | 2'929'500.00  | 0.48                                  |
| 0.400 ROYAL BANK OF CANADA TORONTO CORPORATE HEADQUARTERS 0.4%/22-05.10.2027                 | CHF     | 3'000'000                        |           |              | 3'000'000                        | 2'917'500.00  | 0.47                                  |
| 1.450 ROYAL BANK OF CANADA TORONTO CORPORATE HEADQUARTERS 1.45%/22-04.05.2027                | CHF     | 3'000'000                        |           |              | 3'000'000                        | 2'979'000.00  | 0.48                                  |
| 0.250 SCHINDLER HOLDING LTD. 0.25%/18-05.06.2023   | CHF     | 2'000'000                        |           | 2'000'000    |                                  |               |                                       |
| 3.250 SCNF RESEAU 3.25%/06-30.06.2032  | CHF     | 3'095'000                        |           |              | 3'095'000                        | 3'531'395.00  | 0.57                                  |
| 0.250 SGS LTD 0.25%/15-08.05.2023  | CHF     | 3'000'000                        |           | 3'000'000    |                                  |               |                                       |
| 1.750 SGS LTD 1.75%/14-27.02.2024  | CHF     | 2'500'000                        |           |              | 2'500'000                        | 2'500'000.00  | 0.41                                  |
| 2.000 SNCF RESEAU 2%/10-12.11.2026   | CHF     | 1'000'000                        |           |              | 1'000'000                        | 1'016'000.00  | 0.16                                  |
| 1.950 SONOVA HOLDING AG 1.95%/22-12.12.2030  | CHF     | 1'000'000                        |           |              | 1'000'000                        | 1'026'000.00  | 0.17                                  |
| 0.500 SONOVA HOLDING LTD. 0.5%/20-06.10.2025   | CHF     | 1'420'000                        |           |              | 1'420'000                        | 1'393'020.00  | 0.23                                  |
| 0.750 SONOVA HOLDING LTD. 0.75%/20-06.10.2028  | CHF     | 2'880'000                        |           |              | 2'880'000                        | 2'782'080.00  | 0.45                                  |
| 1.050 SONOVA HOLDING LTD. 1.05%/22-19.02.2029  | CHF     | 1'540'000                        |           |              | 1'540'000                        | 1'502'270.00  | 0.24                                  |
| 0.508 SPAREBANK 1 BOLIGKREDITT 0.5075%/22-06.04.2027   | CHF     | 3'000'000                        |           |              | 3'000'000                        | 2'910'000.00  | 0.47                                  |
| 0.125 SPAREBANK 1 NORD NORGE 0.125%/19-11.12.2025  | CHF     | 3'000'000                        |           |              | 3'000'000                        | 2'914'500.00  | 0.47                                  |
| 0.125 SPAREBANK 1 NORD-NORGE 0.125%/21-15.09.2028  | CHF     | 3'400'000                        |           |              | 3'400'000                        | 3'134'800.00  | 0.51                                  |
| 0.350 SPAREBANK 1 SMN 0.35%/16-05.04.2023  | CHF     | 1'000'000                        |           | 1'000'000    |                                  |               |                                       |
| 1.500 SPAREBANK 1 SMN 1.5%/22-15.06.2027   | CHF     | 3'000'000                        |           |              | 3'000'000                        | 2'986'500.00  | 0.48                                  |
| 1.625 STADT GENF 1.625%/13-12.12.2024  | CHF     | 800'000                          |           |              | 800'000                          | 799'600.00    | 0.13                                  |
| 1.500 STADT LAUSANNE 1.5%/13-03.04.2028  | CHF     | 1'000'000                        |           |              | 1'000'000                        | 1'009'500.00  | 0.16                                  |
| 0.150 STADT WINTERTHUR 0.15%/15-27.03.2023   | CHF     | 3'000'000                        |           | 3'000'000    |                                  |               |                                       |
| 0.300 STADT WINTERTHUR 0.3%/15-10.12.2027  | CHF     | 1'500'000                        |           |              | 1'500'000                        | 1'437'000.00  | 0.23                                  |
| - STADT ZUERICH 0%/21-25.11.2030   | CHF     | 1'665'000                        |           |              | 1'665'000                        | 1'532'632.50  | 0.25                                  |
| 1.375 STATD LAUSANNE 1.375%/13-27.11.2023  | CHF     | 2'000'000                        |           | 2'000'000    |                                  |               |                                       |
| 1.250 SVENSKA HANDELSBANKEN AB 1.25%/22-24.05.2027   | CHF     | 3'000'000                        |           |              | 3'000'000                        | 2'973'000.00  | 0.48                                  |
| 1.250 SWEDISH EXPORT CREDIT 1.25%/13-17.07.2023  | CHF     | 2'000'000                        |           | 2'000'000    |                                  |               |                                       |
| 1.250 SWISS CONFEDERATION 1.25%/12-11.06.2024  | CHF     | 2'000'000                        |           | 1'000'000    | 1'000'000                        | 998'900.00    | 0.16                                  |
| 1.250 SWISS CONFEDERATION 1.25%/12-27.06.2037  | CHF     |                                  | 3'000'000 |              | 3'000'000                        | 3'220'800.00  | 0.52                                  |
| 1.500 SWISS CONFEDERATION 1.5%/13-24.07.2025   | CHF     | 4'000'000                        |           |              | 4'000'000                        | 4'024'000.00  | 0.65                                  |
| 4.000 SWISS CONFEDERATION 4%/98-11.02.2023   | CHF     | 5'000'000                        |           | 5'000'000    |                                  |               |                                       |
| - SWISS LIFE HOLDING AG 0%/19-06.06.2025   | CHF     | 2'540'000                        |           |              | 2'540'000                        | 2'486'660.00  | 0.40                                  |
| 0.350 SWISS LIFE HOLDING AG 0.35%/19-06.03.2029  | CHF     | 2'360'000                        |           |              | 2'360'000                        | 2'225'480.00  | 0.36                                  |
| 2.610 SWISS LIFE HOLDING LTD 2.61%/23-26.01.2032   | CHF     |                                  | 3'000'000 |              | 3'000'000                        | 3'207'000.00  | 0.52                                  |
| 0.130 SWISSCOM AG 0.13%/20-18.09.2031  | CHF     | 3'000'000                        |           |              | 3'000'000                        | 2'722'500.00  | 0.44                                  |
| 0.245 SWISSCOM AG 0.245%/20-20.11.2034   | CHF     |                                  | 2'000'000 |              | 2'000'000                        | 1'756'000.00  | 0.28                                  |
| 0.250 SWISSCOM LTD 0.25%/15-17.04.2023   | CHF     | 4'000'000                        |           | 4'000'000    |                                  |               |                                       |
| 1.500 SWISSCOM LTD 1.5%/14-14.07.2026  | CHF     | 3'500'000                        |           |              | 3'500'000                        | 3'514'000.00  | 0.57                                  |

| Titelbezeichnung  | Währung | 31.12.2022<br>Anzahl/<br>Nominal | Käufe (1) | Verkäufe (1) | 31.12.2023<br>Anzahl/<br>Nominal | Kurswert CHF          | in % des<br>Gesamtfonds-<br>vermögens |
|---|---------|----------------------------------|-----------|--------------|----------------------------------|-----------------------|---------------------------------------|
| 1.625 SWISSGRID 1.625%/13-30.01.2025                          | CHF     | 1'000'000                        |           |              | 1'000'000                        | 998'500.00            | 0.16                                  |
| 1.500 SWITZERLAND 1.5%/22-26.10.2038                          | CHF     |                                  | 3'000'000 |              | 3'000'000                        | 3'347'100.00          | 0.54                                  |
| 0.050 TESSINER STAATSBANK 0.05%/19-10.07.2029                 | CHF     | 1'000'000                        |           |              | 1'000'000                        | 916'000.00            | 0.15                                  |
| 0.450 TESSINER STAATSBANK 0.45%/19-26.02.2029                 | CHF     | 2'500'000                        |           |              | 2'500'000                        | 2'366'250.00          | 0.38                                  |
| 0.375 THURGAUER KANTONALBANK 0.375%/15-31.03.2025             | CHF     | 3'000'000                        |           | 1'000'000    | 2'000'000                        | 1'970'000.00          | 0.32                                  |
| 1.000 TOTAL CAPITAL INTERNATIONAL SA 1%/14-29.08.2024         | CHF     | 1'450'000                        |           | 1'450'000    |                                  |                       |                                       |
| 0.200 WALLISER KANTONALBANK (reg. -S-) 0.2%/16-19.08.2024     | CHF     | 1'600'000                        |           |              | 1'600'000                        | 1'582'880.00          | 0.26                                  |
| - WALLISER KANTONALBANK 0%/20-14.02.2029                      | CHF     | 2'000'000                        |           |              | 2'000'000                        | 1'855'000.00          | 0.30                                  |
| 0.200 WALLISER KANTONALBANK 0.2%/17-020226 0.2%/17-02.02.2026 | CHF     | 1'500'000                        |           |              | 1'500'000                        | 1'456'500.00          | 0.24                                  |
| 0.250 WALLISER KANTONALBANK 0.25%/15-16.03.2023               | CHF     | 3'000'000                        |           | 3'000'000    |                                  |                       |                                       |
| 0.300 WALLISER KANTONALBANK 0.3%/22-07.02.2030                | CHF     | 2'000'000                        |           |              | 2'000'000                        | 1'853'000.00          | 0.30                                  |
| 0.400 WESTPAC BANKING CORP 0.40%/15-09.06.2023                | CHF     | 1'000'000                        |           | 1'000'000    |                                  |                       |                                       |
| 0.250 ZUERCHER KANTONALBANK 0.25%/18-08.05.2025               | CHF     | 3'000'000                        |           |              | 3'000'000                        | 2'947'500.00          | 0.48                                  |
| 2.000 ZUERCHER KANTONALBANK S. 114 2%/10-08.09.2025           | CHF     | 800'000                          |           |              | 800'000                          | 806'400.00            | 0.13                                  |
| 2.375 ZUERCHER KANTONALBANK S. 119 2.375%/11-29.03.2023       | CHF     | 2'300'000                        |           | 2'300'000    |                                  |                       |                                       |
| 0.125 ZUERCHER KANTONALBANK S. -145- 0.125%/19-06.06.2029     | CHF     | 3'000'000                        |           |              | 3'000'000                        | 2'793'000.00          | 0.45                                  |
| 0.100 ZUGER KANTONALBANK 0.1%/20-14.10.2031                   | CHF     | 2'600'000                        |           |              | 2'600'000                        | 2'330'900.00          | 0.38                                  |
| 0.100 ZURICH INSURANCE COMPANY LTD 0.1%/20-27.08.2032         | CHF     | 3'000'000                        |           |              | 3'000'000                        | 2'640'000.00          | 0.43                                  |
| 0.750 ZURICH INSURANCE COMPANY LTD 0.75%/19-22.10.2027        | CHF     | 3'000'000                        |           |              | 3'000'000                        | 2'940'000.00          | 0.48                                  |
|   |         |                                  |           |              |                                  | <b>475'637'259.00</b> | <b>77.19</b>                          |

**Total Anleihen** **475'637'259.00** **77.19**

**Total Börsennotierte / an einem geregelten Markt gehandelte Wertpapiere; bewertet zu den Kursen, die am Hauptmarkt bezahlt werden** **607'257'026.95** **98.54**

Wertpapiere bewertet aufgrund von am Markt beobachtbaren Parametern

Anleihen

**SCHWEIZER FRANKEN**

|   |     |           |  |           |  |             |             |
|---|-----|-----------|--|-----------|--|-------------|-------------|
| 1.625 REGIO EMMENTAL 1.625%/14-17.04.2023 | CHF | 4'500'000 |  | 4'500'000 |  |             |             |
|   |     |           |  |           |  | <b>0.00</b> | <b>0.00</b> |

**Total Anleihen** **0.00** **0.00**

**Total Wertpapiere bewertet aufgrund von am Markt beobachtbaren Parametern** **0.00** **0.00**

**Total Anlagen** **607'257'026.95** **98.54**

|                                  |  |  |  |  |  |                       |               |
|----------------------------------|--|--|--|--|--|-----------------------|---------------|
| Bankguthaben auf Sicht           |  |  |  |  |  | 6'529'825.45          | 1.06          |
| Bankguthaben auf Zeit            |  |  |  |  |  | 0.00                  | 0.00          |
| Sonstige Vermögenswerte          |  |  |  |  |  | 2'437'018.35          | 0.40          |
| <b>Gesamtfondsvermögen (GFV)</b> |  |  |  |  |  | <b>616'223'870.75</b> | <b>100.00</b> |
| ./. Bankverbindlichkeiten        |  |  |  |  |  | 0.00                  | 0.00          |
| ./. Andere Verbindlichkeiten     |  |  |  |  |  | 370'876.86            | 0.06          |
| ./. Andere Kredite               |  |  |  |  |  | 0.00                  | 0.00          |
| <b>Nettofondsvermögen</b>        |  |  |  |  |  | <b>615'852'993.89</b> | <b>99.94</b>  |

(1) Umfassen auch Corporate Actions

**Summarische Gliederung des Portefeuilles gemäss KKV FINMA Art. 84 Absatz 2**

| Anlagekategorien   | Kurswert CHF          | in % des<br>Gesamtfonds-<br>vermögens |
|--|-----------------------|---------------------------------------|
| <b>Börsennotierte / an einem geregelten Markt gehandelte Wertpapiere; bewertet zu den Kursen, die am Hauptmarkt bezahlt werden</b> | <b>607'257'026.95</b> | <b>98.54</b>                          |
| <b>Wertpapiere bewertet aufgrund von am Markt beobachtbaren Parametern</b>   | <b>0.00</b>           | <b>0.00</b>                           |
| <b>Wertpapiere bewertet aufgrund geeigneten Bewertungsmodellen unter Berücksichtigung der aktuellen Marktgegebenheiten</b>         | <b>0.00</b>           | <b>0.00</b>                           |

## Erläuterungen zum Jahresbericht per 31. Dezember 2023

### Erläuterung 1: Angaben über Angelegenheiten von besonderer wirtschaftlicher oder rechtlicher Bedeutung

Am 19. März 2023 haben die Credit Suisse Group AG und die UBS Group AG eine Vereinbarung zum Zusammenschluss unterzeichnet, welche per 12. Juni 2023 vollzogen wurde. Der Fonds bezieht verschiedene Dienstleistungen und unterhält Bankbeziehungen mit konsolidierten Tochtergesellschaften der Credit Suisse Group AG bzw. der UBS Group AG. Es ist geplant, dass die Credit Suisse Funds AG im 2. Quartal 2024 in die UBS Fund Management AG fusioniert wird. Zu diesem geplanten Zeitpunkt wird die UBS Fund Management AG die Fondsleitungsfunktion übernehmen. Folglich können Beziehungen und Dienstleister in Zukunft ändern.

### Erläuterung 2: Verkaufsrestriktionen USA

Anteile dieser kollektiven Kapitalanlage dürfen innerhalb der USA und ihren Territorien weder angeboten, verkauft noch ausgeliefert werden. Anteile dieser kollektiven Kapitalanlage dürfen Bürgern der USA oder Personen mit Wohnsitz oder Sitz in den USA und/oder anderen natürlichen wie juristischen Personen, deren Einkommen und/oder Erträge, ungeachtet der Herkunft, der US-Einkommenssteuer unterliegen, sowie Personen, die gemäss Bestimmung S des US Securities Act von 1933 und/oder dem US Commodity Exchange Act in der jeweils gültigen Fassung als US-Personen gelten, weder angeboten, verkauft noch ausgeliefert werden.

### Erläuterung 3: Kennzahlen und technische Daten

| Fondsname   | Anteilklasse | Valor       | Währung | Depotbankkommission | Verwaltungs- <sup>1</sup> kommission | Total Expense Ratio (TER) <sup>2</sup> |
|---|--------------|-------------|---------|---------------------|--------------------------------------|--|
| Credit Suisse (CH) Interest & Dividend Focus Yield CHF    | A            | 2 087 602   | CHF     | 0.04%               | 1.32%                                | 1.56% <sup>3</sup>                     |
|   | AH EUR       | 43 431 872  | EUR     | 0.04%               | 1.40%                                | 1.64% <sup>3</sup>                     |
|   | B            | 19 955 023  | CHF     | 0.04%               | 1.32%                                | 1.56% <sup>3</sup>                     |
|   | BH EUR       | 43 431 873  | EUR     | 0.04%               | 1.40%                                | 1.64% <sup>3</sup>                     |
|   | IA           | 27 360 265  | CHF     | 0.04%               | 0.64%                                | 0.87% <sup>3</sup>                     |
|   | UA           | 26 530 928  | CHF     | 0.04%               | 1.07%                                | 1.31% <sup>3</sup>                     |
|   | UAH EUR      | 43 431 874  | EUR     | 0.04%               | 1.16%                                | 1.39% <sup>3</sup>                     |
|   | UB           | 26 530 957  | CHF     | 0.04%               | 1.07%                                | 1.31% <sup>3</sup>                     |
| Credit Suisse (CH) Interest & Dividend Focus Balanced CHF | UBH EUR      | 43 431 875  | EUR     | 0.04%               | 1.15%                                | 1.39% <sup>3</sup>                     |
|   | A            | 2 087 605   | CHF     | 0.04%               | 1.52%                                | 1.73% <sup>3</sup>                     |
|   | AH EUR       | 43 431 884  | EUR     | 0.04%               | 1.61%                                | 1.81% <sup>3</sup>                     |
|   | B            | 19 955 038  | CHF     | 0.04%               | 1.52%                                | 1.73% <sup>3</sup>                     |
|   | BH EUR       | 43 431 885  | EUR     | 0.04%               | 1.60%                                | 1.81% <sup>3</sup>                     |
|   | UA           | 26 530 752  | CHF     | 0.04%               | 1.27%                                | 1.48% <sup>3</sup>                     |
|   | UAH EUR      | 43 431 886  | EUR     | 0.04%               | 1.35%                                | 1.56% <sup>3</sup>                     |
|   | UB           | 26 530 769  | CHF     | 0.04%               | 1.27%                                | 1.48% <sup>3</sup>                     |
| Credit Suisse (CH) Interest & Dividend Focus Growth CHF   | UBH EUR      | 43 431 887  | EUR     | 0.04%               | 1.35%                                | 1.56% <sup>3</sup>                     |
|   | A            | 2 087 611   | CHF     | 0.04%               | 1.72%                                | 1.92% <sup>3</sup>                     |
|   | AH EUR       | 43 431 889  | EUR     | 0.04%               | 1.80%                                | 2.00% <sup>3</sup>                     |
|   | B            | 19 955 053  | CHF     | 0.04%               | 1.72%                                | 1.92% <sup>3</sup>                     |
|   | BH EUR       | 43 431 890  | EUR     | 0.04%               | 1.80%                                | 2.00% <sup>3</sup>                     |
|   | IA           | 27 375 461  | CHF     | 0.04%               | 0.62%                                | 0.82% <sup>3</sup>                     |
|   | UA           | 26 530 793  | CHF     | 0.04%               | 1.42%                                | 1.62% <sup>3</sup>                     |
|   | UAH EUR      | 43 431 891  | EUR     | 0.04%               | 1.50%                                | 1.70% <sup>3</sup>                     |
| Credit Suisse (CH) Privilege 35 CHF                       | UB           | 26 530 796  | CHF     | 0.04%               | 1.42%                                | 1.62% <sup>3</sup>                     |
|   | UBH EUR      | 43 431 892  | EUR     | 0.04%               | 1.50%                                | 1.70% <sup>3</sup>                     |
|   | B            | 38 714 599  | CHF     | 0.04%               | 1.12%                                | 1.28% <sup>3</sup>                     |
|   | UA           | 38 714 600  | CHF     | 0.04%               | 0.92%                                | 1.08% <sup>3</sup>                     |
|   | UB           | 38 714 601  | CHF     | 0.04%               | 0.92%                                | 1.08% <sup>3</sup>                     |
|   | IA25         | 116 503 644 | CHF     | 0.04%               | 0.27%                                | 0.43% <sup>3</sup>                     |
| Credit Suisse (CH) Privilege 45 CHF                       | EB           | 38 714 605  | CHF     | 0.04%               | 0.57%                                | 0.73% <sup>3</sup>                     |
|   | A            | 1 021 110   | CHF     | 0.04%               | 1.22%                                | 1.37% <sup>3</sup>                     |
|   | B            | 24 665 730  | CHF     | 0.04%               | 1.22%                                | 1.37% <sup>3</sup>                     |
|   | IA           | 14 954 548  | CHF     | 0.04%               | 0.62%                                | 0.77% <sup>3</sup>                     |
|   | UA           | 26 530 247  | CHF     | 0.04%               | 1.02%                                | 1.17% <sup>3</sup>                     |
|   | UB           | 26 530 564  | CHF     | 0.04%               | 1.02%                                | 1.17% <sup>3</sup>                     |
| Credit Suisse (CH) Privilege 75 CHF                       | IA25         | 48 232 427  | CHF     | 0.04%               | 0.32%                                | 0.47% <sup>3</sup>                     |
|   | EA           | 48 232 425  | CHF     | 0.04%               | 0.62%                                | 0.77% <sup>3</sup>                     |
|   | A            | 55 294 084  | CHF     | 0.04%               | 1.42%                                | 1.61% <sup>3</sup>                     |
|   | B            | 55 294 085  | CHF     | 0.04%               | 1.42%                                | 1.61% <sup>3</sup>                     |
|   | UA           | 55 294 090  | CHF     | 0.04%               | 1.12%                                | 1.31% <sup>3</sup>                     |
|   | UB           | 55 294 091  | CHF     | 0.04%               | 1.12%                                | 1.31% <sup>3</sup>                     |
| Credit Suisse (CH) Privilege 75 CHF                       | EB           | 55 294 087  | CHF     | 0.04%               | 0.62%                                | 0.81% <sup>3</sup>                     |

| Fondsname                           | Anteilklasse | Valor      | Wahrung | Depotbank-kommission | Verwaltungs- <sup>1</sup> kommission | Total Expense Ratio (TER) <sup>2</sup> |
|-------------------------------------|--------------|------------|----------|----------------------|--------------------------------------|--|
| Credit Suisse (CH) Privilege 20 CHF | A            | 277 301    | CHF      | 0.04%                | 1.07%                                | 1.12%                                  |
|                                     | B            | 26 337 013 | CHF      | 0.04%                | 1.07%                                | 1.12%                                  |
|                                     | IA           | 49 129 578 | CHF      | 0.04%                | 0.57%                                | 0.62%                                  |
|                                     | UA           | 26 738 505 | CHF      | 0.04%                | 0.62%                                | 0.67%                                  |
|                                     | UB           | 27 201 443 | CHF      | 0.04%                | 0.62%                                | 0.67%                                  |
|                                     | EB           | 24 900 157 | CHF      | 0.04%                | 0.57%                                | 0.62%                                  |

<sup>1</sup> Die Fondsleitung hat keine Gebuhrenteilungsvereinbarungen oder Vereinbarungen betreffend Retrozessionen in Form von sogenannten «soft commissions» geschlossen.

<sup>2</sup> Die TER (Total Expense Ratio) bezeichnet die Summe aller periodisch erhobenen Kosten und Kommissionen, die dem Fondsvermogen belastet werden, und zwar ruckwirkend als Prozentsatz des durchschnittlichen Fondsvermogens. Allfallige Ruckvergutungen/Bestandespflegekommissionen von Zielfonds wurden dem Fonds gutgeschrieben und reduzieren somit die TER. Die maximale Verwaltungskommission der Zielfonds betragt 3%.

<sup>3</sup> Zusammengesetzte TER, da mehr als 10% des Nettovermogens in andere kollektive Kapitalanlagen (Zielfonds) per Stichtag investiert war. Die TER der Zielfonds konnen auch von KIID's, etc. stammen.

#### Erluterung 4: Fondsperformance

| Fondsname   | Anteilklasse | Valor       | Lancierungs-datum | Wahrung | kum. Seit Lancierung | 2023 <sup>1</sup> | 2022 <sup>1</sup> | 2021 <sup>1</sup> |
|---|--------------|-------------|-------------------|----------|----------------------|-------------------|-------------------|-------------------|
| Credit Suisse (CH) Interest & Dividend Focus Yield CHF    | A            | 2 087 602   | 02.05.2005        | CHF      | -                    | 2.4%              | -10.4%            | 5.3%              |
|   | AH EUR       | 43 431 872  | 01.01.2019        | EUR      | -                    | 4.4%              | -10.1%            | 5.4%              |
|   | B            | 19 955 023  | 03.12.2012        | CHF      | -                    | 2.4%              | -10.4%            | 5.3%              |
|   | BH EUR       | 43 431 873  | 01.01.2019        | EUR      | -                    | 4.4%              | -10.1%            | 5.4%              |
|   | UA           | 26 530 928  | 30.01.2015        | CHF      | -                    | 2.6%              | -10.1%            | 5.6%              |
|   | UAH EUR      | 43 431 874  | 01.01.2019        | EUR      | -                    | 4.6%              | -9.8%             | 5.7%              |
|   | UB           | 26 530 957  | 30.01.2015        | CHF      | -                    | 2.6%              | -10.1%            | 5.6%              |
|   | UBH EUR      | 43 431 875  | 01.01.2019        | EUR      | -                    | 4.6%              | -9.9%             | 5.7%              |
| Credit Suisse (CH) Interest & Dividend Focus Balanced CHF | A            | 2 087 605   | 02.05.2005        | CHF      | -                    | 2.5%              | -10.7%            | 10.0%             |
|   | AH EUR       | 43 431 884  | 01.01.2019        | EUR      | -                    | 4.5%              | -10.6%            | 10.1%             |
|   | B            | 19 955 038  | 03.12.2012        | CHF      | -                    | 2.5%              | -10.7%            | 10.0%             |
|   | BH EUR       | 43 431 885  | 01.01.2019        | EUR      | -                    | 4.5%              | -10.6%            | 10.1%             |
|   | UA           | 26 530 752  | 30.01.2015        | CHF      | -                    | 2.8%              | -10.5%            | 10.2%             |
|   | UAH EUR      | 43 431 886  | 01.01.2019        | EUR      | -                    | 4.8%              | -10.3%            | 10.4%             |
|   | UB           | 26 530 769  | 30.01.2015        | CHF      | -                    | 2.8%              | -10.5%            | 10.2%             |
|   | UBH EUR      | 43 431 887  | 01.01.2019        | EUR      | -                    | 4.8%              | -10.4%            | 10.4%             |
| Credit Suisse (CH) Interest & Dividend Focus Growth CHF   | A            | 2 087 611   | 02.05.2005        | CHF      | -                    | 2.1%              | -10.7%            | 13.8%             |
|   | AH EUR       | 43 431 889  | 01.01.2019        | EUR      | -                    | 4.0%              | -10.6%            | 13.9%             |
|   | B            | 19 955 053  | 03.12.2012        | CHF      | -                    | 2.1%              | -10.7%            | 13.9%             |
|   | BH EUR       | 43 431 890  | 01.01.2019        | EUR      | -                    | 4.0%              | -10.7%            | 13.9%             |
|   | IA           | 27 375 461  | 13.02.2015        | CHF      | -                    | 3.3%              | -9.7%             | 15.1%             |
|   | UA           | 26 530 793  | 30.01.2015        | CHF      | -                    | 2.4%              | -10.4%            | 14.2%             |
|   | UAH EUR      | 43 431 891  | 01.01.2019        | EUR      | -                    | 4.4%              | -10.4%            | 14.3%             |
|   | UB           | 26 530 796  | 30.01.2015        | CHF      | -                    | 2.5%              | -10.4%            | 14.2%             |
| Credit Suisse (CH) Privilege 35 CHF                       | UBH EUR      | 43 431 892  | 01.01.2019        | EUR      | -                    | 4.4%              | -10.4%            | 14.3%             |
|   | B            | 38 714 599  | 13.12.2017        | CHF      | -                    | 4.2%              | -12.1%            | 6.5%              |
|   | UA           | 38 714 600  | 13.12.2017        | CHF      | -                    | 4.4%              | -11.9%            | 6.8%              |
|   | UB           | 38 714 601  | 13.12.2017        | CHF      | -                    | 4.4%              | -11.9%            | 6.8%              |
|   | IA25         | 116 503 644 | 08.03.2022        | CHF      | -0.6%                | 5.0%              | -                 | -                 |
| Credit Suisse (CH) Privilege 45 CHF                       | EB           | 38 714 605  | 21.01.2020        | CHF      | -                    | 4.7%              | -11.6%            | 7.1%              |
|   | A            | 1 021 110   | 29.11.1999        | CHF      | -                    | 4.6%              | -13.2%            | 8.6%              |
|   | B            | 24 665 730  | 27.06.2014        | CHF      | -                    | 4.6%              | -13.2%            | 8.6%              |
|   | IA           | 14 954 548  | 11.02.2014        | CHF      | -                    | 5.3%              | -12.7%            | 9.3%              |
|   | UA           | 26 530 247  | 30.01.2015        | CHF      | -                    | 4.8%              | -13.0%            | 8.8%              |
|   | UB           | 26 530 564  | 30.01.2015        | CHF      | -                    | 4.8%              | -13.0%            | 8.8%              |
|   | IA25         | 48 232 427  | 01.11.2019        | CHF      | -                    | 5.6%              | -12.4%            | 9.6%              |
| Credit Suisse (CH) Privilege 75 CHF                       | EA           | 48 232 425  | 01.11.2019        | CHF      | -                    | 5.3%              | -12.7%            | 9.3%              |
|   | A            | 55 294 084  | 07.09.2020        | CHF      | -                    | 5.9%              | -16.1%            | 16.0%             |
|   | B            | 55 294 085  | 07.09.2020        | CHF      | -                    | 5.9%              | -16.1%            | 16.0%             |
|   | UA           | 55 294 090  | 07.09.2020        | CHF      | -                    | 6.2%              | -15.9%            | 16.3%             |
|   | UB           | 55 294 091  | 07.09.2020        | CHF      | -                    | 6.2%              | -15.9%            | 16.3%             |
| Credit Suisse (CH) Privilege 20 CHF                       | EB           | 55 294 087  | 24.06.2021        | CHF      | -5.8%                | 6.7%              | -15.4%            | -                 |
|   | A            | 277 301     | 15.07.1986        | CHF      | -                    | 3.9%              | -10.4%            | 2.8%              |
|   | B            | 26 337 013  | 29.12.2014        | CHF      | -                    | 3.9%              | -10.4%            | 2.8%              |
|   | IA           | 49 129 578  | 29.07.2019        | CHF      | -                    | 4.4%              | -9.9%             | 3.2%              |
|   | UA           | 26 738 505  | 30.01.2015        | CHF      | -                    | 4.4%              | -10.0%            | 3.2%              |
|   | UB           | 27 201 443  | 27.02.2015        | CHF      | -                    | 4.4%              | -10.0%            | 3.2%              |
| EB  | 24 900 157   | 18.07.2014  | CHF               | -        | 4.4%                 | -10.0%            | 3.3%              |                   |

<sup>1</sup> Die Fondsperformance basiert auf offiziellen publizierten Nettoinventarwerten, die auf den Borsenschlusskursen des jeweiligen Monatsendes basieren.

Die historische Performance stellt keinen Indikator fur die laufende oder zukunftige Performance dar. Die Performancedaten lassen die bei der Ausgabe und Rucknahme der Anteile erhobenen Kommissionen und Kosten unberucksichtigt.

**Erläuterung 5: Identität der Vertragspartner bei OTC-Geschäften**

| Fondsname   | Vertragspartner   |
|---|---|
| Credit Suisse (CH) Interest & Dividend Focus Yield CHF    | BNP-PARIBAS SA PARIS<br>CITIBANK N.A. LONDON<br>CREDIT SUISSE (SCHWEIZ) AG<br>JP MORGAN SECURITIES PLC LONDON<br>UBS AG LONDON BRANCH |
| Credit Suisse (CH) Interest & Dividend Focus Balanced CHF | BNP-PARIBAS SA PARIS<br>CITIBANK N.A. LONDON<br>CREDIT SUISSE (SCHWEIZ) AG<br>JP MORGAN SECURITIES PLC LONDON<br>UBS AG LONDON BRANCH |
| Credit Suisse (CH) Interest & Dividend Focus Growth CHF   | BNP-PARIBAS SA PARIS<br>CITIBANK N.A. LONDON<br>CREDIT SUISSE (SCHWEIZ) AG<br>JP MORGAN SECURITIES PLC LONDON<br>UBS AG LONDON BRANCH |
| Credit Suisse (CH) Privilege 35 CHF                       | CREDIT SUISSE (SCHWEIZ) AG  |
| Credit Suisse (CH) Privilege 45 CHF                       | CREDIT SUISSE (SCHWEIZ) AG  |
| Credit Suisse (CH) Privilege 75 CHF                       | CREDIT SUISSE (SCHWEIZ) AG  |

**Erläuterung 6: Entgegengenommene Sicherheiten**

| Fondsname   | Sicherheit                                 | Wert in Fondswährung |
|---|--|----------------------|
| Credit Suisse (CH) Interest & Dividend Focus Yield CHF    | Collaterals Sec Lending - Equities         | 4'879'141.56         |
|   | Collaterals Sec Lending - Fixed Rate Bonds | 6'887'269.94         |
| Credit Suisse (CH) Interest & Dividend Focus Balanced CHF | Collaterals Sec Lending - Equities         | 8'462'236.10         |
|   | Collaterals Sec Lending - Fixed Rate Bonds | 15'437'713.06        |
| Credit Suisse (CH) Interest & Dividend Focus Growth CHF   | Collaterals Sec Lending - Equities         | 2'963'174.65         |
|   | Collaterals Sec Lending - Fixed Rate Bonds | 5'405'739.04         |
| Credit Suisse (CH) Privilege 35 CHF                       | Collaterals Sec Lending - Equities         | 3'058'205.49         |
|   | Collaterals Sec Lending - Fixed Rate Bonds | 5'086'010.60         |
| Credit Suisse (CH) Privilege 45 CHF                       | Collaterals Sec Lending - Equities         | 10'779'222.00        |
|   | Collaterals Sec Lending - Fixed Rate Bonds | 17'926'603.54        |

**Erläuterung 7: Direkte und indirekte operationelle Kosten und Gebühren aus Effektenleihen**

Principle Borrower Setup mit der Credit Suisse (Schweiz) AG als Borgerin und der Credit Suisse Funds AG, handelnd für die Teilvermögen welche Erträge aus Effektenleihe erwirtschaften, als Verleiherin. Die bis zum 30. April 2023 erwirtschafteten Erträge aus Wertschriftenleihe sind zu 60% dem Fonds gutgeschrieben. Die ab dem 1. Mai 2023 erwirtschafteten Erträge aus Wertschriftenleihe werden zu mindestens 80% dem Fonds gutgeschrieben.

**Erläuterung 8: Zusammensetzung des Portefeuilles**

Die Zusammensetzung des Portefeuilles weist Bestandesveränderungen ohne Fraktionen aus. Dies kann zu Rundungsdifferenzen in der Totalisierung führen.

**Erläuterung 9: Ausweis Ausserbilanzgeschäfte (Commitment-Ansatz I)**

Bei einem Währungsderivat muss jeweils nur der Netto-Verkauf gedeckt sein, deshalb wird im Ausweis der Ausserbilanzgeschäfte auch nur die Verkaufsseite (netto) als engagementreduzierende Derivate gezeigt.

**Erläuterung 10: Ausweis der Ausserbilanzgeschäfte für Brutto/Netto Darstellung (Commitment-Ansatz II)**

Es wird auf eine Verrechnung gegenläufiger Derivat-Positionen verzichtet. Somit entspricht das Netto-Gesamtengagement aus Derivaten dem Wert des Brutto-Gesamtengagements.

**Erläuterung 11: Unterjährig lancierte Teilvermögen oder Anteilklassen – Darstellung von Vergleichsangaben**

Angaben der Vermögens- und Erfolgsrechnung von Teilvermögen oder Anteilklassen, welche während der laufenden Berichtsperiode lanciert wurden, werden in der Vorperiode mit Nullwerten ausgewiesen.

Die folgenden Anteilklassen wurden aktiviert bzw. aufgrund von Rücknahmen des gesamten Umlaufbestandes deaktiviert.

| Fondsname  | Anteilklass | Valor       | Lancierungsdatum | Schlussdatum |
|--|-------------|-------------|------------------|--------------|
| Credit Suisse (CH) Interest & Dividend Focus Yield CHF | IA          | 27 360 265  |                  | 10.02.2023   |
| Credit Suisse (CH) Privilege 35 CHF                    | IA25        | 116 503 644 | 08.03.2022       |              |

**Erläuterung 12: Letzter Bewertungstag**

Im Dezember fällt der letzte Bewertungstag (29. Dezember 2023) nicht mit dem effektiven Monatsende per 31. Dezember 2023 zusammen. Deshalb wurden die Anlagen des Fonds per 29. Dezember 2023 bewertet und der letzte Nettoinventarwert auf diesen Tag berechnet.

**Erläuterung 13: Bewertung des Fondsvermögens und der Anteile**

1. Der Nettoinventarwert jedes Teilvermögens und der Anteil der einzelnen Klassen (Quoten) wird zum Verkehrswert auf Ende des Rechnungsjahres sowie für jeden Tag, an dem Anteile ausgegeben oder zurückgenommen werden, in der Rechnungseinheit des entsprechenden Teilvermögens berechnet. Für Tage, an welchen die Börsen bzw. Märkte der Hauptanlageländer eines Teilvermögens geschlossen sind (z.B. Banken- und Börsenfeiertage), findet keine Berechnung 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 oder 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. Offene kollektive Kapitalanlagen werden mit ihrem Rücknahmepreis bzw. Nettoinventarwert bewertet. Werden sie regelmässig an einer Börse oder an einem anderen geregelten, dem Publikum offenstehenden Markt gehandelt, so kann die Fondsleitung diese gemäss Ziff. 2 bewerten.
4. Der Wert von Geldmarktinstrumenten, welche nicht an einer Börse oder an einem anderen geregelten, dem Publikum offenstehenden Markt gehandelt werden, wird wie folgt bestimmt: Der Bewertungspreis solcher Anlagen wird, ausgehend vom Nettoerwerbspreis, unter Konstanthaltung der daraus berechneten Anlagerendite, sukzessive dem Rückzahlungspreis angeglichen. Bei wesentlichen Änderungen der Marktbedingungen wird die Bewertungsgrundlage der einzelnen Anlagen der neuen Marktrendite 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.
5. 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.
6. Der Nettoinventarwert eines Anteils einer Klasse eines Teilvermögens ergibt sich aus der der betreffenden Anteilklasse am Verkehrswert des Vermögens dieses Teilvermögens zukommenden Quote, vermindert um allfällige Verbindlichkeiten dieses Teilvermögens, die der betreffenden Anteilklasse zugeteilt sind, dividiert durch die Anzahl der im Umlauf befindlichen Anteile der entsprechenden Klasse. Er wird auf die jeweils kleinste gängige Einheit der Rechnungseinheit gerundet.
7. Falls an einem Bewertungstag die Summe der Zeichnungen und Rücknahmen von Anteilen eines Teilvermögens zu einem Nettovermögenszufluss bzw. -abfluss führt, wird der Nettoinventarwert des jeweiligen Teilvermögens erhöht bzw. reduziert (Swinging Single Pricing). Die maximale Anpassung beläuft sich auf 2% des Nettoinventarwertes. Berücksichtigt werden die Nebenkosten (namentlich marktübliche Courtagen, Kommissionen, Steuern und Abgaben) sowie Kosten für die Überprüfung und Aufrechterhaltung von Qualitätsstandards bei physischen Anlagen, die im Durchschnitt aus der Anlage des einbezahlten Betrages bzw. aus dem Verkauf eines dem gekündigten Anteil entsprechenden Teils der Anlagen durchschnittlich erwachsen. Die Anpassung führt zu einer Erhöhung des Nettoinventarwertes, wenn die Nettobewegung zu einem Anstieg der Anzahl Anteile des Teilvermögens führen. Die Anpassung resultiert in einer Verminderung des Nettoinventarwertes, wenn die Nettobewegung einen Rückgang der Anzahl der Anteile des Teilvermögens bewirkt. Der unter Anwendung des Swinging Single Pricing ermittelte Nettoinventarwert ist somit ein gemäss Satz 1 dieser Ziffer modifizierter Nettoinventarwert.  
Der bei den Zeichnungen bzw. Rücknahmen anfallende Zu- bzw. Abschlag zum Nettoinventarwert erfolgt jeweils pauschal bezogen auf einen Durchschnittswert aus einer im Prospekt definierten Periode.
8. Die Quoten am Verkehrswert des Nettovermögens eines Teilvermögens (Vermögen eines Teilvermögens, abzüglich der Verbindlichkeiten), welche den jeweiligen Anteilklassen zuzurechnen sind, werden erstmals bei der Erstausgabe mehrerer Anteilklassen (wenn diese gleichzeitig erfolgt) oder der Erstausgabe einer weiteren Anteilklasse auf der Basis der dem entsprechenden Teilvermögen für jede Anteilklasse zufließenden Befehle bestimmt. Die Quote wird bei folgenden Ereignissen jeweils neu berechnet:
  - a) bei der Ausgabe und Rücknahme von Anteilen;
  - b) auf den Stichtag von Ausschüttungen beziehungsweise Thesaurierungen, sofern (i) solche Ausschüttungen beziehungsweise Thesaurierungen nur auf einzelnen Anteilklassen (Ausschüttungsklassen beziehungsweise Thesaurierungsklassen) anfallen oder sofern (ii) die Ausschüttungen beziehungsweise Thesaurierungen der verschiedenen Anteilklassen in Prozenten ihres jeweiligen Nettoinventarwertes unterschiedlich ausfallen oder sofern (iii) auf den Ausschüttungen beziehungsweise Thesaurierungen der verschiedenen Anteilklassen in Prozenten der Ausschüttung beziehungsweise der Thesaurierung 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 Anteilklassen, sofern die Verbindlichkeiten der verschiedenen Anteilklassen in Prozenten ihres jeweiligen Nettoinventarwertes unterschiedlich ausfallen, namentlich, wenn (i) für die verschiedenen Anteilklassen unterschiedliche Kommissionssätze zur Anwendung gelangen oder wenn (ii) klassenspezifische Kostenbelastungen erfolgen;
  - d) bei der Inventarwertberechnung im Rahmen der Zuweisung von Erträgen oder Kapitalerträgen an die verschiedenen Anteilklassen, sofern die Erträge oder Kapitalerträge aus Transaktionen anfallen, die nur im Interesse einer Anteilklasse oder im Interesse mehrerer Anteilklassen, nicht jedoch proportional zu deren Quote am Nettovermögen eines Teilvermögens getätigt wurden.

**Erläuterung 14: Änderungen des Fondsvertrags per 1. Februar 2023**

Die Eidgenössische Finanzmarktaufsicht FINMA hat die von der Fondsleitung und der Depotbank beantragten Änderungen des Fondsvertrags mit Verfügung vom 1. Februar 2023 bewilligt. Die Änderungen sind per 3. Februar 2023 in Kraft getreten. Die Publikation auf der elektronischen Plattform „www.swissfunddata.ch“ am 13. Dezember 2022 lautet wie folgt:

Mit Publikation vom 10. März 2023 hatten die Fondsleitung Credit Suisse Funds AG, Zürich, und die Depotbank Credit Suisse (Schweiz) AG, Zürich, die Anleger des CS Fund 1 auf anstehende Fondsvertragsänderungen aufmerksam gemacht. In Ergänzung zur Publikation vom 10. März 2023 wird mittels dieser einmaligen Nachpublikation auf folgende Änderungen aufmerksam gemacht:

**1. Änderung des Prospekts**

Für die nachfolgend genannten Teilvermögen erfolgt eine Änderung des Prospekts (und nicht des Fondsvertrags), wobei das Kapitel §8 Anlageziel und Anlagepolitik, Ziff. 4 des Fondsvertrags für die genannten Teilvermögen unverändert bleibt:

**Credit Suisse (CH) Privilege 35 CHF****Credit Suisse (CH) Privilege 45 CHF****Credit Suisse (CH) Privilege 75 CHF**

Die Ziff. 1.10.1 Anlageziel und der Anlagepolitik der genannten Teilvermögen wird für die drei genannten Teilvermögen präzisiert im Hinblick auf den BVV2 Bezug bei Anlagen in kollektive Kapitalanlagen. Der entsprechende Wortlaut lautet neu wie folgt (Änderung im Abschnitt hervorgehoben):

**Credit Suisse (CH) Privilege 35 CHF**

Mit den folgenden Regeln orientiert sich die Fondsleitung weitgehend an den Vorgaben gemäss Bundesgesetz über die berufliche Alters-, Hinterlassenen- und Invalidenvorsorge (BVG) und dessen Verordnung (BVV2). **Bei kollektiven Kapitalanlagen beurteilt die Fondsleitung deren Vereinbarkeit mit BVG/BVV2 ohne Durchsicht auf die zugrundeliegenden Anlagen auf Basis der Fondsdokumentation der entsprechenden kollektiven Kapitalanlage. Insbesondere qualifizieren unter §8 Anlageziel und Anlagepolitik Ziff. 4 lit. D, Ziff. 2 und Ziff. 3 des Fondsvertrags folgende kollektive Kapitalanlagen: Kollektive Kapitalanlagen, welche unter KAG Commitment-Ansatz I aufgesetzt sind; Indexfonds; andere kollektive Kapitalanlagen, welche in ihrer Anlagepolitik nicht explizit Short Positionen oder einen Hebel vorsehen.** Bei der Umsetzung der Anlagepolitik ist die Fondsleitung jedoch ausschliesslich an die Vorgaben gemäss der Kollektivanlagegesetzgebung gebunden.

**Credit Suisse (CH) Privilege 45 CHF**

Mit den folgenden Regeln orientiert sich die Fondsleitung weitgehend an den Vorgaben gemäss Bundesgesetz über die berufliche Alters-, Hinterlassenen- und Invalidenvorsorge (BVG) und dessen Verordnung (BVV2). Bei kollektiven Kapitalanlagen beurteilt die Fondsleitung deren Vereinbarkeit mit BVG/BVV2 ohne Durchsicht auf die zugrundeliegenden Anlagen auf Basis der Fondsdokumentation der entsprechenden kollektiven Kapitalanlage. Insbesondere qualifizieren unter §8 Anlageziel und Anlagepolitik Ziff. 4 lit. E, Ziff. 2 und Ziff. 3 des Fondsvertrags folgende kollektive Kapitalanlagen: Kollektive Kapitalanlagen, welche unter KAG Commitment-Ansatz I aufgesetzt sind; Indexfonds; andere kollektive Kapitalanlagen, welche in ihrer Anlagepolitik nicht explizit Short Positionen oder einen Hebel vorsehen. Bei der Umsetzung der Anlagepolitik ist die Fondsleitung jedoch ausschliesslich an die Vorgaben gemäss der Kollektivanlagegesetzgebung gebunden.

**Credit Suisse (CH) Privilege 75 CHF**

Mit den folgenden Regeln orientiert sich die Fondsleitung weitgehend an den Vorgaben gemäss Bundesgesetz über die berufliche Alters-, Hinterlassenen- und Invalidenvorsorge (BVG) und dessen Verordnung (BVV2). Der maximale Aktienanteil überschreitet allerdings die nach BVV 2 vorgegebene Kategorienbegrenzung für Aktien. Bei kollektiven Kapitalanlagen beurteilt die Fondsleitung deren Vereinbarkeit mit BVG/BVV2 ohne Durchsicht auf die zugrundeliegenden Anlagen auf Basis der Fondsdokumentation der entsprechenden kollektiven Kapitalanlage. Insbesondere qualifizieren unter §8 Anlageziel und Anlagepolitik Ziff. 4 lit. F, Ziff. 2 und Ziff. 3 des Fondsvertrags folgende kollektive Kapitalanlagen: Kollektive Kapitalanlagen, welche unter KAG Commitment-Ansatz I aufgesetzt sind; Indexfonds; andere kollektive Kapitalanlagen, welche in ihrer Anlagepolitik nicht explizit Short Positionen oder einen Hebel vorsehen. Bei der Umsetzung der Anlagepolitik ist die Fondsleitung jedoch ausschliesslich an die Vorgaben gemäss der Kollektivanlagegesetzgebung gebunden.



# Kurzbericht der kollektivanlagengesetzlichen Prüfgesellschaft

an den Verwaltungsrat der Fondsleitung Credit Suisse Funds AG, Zürich

## Kurzbericht zur Prüfung der Jahresrechnung

### Prüfungsurteil

Wir haben die Jahresrechnung des Umbrella-Fonds CS Fund 1 mit den Teilvermögen

- Credit Suisse (CH) Interest & Dividend Focus Yield CHF
- Credit Suisse (CH) Interest & Dividend Focus Balanced CHF
- Credit Suisse (CH) Interest & Dividend Focus Growth CHF
- Credit Suisse (CH) Privilege 35 CHF
- Credit Suisse (CH) Privilege 45 CHF
- Credit Suisse (CH) Privilege 75 CHF
- Credit Suisse (CH) Privilege 20 CHF

bestehend aus der Vermögensrechnung zum 31. Dezember 2023, 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 beigelegte Jahresrechnung (Seiten 3 und 12 bis 168) 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.

### Sonstige Informationen

Der Verwaltungsrat der Fondsleitung ist für die sonstigen Informationen verantwortlich. Die sonstigen Informationen umfassen die im 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 Verwaltungsrats 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 sowie dem Fondsvertrag und 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 ist.

### **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 ist, 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.

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 des Anlagefonds 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 bzw. dessen zuständigem Ausschuss 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.

PricewaterhouseCoopers AG

Raffael Simone

Zugelassener Revisionsexperte  
Leitender Prüfer

Yael Fries

Zugelassene Revisionsexpertin

Zürich, 22. April 2024

**CREDIT SUISSE**   
Teil des UBS-Konzerns

**Credit Suisse Funds AG**  
Teil des UBS-Konzerns  
Uetlibergstrasse 231  
CH-8045 Zürich

[www.credit-suisse.com](http://www.credit-suisse.com)