

Swiss Life Funds (CH) Equity Global Protect Enhanced (CHF hedged)

Vertraglicher Anlagefonds schweizerischen Rechts
(der Art «übrige Fonds für traditionelle Anlagen»)

Halbjahresbericht per 30. Juni 2023

Ungeprüfter Halbjahresbericht per 30. Juni 2023

Inhaltsverzeichnis	Seite	ISIN
Organisation	2	
Swiss Life Funds (CH)		
Equity Global Protect Enhanced (CHF hedged)	4	I-A1/ CH0299461902 I-A2/ CH0299461951 R-A3/ CH0299461969

Verkaufsrestriktionen

Bei der Ausgabe und Rücknahme von Anteilen dieses Anlagefonds im Ausland kommen die dort geltenden Bestimmungen zur Anwendung.

- a) Für folgende Länder liegt eine Bewilligung für die Vertriebstätigkeit vor: - Schweiz
- b) Anteile dieses Anlagefonds dürfen US-Personen weder angeboten, verkauft noch ausgeliefert werden.

US-Person bedeutet:

- (i) ein US-amerikanischer Staatsbürger (inklusive doppelter oder mehrfacher Staatsbürgerschaft);
- (ii) eine in den USA wohnhafte Person (Resident Alien, der eine Green Card besitzt oder den «Substantial Presence Test» besteht);
- (iii) eine Personengesellschaft oder eine Gesellschaft in den USA oder unter US-Recht oder dem Recht eines US-Bundesstaates;
- (iv) einen Nachlass eines Erblassers, der US-Staatsbürger oder in den USA wohnhaft ist;
- (v) einen Trust, wenn (x) ein US-Gericht gemäss geltendem Gesetz Anordnungen oder Urteile bezüglich wesentlicher Aspekte der Trust-Verwaltung treffen kann und (y) eine oder mehrere US-Personen die Befugnis haben, die wesentlichen Entscheidungen des Trusts zu kontrollieren;
- (vi) eine Person, die dem US-amerikanischen Steuerrecht aus anderen Gründen unterliegt (u. a. doppelter Wohnsitz, Ehepartner mit gemeinsamer Einreichung, Verzicht auf US-Staatsbürgerschaft oder langfristige, dauerhafte Niederlassung in den USA).

Dieser Absatz und die hier verwendeten Begriffe sind in Übereinstimmung mit dem US Internal Revenue Code auszulegen.

Die Fondsleitung und die Depotbank können gegenüber natürlichen oder juristischen Personen in bestimmten Ländern und Gebieten den Verkauf, die Vermittlung oder Übertragung von Anteilen untersagen oder beschränken.

Internetadresse

www.swisslife-am.com

Organisation

Fondsleitung

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

Verwaltungsrat

Präsident

Stefan Mächler

Group CIO und Mitglied der Konzernleitung der Swiss Life-Gruppe, mit weiteren Verwaltungsratsmandaten innerhalb der Swiss Life-Gruppe, Präsident des Verwaltungsrats der Ina Invest Holding AG und der Ina Invest AG

Mitglieder

Hermann Inglin

CFO Swiss Life Asset Managers, Swiss Life Investment Management Holding AG, mit weiteren Verwaltungsratsmandaten innerhalb der Swiss Life-Gruppe

Lorenzo Kyburz

Head Legal & Compliance Swiss Life Asset Managers, Swiss Life Investment Management Holding AG, mit einem weiteren Verwaltungsratsmandat innerhalb der Swiss Life-Gruppe

Dr. Rolf Aeberli

Head Corporate Mandates Swiss Life AG, mit weiteren Verwaltungsratsmandaten innerhalb der Swiss Life-Gruppe, Präsident des Verwaltungsrates der First Swiss Mobility 2019-1 AG, der First Swiss Mobility 2020-1 AG, der First Swiss Mobility 2020-2 AG und der RWA Consulting AG

Geschäftsleitung

Robin van Berkel

CEO, mit Verwaltungsratsmandaten innerhalb der Swiss Life-Gruppe

Daniel Berner

Stellvertretender CEO, Bereichsleiter Securities

Paolo di Stefano

Bereichsleiter Real Estate

Cristoph Gisler

Bereichsleiter Infrastructure Equity, mit Verwaltungsratsmandaten innerhalb der Swiss Life-Gruppe

Jan Grunow

Bereichsleiter Operations, mit einem Stiftungsratsmandat innerhalb der Swiss Life-Gruppe

Mark Fehlmann

Bereichsleiter Sales & Marketing

Marion Koch

Bereichsleiterin Private Clients

Depotbank

UBS Switzerland AG, Zürich
Bahnhofstrasse 45
8001 Zürich

Prüfgesellschaft

PricewaterhouseCoopers AG
Birchstrasse 160, 8050 Zürich

Übertragung der Fondsadministration

Folgende Teilaufgaben sind an die UBS Fund Management (Switzerland) AG, Aeschenvorstadt 1, 4051 Basel, übertragen: Buchhaltung, Steuern, Berechnung von Vergütungen, NAV-Berechnung, Kursinformationen, Kontrolle der Einhaltung der reglementarischen Anlagerichtlinien und Erstellen von Halbjahres- und Jahresberichten. Die UBS Fund Management (Switzerland) AG ist als Fondsleitung von Wertschriften-, Spezial- und Immobilienfonds seit ihrer Gründung im Jahre 1959 im Fondsgeschäft tätig und bietet Dienstleistungen im administrativen Bereich für Kollektivanlagen an.

Die genaue Ausführung des Auftrages regelt ein zwischen der Fondsleitung Swiss Life Asset Management AG und der UBS Fund Management (Switzerland) AG abgeschlossener Vertrag.

Weiterdelegation

Die Administration des Anlagefonds, insbesondere Führung der Buchhaltung, Berechnung der Nettoinventarwerte, Steuerabrechnungen, Betrieb der IT-Systeme sowie Erstellung der Rechenschaftsberichte, ist an Northern Trust Global Services SE, Leudelange, Luxembourg, Zweigniederlassung Basel, weiterdelegiert. Die genaue Ausführung dieser Arbeiten ist in einem zwischen UBS Fund Management (Switzerland) AG und Northern Trust Global Services SE, Leudelange, Luxembourg, Zweigniederlassung Basel abgeschlossenen Vertrag geregelt.

Übertragung weiterer Teilaufgaben

Die interne Revision ist an das Konzernrevisorat der Swiss Life Gruppe übertragen. Weitere Teilaufgaben im Bereich Legal & Compliance und Risk Management sind an die Swiss Life Investment Management Holding AG übertragen. IT-Infrastrukturdienstleistungen, Applikationsentwicklung und -betrieb sowie IT-Risk Management und IT-Security sind an die Swiss Life Investment Management Holding AG und an die Swiss Life AG übertragen. Die Beauftragten zeichnen sich aus durch ihre langjährige Erfahrung in den übertragenen Bereichen. Die genaue Ausführung der Aufträge regeln zwischen der Fondsleitung Swiss Life Asset Management AG und den Beauftragten abgeschlossene Verträge.

Zahlstellen

UBS Switzerland AG, Zürich
Bahnhofstrasse 45
8001 Zürich

Swiss Life Funds (CH) Equity Global Protect Enhanced (CHF hedged)

Art übrige Fonds für traditionelle Anlagen

Wichtigste Daten

	ISIN	30.6.2023	31.12.2022	31.12.2021
Nettofondsvermögen in CHF		1 835 622 252.15	1 681 406 761.02	1 709 738 083.73
Klasse I-A1	CH0299461902			
Nettoinventarwert pro Anteil in CHF		121.86	120.69	134.07
Anzahl Anteile im Umlauf		13 263 534,4070	12 216 810,4070	11 005 652,1560
Klasse I-A2	CH0299461951			
Nettoinventarwert pro Anteil in CHF		120.61	119.15	132.36
Anzahl Anteile im Umlauf		1 751 916,4890	1 670 889,4890	1 723 322,0450
Klasse R-A3	CH0299461969			
Nettoinventarwert pro Anteil in CHF		124.58	122.50	136.14
Anzahl Anteile im Umlauf		63 925,8490	63 752,8490	45 203,8490

Struktur des Wertpapierportfolios (ungeprüft)

Die 10 grössten Positionen in % des Gesamtfondsvermögens

Syz AM CH Liquidity Management	1,98
Fast Retailing Co Ltd	0,70
Microsoft Corp	0,60
Eli Lilly and Co Com	0,57
Berkshire Hathaway	0,57
Republic Services Com	0,54
Duke Energy Corp Com	0,52
Waste Connections Com Npv	0,52
Paychex Inc Com	0,52
Oracle Corp Com	0,51
Übrige	84,36
Total	91,39

Obige Prozentsätze können Rundungsdifferenzen enthalten.

Vermögensrechnung

	30.6.2023	31.12.2022
	CHF	CHF
Verkehrswerte		
Bankguthaben		
– auf Sicht	102 303 047.90	86 249 582.76
Effekten		
– Aktien und andere Beteiligungspapiere	1 642 713 191.32	1 440 699 082.14
– Anteile anderer kollektiver Kapitalanlagen	36 409 610.00	62 245 040.00
Derivative Finanzinstrumente	51 749 550.41	92 770 304.17
Sonstige Vermögenswerte	4 128 491.01	2 526 571.63
Gesamtfondsvermögen	1 837 303 890.64	1 684 490 580.70
Kurzfristige Bankverbindlichkeiten	-742 974.60	-2 206 981.47
Andere Verbindlichkeiten	-938 663.89	-876 838.21
Nettofondsvermögen	1 835 622 252.15	1 681 406 761.02

Erfolgsrechnung

	1.1.2023-30.6.2023	1.1.2022-31.12.2022
	CHF	CHF
Ertrag		
Erträge der Bankguthaben	1 427 589.87	418 203.83
Negativzinsen	-91 667.90	-188 889.59
Erträge der Effekten		
– aus Aktien und anderen Beteiligungspapieren	16 444 275.08	25 711 141.87
– aus Gratisaktien	2 531.16	38 888.11
– aus Anteilen anderer kollektiver Kapitalanlagen	33 392.41	409 665.75
Ausgleichszahlungen aus Effektenleihe	167 610.19	270 624.15
Erträge der Effektenleihe	834 782.41	2 357 440.79
Einkauf in laufende Nettoerträge bei der Ausgabe von Anteilen	350 692.65	3 013 964.71
Total Ertrag	19 169 205.87	32 031 039.62
Aufwand		
Passivzinsen	-1 987.06	34 639.24 ¹
Reglementarische Kommissionsvergütung an die Fondsleitung Klasse I-A1	-1 121 127.12	-1 980 655.31
Reglementarische Kommissionsvergütung an die Fondsleitung Klasse I-A2	-608 156.01	-1 233 913.20
Reglementarische Kommissionsvergütung an die Fondsleitung Klasse R-A3	-62 346.19	-109 715.19
Reglementarische Kommissionsvergütung an die Depotbank	-67 016.58	-120 412.60
Teilübertragung der fondsvertraglichen Kommissionsvergütung an die Fondsleitung auf realisierte Kapitalgewinne und -verluste Klasse R-A3	0.00	3.88
Sonstige Aufwendungen	-902.01	-13 370.68
Ausrichtung laufender Nettoerträge bei der Rücknahme von Anteilen	-96 169.71	-1 056 871.56
Total Aufwand	-1 957 704.68	-4 480 295.42
Nettoertrag	17 211 501.19	27 550 744.20
Realisierte Kapitalgewinne und -verluste	103 780 869.08	22 643 112.02
Teilübertragung der fondsvertraglichen Kommissionsvergütung an die Fondsleitung auf realisierte Kapitalgewinne und -verluste Klasse R-A3	0.00	-3.88
Realisierter Erfolg	120 992 370.27	50 193 852.34
Nicht realisierte Kapitalgewinne und -verluste	-76 390 593.14	-190 287 884.33
Gesamterfolg	44 601 777.13	-140 094 031.99

¹ Die Passivzinsen per 31.12.2022 umfassen eine Korrektur der Zinsaufwände des Vorjahres im Umfang von CHF 35 393.50.

Veränderung des Nettofondsvermögens

	1.1.2023-30.6.2023	1.1.2022-31.12.2022
	CHF	CHF
Nettofondsvermögen zu Beginn des Rechnungsjahres	1 681 406 761.02	1 709 738 083.73
Ordentliche Jahresausschüttung	-29 328 856.89	-22 440 870.38
Saldo aus dem Anteilverkehr	138 942 570.89	134 203 579.66
Gesamterfolg	44 601 777.13	-140 094 031.99
Nettofondsvermögen am Ende der Berichtsperiode	1 835 622 252.15	1 681 406 761.02

Entwicklung der Anteile im Umlauf

	1.1.2023-30.6.2023	1.1.2022-31.12.2022
	Anzahl	Anzahl
Klasse I-A1		
Bestand Anfang Rechnungsjahr	12 216 810,4070	11 005 652,1560
Ausgegebene Anteile	1 138 052,0000	2 881 346,0000
Zurückgenommene Anteile	-91 328,0000	-1 670 187,7490
Bestand Ende Berichtsperiode	13 263 534,4070	12 216 810,4070
Differenz zwischen den ausgegebenen und zurückgenommenen Anteilen	1 046 724,0000	1 211 158,2510
Klasse I-A2		
Bestand Anfang Rechnungsjahr	1 670 889,4890	1 723 322,0450
Ausgegebene Anteile	170 401,0000	327 069,4440
Zurückgenommene Anteile	-89 374,0000	-379 502,0000
Bestand Ende Berichtsperiode	1 751 916,4890	1 670 889,4890
Differenz zwischen den ausgegebenen und zurückgenommenen Anteilen	81 027,0000	-52 432,5560
Klasse R-A3		
Bestand Anfang Rechnungsjahr	63 752,8490	45 203,8490
Ausgegebene Anteile	8 031,0000	29 401,0000
Zurückgenommene Anteile	-7 858,0000	-10 852,0000
Bestand Ende Berichtsperiode	63 925,8490	63 752,8490
Differenz zwischen den ausgegebenen und zurückgenommenen Anteilen	173,0000	18 549,0000

Inventar des Fondsvermögens

Titel		31.12.2022 Anzahl/ Nominal	Käufe ¹	Verkäufe ²	30.6.2023 Anzahl/ Nominal	Verkehrswert ³ in CHF	in % ³	Davon ausgeliehen Anzahl/Nominal
Effekten, die an einer Börse gehandelt werden								
Inhaberaktien								
Österreich								
ERSTE GROUP BK AG NPV*	EUR	34 367	2 196	9 621	26 942	843 874	0,05	
OMV AG NPV(VAR)*	EUR	24 439	1 466	7 922	17 983	681 741	0,04	
VOESTALPINE AG NPV*	EUR	49 078	1 648	30 509	20 217	649 218	0,04	
Total Österreich						2 174 832	0,12	
Belgien								
ANHEUSER-BUSCH IN NPV*	EUR	12 246	2 955		15 201	769 009	0,04	
COLRUYT SA NPV*	EUR	58 092		58 092				
GPE BRUXELLES LAM NPV*	EUR	22 851	33 907		56 758	3 997 620	0,22	
PROXIMUS SA NPV*	EUR	38 287		38 287				
SA D'ETEREN NV NPV*	EUR		3 603		3 603	569 363	0,03	
SOFINA NPV*	EUR		2 557		2 557	473 452	0,03	2 557
SOLVAY SA NPV*	EUR	13 906	600	7 151	7 355	734 406	0,04	7 355
UMICORE NPV*	EUR		21 292		21 292	531 820	0,03	21 292
Total Belgien						7 075 670	0,39	
China								
NXP SEMICONDUCTORS EURO.20*	USD		15 162		15 162	2 776 419	0,15	
Total China						2 776 419	0,15	
Finnland								
KESKO OYJ EUR2 SER'B'*	EUR		19 538		19 538	328 963	0,02	19 538
KONE CORPORATION NPV ORD 'B'*	EUR		76 445		76 445	3 568 843	0,19	
WARTSILA OYJ ABP SER'B*EUR3.50*	EUR	95 721	4 581	44 116	56 186	565 686	0,03	15 000
Total Finnland						4 463 491	0,24	
Frankreich								
ACCOR EUR3*	EUR	56 151	2 723	25 474	33 400	1 109 069	0,06	33 400
ADP EUR3*	EUR		4 434		4 434	569 114	0,03	4 434
AIR LIQUIDE(L) EUR5.5 (POST-SUBDIVISION)*	EUR		28 657		28 657	4 592 845	0,25	
AIRBUS EUR1*	EUR	8 450	469	3 162	5 757	743 757	0,04	
ALSTOM EUR7.00*	EUR		22 247		22 247	593 240	0,03	22 247
AMUNDI EUR2.5 (AIW)*	EUR		9 459		9 459	499 021	0,03	9 459
ARKEMA EUR10*	EUR	14 520	449	9 464	5 505	463 710	0,03	
AXA EUR2.29*	EUR		78 533		78 533	2 071 552	0,11	
BIOMERIEUX NPV (POST SPLIT)*	EUR		16 899		16 899	1 585 450	0,09	
BNP PARIBAS EUR2*	EUR		18 374		18 374	1 035 161	0,06	18 374
BOLLORE EURO.16*	EUR	680 735		680 735				
BOUYGUES EUR1*	EUR		19 640		19 640	589 666	0,03	13 525
BUREAU VERITAS EURO.12*	EUR	48 135	2 506	19 901	30 740	753 705	0,04	
CAPGEMINI EUR8*	EUR		4 447		4 447	753 303	0,04	
CARREFOUR EUR2.50*	EUR		193 602		193 602	3 279 536	0,18	193 305
CIE DE ST-GOBAIN EUR4*	EUR			36 386				
COVIVIO EUR3*	EUR	36 386	1 205	2 353	14 781	622 966	0,03	3 048
DANONE EURO.25*	EUR	15 929	40 378		40 378	2 212 560	0,12	40 378
EDENRED EUR2*	EUR		16 957		16 957	1 015 245	0,06	
EIFFAGE EUR4*	EUR		7 315		7 315	682 432	0,04	
ENGIE EUR1*	EUR		70 386		70 386	1 046 182	0,06	
ESSILORLUXOTTICA EURO.18*	EUR	27 785	943	17 166	11 562	1 947 833	0,11	
EURAZEO NPV*	EUR		13 483		13 483	848 179	0,05	
EUROAPI SA EUR1*	EUR	762		762				
GETLINK SE EURO.40*	EUR	325 397	6 275	254 702	76 970	1 170 488	0,06	
HERMES INTL NPV*	EUR	7 399	204	5 097	2 506	4 867 568	0,26	
ICADE NPV*	EUR	23 575		23 575				
IMERYS EUR2*	EUR	20 153		20 153				
IPSEN EUR1*	EUR		14 907		14 907	1 603 429	0,09	
JC DECAUX SA NPV*	EUR	42 081		42 081				
KLEPIERRE EUR1.40*	EUR		27 350		27 350	606 518	0,03	23 811
L'OREAL EURO.20*	EUR		8 843		8 843	3 686 440	0,20	
LEGRAND SA EUR4*	EUR	40 594	744	32 221	9 117	808 008	0,04	
LVMH MOET HENNESSY EURO.30*	EUR		3 167		3 167	2 667 699	0,15	
ORANGE EUR4*	EUR	425 019	33 796	44 264	414 551	4 330 328	0,24	287 507
PERNOD RICARD EUR1.55*	EUR	23 255	1 445	6 975	17 725	3 501 666	0,19	
REMY COINTREAU EUR1.60*	EUR	7 949	275	4 854	3 370	483 367	0,03	3 370
RENAULT SA EUR3.81*	EUR		14 744		14 744	555 208	0,03	
SAFRAN EURO.20*	EUR	14 484	545	8 345	6 684	935 934	0,05	6 684
SANOFI EUR2*	EUR	17 540	34 191		51 731	4 958 385	0,27	
SARTORIUS STEDIM B EURO.20 (POST SUBD)*	EUR		3 072		3 072	685 749	0,04	3 072
SCHNEIDER ELECTRIC EUR8*	EUR	27 640		27 640				
SEB SA EUR1*	EUR	7 626	14 799		22 425	2 071 720	0,11	
SOC GENERALE EUR1.25*	EUR		29 768		29 768	691 520	0,04	
SODEXO EUR4*	EUR	43 622		43 622				
STMICROELECTRONICS EUR1.04*	EUR	128 747	1 082	116 560	13 269	590 130	0,03	
TELEPERFORMANCE EUR2.50*	EUR	6 909	273	3 832	3 350	501 753	0,03	
THALES EUR3*	EUR	9 757	3 196		12 953	1 734 612	0,09	
TOTALENERGIES SE EUR2.5*	EUR	43 320	11 149		54 469	2 793 830	0,15	
UBISOFT ENTERTAIN EURO.31*	EUR		22 595		22 595	570 761	0,03	22 595
VALEO EUR1 (POST SUBD)*	EUR	43 923	2 136	19 861	26 198	501 957	0,03	26 198
VEOLIA ENVIRONNEME EUR5*	EUR		30 164		30 164	852 345	0,05	30 000
VINCI EUR2.50*	EUR		12 607		12 607	1 309 030	0,07	
VIVENDI SA EUR5.50*	EUR		61 728		61 728	506 465	0,03	5 372
WENDEL EUR4*	EUR	10 312		10 312				
WORLDLINE EURO.68*	EUR		17 986		17 986	588 108	0,03	2 000
Total Frankreich						70 587 542	3,84	
Deutschland								
AROUNDTOWN SA EURO.01*	EUR	133 399	158 363		291 762	301 010	0,02	291 762
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG EUR1*	EUR	16 783	1 018	5 320	12 481	1 370 746	0,07	
BEIERSDORF AG NPV*	EUR	10 215	20 999		31 214	3 694 104	0,20	
CARL ZEISS MEDITEC NPV*	EUR		6 765		6 765	653 968	0,04	

Halbjahresbericht per 30. Juni 2023

Swiss Life Funds (CH) Equity Global Protect Enhanced (CHF hedged)

Titel		31.12.2022 Anzahl/ Nominal	Käufe ¹	Verkäufe ²	30.6.2023 Anzahl/ Nominal	Verkehrswert ³ in CHF	in % ³	Davon ausgeliehen Anzahl/Nominal
COMMERZBANK AG NPV*	EUR		84 018		84 018	832 370	0,05	
CONTINENTAL AG ORD NPV*	EUR	9 951	697	2 103	8 545	576 326	0,03	
COVESTRO AG NPV*	EUR		13 815		13 815	641 584	0,03	13 815
DEUTSCHE WOHNEN AG NPV (BR)*	EUR	125 961		125 961				
FRAPORT AG NPV*	EUR	12 805		12 805				
FRESENIUS MED CARE NPV*	EUR	13 246	21 207		34 453	1 471 911	0,08	34 453
FRESENIUS SE & CO. KGAA NPV*	EUR		27 213		27 213	673 868	0,04	
GEA GROUP AG NPV*	EUR		22 537		22 537	842 726	0,05	
HEIDELBERGCEMENT NPV*	EUR		11 326		11 326	831 328	0,05	
HELLOFRESH SE NPV*	EUR		25 369		25 369	559 615	0,03	25 369
HENKEL AG & CO KGAA*	EUR	6 179	24 230		30 409	1 914 431	0,10	
HOCHTIEF AG NPV*	EUR	10 114		10 114				
KNORR BREMSE AG NPV*	EUR		19 338		19 338	1 320 880	0,07	
LANXESS AG NPV*	EUR	22 038		22 038				
MERCK KGAA NPV*	EUR	29 799	1 532	12 544	18 787	2 779 018	0,15	
METRO AG (NEW) NPV*	EUR	57 849		57 849				
NEMETSCHKE SE ORD NPV*	EUR		16 785		16 785	1 124 544	0,06	16 785
PUMA SE NPV*	EUR		12 090		12 090	650 449	0,04	12 090
RATIONAL AG NPV*	EUR		851		851	550 708	0,03	
RHEINMETALL AG NPV*	EUR		4 124		4 124	1 009 541	0,05	4 124
RWE AG (NEU) NPV*	EUR		24 384		24 384	948 919	0,05	
SAP AG ORD NPV*	EUR		22 844		22 844	2 790 270	0,15	
SYMRISE AG NPV (BR)*	EUR		32 316		32 316	3 028 707	0,16	
ZALANDO SE NPV*	EUR		22 995		22 995	591 639	0,03	22 995
Total Deutschland						29 158 661	1,59	
Irland								
AIB GROUP PLC ORD EURO.625*	EUR	385 393	19 794	162 387	242 800	912 404	0,05	
BANK OF IRELAND GR EUR1*	EUR		80 577		80 577	687 228	0,04	
FLUTTER ENTERTAINM ORD EURO.09*	EUR		5 278		5 278	949 194	0,05	
KERRY GROUP 'A' ORD EURO.125(DUBLIN LIST)*	EUR	37 846	2 792	6 385	34 253	2 988 250	0,16	
Total Irland						5 537 076	0,30	
Italien								
AMPLIFON EURO.02*	EUR		29 072		29 072	953 153	0,05	29 072
ASSIC GENERALI SPA EUR1*	EUR	167 981		167 981				
DIASORIN SPA EUR1*	EUR		8 605		8 605	801 267	0,04	8 605
INFRASTRUTTURE WIR NPV*	EUR		172 210		172 210	2 030 501	0,11	
POSTE ITALIANE SPA NPV*	EUR		181 681		181 681	1 758 425	0,10	
TELECOM ITALIA SPA EURO.55*	EUR	2 135 944	487 123		2 623 067	660 040	0,04	2 603 588
Total Italien						6 203 387	0,34	
Japan								
ADVANTEST CORP NPV*	JPY	39 451	2 400	3 000	38 851	4 605 228	0,25	
AMADA CO LTD NPV*	JPY	30 786	12 700		43 486	380 340	0,02	
BANDAI NAMCO HLDGS NPV*	JPY		64 800	16 200	48 600	999 046	0,05	
CENTRAL JAPAN RLWY NPV*	JPY	2 804	3 400		6 204	693 537	0,04	
CHUGAI PHARM CO NPV*	JPY	59 140	3 100	10 800	51 440	1 301 006	0,07	
COMSYS HOLDINGS NPV*	JPY	24 021	19 500		43 521	766 276	0,04	
CREDIT SAISON CO NPV*	JPY		27 530		27 530			
DAIICHI SANKYO COM NPV*	JPY	57 512	3 300	6 800	54 012	1 521 184	0,08	
DAIKIN INDUSTRIES NPV*	JPY	22 655	1 200	3 400	20 455	3 705 341	0,20	
DAIWA HOUSE INDS NPV*	JPY	20 947	3 600		24 547	576 165	0,03	
EISAI CO NPV*	JPY	18 956	1 100	800	19 256	1 159 021	0,06	
FANUC CORP NPV*	JPY	22 112	97 660	23 212	96 560	3 007 586	0,16	81 800
FAST RETAILING CO NPV*	JPY	22 203	57 509	23 303	56 409	12 821 275	0,70	
FUKUOKA FINANCIAL NPV*	JPY		31 100		31 100	572 315	0,03	
IDEMITSU KOSAN CO LTD*	JPY	3 349	10 900		14 249	254 543	0,01	
ISETAN MITSUKOSHI NPV*	JPY		43 600		43 600	394 561	0,02	
JAPAN EXCHANGE GP NPV*	JPY		35 800		35 800	555 764	0,03	
JGC HLDGS CORP NPV*	JPY	8 583	35 800		44 383	512 360	0,03	
JTEKT CORPORATION NPV*	JPY	28 073	51 900		79 973	646 002	0,04	
KAO CORP NPV*	JPY	22 475	1 200	3 500	20 175	651 126	0,04	
KEIO CORPORATION NPV*	JPY		17 400		17 400	487 142	0,03	
KEISEI ELEC RY CO NPV*	JPY	17 519		17 519				
KIKKOMAN CORP NPV*	JPY	19 499	1 000	3 300	17 199	872 114	0,05	
KIRIN HOLDINGS CO LTD NPV*	JPY	18 242	17 300		35 542	462 329	0,03	
KOMATSU NPV*	JPY	21 218	12 000		33 218	797 990	0,04	
KURARAY CO NPV*	JPY	26 816	47 900		74 716	646 779	0,04	
M3 INC NPV*	JPY		50 600		50 600	973 759	0,05	
MARUI GROUP NPV*	JPY	24 384	16 700		41 084	637 794	0,03	
MINEBEA MITSUMI INC*	JPY	23 017	11 700		34 717	581 286	0,03	
MITSUBISHI LOGISTI NPV*	JPY	15 438	11 300		26 738	587 374	0,03	
MIYOSHI FUDOSAN CO NPV*	JPY	23 931	20 500		44 431	786 698	0,04	
MIYOSHI MINING & SM NPV*	JPY		21 600		21 600	442 416	0,02	
NH FOODS LTD NPV*	JPY	10 554	7 300		17 854	431 114	0,02	
NICHIREI CORP NPV*	JPY	11 920	11 700		23 620	450 455	0,02	
NIDEC CORPORATION NPV*	JPY		13 600		13 600	660 408	0,04	
NIPPON KAYAKU CO NPV*	JPY	30 344		30 344				
NISSAN CHEMICAL CO NPV*	JPY	20 313	1 100	3 600	17 813	680 193	0,04	
NISSHIN SEIFUN GRP NPV*	JPY	21 489	24 700		46 189	508 764	0,03	
NITTO DENKO CORP NPV*	JPY	21 670	1 100	3 300	19 470	1 281 089	0,07	
OBAYASHI CORP NPV*	JPY		64 800		64 800	498 971	0,03	
OKUMA CORPORATION NPV*	JPY	2 352		2 352				
OLYMPUS CORP NPV*	JPY	82 257	4 400	15 300	71 357	1 000 868	0,05	
RAKUTEN GROUP INC NPV*	JPY	21 670		21 670				
RECRUIT HLDGS CO L NPV*	JPY	60 306	3 800	2 100	62 006	1 751 315	0,10	
SCREEN HOLDINGS CO NPV*	JPY		6 400		6 400	643 348	0,04	
SECOM CO NPV*	JPY	24 474	1 100	7 000	18 574	1 119 696	0,06	
SEKISUI HOUSE NPV*	JPY	35 942	1 600	11 500	26 042	468 355	0,03	
SHIN-ETSU CHEMICAL NPV*	JPY	20 494	95 570	21 594	94 470	2 788 113	0,15	
SHIONOGI & CO NPV*	JPY	19 770	1 200	600	20 370	765 350	0,04	
SHISEIDO CO LTD NPV*	JPY	20 313	1 200	1 800	19 713	792 279	0,04	
SMC CORP NPV*	JPY		2 200		2 200	1 082 332	0,06	
SUMITOMO METAL MNG NPV*	JPY	16 062	600	6 600	10 062	288 429	0,02	
SUZUKI MOTOR CORP NPV*	JPY	19 138	1 000	2 800	17 338	558 169	0,03	
TAIYO YUDEN CO LTD NPV*	JPY	16 062	8 200		24 262	613 778	0,03	23 048
TAKARA HOLDINGS NPV*	JPY		7 308		7 308			
TERUMO CORP NPV*	JPY	81 253	5 100	2 900	83 453	2 356 554	0,13	

Titel		31.12.2022 Anzahl/ Nominal	Käufe ¹	Verkäufe ²	30.6.2023 Anzahl/ Nominal	Verkehrswert ³ in CHF	in % ³	Davon ausgeliehen Anzahl/Nominal
TOKAI CARBON CO NPV*	JPY	7 308		7 308				
TOTO LTD NPV*	JPY	10 021		10 021				
TOYOTA TSUSHO CORP NPV*	JPY	26 635	1 000	11 600	16 035	708 576	0,04	
UBE CORPORATION NPV*	JPY		45 200		45 200	691 200	0,04	
YAMAHA CORP NPV*	JPY	19 409	1 700		21 109	719 422	0,04	
YAMATO HOLDINGS CO NPV*	JPY	19 680		19 680				
Total Japan						63 257 135	3,44	
Luxemburg								
RTL GROUP NPV*	EUR	26 465		26 465				
Total Luxemburg							0,00	
Niederlande								
AKZO NOBEL NV EURO.50(POST REV SPLIT)*	EUR		15 606		15 606	1 138 168	0,06	
ASM INTL NV EURO.04*	EUR		2 045		2 045	775 166	0,04	
EURONEXT EUR1.60*	EUR		11 838		11 838	719 854	0,04	500
EXOR NV EURO.01*	EUR		8 588		8 588	684 677	0,04	
HEINEKEN HOLDING EUR1.6*	EUR	72 308	1 654	53 678	20 284	1 576 948	0,09	
HEINEKEN NV EUR1.60*	EUR	19 904	17 493		37 397	3 437 743	0,19	
IMCD NV EURO.16*	EUR		6 240		6 240	802 137	0,04	
ING GROEP N.V. EURO.01*	EUR	152 328	6 666	77 228	81 766	984 681	0,05	
JUST EAT TAKEAWAY EURO.04*	EUR		30 323		30 323	415 426	0,02	30 323
KON KPN NV EURO.04*	EUR	400 954	694 738		1 095 692	3 496 080	0,19	857 246
KONINKLIJKE AHOLD EURO.01*	EUR	225 863	15 489	51 358	189 994	5 797 046	0,32	
KONINKLIJKE PHILIPS NV EURO.20*	EUR	51 779	3 949	55 728				
OCI N.V. EURO.02*	EUR		36 881		36 881	790 880	0,04	
RANDSTAD N.V. EURO.10*	EUR		12 892		12 892	607 904	0,03	
UNIBAIL-RODAMCO-WE NPV(1 ORD UNIBAIL-R & 1CLS)*	EUR		10 985		10 985	516 267	0,03	
WOLTERS KLUWER EURO.12*	EUR	23 208	19 918		43 126	4 895 497	0,27	
Total Niederlande						26 638 473	1,45	
Portugal								
EDP RENOVAVEIS SA EUR5*	EUR		52 429		52 429	936 229	0,05	
Total Portugal						936 229	0,05	
Spanien								
ACCIONA SA EUR1*	EUR		4 720		4 720	715 931	0,04	100
ACS ACTIVIDADES CO EURO.5*	EUR		35 357		35 357	1 110 208	0,06	20 713
AENA SME S.A. EUR10*	EUR	22 810	1 540	5 464	18 886	2 728 221	0,15	
AMADEUS IT GROUP EURO.01*	EUR		14 738		14 738	1 002 650	0,05	
CAIXABANK SA EUR1*	EUR	347 245	21 110	109 408	258 947	957 159	0,05	
CELLNEX TELECOM SA EURO.25*	EUR		15 622		15 622	564 026	0,03	
CORP ACCIONA ENERG EUR1*	EUR		20 045		20 045	599 086	0,03	20 045
ENAGAS SA EUR1.50*	EUR	82 210	8 713		90 923	1 597 439	0,09	
ENDESA SA EUR1.2*	EUR	267 417	9 211	163 648	112 980	2 166 916	0,12	
GRIFOLS SA EURO.25 (CLASS A) POST SUBD*	EUR	37 059	69 976		107 035	1 226 512	0,07	107 035
IBERDROLA SA EURO.75 (POST SUBDIVISION)*	EUR		387 267		387 267	4 517 065	0,25	
INDITEX EURO.03 (POST SUBD)*	EUR		139 546		139 546	4 829 854	0,26	
NATURGY ENERGY GRO EUR1*	EUR	52 987	7 348		60 335	1 605 362	0,09	52 009
RED ELECTRICA CORP EURO.5*	EUR	305 974	21 394	64 944	262 424	3 940 751	0,21	
REPSOL SA EUR1*	EUR	85 639	32 655		118 294	1 539 114	0,08	
TELEFONICA SA EUR1*	EUR	195 506	15 917	16 173	195 250	708 182	0,04	94 558
Total Spanien						29 808 475	1,62	
Schweiz								
ROCHE HLDGS AG CHF1(BR)*	CHF		8 398		8 398	2 465 653	0,13	
SWISS RE AG CHF0.10*	CHF	36 484	1 202	22 939	14 747	1 327 820	0,07	
Total Schweiz						3 793 473	0,21	
Grossbritannien								
3I GROUP ORD GBP0.738636*	GBP	69 841	4 563	18 431	55 973	1 240 501	0,07	
ASTRAZENECA ORD USDO.25*	GBP	22 890	12 942		35 832	4 595 623	0,25	
BAE SYSTEMS ORD GBP0.025*	GBP		380 742		380 742	4 014 476	0,22	
BARRATT DEVEL ORD GBP0.10*	GBP		273 932		273 932	1 288 358	0,07	
BRIT AMER TOBACCO ORD GBP0.25*	GBP		76 441		76 441	2 267 526	0,12	
COCA-COLA EUROPACI COM EUR0.01*	USD	18 666		18 666				
FRESNILLO PLC ORD USDO.50*	GBP	131 989		131 989				
HALMA ORD GBP0.10*	GBP	49 329	36 509		85 838	2 223 110	0,12	
HIKMA PHARMACEUTIC ORD GBP0.10*	GBP		66 550		66 550	1 431 011	0,08	
INFORMA PLC (GB) ORD GBP0.001*	GBP	131 001		131 001				
JOHNSON MATTHEY ORD GBP1.109245*	GBP	26 929		26 929				
KINGFISHER ORD GBP0.157142857*	GBP		248 024		248 024	653 639	0,04	
LAND SECURITIES GP ORD GBP0.106666666*	GBP		171 692		171 692	1 121 325	0,06	
LIBERTY GLOBAL INC USDO.01 A*	USD	123 898		123 898				
LLOYDS BANKING GP ORD GBP0.1*	GBP	7 094 438		7 094 438				
NATIONAL GRID ORD GBP0.12431289*	GBP	382 410	21 201	143 550	260 061	3 077 766	0,17	
OCADO GROUP PLC ORD GBP0.02*	GBP		89 818		89 818	580 270	0,03	
RECKITT BENCK GRP ORD GBP0.10*	GBP		61 621		61 621	4 143 635	0,23	
RELX PLC GBP0.1444*	GBP	166 175	9 842	55 290	120 727	3 599 065	0,20	
RENTOKIL INITIAL ORD GBP0.01*	GBP	186 087	16 141	4 248	197 980	1 384 888	0,08	
ROLLS-ROYCE HLDGS ORD GBP0.20*	GBP		534 111		534 111	917 636	0,05	
SAGE GROUP GBP0.01051948*	GBP		238 298		238 298	2 506 609	0,14	
SEVERN TRENT ORD GBP0.9789*	GBP	33 953	7 541		41 494	1 211 045	0,07	
SMITHS GROUP ORD GBP0.375*	GBP	89 037	4 006	43 914	49 129	918 667	0,05	
SPIRAX-SARCO ENG ORD GBP0.269230769*	GBP	8 667		8 667				
SSE PLC ORD GBP0.50*	GBP		53 178		53 178	1 113 536	0,06	
ST JAMES'S PLACE ORD GBP0.15*	GBP	83 118	15 426		98 544	1 218 927	0,07	
UNITED UTILITIES G ORD GBP0.05*	GBP	84 878	138 939		223 817	2 447 968	0,13	
WEIR GROUP ORD GBP0.125*	GBP	42 344		42 344				
WHITBREAD ORD GBP0.76797385*	GBP	31 917	6 153		38 070	1 466 183	0,08	
WPP PLC ORD GBP0.10*	GBP		120 057		120 057	1 124 389	0,06	
Total Grossbritannien						44 546 153	2,42	
Vereinigte Staaten								
3M CO COM*	USD		14 623		14 623	1 309 424	0,07	14 623
AKAMAI TECHNOLOGIES INC COM*	USD	5 946	38 798		44 744	3 597 516	0,20	
ALPHABET INC CAP STK USDO.001 CL C*	USD	204 561	5 392	143 812	66 141	7 158 163	0,39	
AMER ELEC PWR INC COM USD6.50*	USD	40 493	3 303	3 277	40 519	3 052 277	0,17	

Halbjahresbericht per 30. Juni 2023

Swiss Life Funds (CH) Equity Global Protect Enhanced (CHF hedged)

Titel		31.12.2022 Anzahl/ Nominal	Käufe ¹	Verkäufe ²	30.6.2023 Anzahl/ Nominal	Verkehrswert ³ in CHF	in % ³	Davon ausgeliehen Anzahl/Nominal
ARROW ELECTRS INC COM*	USD	37 568	3 231	1 164	39 635	5 078 857	0,28	
BERKLEY(WR)CORP COM USD0.20*	USD		21 472		21 472	1 144 143	0,06	
BERKSHIRE HATHAWAY CLASS'B'COM USD0.0033*	USD	25 200	9 119		34 319	10 469 891	0,57	
BIO-TECHNE CORP COM USD0.01*	USD		33 278		33 278	2 430 302	0,13	
BIOMARIN PHARMA COM USD0.001*	USD	32 192	2 826	358	34 660	2 687 823	0,15	
BLACK KNIGHT INC COM USD0.0001 WI*	USD		66 470		66 470	3 551 987	0,19	
BLACKROCK INC COM STK USD0.01*	USD		5 540		5 540	3 425 539	0,19	
BOSTON SCIENTIFIC COM USD0.01*	USD		50 586		50 586	2 447 938	0,13	
BROADRIDGE FIN SOL COM STK USD0.01*	USD		34 683		34 683	5 139 357	0,28	15 571
BROWN FORMAN CORP CL B*	USD		45 474		45 474	2 716 832	0,15	
CAMPBELL SOUP CO CAP USD0.0375*	USD	70 525		70 525				
CATALENT INC COM USD0.01*	USD		56 318		56 318	2 184 689	0,12	7 705
CHARLES RIV LABS INTL INC COM*	USD		10 365		10 365	1 949 658	0,11	10 365
CHENIERE ENERGY INC COM NEW*	USD		22 339		22 339	3 045 004	0,17	
CINCINNATI FINL CORP COM*	USD		17 032		17 032	1 482 931	0,08	
CINTAS CORP COM*	USD		6 358		6 358	2 827 483	0,15	
CLOROX CO DEL COM*	USD	6 288	14 397		20 685	2 943 168	0,16	11 300
CME GROUP INC COM STK USD0.01 CLASS'A*	USD	32 592	862	22 875	10 579	1 753 678	0,10	
CMS ENERGY CORP COM*	USD		31 102		31 102	1 634 743	0,09	
COCA-COLA CO COM USD0.25*	USD	123 806		123 806				
COGNEX CORP COM*	USD	53 939		53 939				
COLGATE-PALMOLIVE COM USD1*	USD	39 651	2 380	12 836	29 195	2 012 231	0,11	
COPART INC COM*	USD		36 530		36 530	2 980 886	0,16	
COTERRA ENERGY INC COM USD0.10*	USD	118 834		118 834				
DEERE & CO COM USD1*	USD		5 833		5 833	2 114 481	0,12	
DIGITAL REALTY TRU COM STK USD0.01*	USD		21 141		21 141	2 153 714	0,12	21 141
DOMINION ENERGY IN COM STK NPV*	USD	77 886	5 469	16 274	67 081	3 108 126	0,17	
DROBOX INC COM USD0.0001 CL A*	USD		100 274		100 274	2 392 569	0,13	
DUKE ENERGY CORP COM USD0.001 (POST REV SPLT)*	USD	74 479	43 973		118 452	9 510 024	0,52	
ECOLAB INC COM*	USD	32 405		32 405				
EOG RESOURCES INC COM USD0.01*	USD	30 718	2 218	5 732	27 204	2 785 247	0,15	
EQUITY LIFESTYLE PPTY INC*	USD		30 201		30 201	1 807 323	0,10	
ERIE INDY CO CL A*	USD		13 425		13 425	2 522 362	0,14	13 425
ESSEX PROP TRUST COM USD0.0001*	USD	21 431		21 431				
ETSY INC USD0.001*	USD		12 799		12 799	968 837	0,05	
EXACT SCIENCES CORP COM*	USD		36 903		36 903	3 100 134	0,17	36 719
EXPEDITRS INTL WASH COM USD0.01*	USD		51 468		51 468	5 577 533	0,30	51 468
F M C CORP COM NEW*	USD	32 386	1 334	17 359	16 361	1 527 263	0,08	
F5 NETWORK INC COM STK NPV*	USD	17 146		17 146				
FAIR ISAAC CORP COM*	USD		3 273		3 273	2 369 520	0,13	
FASTENAL COM USD0.01*	USD	78 943	5 220	20 130	64 033	3 379 367	0,18	
FIRST HORIZON CORP COM USD0.625*	USD		249 192		249 192	2 512 530	0,14	
FIRST SOLAR INC COM STK USD0.001*	USD		8 248		8 248	1 402 688	0,08	
FLEX LTD COM USD0.01*	USD	281 048		281 048				
FLOWSERVE CORP COM*	USD	49 688		49 688				
FRANKLIN RES INC COM*	USD		105 905		105 905	2 530 717	0,14	102 526
GALLAGHER ARTHUR J & CO COM*	USD		40 587		40 587	7 972 841	0,43	
GARTNER INC COM*	USD	15 188		15 188				
GEN DYNAMICS CORP COM USD1*	USD		8 885		8 885	1 710 220	0,09	
GENERAC HLDGS INC COM USD0.01*	USD		18 169		18 169	2 424 093	0,13	17 795
HENRY JACK & ASSOC COM USD0.01*	USD	25 888	1 746	6 208	21 426	3 207 510	0,17	
HORIZON THERAPEUTI COM USD0.0001*	USD		54 120		54 120	4 979 838	0,27	
HUBSPOT INC COM USD0.001*	USD		8 753		8 753	4 166 728	0,23	
HUNT J B TRANS SVCS INC COM*	USD		17 873		17 873	2 894 684	0,16	
ILLINOIS TOOL WKS COM NPV*	USD	23 276	1 338	8 204	16 410	3 672 651	0,20	
ILLUMINA INC COM USD0.01*	USD		10 250		10 250	1 719 314	0,09	
INCYTE CORPORATION COM USD0.001*	USD		53 403		53 403	2 974 118	0,16	
INTERCONTINENTAL E COM USD0.01*	USD	74 539	3 904	30 550	47 893	4 845 192	0,26	
INTERNATIONAL FLAVORS&FRAGRANC COM*	USD	2 524		2 524				
INTERPUBLIC GROUP COM USD0.10*	USD	120 159	7 266	38 304	89 121	3 076 065	0,17	89 121
INVITATION HOMES I COM USD0.01*	USD	124 686		124 686				
JOHNSON & JOHNSON COM USD1*	USD	66 117	3 883		22 372	7 052 872	0,38	
JUNIPER NETWORKS COM USD0.00001*	USD	97 758	7 289		15 645	2 505 883	0,14	
LEGGETT & PLATT IN COM USD0.01*	USD	68 834		68 834				
LIBERTY BROADBAND COM USD0.01 CL 'C'*	USD	25 457	9 816		35 273	2 528 030	0,14	
LIBERTY MEDIA CORP COM USD0.01 SER C SIRIUSXM*	USD	75 928		75 928				
LIVE NATION INC COM*	USD		26 696		26 696	2 176 033	0,12	26 696
LOEWS CORP COM*	USD	73 956		73 956				
LPL FINL HLDGS INC COM USD0.001*	USD		14 729		14 729	2 865 140	0,16	
M & T BANK CORP COM USD0.50*	USD	27 175		27 175				
MARKEL GROUP INC COM NPV*	USD	4 688		4 688				
MARKETAXESS HLDGS INC COM*	USD		10 091		10 091	2 360 077	0,13	
MARSH & MCLENNAN COM USD1*	USD	2 782	33 140		35 922	6 044 443	0,33	
MARTIN MARIETTA M. COM USD0.01*	USD		7 370		7 370	3 044 186	0,17	
MOLINA HEALTHCARE INC COM*	USD		10 164		10 164	2 739 242	0,15	
MONGODB INC COM USD0.001 CL A*	USD		16 287		16 287	5 988 603	0,33	5 192
MOODYS CORP COM USD0.01*	USD	13 803	531	7 831	6 503	2 023 003	0,11	
NASDAQ INC COM STK USD0.01*	USD	86 421		86 421				
NEXTERA ENERGY INC COM USD0.01*	USD	124 555	4 077	78 621	50 011	3 319 882	0,18	
NORDSON CORP COM*	USD		9 223		9 223	2 047 822	0,11	3 117
NOVOCURE LTD COM USD0.00*	USD		22 408		22 408	831 964	0,05	20 111
PAYCOM SOFTWARE IN COM USD0.01*	USD		9 673		9 673	2 779 995	0,15	
PEPSICO INC CAP USD0.016666*	USD	49 906	4 071	4 043	49 934	8 274 417	0,45	
PIONEER NATURAL RE COM STK USD0.01*	USD	16 756	959	5 940	11 775	2 182 538	0,12	
PLUG POWER INC COM USD0.01*	USD		134 270		134 270	1 248 095	0,07	134 270
PPG INDS INC COM*	USD	24 282		13 799	11 413	1 514 238	0,08	
PROGRESSIVE CPOH) COM USD1*	USD		53 606		53 606	6 348 281	0,35	
PTC INC COM USD0.01*	USD	31 763		31 763				
PUBLIC STORAGE COM USD0.10*	USD	27 469	2 399	449	29 419	7 682 196	0,42	
QIAGEN NV EUR0.01*	EUR	29 939	35 206		65 145	2 615 913	0,14	
QORVO INC COM USD 0.0001*	USD	44 030		44 030				
QUANTA SVCS INC COM*	USD		12 052		12 052	2 118 187	0,12	
RALPH LAUREN CORP CLASS 'A' COM USD0.01*	USD	21 708		21 708				
REVVITY INC COM USD1.00*	USD	31 687		31 687				
ROLLINS INC COM*	USD		92 919		92 919	3 560 457	0,19	
ROPER TECHNOLOGIES COM USD0.01*	USD		8 996		8 996	3 869 609	0,21	
S&P GLOBAL INC COM USD1*	USD	28 048		28 048				
SHERWIN-WILLIAMS COM USD1*	USD	19 137	1 307	4 409	16 035	3 809 074	0,21	
SMITH A O COM*	USD	55 620		55 620				
SOUTHERN CO COM*	USD	112 161	12 057		124 218	7 806 997	0,42	

Titel		31.12.2022 Anzahl/ Nominal	Käufe ¹	Verkäufe ²	30.6.2023 Anzahl/ Nominal	Verkehrswert ³ in CHF	in % ³	Davon ausgeliehen Anzahl/Nominal
SS&C TECH HLDGS COM USD0.01*	USD	45 190		45 190				
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC COM*	USD	3 461		3 461				
TERADYNE INC COM USD0.125*	USD		42 812		42 812	4 264 134	0,23	42 807
TRANSUNION COM USD0.01*	USD	40 668		40 668				
TYLER TECHNOLOGIES INC COM*	USD		7 011		7 011	2 612 263	0,14	
UNDER ARMOUR INC COM STK USD0.0003333 CL C*	USD	112 743		112 743				
UNITED PARCEL SERVICE INC CL B*	USD		21 061		21 061	3 377 469	0,18	
VEEVA SYSTEMS INC COM USD0.0001 CL 'A'*	USD		12 872		12 872	2 277 046	0,12	
VERISIGN INC COM*	USD	1 482	24 506		25 988	5 253 840	0,29	
VERISK ANALYTICS I CL A USD0.001*	USD		18 617		18 617	3 764 688	0,20	
VERTEX PHARMACEUTI COM USD0.01*	USD		12 279		12 279	3 865 875	0,21	
VICI PPTYS INC COM USD0.01*	USD		106 588		106 588	2 997 132	0,16	57 100
VORNADO REALTY TR COM USD0.04*	USD	41 483		41 483				
WABTEC CORP COM*	USD		36 886		36 886	3 619 117	0,20	
WASTE CONNECTIONS COM NPV (POST REV SPLT)*	CAD	40 827			40 827	5 226 105	0,28	
WASTE CONNECTIONS COM NPV (POST REV SPLT)*	USD	56 663	5 808	32 053	30 418	3 889 620	0,21	
WATERS CORP COM*	USD		4 673		4 673	1 114 324	0,06	4 673
WEC ENERGY GROUP COM USD0.01*	USD		69 038		69 038	5 450 130	0,30	33 682
WESTERN UN CO COM*	USD	277 554	13 384	126 776	164 162	1 722 756	0,09	
WILLIS TOWERS WATS COM USD0.000304635*	USD	7 232	1 258		8 490	1 788 759	0,10	
XCEL ENERGY INC COM*	USD		100 479		100 479	5 588 681	0,30	
ZOETIS INC COM USD0.01 CL 'A'*	USD	41 527	2 085	18 036	25 576	3 940 435	0,21	
Total Vereinigte Staaten						330 519 761	17,99	
Total Inhaberaktien						627 476 776	34,15	
Partizipationsscheine								
Schweiz								
LINDT & SPRUENGLI PTG CERT CHF10*	CHF	341	15	167	189	2 124 360	0,12	
Total Schweiz						2 124 360	0,12	
Total Partizipationsscheine						2 124 360	0,12	
Weitere Aktien								
Schweiz								
ROCHE HLDGS AG GENUSSSCHEINE NPV*	CHF	18 034	1 094	5 713	13 415	3 669 003	0,20	
Total Schweiz						3 669 003	0,20	
Vereinigte Staaten								
CAMDEN PROP TST SBI USD0.01*	USD	22 727		22 727				
Total Vereinigte Staaten							0,00	
Total Weitere Aktien						3 669 003	0,20	
Vorzugsaktien								
Deutschland								
BAYERISCHE MOTORENWERKE AG EUR1*	EUR	18 217		18 217				
DR.ING. F.PORSCHER NON-VTG PRF NPV*	EUR		7 997		7 997	887 884	0,05	
HENKEL AG&CO. KGAA NON-VTG PRF NPV*	EUR	5 557		5 557				
SARTORIUS AG NON VTG PRF NPV*	EUR		1 459		1 459	451 575	0,02	1 459
Total Deutschland						1 339 459	0,07	
Total Vorzugsaktien						1 339 459	0,07	
Namensaktien								
Argentinien								
MERCADOLIBRE INC COM STK USD0.001*	USD		2 189		2 189	2 319 907	0,13	
Total Argentinien						2 319 907	0,13	
Belgien								
KBC GROUP NV NPV*	EUR	93 568	1 333	78 555	16 346	1 019 826	0,06	
UCB NPV*	EUR	91 247	4 905	35 976	60 176	4 769 329	0,26	
WAREHOUSES DE PAUW NPV (POST SPLIT)*	EUR		16 493		16 493	404 387	0,02	
Total Belgien						6 193 542	0,34	
Finnland								
ELISA OYJ NPV*	EUR	138 718	7 309	56 378	89 649	4 282 401	0,23	
FORTUM OYJ EUR3.40*	EUR	49 171	3 435	10 463	42 143	504 511	0,03	31 271
METSO CORPORATION RG*	EUR	245 403		245 403				
NESTE OIL OYJ NPV*	EUR		12 716		12 716	437 634	0,02	2 651
NOKIA OYJ NPV*	EUR	306 391	22 216	56 096	272 511	1 020 197	0,06	
NORDEA HOLDING ABP NPV*	EUR	9 788		9 788				
ORION CORP SER'B'NPV*	EUR		65 732		65 732	2 439 309	0,13	
SAMPO PLC SER'A'NPV*	EUR	145 431	6 620	70 846	81 205	3 259 221	0,18	5 000
STORA ENSO OYJ NPV SER'R'*	EUR	114 593	4 574	63 066	56 101	581 805	0,03	56 101
UPM-KYMMENE CORP NPV*	EUR	39 064	1 854	18 164	22 754	605 649	0,03	
Total Finnland						13 130 727	0,71	
Frankreich								
DASSAULT AVIATION EURO.80 (POST SUBDIVISION)*	EUR		4 111		4 111	735 910	0,04	
DASSAULT SYSTEMES EURO.10*	EUR		62 416		62 416	2 474 955	0,13	
GECINA EUR7.50*	EUR	15 245	443	10 246	5 442	518 160	0,03	
LA FRANCAISE DES EURO.40 (PROMESSES)*	EUR		28 574		28 574	1 005 157	0,05	
MICHELIN (CGDE) EURO.50 (POST SUBDIVISION)*	EUR	49 819	3 100	14 885	38 034	1 004 564	0,05	10 881
Total Frankreich						5 738 745	0,31	
Deutschland								
ADIDAS AG NPV (REGD)*	EUR		6 273		6 273	1 088 519	0,06	
ALLIANZ SE NPV(REGD)(VINKULIERT)*	EUR	7 545	1 604		9 149	1 903 876	0,10	
BASF SE NPV*	EUR	20 179	1 736	621	21 294	924 277	0,05	21 294
BRENTNAG AG*	EUR	34 116	637	26 931	7 822	545 122	0,03	5 563
DAIMLER TRUCK HOLD NPV (YOUNG SHARE)*	EUR	21 595	1 334	6 561	16 368	527 215	0,03	
DELIVERY HERO SE NPV*	EUR		12 645		12 645	498 691	0,03	

Titel		31.12.2022 Anzahl/ Nominal	Käufe ¹	Verkäufe ²	30.6.2023 Anzahl/ Nominal	Verkehrswert ³ in CHF	in % ³	Davon ausgeliehen Anzahl/Nominal
DEUTSCHE BANK AG NPV(REGD)*	EUR		64 767		64 767	608 018	0,03	
DEUTSCHE BOERSE AG NPV(REGD)*	EUR	36 013	1 813	15 582	22 244	3 671 423	0,20	22 244
DEUTSCHE LUFTHANSA ORD NPV (REGD)(VINK)*	EUR		66 581		66 581	609 516	0,03	
DEUTSCHE POST AG NPV(REGD)*	EUR	34 270		34 270				
DEUTSCHE TELEKOM NPV(REGD)*	EUR	415 303	17 840	214 307	218 836	4 266 829	0,23	
E.ON SE NPV*	EUR		198 569		198 569	2 263 770	0,12	
EVONIK INDUSTRIES NPV*	EUR	44 727	3 596	4 215	44 108	750 400	0,04	44 108
HANNOVER RUECKVERS ORD NPV(REGD)*	EUR	35 745	594	29 059	7 280	1 381 001	0,08	
INFINEON TECHNOLOG AG NPV (REGD)*	EUR		14 448		14 448	532 850	0,03	
LEG IMMOBILIEN SE NPV*	EUR		13 208		13 208	678 627	0,04	7 366
MERCEDES-BENZ ORD NPV(REGD)*	EUR	43 192	1 528	25 981	18 739	1 347 457	0,07	18 739
MTU AERO ENGINES H NPV (REGD)*	EUR	4 958	228	2 391	2 795	647 650	0,04	2 795
SCOUT24 AG NPV*	EUR		10 099		10 099	572 510	0,03	
SIEMENS AG NPV(REGD)*	EUR	12 043	622	5 047	7 618	1 134 234	0,06	
SIEMENS ENERGY AG NPV*	EUR	6 023	46 565		52 588	830 507	0,05	28 728
SIEMENS HEALTHINEE NPV*	EUR	62 291	3 066	27 750	37 607	1 903 615	0,10	37 607
TE CONNECTIVITY LT COM CHF0.57*	USD		18 916		18 916	2 371 956	0,13	
TELEFONICA DEUTSCH NPV*	EUR	1 484 330	45 038	976 914	552 454	1 389 596	0,08	
UNIPER SE NPV*	EUR		86 544		86 544			
UNITED INTERNET AG NPV(REGD)*	EUR	28 012	21 466		49 478	622 988	0,03	33 381
VITESCO TECHNOLOGI NPV*	EUR		1 990		1 990			
VONOVIA SE NPV*	EUR	100 005	1 335	84 961	16 379	286 086	0,02	
Total Deutschland						31 356 731	1,71	
Irland								
CRH ORD EURO.32*	EUR		18 814		18 814	927 364	0,05	
KINGSPAN GROUP ORD EURO.13(DUBLIN LISTING)*	EUR		11 179		11 179	664 505	0,04	
MEDTRONIC PLC USD0.0001*	USD	31 792	1 998	9 276	24 514	1 932 161	0,11	
SMURFIT KAPPA GRP ORD EURO.001*	EUR		15 187		15 187	452 561	0,02	
Total Irland						3 976 591	0,22	
Italien								
CNH INDUSTRIAL NV COM EURO.01*	EUR	128 928	3 063	94 428	37 563	484 146	0,03	2 850
DAVIDE CAMPARI MIL EURO.01*	EUR		105 488		105 488	1 306 600	0,07	105 488
ENEL EUR1*	EUR		373 101		373 101	2 246 201	0,12	
ENI SPA EUR1*	EUR	162 221	94 947		257 168	3 308 843	0,18	195 072
FERRARI NV EURO.01(NEW)*	EUR		20 704		20 704	6 052 419	0,33	
IVECO GROUP NV EUR1*	EUR	25 786		25 786				
MEDIOBANCA SPA EURO.5*	EUR	128 923	5 609	65 736	68 796	735 956	0,04	
MONCLER SPA NPV*	EUR	35 031	1 006	23 696	12 341	762 968	0,04	
NEXI SPA NPV*	EUR		62 001		62 001	434 632	0,02	
PRYSMIAN SPA EURO.10*	EUR		22 582		22 582	843 747	0,05	
RECORDATI EURO.125*	EUR		43 688		43 688	1 865 598	0,10	29 862
SNAM EUR1*	EUR		510 463		510 463	2 385 095	0,13	
TERNA SPA ORD EURO.22*	EUR	424 332	32 749	55 373	401 708	3 060 673	0,17	1 350
UNICREDIT SPA NPV (POST REV SPLIT)*	EUR	130 314	5 309	70 498	65 125	1 351 733	0,07	47 813
Total Italien						24 838 612	1,35	
Japan								
AEON CO LTD NPV*	JPY	22 203		22 203				
AJINOMOTO CO INC NPV*	JPY	23 931	1 300	4 300	20 931	741 600	0,04	
ALPS ALPINE CO LTD NPV*	JPY	20 584		20 584				
ASAHI GROUP HLDGS NPV*	JPY	21 308	1 100	4 600	17 808	614 416	0,03	
ASAHI KASEI CORP NPV*	JPY	30 515		30 515				
ASTELLAS PHARMA NPV*	JPY	102 380	5 000	24 600	82 780	1 101 139	0,06	
BRIDGESTONE CORP NPV*	JPY	21 751	1 200	3 200	19 751	720 331	0,04	
CANON INC NPV*	JPY	34 757	2 200	700	36 257	850 572	0,05	
CASIO COMPUTER CO NPV*	JPY	25 459		25 459				
DENSO CORP NPV*	JPY	21 661	1 200	2 700	20 161	1 203 634	0,07	
DENTSU GROUP INC NPV*	JPY	20 584	1 200	1 900	19 884	580 071	0,03	
FUJII FILM HLD CORP NPV*	JPY	20 584	1 300	800	21 084	1 114 659	0,06	
FUJITSU NPV*	JPY		3 800		3 800	437 381	0,02	
HITACHI CONST MACH NPV*	JPY	21 670	2 800		24 470	610 104	0,03	
HONDA MOTOR CO NPV*	JPY	50 376	3 100	2 600	50 876	1 367 045	0,07	
HOYA CORP NPV*	JPY		9 700		9 700	1 025 209	0,06	
ITOCHU CORP NPV*	JPY	31 953	1 300	12 000	21 253	748 141	0,04	
JAPAN TOBACCO INC NPV*	JPY	21 037	4 400		25 437	496 444	0,03	
KDDI CORP NPV*	JPY	142 916	7 400	28 500	121 816	3 355 401	0,18	
KEYENCE CORP NPV*	JPY		2 100		2 100	881 961	0,05	
KONAMI HOLDINGS CORP NPV*	JPY	19 499	1 000	3 900	16 599	772 748	0,04	
KUBOTA CORP NPV*	JPY	26 173		26 173				
KYOCERA CORP NPV*	JPY	45 772	2 200	11 200	36 772	1 773 334	0,10	
KYOWA KIRIN CO LTD NPV*	JPY	18 695	3 200		21 895	361 043	0,02	
MARUBENI CORP NPV*	JPY		33 000		33 000	498 407	0,03	
mitsubishi corp npv*	JPY		1 100	9 900	18 649	799 961	0,04	
mitsubishi elec cp npv*	JPY		52 600		52 600	659 963	0,04	
mitsubishi estate npv*	JPY	28 163		28 163				
mitsubishi ufj fin npv*	JPY	92 449		92 449				
mitsui & co npv*	JPY	39 722	1 400	17 800	23 322	781 130	0,04	
MURATA MFG CO NPV*	JPY		15 600		15 600	795 282	0,04	
NEXON CO LTD NPV*	JPY		39 200		39 200	666 538	0,04	
NGK INSULATORS NPV*	JPY	39 541	2 100	6 000	35 641	378 130	0,02	
NIKON CORP NPV*	JPY	23 570		23 570				
NINTENDO CO LTD NPV*	JPY		20 800		20 800	842 275	0,05	
NIPPON YUSEN KK NPV*	JPY		20 200		20 200	398 862	0,02	20 200
NTT DATA CORP NPV*	JPY	106 070	5 400	23 700	87 770	1 090 369	0,06	
OMRON CORP NPV*	JPY	23 570	900	10 700	13 770	747 334	0,04	9 700
ORIX CORP NPV*	JPY		37 400		37 400	604 795	0,03	
OTSUKA HLDGS CO NPV*	JPY	19 138	1 100	1 400	18 838	614 622	0,03	
SEIKO EPSON CORP NPV*	JPY	45 592	2 900	600	47 892	663 739	0,04	10 800
SEVEN & I HOLDINGS NPV*	JPY	20 947	1 400	500	21 847	839 100	0,05	
SHIZUOKA FINANCIAL NPV*	JPY	47 672		47 672				
SOFTBANK CORP NPV*	JPY		45 800		45 800	436 583	0,02	
SOFTBANK GROUP CO NPV*	JPY	135 237	6 900	28 900	113 237	4 747 332	0,26	
SONY GROUP CORPORA NPV*	JPY	21 579	1 400	1 000	21 979	1 763 846	0,10	
SUBARU CORPORATION NPV*	JPY	21 841		21 841				
SUMITOMO CORP NPV*	JPY	48 566		48 566				

Titel		31.12.2022 Anzahl/ Nominal	Käufe ¹	Verkäufe ²	30.6.2023 Anzahl/ Nominal	Verkehrswert ³ in CHF	in % ³	Davon ausgeliehen Anzahl/Nominal
SUMITOMO ELECTRIC NPV*	JPY		44 600		44 600	485 050	0,03	
SUMITOMO PHARMA CO NPV*	JPY	16 333		16 333				
SUMITOMO RLTY&DEV NPV*	JPY	22 022	1 200	3 500	19 722	433 737	0,02	
TAKEDA PHARMACEUTI NPV*	JPY	19 409	2 200		21 609	605 516	0,03	
TDK CORP NPV*	JPY	58 327	3 400	6 100	55 627	1 916 845	0,10	
TOKIO MARINE HLDG NPV*	JPY	40 347	2 800		43 147	885 349	0,05	
TOKYO ELECTRON NPV*	JPY	21 751	57 953	22 851	56 853	7 235 302	0,39	
TOYO SEIKAN GROUP NPV*	JPY	22 565		22 565				
TOYOTA MOTOR CORP NPV*	JPY	112 575	6 400	13 000	105 975	1 514 305	0,08	
TREND MICRO INC NPV*	JPY	19 318	3 100		22 418	963 716	0,05	
YAMAHA MOTOR CO NPV*	JPY	20 856	5 500		26 356	672 462	0,04	
YASKAWA ELEC CORP NPV*	JPY	19 852	1 200	1 100	19 952	813 000	0,04	19 952
YOKOGAWA ELECTRIC NPV*	JPY	19 680		19 680				
Total Japan						51 608 780	2,81	
Luxemburg								
ARCELORMITTAL NPV(POST STOCK SPLIT)*	EUR	84 533	3 080	49 832	37 781	919 335	0,05	
EUROFINS SCIENTIFI EURO.01*	EUR		19 321		19 321	1 096 811	0,06	19 321
TENARIS S.A. USD1*	EUR		37 520		37 520	502 269	0,03	
Total Luxemburg						2 518 415	0,14	
Niederlande								
ADYEN NV EURO.01*	EUR		357		357	552 579	0,03	357
ASML HOLDING NV EURO.09*	EUR		1 245		1 245	805 677	0,04	
JDE PEETS N.V. EURO.01*	EUR		60 321		60 321	1 604 990	0,09	60 321
PROSUS N.V. EURO.05*	EUR		19 383		19 383	1 269 656	0,07	
SHELL PLC ORD EURO.07*	GBP		126 455		126 455	3 369 255	0,18	
UNIVERSAL MUSIC GR EURO10.00*	EUR		36 363		36 363	722 274	0,04	36 363
Total Niederlande						8 324 431	0,45	
Portugal								
GALP ENERGIA EUR1-B*	EUR	127 413	5 622	64 073	68 962	721 577	0,04	
JERONIMO MARTINS EUR5*	EUR		139 529		139 529	3 437 413	0,19	
Total Portugal						4 158 990	0,23	
Spanien								
BANCO SANTANDER SA EURO.50(REGD)*	EUR	538 379	17 016	346 667	208 728	689 632	0,04	
BANKINTER SA EURO.3(REGD)*	EUR	628 501		628 501				
BBVA(BILB-VIZ-ARG) EURO.49*	EUR		118 561		118 561	813 764	0,04	
LINEA DIRECTA SA EURO.04*	EUR	673 767		673 767				
MAPFRE SA EURO.10*	EUR	853 762		853 762				
Total Spanien						1 503 396	0,08	
Schweiz								
ABB LTD CHF0.12 (REGD)*	CHF	60 527		60 527				
ACCELERON INDUSTR CHF1*	CHF	3 026		3 026				
ADECCO GROUP AG CHF0.1 (REGD)*	CHF	17 419	8 010		25 429	743 290	0,04	25 429
ALCON AG CHF0.04*	CHF	16 696	6 579		23 275	1 724 678	0,09	
BACHEM HOLDING AG CHF0.01 (REGD) (SUBD)*	CHF		6 235		6 235	486 330	0,03	6 234
BALOISE-HLDGS CHF0.1(REGD)*	CHF	5 648		5 648				
BARRY CALLEBAUT AG CHF0.02 (REGD)*	CHF		1 291		1 291	2 229 557	0,12	
BKW AG CHF2.5*	CHF		10 663		10 663	1 684 754	0,09	10 662
BQE CANT VAUDOISE CHF1*	CHF		22 976		22 976	2 171 232	0,12	22 975
CLARIANT CHF4.00(REGD)*	CHF		63 368		63 368	818 715	0,04	
COCA-COLA HBC AG ORD CHF6.70*	GBP		36 344		58 740	1 566 733	0,09	
CREDIT SUISSE GRP CHF0.04(REGD)*	CHF	95 301		95 301				
DSM FIRMENICH AG EURO.01*	EUR		22 495		22 495	2 165 354	0,12	
EMS-CHEMIE HLDG AG CHF0.01(REGD)(POST RECON)*	CHF		4 170		4 170	2 823 090	0,15	
GEBERIT CHF0.10(REGD)*	CHF	2 572	2 226		4 798	2 245 944	0,12	
GIVAUDAN AG CHF10*	CHF		1 111		1 111	3 294 115	0,18	
JULIUS BAER GRUPPE CHF0.02 (REGD)*	CHF		22 967		22 967	1 293 961	0,07	
KUEHNE&NAGEL INTL CHF1(REGD)(POST-SUBD)*	CHF	37 287	1 154	24 279	14 162	3 748 681	0,20	
LINDT & SPRUENGLI CHF100(REGD)*	CHF	63		56	7	777 000	0,04	
LONZA GROUP AG CHF1(REGD)*	CHF	3 133	131	1 655	1 609	858 241	0,05	
NESTLE SA CHF0.10(REGD)*	CHF	35 469	2 714	4 894	33 289	3 581 896	0,19	
NOVARTIS AG CHF0.50(REGD)*	CHF		52 444		52 444	4 719 960	0,26	
PARTNERS GROUP HLG CHF0.01 (REGD)*	CHF	2 201		2 201				
RICHEMONT(CIE FIN) CHF1.00 (REG) SER 'A'*	CHF	11 605		11 605				
SCHINDLER-HLDG AG CHF0.1(REGD)(POST-SUBD)*	CHF	7 095	8 809		15 904	3 196 704	0,17	
SGS SA CHF0.04*	CHF		34 350		34 350	2 904 636	0,16	
SIKA AG CHF0.01 (REG)*	CHF	5 077	287	1 837	3 527	901 854	0,05	
STRAUMANN HLDG CHF0.01 (REGD) (POST SPLIT)*	CHF	12 201	615	5 277	7 539	1 094 286	0,06	
SWATCH GROUP CHF0.45(REGD)*	CHF	29 851	5 214		35 065	1 723 445	0,09	
SWISS PRIME SITE CHF15.3 (REGD)*	CHF	38 099	12 112		50 211	3 898 884	0,21	50 210
SWISSCOM AG CHF1(REGD)*	CHF	9 582	651	2 252	7 981	4 451 802	0,24	
TEMENOS AG CHFS (REGD)*	CHF	5 104		5 104				
UBS GROUP CHF0.10 (REGD)*	CHF	69 468	5 141	11 552	63 057	1 141 016	0,06	
VAT GROUP AG CHF0.10*	CHF		3 846		3 846	1 423 020	0,08	3 845
ZURICH INSURANCE GRP CHF0.10*	CHF	10 731	1 839		12 570	5 340 993	0,29	
Total Schweiz						63 010 170	3,43	
Grossbritannien								
ADMIRAL GROUP ORD GBPO.001*	GBP	46 801	3 446	7 972	42 275	1 001 112	0,05	
AMCOR PLC ORD USD0.01*	USD		295 479		295 479	2 638 216	0,14	295 479
ANGLO AMERICAN USD0.54945*	GBP	32 543	1 906	11 074	23 375	593 689	0,03	
ANTOFAGASTA ORD GBPO.05*	GBP	83 855	3 506	44 352	43 009	714 707	0,04	
ASHTED GROUP ORD GBPO.10*	GBP	45 951	1 117	33 356	13 712	849 058	0,05	
AUTO TRADER GROUP ORD GBPO.01*	GBP	126 833		126 833				
AVIVA ORD GBPO.33*	GBP	170 477	95 284		265 761	1 194 611	0,07	
BARCLAYS ORD GBPO.25*	GBP	780 808	63 100	69 907	774 001	1 350 295	0,07	
BERKELEY GP HLDGS ORD GBPO.053943*	GBP		24 853		24 853	1 108 959	0,06	
BP ORD USD0.25*	GBP	853 123		853 123				
BUNZL ORD GBPO.32142857*	GBP		32 160		32 160	1 097 011	0,06	
BURBERRY GROUP ORD GBPO.0005*	GBP	45 058	8 775		53 833	1 298 084	0,07	
COMPASS GROUP ORD GBPO.1105*	GBP	214 464		214 464				
CRODA INTL ORD GBPO.10609756*	GBP	15 239	12 703		27 942	1 788 033	0,10	

Titel		31.12.2022 Anzahl/ Nominal	Käufe ¹	Verkäufe ²	30.6.2023 Anzahl/ Nominal	Verkehrswert ³ in CHF	in % ³	Davon ausgeliehen Anzahl/Nominal
DIAGEO ORD GBPO.28 101/108*	GBP	130 570		130 570				
DOWLAIS GROUP PLC ORD GBPO.01*	GBP		172 134		172 134	248 650	0,01	
EXPERIAN ORD USDO.10*	GBP	62 361		62 361				
FERGUSON PLC (NEW) ORD GBPO.10*	GBP	12 612		12 612				
HALEON PLC ORD GBP1.25*	GBP	198 754	82 699		281 453	1 031 614	0,06	
HSBC HLDGS ORD USDO.50(UK REG)*	GBP	484 458	398 991		883 449	6 247 131	0,34	
INTERCONTL HOTELS ORD GBPO.208521303*	GBP	25 420	1 676	6 549	20 547	1 269 949	0,07	
JD SPORTS FASHION ORD GBPO.0005*	GBP		695 155		695 155	1 154 391	0,06	
LEGAL & GENERAL GP ORD GBPO.025*	GBP	354 319		354 319				
LIBERTY GLOBAL INC USDO.01 C*	USD		150 056		150 056	2 385 580	0,13	150 056
LONDON STOCK EXCH ORD GBPO.06918604*	GBP		17 660		17 660	1 680 455	0,09	
M&G PLC ORD GBPO.05*	GBP	41 098		41 098				
MELROSE INDUST PLC ORD GBPO.22857142*	GBP		172 134		172 134	991 076	0,05	
MELROSE INDUST PLC ORD GBPO.076190476*	GBP		516 402	516 402				
MONDI ORD EURO.20*	GBP	39 048		39 048				
NATWEST GROUP PLC ORD GBP1.0769*	GBP	475 981		475 981				
PHOENIX GP HLDGS ORD GBPO.10*	GBP		411 005		411 005	2 486 072	0,14	
PRUDENTIAL ORD GBPO.05*	GBP	41 098		41 098				
RIO TINTO ORD GBPO.10*	GBP	56 797	3 389	18 620	41 566	2 357 031	0,13	
SAINSBURY(J) ORD GBPO.28571428*	GBP		640 316		640 316	1 959 138	0,11	
SCHRODERS PLC ORD GBPO.20*	GBP	145 086	120 324		265 410	1 320 125	0,07	
SMITH & NEPHEW ORD USDO.20*	GBP	78 466	5 904	11 942	72 428	1 044 586	0,06	
STELLANTIS N V COM EURO.01*	EUR		96 785		96 785	1 519 995	0,08	
TESCO ORD GBPO.0633333*	GBP	284 919	642 209		927 128	2 619 447	0,14	
UNILEVER PLC ORD GBPO.031111*	GBP	10 215	6 778	7 031	9 962	464 284	0,03	
UNILEVER PLC ORD GBPO.031111*	EUR	73 190			73 190	3 408 310	0,19	
VODAFONE GROUP ORD USDO.2095238(POST CONS)*	GBP		956 873		956 873	805 060	0,04	
Total Grossbritannien						46 626 665	2,54	
Vereinigte Staaten								
ABBOTT LABS COM*	USD	36 206	2 735	5 389	33 552	3 272 486	0,18	
ABBVIE INC COM USDO.01*	USD		51 158		51 158	6 166 391	0,34	
ACCENTURE PLC SHS CL A 'NEW'*	USD	34 871	2 686	4 618	32 939	9 093 506	0,49	
ACTIVISION BLIZZARD COM STK USDO.000001*	USD		71 035		71 035	5 357 388	0,29	
ADOBE INC COM USDO.0001*	USD	8 337	554	2 090	6 801	2 975 267	0,16	
ADVANCED MICRO DEV COM USDO.01*	USD		34 473		34 473	3 513 129	0,19	
AES CORP COM*	USD	169 492		169 492				
AGILENT TECHNOLOGIES INC COM*	USD	38 856		38 856				
AGNC INV CORP COM USDO.01*	USD	175 057		175 057				
AIR PRODS & CHEMS COM USD1*	USD		7 569		7 569	2 028 299	0,11	
AIRBNB INC USDO.0001 A*	USD		19 572		19 572	2 244 093	0,12	
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQ INC COM*	USD	20 503	1 711	1 222	20 992	2 131 398	0,12	
ALLEGION PLC CIM USDO.01*	USD		22 556		22 556	2 421 971	0,13	
ALLSTATE CORP COM*	USD	63 656		63 656				
ALLY FINANCIAL INC COM USDO.01*	USD		138 649		138 649	3 350 383	0,18	
ALPHABET INC CAP STK USDO.001 CL A*	USD	88 567		88 567				
ALTRIA GROUP INC COM USDO.3333333*	USD		48 257		48 257	1 955 743	0,11	
AMAZON COM INC COM USDO.01*	USD		20 768		20 768	2 422 101	0,13	
AMER EXPRESS CO COM USDO.20*	USD	18 944		18 944				
AMER FINL GP OHIO COM NPV*	USD	23 614	7 354		30 968	3 290 031	0,18	
AMEREN CORP COM*	USD		37 916		37 916	2 770 373	0,15	37 881
AMETEK INC COM USDO.01*	USD		24 591		24 591	3 561 415	0,19	
AMGEN INC COM USDO.0001*	USD	18 032	1 326	3 095	16 263	3 230 323	0,18	
AMPHENOL CORP NEW CL A*	USD		91 657		91 657	6 965 979	0,38	
ANNALY CAPITAL MGT COM USDO.01(POST REV SPLT)*	USD	117 391		117 391				
AON PLC COM USDO.01 CL A*	USD	17 879	1 544	491	18 932	5 846 830	0,32	
APPLE INC COM NPV*	USD		38 282		38 282	6 643 277	0,36	
ARAMARK COM USDO.01*	USD		60 864		60 864	2 344 158	0,13	
ARCHER DANIELS MIDLAND CO COM*	USD	72 044		72 044				
ARES MANAGEMNT COR COM USDO.01 CLASS A*	USD		34 362		34 362	2 961 988	0,16	8 888
ASPEN TECHNOLOGY COM USDO.10*	USD		9 090		9 090	1 363 066	0,07	5 233
ASSURANT INC COM*	USD	2 834	43 121		45 955	5 168 807	0,28	
AT&T INC COM USD1*	USD	192 688	30 839		223 527	3 189 656	0,17	
AUTO DATA PROCESS COM USDO.10*	USD	37 787	2 306	11 800	28 293	5 563 398	0,30	
AUTODESK INC COM USDO.01*	USD	14 268	1 110	1 753	13 625	2 494 115	0,14	3 000
AUTOZONE INC COM USDO.01*	USD		2 297		2 297	5 123 882	0,28	2 297
AVALONBAY COMMUNI COM USDO.01*	USD	30 774	972	19 822	11 924	2 019 096	0,11	
AVANTOR INC COM USDO.01*	USD		116 262		116 262	2 136 443	0,12	
AVERY DENNISON CORP COM*	USD	23 280		23 280				
AXALTA COATING SYS COM USD1.00*	USD	101 321		101 321				
BALL CORP COM NPV*	USD	42 384	3 151	6 896	38 639	2 012 225	0,11	19 497
BECTON DICKINSON COM USD1*	USD	13 154	4 418		17 572	4 150 446	0,23	17 572
BENTLEY SYSTEMS IN COM USDO.01 CLASS B*	USD		65 934		65 934	3 198 911	0,17	65 934
BEST BUY CO INC COM USDO.10*	USD		22 121		22 121	1 621 836	0,09	10 000
BK OF AMERICA CORP COM USDO.01*	USD	137 924		137 924				
BRISTOL-MYRS SQUIB COM STK USDO.10*	USD	37 500	57 386		94 886	5 428 700	0,30	
BROADCOM CORP COM USD1.00*	USD		7 981		7 981	6 193 625	0,34	
CAESARS ENT INC COM USDO.00001*	USD		62 225		62 225	2 837 479	0,15	4 500
CAPITAL ONE FINL COM USDO.01*	USD		23 449		23 449	2 294 435	0,12	23 449
CARLYLE GROUP INC COM USDO.01*	USD		73 951		73 951	2 113 820	0,12	41 511
CATERPILLAR INC DEL COM*	USD		9 695		9 695	2 134 147	0,12	9 695
CBOE GLOBAL MARKET COM USDO.01*	USD	16 432	28 156		44 588	5 505 309	0,30	
CBRE GROUP INC CLASS 'A' USDO.01*	USD	46 992	2 048	23 916	25 124	1 814 134	0,10	
CELANESE CORP COM SERIES 'A' USDO.0001*	USD		45 036		45 036	4 665 751	0,25	
CENTERPOINT ENERGY INC COM*	USD	106 832		106 832				
CF INDS HLDGS INC COM*	USD		44 378		44 378	2 756 167	0,15	
CH ROBINSON WORLDW COM USDO.1*	USD		44 149		44 149	3 726 627	0,20	44 149
CHARTER COMMUN INC COM USDO.001 CLASS 'A'*	USD		4 591		4 591	1 508 913	0,08	4 591
CHESAPEAKE ENERGY COM USDO.01*	USD		27 419		27 419	2 052 705	0,11	27 419
CHEVRON CORP COM USDO.75*	USD	79 886		79 886				
CHUBB LIMITED ORD CHF24.15*	USD	44 308		44 308				
CHURCH & DWIGHT INC COM*	USD		63 869		63 869	5 727 182	0,31	
CIGNA CORP COM USDO.25*	USD		11 086		11 086	2 783 016	0,15	
CISCO SYSTEMS COM USDO.001*	USD		184 625		184 625	8 546 142	0,47	
CITIGROUP INC COM USDO.01*	USD	41 869		41 869				
CITIZENS FINL GP COM USDO.01*	USD		102 761		102 761	2 397 668	0,13	
CLOUDFLARE INC COM USDO.001 CL A*	USD		49 286		49 286	2 882 406	0,16	25 548
COGNIZANT TECHNOLO COM CL'A'USDO.01*	USD	38 100	27 680		65 780	3 841 733	0,21	

Titel		31.12.2022 Anzahl/ Nominal	Käufe ¹	Verkäufe ²	30.6.2023 Anzahl/ Nominal	Verkehrswert ³ in CHF	in % ³	Davon ausgeliehen Anzahl/Nominal	
COINBASE GLOBAL IN COM USD0.00001 CL A*	USD		26 096		26 096	1 670 463	0,09	25 315	
COMCAST CORP COM CLS'A' USD0.01*	USD	63 290	39 299		102 589	3 813 511	0,21		
CONAGRA BRANDS IN COM USD5*	USD		88 959		88 959	2 683 679	0,15		
CONSOLIDATED EDISON INC COM*	USD	62 595	22 226		84 821	6 860 014	0,37		
COOPER COS INC COM USD0.10*	USD		6 552		6 552	2 247 570	0,12		
CORNING INC COM USD0.50*	USD	84 626	6 361	12 949	78 038	2 446 377	0,13		
CORTEVA INC COM USD0.01*	USD	148 416	5 499	86 456	67 459	3 458 181	0,19		
COSTCO WHSL CORP NEW COM*	USD	20 587		20 587					
CROWN CASTLE INTL COM USD0.01*	USD	48 601	966	37 712	11 855	1 208 456	0,07		
CUMMINS INC COM*	USD	16 506		16 506					
DANAHER CORP COM USD0.01*	USD		34 797		34 797	7 471 473	0,41		
DARDEN RESTAURANTS INC COM*	USD	41 723	1 931	19 968	23 686	3 540 539	0,19	17 960	
DAVITA INC COM USD0.001*	USD		36 726		36 726	3 301 134	0,18	3 620	
DELL TECHNOLOGIES COM USD0.01 CL C*	USD		100 894		100 894	4 884 229	0,27	82 600	
DELTA AIRLINES INC COM USD0.0001*	USD		68 710		68 710	2 922 350	0,16		
DENTSPLY SIRONA IN COM NPV*	USD		79 765		79 765	2 855 898	0,16		
DIAMONDBACK ENERGY COM USD0.01*	USD	25 939	1 873	4 833	22 979	2 700 520	0,15	2 660	
DISCOVER FINL SVCS COM STK USD0.01*	USD	30 712		30 712					
DOLLAR GENERAL CP COM USD0.875*	USD		31 090		31 090	4 722 374	0,26		
DOMINOS PIZZA INC COM USD0.01*	USD		16 600		16 600	5 004 703	0,27		
DOORDASH INC COM USD0.00001 CLASS A*	USD		23 686		23 686	1 619 392	0,09	20 051	
DTE ENERGY CO COM*	USD		30 284		30 284	2 980 836	0,16		
DYNATRACE INC COM USD0.001*	USD		94 753		94 753	4 363 152	0,24		
EATON CORP PLC COM USD0.01*	USD	36 820		36 820					
EBAY INC COM USD0.001*	USD	78 783		78 783					
ELANCO ANIMAL HEAL COM NPV*	USD		136 888		136 888	1 232 017	0,07		
ELECTRONIC ARTS INC COM*	USD		56 598		56 598	6 567 411	0,36		
ELEVANCE HEALTH INC USD0.01*	USD	9 163	597	2 441	7 319	2 909 186	0,16		
ELI LILLY AND CO COM NPV*	USD	78 522	2 043	55 506	25 059	10 514 079	0,57		
EMBECTA CORPORATIO COM USD0.01*	USD	2 712		2 712					
EMERSON ELEC CO COM*	USD	47 370	2 227	22 282	27 315	2 208 893	0,12		
ENERGY CORP NEW COM*	USD		15 376		15 376	1 339 435	0,07		
EQUINIX INC COM USD0.001 NEW*	USD	5 475		5 475					
ESSENTIAL UTILS IN COM USD0.50*	USD		74 845		74 845	2 672 377	0,15		
ESTEE LAUDER COS CLASS'A'COM USD0.01*	USD		10 243		10 243	1 799 607	0,10		
EVERGY INC COM NPV*	USD	18 592		18 592					
EVERSOURCE ENERGY COM USD5*	USD		27 423		27 423	1 739 950	0,09	27 423	
EXPEDIA GROUP INC COM USD0.001*	USD	18 628		18 628					
EXTRA SPACE STORAG COM USD0.01*	USD		13 021		13 021	1 733 989	0,09	12 321	
EXXON MOBIL CORP COM NPV*	USD	125 931		125 931					
FED REALTY INV TR COM USD0.01*	USD	5 929		5 929					
FIDELITY NATL INF COM STK USD0.01*	USD	75 895		75 895					
FIRSTENERGY CORP COM USD0.10*	USD	82 278		82 278					
FISERV INC COM USD0.01*	USD	17 812	17 632		35 444	4 000 213	0,22		
FLEETCOR TECHNOLOG COM STK USD0.001*	USD	9 184	7 222		16 406	3 685 259	0,20		
FORTUNE BRANDS INNOVATIONS INC RG*	USD	65 579		65 579					
FOX CORP COM USD0.01 CL B*	USD	86 954	31 821		118 775	3 388 697	0,18		
GARMIN LTD COM CHF10.00*	USD		20 718		20 718	1 933 053	0,11		
GENERAL MILS INC COM*	USD		86 330		86 330	5 923 935	0,32		
GENERAL MOTORS CO COM USD0.01*	USD		84 795		84 795	2 925 233	0,16		
GILEAD SCIENCES COM USD0.001*	USD		126 052		126 052	8 691 371	0,47		
GLOBAL PAYMENTS COM NPV*	USD	52 534		52 534					
GODADDY INC COM CL A USD0.001*	USD		33 194		33 194	2 231 137	0,12	33 194	
GOLDMAN SACHS GRP COM USD0.01*	USD		12 595		12 595	3 634 418	0,20	12 595	
GSK PLC ORD GBPO.3125*	GBP	159 003	122 435		281 438	4 445 706	0,24		
HARTFORD FINL SVCS COM USD0.01*	USD	38 174		38 174					
HEALTHPEAK PPTYS I COM USD1*	USD	84 423	6 575		10 346	80 652	1 450 322	0,08	
HELMERICH & PAYNE COM USD0.10*	USD	60 763		60 763					
HERSHEY COMPANY COM USD1.00*	USD	44 482	2 608	15 096	31 994	7 147 271	0,39		
HEWLETT PACKARD EN COM USD0.01*	USD	200 769	13 216	51 872	162 113	2 436 578	0,13		
HF SINCLAIR CORPOR COM USD0.01*	USD		60 720		60 720	2 423 356	0,13		
HILTON WORLDWIDE H COM USD0.01*	USD	34 954		34 954					
HOLOGIC INC COM USD0.01*	USD		54 260		54 260	3 930 584	0,21		
HOME DEPOT INC COM USD0.05*	USD	47 368	1 990	24 957	24 401	6 781 381	0,37		
HORMEL FOODS CORP COM USD0.0586*	USD	94 535	87 564		182 099	6 552 436	0,36	15 570	
HOWMET AEROSPACE I COM USD1.00*	USD		89 234		89 234	3 956 533	0,22		
HUMANA INC COM USD0.166*	USD	11 005	419	6 290	5 134	2 053 728	0,11		
HUNTINGTON BANCSHARES INC COM*	USD	245 484		245 484					
INTL BUSINESS MCHN COM USD0.20*	USD	69 621	3 975		24 841	5 836 613	0,32		
INTL PAPER CO COM USD1.00*	USD	63 011	4 948		7 268	60 691	1 727 194	0,09	
INVESCO LTD COM STK USD0.20*	USD	125 034		125 034					
JAZZ PHARMA PLC COM USD0.0001*	USD	19 967		19 967					
JOHNSON CTLS INTL COM USD0.01*	USD		39 644		39 644	2 416 756	0,13		
KELLOGG CO COM USD0.25*	USD		83 015		83 015	5 005 756	0,27		
KEURIG DR PEPPER COM USD0.01*	USD		196 476		196 476	5 496 555	0,30	834	
KEYCORP NEW COM*	USD	213 822	10 889	91 148	133 563	1 104 107	0,06		
KEYSIGHT TECHNOLOG COM USD0.01 'WD'*	USD		38 443		38 443	5 759 113	0,31		
KIMBERLY-CLARK CP COM USD1.25*	USD		15 710		15 710	1 940 427	0,11		
KIMCO REALTY COM USD0.01*	USD	172 825		172 825					
KINDER MORGAN INC USD0.01*	USD		148 355		148 355	2 285 538	0,12	148 355	
KKR & CO INC COM NPV CLASS A*	USD	110 698		110 698					
KLA CORPORATION COM USD0.001*	USD		6 004		6 004	2 605 275	0,14		
KNIGHT SWIFT TRANS CL A COM STK USD0.01*	USD	82 382	2 225	57 318	27 289	1 356 448	0,07		
KROGER CO COM USD1*	USD		158 005		158 005	6 643 881	0,36		
KYNDRYL HLDGS INC COM USD0.01 WI*	USD	13 924		13 924					
L3HARRIS TECHNOLOG COM USD1.00*	USD		8 075		8 075	1 414 301	0,08		
LAB CORP AMER HLDG COM USD0.1*	USD	18 252	638	11 049	7 841	1 692 918	0,09		
LAM RESEARCH CORP COM USD0.001*	USD		5 758		5 758	3 311 626	0,18		
LAS VEGAS SANDS CORP COM*	USD		50 863		50 863	2 639 266	0,14	1 125	
LENNAR CORP COM CL'A'USD0.10*	USD	54 853		54 853					
LINCOLN NATL CORP COM NPV*	USD		85 337		85 337	1 966 692	0,11	52 903	
LQJ CORP COM*	USD	110 841		110 841					
LOWE'S COS INC COM USD0.50*	USD		6 768		6 768	1 366 612	0,07	6 768	
LULULEMON ATHLETIC COM STK USD0.01*	USD		6 543		6 543	2 215 624	0,12		
MARRIOTT INTL INC COM USD0.01 CLASS 'A'*	USD	23 113	1 834	2 451	22 496	3 696 953	0,20		
MASCO CORP COM*	USD	66 300		66 300					
MASTERBRAND INC COM USD0.01 WI*	USD	65 579		65 579					
MASTERCARD INC COM USD0.0001 CLASS 'A'*	USD	24 409	1 085	12 185	13 309	4 682 983	0,25		

Titel		31.12.2022 Anzahl/ Nominal	Käufe ¹	Verkäufe ²	30.6.2023 Anzahl/ Nominal	Verkehrswert ³ in CHF	in % ³	Davon ausgeliehen Anzahl/Nominal
MCCORMICK & CO INC COM NVTG NPV*	USD	81 711		81 711				
MCDONALD'S CORP COM USD0.01*	USD	31 979	2 697	1 593	33 083	8 832 251	0,48	
MCKESSON CORP COM USD0.01*	USD		8 825		8 825	3 373 735	0,18	
MERCK & CO INC COM USD0.50*	USD	106 594	6 637	31 815	81 416	8 404 872	0,46	
MICROCHIP TECHN LGY COM USD0.001*	USD	75 455	2 848	43 373	34 930	2 799 699	0,15	
MICROSOFT CORP COM USD0.0000125*	USD	48 949	2 973	15 464	36 458	11 107 444	0,60	
MODERNA INC COM USD0.0001*	USD		8 542		8 542	928 515	0,05	
MOLSON COORS BEVER COM USD0.01 CLASS B*	USD		48 009		48 009	2 827 910	0,15	
MONDELEZ INTL INC COM USD0.01*	USD	117 716	5 484	55 938	67 262	4 389 234	0,24	
MORGAN STANLEY COM STK USD0.01*	USD	58 419		58 419				
MOSAIC CO COM USD0.01*	USD		42 917		42 917	1 343 849	0,07	
MOTOROLA SOLUTIONS COM USD0.01*	USD		32 690		32 690	8 577 299	0,47	
NEKTAR THERAPEUTICS COM*	USD	36 707		36 707				
NETAPP INC COM USD0.001*	USD	39 065		39 065				
NETFLIX INC COM USD0.001*	USD	7 034	1 451		8 485	3 343 806	0,18	
NEWMONT CORPORATIO COM USD1.60*	USD	177 848	14 705	12 169	180 384	6 884 494	0,37	180 384
NIKE INC CLASS'B'COM NPV*	USD		18 973		18 973	1 873 442	0,10	434
NISOURCE INC COM NPV*	USD	111 902		111 902				
NORFOLK STHN CORP COM USD1*	USD		10 930		10 930	2 217 378	0,12	
NORTONLIFLOCK INC COM USD0.01*	USD	131 651	206 331		337 982	5 609 067	0,31	
NUCOR CORP COM*	USD		21 783		21 783	3 195 669	0,17	
NVR INC COM STK USD0.01*	USD		613		613	3 482 810	0,19	
OCCIDENTAL PETRLM COM USD0.20*	USD		39 632		39 632	2 084 858	0,11	39 632
OLD DOMINION FGHT LINES INC COM*	USD		20 036		20 036	6 627 845	0,36	
ON SEMICONDUCTOR COM USD0.01*	USD	161 176		161 176				
ONEOK INC*	USD	76 482		76 482				
ORACLE CORP COM USD0.01*	USD	96 928	7 149	16 374	87 703	9 344 217	0,51	
OREILLY AUTO NEW COM USD0.01*	USD		4 587		4 587	3 920 322	0,21	
ORGANON & CO COM USD0.01 WI*	USD	10 658		10 658				
OWENS CORNING COM STK USD0.01*	USD	53 826		53 826				
PACCAR INC COM STK USD1*	USD	42 506		42 506				
PACKAGING CORP AMER COM*	USD	26 777		26 777				
PARKER-HANNIFIN COM STK USD0.50*	USD	14 919		14 919				
PAYCHEX INC COM*	USD	75 942	18 644		94 586	9 466 592	0,52	
PAYPAL HOLDINGS IN COM USD0.0001*	USD	17 272		17 272				
Pfizer INC COM USD0.05*	USD	215 220	12 758	71 472	156 506	5 135 864	0,28	
PHILLIPS 66 COM USD0.01*	USD	2 439		2 439				
PINTEREST INC COM USD0.00001 CL A*	USD		98 732		98 732	2 414 958	0,13	
PPL CORP COM USD0.01*	USD	101 943	8 011	11 680	98 274	2 326 385	0,13	
PRINCIPAL FINL GP COM USD0.01*	USD	50 304	2 987	16 656	36 635	2 485 694	0,14	
PROCTER & GAMBLE COM NPV*	USD	42 959	19 867		62 826	8 528 893	0,46	
PROLOGIS INC COM USD0.01*	USD	128 280		128 280				
PRUDENTIAL FINL COM USD0.01*	USD	24 788		24 788				
QUEST DIAGNOSTICS INC COM*	USD		8 734		8 734	1 098 318	0,06	
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC COM*	USD	47 659	2 605	18 318	31 946	2 965 797	0,16	
RAYTHEON TECHNOLOG COM USD1.00*	USD		40 492		40 492	3 548 715	0,19	
REGENCY CENTERS COM USD0.01*	USD	43 124		43 124				
REGENERON PHARMACE COM USD0.001*	USD		7 458		7 458	4 794 314	0,26	
REGIONS FINANCIAL CORP NEW COM*	USD	239 734		239 734				
REINSURANCE GROUP COM USD0.01*	USD	21 231		21 231				
RENAISSANCE RE HLG COM USD1*	USD	13 408		13 408				
REPUBLIC SERVICES COM USD0.01*	USD	72 007	5 881	5 752	72 136	9 885 051	0,54	
ROBERT HALF INTL COM USD0.001*	USD		40 772		40 772	2 743 775	0,15	
ROBLOX CORPORATION COM USD0.0001 CL A*	USD		43 077		43 077	1 553 115	0,08	43 077
ROSS STORES INC COM USD0.01*	USD		24 281		24 281	2 435 800	0,13	
ROYAL CARIBBEAN GR COM USD0.01*	USD	20 464		20 464				
ROYALTY PHARMA PLC COM USD0.0001 CLASS A*	USD		56 825		56 825	1 562 775	0,09	
SALESFORCE.COM INC COM USD0.001*	USD	37 842		37 842				
SBA COMMUNICATIONS COM USD0.01 CL A*	USD		10 421		10 421	2 160 733	0,12	
SCHWAB(Charles)CP COM USD0.01*	USD	34 538		34 538		1 751 379	0,10	
SEAGEN INC COM USD0.001*	USD		36 859		36 859	6 346 543	0,35	
SEI INVESTMENT COM USD0.01*	USD	49 131		49 131		2 620 600	0,14	
SENSATA TECHNO PLC COM EURO.01*	USD	50 351		50 351		2 026 643	0,11	
SIGNATURE BK COM USD0.01*	USD		28 382		28 382	5 332	0,00	
SIMON PROP GROUP COM USD0.0001*	USD	38 839	2 512	10 542	30 809	3 183 007	0,17	
SIRIUS XM HLDGS IN COM USD0.001*	USD		574 848		574 848	2 329 724	0,13	574 848
SL GREEN RLTY CORP COM USD0.01(POST REV SPLT)*	USD	32 791		32 791				
SMUCKER(JM)CO COM NPV*	USD	19 839	5 342		25 181	3 326 737	0,18	
SQUARE INC COM USD0.0000001 CL A*	USD		31 021		31 021	1 847 513	0,10	
STANLEY BLACK & DE COM USD2.50*	USD	19 881	1 599	1 881	19 599	1 643 134	0,09	19 599
STARBUCKS CORP COM USD0.001*	USD	112 464		112 464				
STEEL DYNAMICS INC COM*	USD		24 333		24 333	2 371 354	0,13	
STERIS PLC ORD USD0.001*	USD	22 273	1 204	8 713	14 764	2 971 674	0,16	14 764
SYLVAMO CORPORATI COM USD1.00 WI*	USD		5 729		5 729			
SYSCO CORP COM USD1*	USD	69 444		69 444				
T-MOBILE US INC COM USD0.0001*	USD		55 945		55 945	6 952 111	0,38	
TARGET CORP COM STK USD0.0833*	USD	27 272	12 204		39 476	4 658 339	0,25	
TELEFLEX INC COM*	USD		8 512		8 512	1 843 122	0,10	1 529
TEXAS INSTRUMENTS COM USD1*	USD		55 598		55 598	8 954 330	0,49	36 639
THERMO FISHER SCIE COM USD1*	USD		3 207		3 207	1 496 975	0,08	
TJX COS INC COM USD1*	USD	82 758	3 310	45 470	40 598	3 079 658	0,17	
TOAST INC COM USD0.000001 CLASS A*	USD		65 941		65 941	1 331 497	0,07	65 941
TRACTOR SUPPLY CO COM USD0.008*	USD	22 972	1 032	11 339	12 665	2 505 227	0,14	12 665
TRANE TECHNOLOGIES COM USD1*	USD		14 176		14 176	2 425 666	0,13	
TRAVELERS CO INC COM NPV*	USD	44 245	3 633	3 308	44 570	6 924 614	0,38	
TYSON FOODS INC CL A*	USD		28 417		28 417	1 297 604	0,07	
U HAUL HOLDING COM COM USD0.25 SER N*	USD		45 383		45 383	2 057 298	0,11	30 801
UBER TECHNOLOGIES COM USD0.00001*	USD	91 600		91 600				
UGI CORP NEW COM*	USD	57 527		57 527				
UNITED RENTALS INC COM*	USD		5 545		5 545	2 209 407	0,12	
UNITEDHEALTH GRP COM USD0.01*	USD	12 931	5 086		18 017	7 747 392	0,42	
US BANCORP COM USD0.01*	USD	64 226		64 226				
VERIZON COMMUN COM USD0.10*	USD	162 313	109 072		271 385	9 029 531	0,49	
VF CORP COM NPV*	USD		115 978		115 978	1 980 773	0,11	
VIATRIS INC COM USD0.01*	USD	26 703	375 297		402 000	3 589 300	0,20	
VISA INC COM STK USD0.0001*	USD	39 461	2 270	13 881	27 850	5 917 052	0,32	27 850
VISTRA CORP COM USD0.01*	USD	113 481	79 516		192 997	4 532 450	0,25	
VOYA FINL INC COM USD0.01*	USD	54 723		54 723				

Titel		31.12.2022 Anzahl/ Nominal	Käufe ¹	Verkäufe ²	30.6.2023 Anzahl/ Nominal	Verkehrswert ³ in CHF	in % ³	Davon ausgeliehen Anzahl/Nominal
WALT DISNEY CO. DISNEY COM USD0.01*	USD	35 038	2 221	10 023	27 236	2 175 458	0,12	
WARNER BROS DISCOV COM USD0.01 SER A WI*	USD	147 271		147 271				
WASTE MGMT INC DEL COM*	USD	57 861	4 979	1 768	61 072	9 475 333	0,52	
WILLIAMS COS INC COM USD1*	USD		98 541		98 541	2 876 651	0,16	
WOLFSPEED INC COM USD0.00125*	USD		18 383		18 383	914 253	0,05	15 457
WORKDAY INC COM USD0.001 CL A*	USD	13 023	929	2 564	11 388	2 301 429	0,13	
XYLEM INC COM USD0.01 WI*	USD		31 423		31 423	3 166 040	0,17	
YUM BRANDS INC COM*	USD	61 198		61 198				
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC COM USD0.01*	USD		34 203		34 203	4 455 318	0,24	
ZIONS BANCORPORATI COM USD0.001*	USD	77 880		77 880				
Total Vereinigte Staaten						736 621 969	40,09	
Total Namensaktien						1 001 927 672	54,53	
Depository Receipts								
Niederlande								
ABN AMRO BANK N.V. DR EACH REP SHS*	EUR	132 860	4 049	87 243	49 666	689 830	0,04	
Total Niederlande						689 830	0,04	
Total Depository Receipts						689 830	0,04	
Investmentzertifikate, closed end								
Grossbritannien								
SEGRO PLC REIT*	GBP	258 663		258 663				
Total Grossbritannien							0,00	
Vereinigte Staaten								
EQUITY RESIDENTIAL SBI USD0.01*	USD		45 999		45 999	2 714 864	0,15	
VENTAS INC REIT*	USD		65 529		65 529	2 771 228	0,15	
Total Vereinigte Staaten						5 486 092	0,30	
Total Investmentzertifikate, closed end						5 486 092	0,30	
Anrechte								
Spanien								
ACS ACTIVIDADES (STOCK DIVIDEND) RIGHTS 23-03.02.23*	EUR		32 475	32 475				
EDP RENOVAVEIS SA RIGHTS 23-25.05.23*	EUR		52 429	52 429				
Total Spanien							0,00	
Total Anrechte							0,00	
Total Effekten, die an einer Börse gehandelt werden						1 642 713 191	89,41	
Effekten, die nicht an einer Börse oder einem andern geregelten Markt gehandelt werden								
Namensaktien								
Niederlande								
KONINKLIJKE DSM NV EUR1.5**	EUR	11 551	10 944	22 495				
Total Niederlande							0,00	
Schweiz								
SGS LTD CHF1(REGD)**	CHF	475	899	1 374				
Total Schweiz							0,00	
Grossbritannien								
LINDE PLC COM EURO.001**	EUR	1 731		1 731				
LINDE PLC COM EURO.001**	USD	12 368		12 368				
Total Grossbritannien							0,00	
Total Namensaktien							0,00	
Investmentzertifikate, open end								
Global								
SYZ AM CH LIQUIDITY MANAGEMENT-CHF-I3-DISTRIBUTION**	CHF	71 500		30 000	41 500	36 409 610	1,98	
Total Global						36 409 610	1,98	
Total Investmentzertifikate, open end						36 409 610	1,98	
Total Effekten, die nicht an einer Börse oder einem andern geregelten Markt gehandelt werden						36 409 610	1,98	
Total Wertschriften (davon ausgeliehen)						1 679 122 801	91,39	 218 852 363 (11,91)
Bankguthaben auf Sicht						102 303 048	5,57	
Derivative Finanzinstrumente						51 749 550	2,82	
Sonstige Vermögenswerte						4 128 492	0,22	
Gesamtfondsvermögen						1 837 303 891	100,00	
Kurzfristige Bankverbindlichkeiten						-742 975		
Andere Verbindlichkeiten						-938 664		
Nettofondsvermögen						1 835 622 252		

Bewertungskategorie	Verkehrswert per 30.6.2023	in % des Gesamt- fondsvermögens ³
Anlagen bewertet zu den Kursen, die am Hauptmarkt bezahlt werden	1 669 705 864	90,88
Anlagen bewertet aufgrund von am Markt beobachtbaren Parametern	61 166 487	3,33
Anlagen bewertet mit geeigneten Bewertungsmodellen unter Berücksichtigung der aktuellen Marktgegebenheiten	-	-
Total	1 730 872 351	94,21

¹ «Käufe» umfassen die Transaktionen: Gratistitel / Käufe / Konversionen / Namensänderungen / «Splits» / Stock-/Wahldividenden / Titelaufteilungen / Überträge / Umbuchungen infolge Redenominierung in Euro / Umtausch zwischen Gesellschaften / Zuteilung aus Bezugs-/Optionsrechten / Zuteilung von Bezugsrechten ab Basistiteln / Sacheinlagen

² «Verkäufe» umfassen die Transaktionen: Auslosungen / Ausbuchung infolge Verfall / Ausübung von Bezugs-/Optionsrechten / «Reverse splits» / Rückzahlungen / Überträge / Umbuchungen infolge Redenominierung in Euro / Umtausch zwischen Gesellschaften / Verkäufe / Sachauslagen

³ Allfällige Abweichungen in den Totalisierungen sind auf Rundungsdifferenzen zurückzuführen

* bewertet zu den Kursen, die am Hauptmarkt bezahlt werden (Art. 88 Abs. 1 KAG)

** bewertet aufgrund von am Markt beobachtbaren Parametern

Derivative Finanzinstrumente

Gemäss KKV-FINMA Art. 23

Am Ende der Berichtsperiode offene engagementreduzierende Derivate

Instrument	Anzahl Kontrakte	Währung	Gebundene Basiswerte in Obligationen/Aktien in CHF	Variation Margin in CHF	In % des Vermögens
Optionen/Warrants auf Indices/Commodities					
EURO STOXX 50 INDEX PUT 4050.00000 15.12.23*	1 750	EUR	-14 953 122	1 076 110	0.06
EURO STOXX 50 INDEX PUT 4100.00000 15.09.23*	1 750	EUR	-11 646 904	495 352	0.03
EURO STOXX 50 INDEX PUT 4100.00000 21.06.24*	1 750	EUR	-21 340 135	2 567 290	0.14
EURO STOXX 50 PUT 4000.00000 15.03.24*	1 750	EUR	-15 554 253	1 489 472	0.08
FTSE 100 INDEX PUT 7000.00000 15.09.23*	360	GBP	-3 824 069	131 030	0.01
FTSE 100 INDEX PUT 7100.00000 15.12.23*	360	GBP	-6 661 281	382 853	0.02
FTSE 100 INDEX PUT 7200.00000 21.06.24*	360	GBP	-8 789 190	872 169	0.05
NIKKEI 225 INDEX PUT 30000.00000 08.03.24*	120	JPY	-6 360 273	679 646	0.04
NIKKEI 225 INDEX PUT 30000.00000 08.09.23*	120	JPY	-2 489 874	144 842	0.01
NIKKEI 225 INDEX PUT 30000.00000 08.12.23*	120	JPY	-4 782 531	449 383	0.02
NIKKEI 225 INDEX PUT 30000.00000 14.06.24*	120	JPY	-7 173 797	950 761	0.05
S&P 500 INDEX PUT 4150.00000 21.06.24*	700	USD	-67 168 453	8 062 407	0.44
S&P 500 INDEX PUT 4200.00000 15.03.24*	750	USD	-74 653 734	7 115 151	0.39
S&P 500 INDEX PUT 4200.00000 15.09.23*	750	USD	-52 854 844	2 200 839	0.12
S&P 500 INDEX PUT 4200.00000 15.12.23*	750	USD	-69 278 665	4 871 369	0.27
SWISS MARKET INDEX PUT 10300.00000 15.09.23*	130	CHF	-1 158 486	36 660	0.00
SWISS MARKET INDEX PUT 10700.00000 15.12.23*	120	CHF	-3 167 505	169 560	0.00
SWISS MARKET INDEX PUT 10800.00000 21.06.24*	130	CHF	-5 205 854	512 200	0.02
			-377 062 970	32 207 094	1.75

Instrument	Anzahl Kontrakte	Währung	Gebundene Basiswerte in Obligationen/Aktien in CHF	Variation Margin in CHF	In % des Vermögens
Futures auf Indices/Commodities/Währungen					
NIKKEI 225 (OSE) INDEX FUTURE 07.09.23*	42	JPY	-8 623 328	-166 383	-0.01
SWISS MARKET INDEX FUTURE 15.09.23*	172	CHF	-19 482 440	61 920	0.00
			-28 105 768	-104 463	-0.01

Am Ende der Berichtsperiode offene engagementerhöhende Derivate

Instrument	Anzahl Kontrakte	Währung	Deckung in CHF	Variation Margin in CHF	In % des Vermögens
Optionen/Warrants auf Indices/Commodities					
EURO STOXX 50 INDEX PUT 3300.00000 15.03.24*	1 500	EUR	3 928 818	-390 913	-0.02
EURO STOXX 50 INDEX PUT 3300.00000 15.09.23*	1 500	EUR	1 094 916	-61 492	0.00
EURO STOXX 50 INDEX PUT 3300.00000 15.12.23*	1 500	EUR	2 705 087	-213 758	-0.01
EURO STOXX 50 INDEX PUT 3500.00000 21.06.24*	1 500	EUR	7 406 787	-887 241	-0.05
FTSE 100 INDEX PUT 6000.00000 15.09.23*	300	GBP	539 687	-23 886	0.00
FTSE 100 INDEX PUT 6000.00000 15.12.23*	300	GBP	1 207 871	-78 482	0.00
FTSE 100 INDEX PUT 6000.00000 21.06.24*	300	GBP	2 261 546	-232 032	-0.01
NIKKEI 225 INDEX PUT 26000.00000 08.03.24*	120	JPY	2 465 222	-252 546	-0.01
NIKKEI 225 INDEX PUT 26000.00000 08.09.23*	120	JPY	320 479	-25 997	0.00
NIKKEI 225 INDEX PUT 26000.00000 08.12.23*	120	JPY	1 577 742	-137 415	-0.01
NIKKEI 225 INDEX PUT 26000.00000 14.06.24*	120	JPY	3 229 441	-408 530	-0.02
S&P 500 INDEX PUT 3500.00000 15.03.24*	620	USD	19 501 546	-1 973 007	-0.11
S&P 500 INDEX PUT 3500.00000 15.09.23*	620	USD	5 924 520	-299 529	-0.02
S&P 500 INDEX PUT 3500.00000 15.12.23*	620	USD	14 070 736	-1 103 819	-0.06
S&P 500 INDEX PUT 3500.00000 21.06.24*	650	USD	24 585 963	-3 052 993	-0.17
SWISS MARKET INDEX PUT 8800.00000 15.09.23*	105	CHF	165 820	-6 930	0.00
SWISS MARKET INDEX PUT 9000.00000 15.12.23*	130	CHF	601 239	-35 750	0.00
SWISS MARKET INDEX PUT 9000.00000 21.06.24*	90	CHF	974 617	-91 980	-0.01
			92 562 037	-9 276 300	-0.50

Instrument	Anzahl Kontrakte	Währung	Deckung in CHF	Variation Margin in CHF	In % des Vermögens
Futures auf Indices/Commodities/Währungen					
EURO STOXX 50 INDEX FUTURE 15.09.23*	900	EUR	38 889 284	680 804	0.04
FTSE 100 INDEX FUTURE 15.09.23*	96	GBP	8 234 690	-46 406	0.00
S&P500 EMINI FUTURE 15.09.23*	566	USD	113 636 184	3 531 944	0.19
			160 760 158	4 166 342	0.23

Am Ende der Berichtsperiode offene Derivate auf Devisen

Verkauf Währung	Verkauf Betrag	Kauf Währung	Kauf Betrag	Fälligkeit	Wiederbeschaffungswert in CHF	In % des Vermögens
Devisentermingeschäfte**						
EUR	114 000 000	CHF	109 132 542	21.09.2023	-1 640 821	-0.09
USD	270 000 000	CHF	251 660 520	21.09.2023	12 162 375	0.66
GBP	67 500 000	CHF	72 986 400	21.09.2023	-3 148 884	-0.17
JPY	6 750 000 000	CHF	45 837 900	21.09.2023	3 884 335	0.21
EUR	30 000 000	CHF	29 334 570	21.09.2023	183 685	0.01
USD	100 000 000	CHF	90 388 100	21.09.2023	1 685 083	0.09
USD	30 000 000	CHF	27 090 324	21.09.2023	479 419	0.03
EUR	130 000 000	CHF	125 654 230	21.12.2023	1 378	0.00
USD	450 000 000	CHF	400 141 350	21.12.2023	5 095 643	0.28
EUR	30 000 000	CHF	29 229 282	21.12.2023	232 470	0.01
JPY	8 500 000 000	CHF	55 690 011	21.12.2023	2 592 390	0.14
USD	350 000 000	CHF	307 658 750	21.03.2024	3 229 804	0.18
					24 756 877	1.35

Obige Angaben können Rundungsdifferenzen enthalten.

* bewertet zu den Kursen, die am Hauptmarkt bezahlt werden (Art. 88 Abs. 1 KAG)

** bewertet aufgrund von am Markt beobachtbaren Parametern

Während der Berichtsperiode getätigte engagementreduzierende Derivate

Instrument	Währung	Käufe/ Kontrakte	Verkäufe/ Kontrakte
Optionen/Warrants auf Indices/Commodities			
EURO STOXX 50 PUT 3800.00000 15.09.23	EUR	0	1 750
EURO STOXX 50 INDEX PUT 4100.00000 15.09.23	EUR	1 750	0
SWISS MARKET INDEX PUT 10800.00000 21.06.24	CHF	130	0
EURO STOXX 50 INDEX PUT 4050.00000 15.12.23	EUR	1 750	0
EURO STOXX 50 PUT 3800.00000 17.03.23	EUR	0	1 750
EURO STOXX 50 INDEX PUT 4100.00000 17.03.23	EUR	1 750	1 750
EURO STOXX 50 PUT 3800.00000 16.06.23	EUR	0	1 750
SWISS MARKET INDEX PUT 11000.00000 16.06.23	CHF	0	130
EURO STOXX 50 INDEX PUT 4100.00000 16.06.23	EUR	1 750	1 750
EURO STOXX 50 INDEX PUT 4100.00000 21.06.24	EUR	1 750	0
EURO STOXX 50 PUT 4000.00000 15.03.24	EUR	1 750	0
SWISS MARKET INDEX PUT 10300.00000 17.03.23	CHF	0	130
SWISS MARKET INDEX PUT 10300.00000 15.09.23	CHF	130	0
EURO STOXX 50 PUT 3800.00000 15.12.23	EUR	0	1 750
FTSE 100 INDEX PUT 6800.00000 16.06.23	GBP	0	240
FTSE 100 INDEX PUT 7200.00000 21.06.24	GBP	360	0
FTSE 100 INDEX PUT 7500.00000 15.12.23	GBP	360	360
FTSE 100 INDEX PUT 7100.00000 15.12.23	GBP	360	240
FTSE 100 INDEX PUT 6900.00000 17.03.23	GBP	0	240
FTSE 100 INDEX PUT 7600.00000 17.03.23	GBP	260	260
FTSE 100 INDEX PUT 7100.00000 16.06.23	GBP	360	360
FTSE 100 INDEX PUT 7600.00000 16.06.23	GBP	360	360
FTSE 100 INDEX PUT 7000.00000 15.09.23	GBP	360	0
FTSE 100 INDEX PUT 6900.00000 15.09.23	GBP	0	240
FTSE 100 INDEX PUT 7600.00000 15.09.23	GBP	360	360
NIKKEI 225 INDEX PUT 26000.00000 10.03.23	JPY	0	110
NIKKEI 225 INDEX PUT 27000.00000 09.06.23	JPY	0	100
NIKKEI 225 INDEX PUT 27000.00000 08.09.23	JPY	0	120
S&P 500 INDEX PUT 3900.00000 15.09.23	USD	800	1 500
S&P 500 INDEX PUT 3900.00000 16.06.23	USD	0	700
S&P 500 INDEX PUT 3900.00000 17.03.23	USD	0	700
S&P 500 INDEX PUT 3900.00000 15.12.23	USD	0	700
NIKKEI 225 INDEX PUT 27000.00000 08.12.23	JPY	0	110
S&P 500 INDEX PUT 4050.00000 15.09.23	USD	800	800
S&P 500 INDEX PUT 4050.00000 16.06.23	USD	800	800
S&P 500 INDEX PUT 4050.00000 17.03.23	USD	800	800
NIKKEI 225 INDEX PUT 26000.00000 08.03.24	JPY	110	110
S&P 500 INDEX PUT 3700.00000 15.03.24	USD	800	800
S&P 500 INDEX PUT 3700.00000 15.09.23	USD	800	800
S&P 500 INDEX PUT 3700.00000 16.06.23	USD	800	800
S&P 500 INDEX PUT 3950.00000 16.06.23	USD	800	800
S&P 500 INDEX PUT 3900.00000 15.03.24	USD	800	800
NIKKEI 225 INDEX PUT 30000.00000 08.09.23	JPY	120	0
NIKKEI 225 INDEX PUT 30000.00000 08.12.23	JPY	120	0
NIKKEI 225 INDEX PUT 30000.00000 08.03.24	JPY	120	0
NIKKEI 225 INDEX PUT 30000.00000 14.06.24	JPY	120	0
S&P 500 INDEX PUT 4150.00000 21.06.24	USD	700	0
S&P 500 INDEX PUT 4200.00000 15.09.23	USD	750	0
S&P 500 INDEX PUT 4200.00000 15.12.23	USD	750	0
S&P 500 INDEX PUT 4200.00000 15.03.24	USD	750	0
Futures auf Indices/Commodities/Währungen			
SWISS MARKET INDEX FUTURE 17.03.23	CHF	172	0
SWISS MARKET INDEX FUTURE 16.06.23	CHF	172	172
SWISS MARKET INDEX FUTURE 15.09.23	CHF	0	172
NIKKEI 225 (OSE) INDEX FUTURE 09.03.23	JPY	42	0
NIKKEI 225 (OSE) INDEX FUTURE 08.06.23	JPY	42	42
NIKKEI 225 (OSE) INDEX FUTURE 07.09.23	JPY	0	42

Während der Berichtsperiode getätigte engagementerhöhende Derivate

Instrument	Währung	Käufe/ Kontrakte	Verkäufe/ Kontrakte
Optionen/Warrants auf Indices/Commodities			
EURO STOXX 50 PUT 3200.00000 15.09.23	EUR	1 750	0
EURO STOXX 50 INDEX PUT 3300.00000 15.09.23	EUR	0	1 500
EURO STOXX 50 PUT 3200.00000 17.03.23	EUR	1 750	0
EURO STOXX 50 INDEX PUT 3300.00000 17.03.23	EUR	1 500	1 500
EURO STOXX 50 PUT 3200.00000 16.06.23	EUR	1 750	0
EURO STOXX 50 INDEX PUT 3300.00000 16.06.23	EUR	1 500	1 500

Instrument	Währung	Käufe/ Kontrakte	Verkäufe/ Kontrakte
SWISS MARKET INDEX PUT 9400.00000 16.06.23	CHF	90	0
SWISS MARKET INDEX PUT 8800.00000 15.09.23	CHF	0	105
SWISS MARKET INDEX PUT 9000.00000 21.06.24	CHF	0	90
EURO STOXX 50 INDEX PUT 3500.00000 21.06.24	EUR	0	1 500
EURO STOXX 50 INDEX PUT 3300.00000 15.03.24	EUR	0	1 500
SWISS MARKET INDEX PUT 9000.00000 17.03.23	CHF	105	0
EURO STOXX 50 PUT 3200.00000 15.12.23	EUR	1 750	0
EURO STOXX 50 INDEX PUT 3300.00000 15.12.23	EUR	0	1 500
FTSE 100 INDEX PUT 6000.00000 15.12.23	GBP	240	300
FTSE 100 INDEX PUT 6200.00000 17.03.23	GBP	220	220
FTSE 100 INDEX PUT 6200.00000 15.12.23	GBP	300	300
FTSE 100 INDEX PUT 6000.00000 16.06.23	GBP	300	300
FTSE 100 INDEX PUT 6000.00000 17.03.23	GBP	240	0
FTSE 100 INDEX PUT 5800.00000 16.06.23	GBP	240	0
FTSE 100 INDEX PUT 6200.00000 16.06.23	GBP	300	300
FTSE 100 INDEX PUT 5800.00000 15.09.23	GBP	240	0
FTSE 100 INDEX PUT 6000.00000 15.09.23	GBP	0	300
FTSE 100 INDEX PUT 6200.00000 15.09.23	GBP	300	300
FTSE 100 INDEX PUT 6000.00000 21.06.24	GBP	0	300
NIKKEI 225 INDEX PUT 22000.00000 10.03.23	JPY	90	0
NIKKEI 225 INDEX PUT 23000.00000 09.06.23	JPY	90	0
NIKKEI 225 INDEX PUT 24000.00000 08.09.23	JPY	110	0
S&P 500 INDEX PUT 3300.00000 15.09.23	USD	1 350	650
S&P 500 INDEX PUT 3300.00000 16.06.23	USD	1 350	650
S&P 500 INDEX PUT 3300.00000 17.03.23	USD	700	0
S&P 500 INDEX PUT 3300.00000 15.12.23	USD	700	0
NIKKEI 225 INDEX PUT 22500.00000 08.12.23	JPY	110	0
S&P 500 INDEX PUT 3400.00000 15.09.23	USD	650	650
S&P 500 INDEX PUT 3400.00000 16.06.23	USD	650	650
S&P 500 INDEX PUT 3400.00000 17.03.23	USD	650	650
NIKKEI 225 INDEX PUT 22000.00000 08.03.24	JPY	90	90
NIKKEI 225 INDEX PUT 26000.00000 08.03.24	JPY	0	120
S&P 500 INDEX PUT 3050.00000 15.03.24	USD	650	650
S&P 500 INDEX PUT 3050.00000 15.09.23	USD	650	650
S&P 500 INDEX PUT 3050.00000 16.06.23	USD	650	650
S&P 500 INDEX PUT 3300.00000 15.03.24	USD	650	650
NIKKEI 225 INDEX PUT 26000.00000 08.09.23	JPY	0	120
NIKKEI 225 INDEX PUT 26000.00000 08.12.23	JPY	0	120
NIKKEI 225 INDEX PUT 26000.00000 14.06.24	JPY	0	120
S&P 500 INDEX PUT 3500.00000 21.06.24	USD	0	650
S&P 500 INDEX PUT 3500.00000 15.09.23	USD	0	620
S&P 500 INDEX PUT 3500.00000 15.12.23	USD	0	620
S&P 500 INDEX PUT 3500.00000 15.03.24	USD	0	620

Futures auf Indices/Commodities/Währungen

EURO STOXX 50 INDEX FUTURE 15.09.23	EUR	900	0
EURO STOXX 50 INDEX FUTURE 17.03.23	EUR	0	900
EURO STOXX 50 INDEX FUTURE 16.06.23	EUR	900	900
FTSE 100 INDEX FUTURE 17.03.23	GBP	0	96
FTSE 100 INDEX FUTURE 16.06.23	GBP	96	96
FTSE 100 INDEX FUTURE 15.09.23	GBP	96	0
S&P500 EMINI FUTURE 16.06.23	USD	766	766
S&P500 EMINI FUTURE 17.03.23	USD	65	566
S&P500 EMINI FUTURE 15.09.23	USD	566	0

Während der Berichtsperiode getätigte Derivate auf Devisen

Verkauf Währung	Verkauf Betrag	Kauf Währung	Kauf Betrag	Fälligkeit
CHF	45 751 690	USD	50 000 000	16.03.2023
EUR	30 000 000	CHF	29 334 570	21.09.2023
USD	100 000 000	CHF	90 388 100	21.09.2023
USD	30 000 000	CHF	27 090 324	21.09.2023
EUR	130 000 000	CHF	125 654 230	21.12.2023
USD	450 000 000	CHF	400 141 350	21.12.2023
EUR	30 000 000	CHF	29 229 282	21.12.2023
JPY	8 500 000 000	CHF	55 690 011	21.12.2023
USD	350 000 000	CHF	307 658 750	21.03.2024

Ergänzende Angaben

Derivative Finanzinstrumente

Risikomessverfahren Commitment-Ansatz II:
Art. 35ff KKV-FINMA

Position	Betrag in CHF	in % des Nettofonds- vermögens
Brutto Gesamtengagement aus Derivaten	2 199 964 744,66	119,85%
Netto Gesamtengagement aus Derivaten	100 763 192,60	5,49%
Engagement aus Effektenleihe und Pensionsgeschäften	–	–

Pensionsgeschäfte

Die Fondsleitung tätigt keine Pensionsgeschäfte.

Vergütung an die Fondsleitung

Verwaltungskommission

- Effektiv erhobene Verwaltungskommission:
 - Klasse I-A1: 0,1425% p.a.;
 - Klasse I-A2: 0,5925% p.a.;
 - Klasse R-A3: 1,5000% p.a.;
- Maximale erhobene Verwaltungskommission gemäss Fondsvertrag:
 - Klasse I-A1: 0,15% p.a.;
 - Klasse I-A2: 1,00% p.a.;
 - Klasse R-A3: 1,60% p.a.;
- Effektiv erhobene Depotbankkommission für alle Klassen: 0,0075% p.a.;
- Maximale erhobene Depotbankkommission für alle Klassen gemäss Fondsvertrag: 0,25% p.a.;

Die Verwaltungskommission der Zielfonds, in die das Vermögen der Teilvermögen investiert wird, darf unter Berücksichtigung von allfälligen Retrozessionen und Rabatten höchstens 3% betragen.

Gebührenteilungsvereinbarungen («commission sharing agreements») und geldwerte Vorteile («soft commissions»)

Die Fondsleitung hat keine Gebührenteilungsvereinbarungen («commission sharing agreements») geschlossen. Die Fondsleitung hat keine Vereinbarungen bezüglich so genannten «soft commissions» geschlossen.

Total Expense Ratio (TER)

Diese Kennziffer wurde gemäss der «Richtlinie zur Berechnung und Offenlegung der Total Expense Ratio (TER) von kollektiven Kapitalanlagen» der Asset Management Association Switzerland (AMAS) in der aktuell gültigen Fassung berechnet und drückt die Gesamtheit derjenigen Kommissionen und Kosten, die laufend dem Fondsvermögen belastet werden (Betriebsaufwand), retrospektiv in einem %-Satz des Fondsvermögens aus.

TER für die letzten 12 Monate:

Klasse I-A1:	0,15%
Klasse I-A2:	0,60%
Klasse R-A3:	1,51%

Umrechnungskurse

CAD 1 = CHF	0.676101	JPY 1 = CHF	0.006190
EUR 1 = CHF	0.976063	USD 1 = CHF	0.894650
GBP 1 = CHF	1.137413		

(OTC-)Derivate und Effektenleihe

Führt der Anlagefonds ausserbörsliche Transaktionen (OTC-Geschäfte) durch, so kann es dadurch Risiken im Zusammenhang mit der Kreditwürdigkeit der OTC-Gegenpartei ausgesetzt sein: bei Abschluss von Terminkontrakten, Optionen und Swap-Transaktionen oder Verwendung sonstiger derivativer Techniken unterliegt der Anlagefonds dem Risiko, dass eine OTC-Gegenpartei ihren Verpflichtungen aus einem bestimmten oder mehreren Verträgen nicht nachkommt (bzw. nicht nachkommen kann). Das Kontrahentenrisiko kann durch die Hinterlegung einer Sicherheit verringert werden. Falls dem Anlagefonds ein Wertpapier gemäss einer anwendbaren Vereinbarung geschuldet wird, wird dieses Wertpapier in einer Depotbank/Verwahrstelle für den Anlagefonds verwahrt. Konkurs- und Insolvenzfälle bzw. sonstige Kreditausfallereignisse bei der OTC-Gegenpartei, der Depotbank oder innerhalb ihres Unterverwahrstellen-/ Korrespondenzbanknetzwerks können dazu führen, dass die Rechte oder die Anerkennung des Anlagefonds in Zusammenhang mit dem Wertpapier verzögert, eingeschränkt oder sogar ausgeschlossen werden könnten, was den Anlagefonds zwingen würde, seinen Verpflichtungen im Rahmen der OTC-Transaktion nachzukommen, und zwar trotz eines Wertpapiers, das zuvor zur Verfügung gestellt wurde, um eine solche Verpflichtung abzusichern.

Die Gesellschaft darf ebenfalls Teile ihres Wertpapierbestandes an Dritte ausleihen. Im Allgemeinen dürfen Ausleihungen nur über anerkannte Clearinghäuser, wie Clearstream International oder Euroclear, sowie über erstrangige Finanzinstitute, welche in dieser Aktivität spezialisiert sind, innerhalb deren festgesetzten Rahmenbedingungen erfolgen. Collateral erhält man in Verbindung mit ausgeliehenen Wertpapieren. Collateral setzt sich aus hochwertigen Wertpapieren zusammen, welche zumindest dem Betrag des Marktwertes der ausgeliehenen Wertpapiere entsprechen.

Gegenparteien, Art und Höhe der entgegengenommenen Sicherheiten aus OTC-Derivaten:

Stichtag: 30.6.2023	Swiss Life Funds (CH) Equity Global Protect Enhanced (CHF hedged)
Währung:	CHF
Gegenparteien und Kurswert der OTC Derivate	
Credit Agricole CIB	735 451.43
Goldman Sachs	479 419.03
Merrill Lynch	6 005 878.47
UBS AG	15 617 197.20
Zuercher Kantonalbank	1 918 931.77
Art und Höhe der entgegengenommenen Sicherheiten:	
- Anleihen	-
- Aktien	-
- Barmittel	-
- Anlagefonds	-
- Geldmarktanlagen	-
- Übrige Sicherheiten	-
Total entgegengenommenen Sicherheiten	-

Effektenleihe und Sicherheiten

Berichtszeitraum: 1. Januar 2023 - 30. Juni 2023	Swiss Life Funds (CH) Equity Global Protect Enhanced (CHF hedged)
Kontrahentenrisiko aus der Effektenleihe per 30. Juni 2023	
UBS AG	
- Marktwert der verliehenen Effekten	226 353 180.98 CHF
- Sicherheiten	237 772 021.73 CHF
Aufschlüsselung der Sicherheiten (Gewichtung in %) per 30. Juni 2023	
nach Art der Vermögenswerte:	
- Anleihen	99.97
- Aktien	0.03
- Geldmarktanlagen	-
Effektenleihe	
Erträge aus der Effektenleihe	239 443.13 CHF
Operative Kosten der Effektenleihe	71 832.94 CHF
Fondserträge aus der Effektenleihe	167 610.19 CHF

Der Marktwert der verliehenen Effekten sowie die Werte der erhaltenen Sicherheiten für ausgeliehene Wertschriften in der Tabelle Effektenleihe und Sicherheiten beziehen sich auf die Daten der Depotbank per Monatsultimo.

Die Ausgleichszahlungen und die Kommissionserträge aus Effektenleihe in den Erfolgsrechnungen sowie die im Inventar ausgewiesenen, ausgeliehenen Werte stammen hingegen aus der Wertschriftenbuchhaltung. Die Wertschriftenbuchhaltung verbucht die ausgeliehenen Wertschriften an T+1 gegenüber der Depotbank.