

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 2024

Ungeprüfter Halbjahresbericht per 30. Juni 2024

Inhaltsverzeichnis	Seite	ISIN
Organisation	3	
Swiss Life Funds (CH)		
Equity Global Protect Enhanced (CHF hedged)	5	I-A1/ CH0299461902 I-A2/ CH0299461951 R-A3/ CH0299461969

Internetadresse

www.swisslife-am.com

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.

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 Verwaltungsratsmandaten innerhalb der Swiss Life-Gruppe, Präsident des Verwaltungsrats der Ina Invest Holding AG und der Ina Invest AG

Mitglieder

Lorenzo Kyburz

Swiss Life Investment Management Holding AG, mit einem Verwaltungsratsmandat innerhalb der Swiss Life-Gruppe

Dr. Rolf Aeberli

Head Corporate Mandates Swiss Life AG, mit Verwaltungsratsmandaten innerhalb der Swiss Life-Gruppe, Präsident des Verwaltungsrates der First Swiss Mobility 2022-1 AG, der First Swiss Mobility 2023-1 AG, der First Swiss Mobility 2023-2 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, mit Verwaltungsratsmandaten innerhalb der Swiss Life-Gruppe

Christoph 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, mit einem Verwaltungsratsmandat innerhalb der Swiss Life-Gruppe

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 Anlage Richtlinien 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.

Zahlstelle

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	30.6.2024	31.12.2023	31.12.2022
Nettofondsvermögen in CHF		243 798 558.87	393 835 026.96	1 681 406 761.02
Klasse I-A1	CH0299461902			
Nettoinventarwert pro Anteil in CHF		127.18	123.46	120.69
Ausgabe- und Rücknahmepreis pro Anteil in CHF ¹		127.18	123.46	120.69
Anzahl Anteile im Umlauf		1 837 932,4070	1 975 782,4070	12 216 810,4070
Klasse I-A2	CH0299461951			
Nettoinventarwert pro Anteil in CHF		125.79	121.92	119.15
Ausgabe- und Rücknahmepreis pro Anteil in CHF ¹		125.79	121.92	119.15
Anzahl Anteile im Umlauf		11 630,4890	1 162 801,4890	1 670 889,4890
Klasse R-A3	CH0299461969			
Nettoinventarwert pro Anteil in CHF		129.83	125.37	122.50
Ausgabe- und Rücknahmepreis pro Anteil in CHF ¹		129.83	125.37	122.50
Anzahl Anteile im Umlauf		66 136,8490	64 816,8490	63 752,8490

¹ Siehe Ergänzende Angaben

Struktur des Wertpapierportfolios (ungeprüft)

Die 10 grössten Positionen in % des Gesamtfondsvermögens	
Swiss Life Funds (CH) Money Market Swiss Francs A Cap	1,22
Broadcom Corp Com	1,15
Eli Lilly and Co Com	1,04
Republic Services Com	0,79
Amphenol Corp	0,76
Microsoft Corp	0,75
Waste Connections Com Npv	0,75
Texas Instruments Com	0,70
Duke Energy Corp Com	0,65
T-Mobile US Inc Com	0,65
Übrige	81,37
Total	89,83

Obige Prozentsätze können Rundungsdifferenzen enthalten.

Vermögensrechnung

	30.6.2024	31.12.2023
	CHF	CHF
Verkehrswerte		
Bankguthaben		
– auf Sicht	22 616 260.74	20 109 715.94
Effekten		
– Aktien und andere Beteiligungspapiere	222 158 462.43	345 165 201.32
– Anteile anderer kollektiver Kapitalanlagen	3 051 300.00	10 107 000.00
Derivative Finanzinstrumente	1 825 316.11	17 676 257.66
Sonstige Vermögenswerte	1 046 699.99	3 858 824.98
Gesamtfondsvermögen	250 698 039.27	396 916 999.90
Kurzfristige Bankverbindlichkeiten	-6 757 533.20	-2 500 706.54
Andere Verbindlichkeiten	-141 947.20	-581 266.40
Nettofondsvermögen	243 798 558.87	393 835 026.96

Erfolgsrechnung

	1.1.2024-30.6.2024	1.1.2023-31.12.2023
	CHF	CHF
Ertrag		
Erträge der Bankguthaben	468 599.16	2 271 620.06
Negativzinsen	0.00	-160 744.08
Erträge der Effekten		
– aus Aktien und anderen Beteiligungspapieren	2 675 866.32	24 422 441.50
– aus Gratisaktien	1 699.37	2 714.45
– aus Anteilen anderer kollektiver Kapitalanlagen	50 420.80	47 813.79
Ausgleichszahlungen aus Effektenleihe	22 925.30	441 243.43
Erträge der Effektenleihe	186 853.29	1 544 392.34
Einkauf in laufende Nettoerträge bei der Ausgabe von Anteilen	3 120.66	544 950.64
Total Ertrag	3 409 484.90	29 114 432.13
Aufwand		
Passivzinsen	-71 963.61	-15 517.63
Reglementarische Kommissionsvergütung an die Fondsleitung Klasse I-A1	-171 408.68	-1 946 492.06
Reglementarische Kommissionsvergütung an die Fondsleitung Klasse I-A2	-142 324.56	-1 135 028.70
Reglementarische Kommissionsvergütung an die Fondsleitung Klasse R-A3	-63 180.92	-122 195.06
Reglementarische Kommissionsvergütung an die Depotbank	-9 404.94	-109 563.88
Teilübertragung der fondsvertraglichen Kommissionsvergütung an die Fondsleitung auf realisierte Kapitalgewinne und -verluste Klasse R-A3	0.00	719.40
Sonstige Aufwendungen	-562.89	-1 213.13
Ausrichtung laufender Nettoerträge bei der Rücknahme von Anteilen	-436 495.16	-20 157 067.70
Total Aufwand	-895 340.76	-23 486 358.76
Nettoertrag	2 514 144.14	5 628 073.37
Realisierte Kapitalgewinne und -verluste	5 996 354.30	139 685 728.10
Teilübertragung der fondsvertraglichen Kommissionsvergütung an die Fondsleitung auf realisierte Kapitalgewinne und -verluste Klasse R-A3	0.00	-719.40
Realisierter Erfolg	8 510 498.44	145 313 082.07
Nicht realisierte Kapitalgewinne und -verluste	5 833 853.13	-152 851 241.71
Gesamterfolg	14 344 351.57	-7 538 159.64

Veränderung des Nettofondsvermögens

	1.1.2024-30.6.2024	1.1.2023-31.12.2023
	CHF	CHF
Nettofondsvermögen zu Beginn des Rechnungsjahres	393 835 026.96	1 681 406 761.02
Ordentliche Jahresausschüttung	-4 203 438.77	-29 328 856.89
Saldo aus dem Anteilverkehr	-160 177 380.89	-1 250 704 717.53
Gesamterfolg	14 344 351.57	-7 538 159.64
Nettofondsvermögen am Ende der Berichtsperiode	243 798 558.87	393 835 026.96

Entwicklung der Anteile im Umlauf

	1.1.2024-30.6.2024	1.1.2023-31.12.2023
Klasse I-A1	Anzahl	Anzahl
Bestand Anfang Rechnungsjahr	1 975 782,4070	12 216 810,4070
Ausgegebene Anteile	5 250,0000	1 228 527,0000
Zurückgenommene Anteile	-143 100,0000	-11 469 555,0000
Bestand Ende Berichtsperiode	1 837 932,4070	1 975 782,4070
Differenz zwischen den ausgegebenen und zurückgenommenen Anteilen	-137 850,0000	-10 241 028,0000
Klasse I-A2	Anzahl	Anzahl
Bestand Anfang Rechnungsjahr	1 162 801,4890	1 670 889,4890
Ausgegebene Anteile	1 908,0000	218 046,0000
Zurückgenommene Anteile	-1 153 079,0000	-726 134,0000
Bestand Ende Berichtsperiode	11 630,4890	1 162 801,4890
Differenz zwischen den ausgegebenen und zurückgenommenen Anteilen	-1 151 171,0000	-508 088,0000
Klasse R-A3	Anzahl	Anzahl
Bestand Anfang Rechnungsjahr	64 816,8490	63 752,8490
Ausgegebene Anteile	4 052,0000	12 170,0000
Zurückgenommene Anteile	-2 732,0000	-11 106,0000
Bestand Ende Berichtsperiode	66 136,8490	64 816,8490
Differenz zwischen den ausgegebenen und zurückgenommenen Anteilen	1 320,0000	1 064,0000

Inventar des Fondsvermögens

Titel		31.12.2023 Anzahl/ Nominal	Käufe ¹	Verkäufe ²	30.6.2024 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	5 208		2 245	2 963	126 243	0,05	
OMV AG NPV(VAR)*	EUR	3 988		1 720	2 268	88 812	0,04	
VERBUND AG CLASS'A'NPV*	EUR	1 537		663	874	61 993	0,02	
Total Österreich						277 048	0,11	
Belgien								
ANHEUSER-BUSCH IN NPV*	EUR	3 059		1 318	1 741	90 744	0,04	
D'ETEREN GROUP NPV*	EUR	1 075		464	611	116 570	0,05	
ELIA GROUP NPV*	EUR	1 553		669	884	74 451	0,03	884
GPE BRUXELLES LAM NPV*	EUR	11 461		4 941	6 520	418 512	0,17	
LOTUS BAKERIES NPV*	EUR	18		8	10	92 744	0,04	
SOLVAY SA NPV*	EUR	2 132		919	1 213	38 399	0,02	
SYENSCO SA NPV*	EUR	2 132		919	1 213	97 627	0,04	
UMICORE NPV*	EUR	6 438		2 776	3 662	49 481	0,02	3 662
Total Belgien						978 527	0,39	
China								
NXP SEMICONDUCTORS EURO.20*	USD	2 575		1 110	1 465	354 243	0,14	
Total China						354 243	0,14	
Finnland								
KESKO OYJ EUR2 SER'B'*	EUR	9 727		4 193	5 534	87 353	0,03	5 534
KONE CORPORATION NPV ORD 'B'*	EUR	12 946		5 582	7 364	326 874	0,13	7 364
WARTSILA OYJ ABP SER'B'EUR3.50*	EUR	13 020		5 612	7 408	128 420	0,05	
Total Finnland						542 647	0,22	
Frankreich								
AIR LIQUIDE(L') EUR5.5 (POST-SUBDIVISION)*	EUR	3 774	215	1 626	2 363	367 001	0,15	
AIRBUS EUR1*	EUR	1 428		616	812	100 301	0,04	
AMUNDI EUR2.5 (AIW)*	EUR	3 330		1 435	1 895	109 958	0,04	
ARKEMA EUR10*	EUR	1 825		788	1 037	81 045	0,03	
BIOMERIEUX NPV (POST SPLIT)*	EUR	1 471		635	836	71 455	0,03	
BOLLORE EURO.16*	EUR	32 448		13 988	18 460	97 425	0,04	
BUREAU VERITAS EURO.12*	EUR	7 766		3 347	4 419	110 056	0,04	
CARREFOUR EUR2.50*	EUR	13 123		5 658	7 465	94 899	0,04	7 465
CIE DE ST-GOBAIN EUR4*	EUR	3 217		1 386	1 831	128 057	0,05	
COVIVIO EUR3*	EUR	3 924		1 691	2 233	95 441	0,04	
CREDIT AGRICOLE SA EUR3*	EUR	17 498		7 543	9 955	122 144	0,05	
DANONE EURO.25*	EUR	4 910		2 117	2 793	153 538	0,06	
ENGIE EUR1*	EUR	8 568		3 694	4 874	62 595	0,02	
ESSILORLUXOTTICA EURO.18*	EUR	3 068		1 323	1 745	338 130	0,13	
EURAZEO NPV*	EUR	2 580		1 112	1 468	105 116	0,04	
GETLINK SE EURO.40*	EUR	13 517		5 828	7 689	114 408	0,05	
HERMES INTL NPV*	EUR	168		73	95	195 793	0,08	
LEGRAND SA EUR4*	EUR	2 205		951	1 254	111 881	0,04	
LVMH MOET HENNESSY EURO.30*	EUR	393		169	224	153 944	0,06	
ORANGE EUR4*	EUR	50 288		21 679	28 609	257 727	0,10	
PERNOD RICARD EUR1.55*	EUR	2 111		909	1 202	146 670	0,06	
PUBLICIS GROUPE SA EURO.40*	EUR	2 159		931	1 228	117 532	0,05	
RENAULT SA EUR3.81*	EUR	4 010		1 728	2 282	105 140	0,04	
SANOFI EUR2*	EUR	8 532		3 678	4 854	420 448	0,17	
SCHNEIDER ELECTRIC EUR8*	EUR	1 390		600	790	170 654	0,07	
SEB SA EUR1*	EUR	1 296		559	737	67 856	0,03	
TELEPERFORMANCE EUR2.50*	EUR	1 260		543	717	67 906	0,03	
THALES EUR3*	EUR	3 592		1 548	2 044	294 294	0,12	2 044
TOTALENERGIES SE EUR2.5*	EUR	11 525		4 969	6 556	393 546	0,16	
VIVENDI SA EUR5.50*	EUR	21 112		9 102	12 010	112 843	0,05	
WENDEL EUR4*	EUR	2 233		963	1 270	101 028	0,04	
Total Frankreich						4 868 833	1,94	
Deutschland								
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG EUR1*	EUR	2 064		889	1 175	100 012	0,04	
BECHTLE AG NPV*	EUR	3 181		1 372	1 809	76 552	0,03	
BEIERSDORF AG NPV*	EUR	5 059		2 181	2 878	378 480	0,15	
CARL ZEISS MEDITEC NPV*	EUR	1 854		800	1 054	66 640	0,03	1 054
COMMERZBANK AG NPV*	EUR	16 931		7 299	9 632	131 585	0,05	
CONTINENTAL AG ORD NPV*	EUR	2 110		909	1 201	61 187	0,02	630
FRESENIUS MED CARE NPV*	EUR	3 541		1 526	2 015	69 396	0,03	2 015
FRESENIUS SE & CO. KGAA NPV*	EUR	5 118		2 205	2 913	78 216	0,03	
GEA GROUP AG NPV*	EUR	5 356		2 309	3 047	114 152	0,05	
HEIDELBERG MATER NPV*	EUR	1 937		834	1 103	102 849	0,04	
HENKEL AG & CO KGAA*	EUR	4 428		1 909	2 519	178 189	0,07	
KNORR BREMSE AG NPV*	EUR	2 497		1 077	1 420	97 507	0,04	
MERCK KGAA NPV*	EUR	3 892		1 678	2 214	329 965	0,13	
NEMETSCHEK SE ORD NPV*	EUR	1 914		825	1 089	96 331	0,04	
RWE AG (NEU) NPV*	EUR	3 764		1 623	2 141	65 879	0,03	
SAP AG ORD NPV*	EUR	3 688		1 590	2 098	382 931	0,15	
SYMRISE AG NPV (BR)*	EUR	5 354		2 308	3 046	335 302	0,13	
Total Deutschland						2 665 172	1,06	
Irland								
AIB GROUP PLC ORD EURO.625*	EUR	43 778		18 873	24 905	118 392	0,05	
DCC ORD EURO.25*	GBP	2 501		1 078	1 423	89 549	0,04	
KERRY GROUP 'A'ORD EURO.125(DUBLIN LIST)*	EUR	3 896		1 679	2 217	161 523	0,06	
Total Irland						369 464	0,15	

Titel		31.12.2023 Anzahl/ Nominal	Käufe ¹	Verkäufe ²	30.6.2024 Anzahl/ Nominal	Verkehrswert ³ in CHF	in % ³	Davon ausgeliehen Anzahl/Nominal
Italien								
AMPLIFON EURO.02*	EUR	5 089		2 194	2 895	92 676	0,04	
DIASORIN SPA EUR1*	EUR	1 833		791	1 042	93 388	0,04	1 042
GENERALI SPA NPV EUR1*	EUR	28 147		12 135	16 012	359 149	0,14	
INFRASTRUTTURA WIR NPV*	EUR	14 816		6 387	8 429	79 148	0,03	3 083
POSTE ITALIANE SPA NPV*	EUR	16 977		7 320	9 657	110 628	0,04	
Total Italien						734 990	0,29	
Japan								
ADVANTEST CORP NPV*	JPY	9 704		3 800	5 904	211 903	0,08	
BANDAI NAMCO HLDGS NPV*	JPY	10 300		4 000	6 300	110 507	0,04	
CENTRAL JAPAN RLWY NPV*	JPY	10 620		4 200	6 420	124 554	0,05	
CHUGAI PHARM CO NPV*	JPY	7 640		3 000	4 640	148 159	0,06	
DAIICHI LIFE HOLD NPV*	JPY	11 100		4 400	6 700	160 864	0,06	
DAIICHI SANKYO COM NPV*	JPY	20 612		8 100	12 512	386 099	0,15	
DAIKIN INDUSTRIES NPV*	JPY	3 355		1 200	2 155	269 297	0,11	
DAIWA HOUSE INDS NPV*	JPY	9 247		3 600	5 647	128 611	0,05	
DAIWA HOUSE REIT I REIT*	JPY	86		34	52	71 401	0,03	
DISCO CORPORATION NPV*	JPY	1 200		500	700	238 688	0,10	
EISAI CO NPV*	JPY	3 556		1 400	2 156	79 393	0,03	
FANUC CORP NPV*	JPY	12 560		4 900	7 660	188 663	0,08	
FAST RETAILING CO NPV*	JPY	2 009		900	1 109	251 274	0,10	
JAPAN EXCHANGE GP NPV*	JPY	8 200		3 100	5 100	106 894	0,04	
JAPAN REAL ESTATE INVESTMENT CORP*	JPY	43		17	26	73 783	0,03	4
KANSAI ELEC POWER NPV*	JPY	10 500		4 100	6 400	96 601	0,04	
KAO CORP NPV*	JPY	6 275		2 500	3 775	137 578	0,05	
KIKKOMAN CORP NPV*	JPY	2 100	8 000	3 800	6 300	65 583	0,03	
KINTETSU GROUP HOL NPV*	JPY	5 400		2 000	3 400	66 514	0,03	
KIRIN HOLDINGS CO LTD NPV*	JPY	12 100		4 700	7 400	85 694	0,03	
KOMATSU NPV*	JPY	12 218		4 700	7 518	196 169	0,08	
LASERTEC CORP NPV*	JPY	900		200	700	141 125	0,06	
MCDONALD'S HOLDING NPV*	JPY	3 600		1 400	2 200	77 917	0,03	2 200
MITSUI FUDOSAN CO NPV*	JPY	11 631	27 393	17 731	21 293	174 674	0,07	
NIDEC CORPORATION NPV*	JPY	6 100		2 500	3 600	144 493	0,06	
NIPPON BUILDING FD REIT*	JPY	45		18	27	84 916	0,03	
NIPPON STEEL CORP NPV*	JPY	12 400		4 800	7 600	144 390	0,06	
NITORI HOLDINGS CO LTD*	JPY	1 300		500	800	75 928	0,03	
NITTO DENKO CORP NPV*	JPY	2 670		1 000	1 670	118 572	0,05	
OBIC CO LTD NPV*	JPY	1 300		500	800	92 687	0,04	
OLYMPUS CORP NPV*	JPY	16 457		6 500	9 957	144 256	0,06	
ORIENTAL LAND CO NPV*	JPY	12 900		5 000	7 900	197 796	0,08	
PAN PACIFIC INTERNATIONAL HOLDINGS CORP*	JPY	5 600		2 200	3 400	71 490	0,03	
RECRUIT HLDGS CO L NPV*	JPY	17 500		6 900	10 600	509 655	0,20	
SECOM CO NPV*	JPY	3 474		1 300	2 174	115 336	0,05	
SEKISUI HOUSE NPV*	JPY	10 442		4 100	6 342	126 229	0,05	
SHIMANO INC NPV*	JPY	1 200		500	700	97 153	0,04	
SHIN-ETSU CHEMICAL NPV*	JPY	21 370		8 500	12 870	448 479	0,18	
SHIONOGI & CO NPV*	JPY	3 800		1 600	2 200	77 142	0,03	
SHISEIDO CO LTD NPV*	JPY	6 113		2 500	3 613	92 600	0,04	
SMC CORP NPV*	JPY	800		200	600	255 871	0,10	
SUZUKI MOTOR CORP NPV*	JPY	4 938	15 352	8 338	11 952	123 585	0,05	
SYSMEX CORP NPV*	JPY	2 800	6 600	4 300	5 100	73 817	0,03	
TERUMO CORP NPV*	JPY	8 953	14 106	12 153	10 906	161 630	0,06	
TOKYO GAS CO NPV*	JPY	6 100		2 500	3 600	69 481	0,03	
TORAY INDS INC NPV*	JPY	32 700		13 000	19 700	83 802	0,03	
TOYOTA INDUSTRIES NPV*	JPY	2 100		900	1 200	90 933	0,04	
TOYOTA TSUSHO CORP NPV*	JPY	2 835	5 205	2 835	5 205	91 067	0,04	
Total Japan						7 083 253	2,83	
Niederlande								
AERCAP HOLDINGS EURO.01*	USD	2 744		1 183	1 561	130 733	0,05	
AKZO NOBEL NV EURO.50(POST REV SPLIT)*	EUR	2 347		1 013	1 334	72 948	0,03	
ARGEN X NV EURO.10*	EUR	1 354		583	771	303 398	0,12	771
ASR NEDERLAND N.V. EURO.16*	EUR	3 725		1 605	2 120	90 877	0,04	
EURONEXT EUR1.60*	EUR	2 141		922	1 219	101 550	0,04	
EXOR NV EURO.01*	EUR	2 012		868	1 144	107 642	0,04	
HEINEKEN HOLDING EUR1.6*	EUR	2 479		1 068	1 411	100 083	0,04	
HEINEKEN NV EUR1.60*	EUR	5 148		2 219	2 929	254 722	0,10	
IMCD NV EURO.16*	EUR	1 663		717	946	117 801	0,05	
KON KPN NV EURO.04*	EUR	121 095		52 206	68 889	237 516	0,09	
KONINKLIJKE AHOLD EURO.01*	EUR	16 387		7 066	9 321	247 670	0,10	
KONINKLIJKE PHILIPS NV EURO.20*	EUR	6 850	133	2 953	4 030	91 557	0,04	
RANDSTAD N.V. EURO.10*	EUR	3 556		1 533	2 023	82 472	0,03	2 023
UNIBAIL-RODAMCO-WE NPV(1 ORD UNIBAIL-R & 1CLS)*	EUR	2 686		1 159	1 527	108 120	0,04	
WOLTERS KLUWER EURO.12*	EUR	6 449		2 780	3 669	546 989	0,22	
Total Niederlande						2 594 077	1,03	
Portugal								
EDP RENOVAVEIS SA EUR5*	EUR	10 382		4 476	5 906	74 227	0,03	
Total Portugal						74 227	0,03	
Spanien								
ACCIONA SA EUR1*	EUR	1 438		620	818	86 894	0,03	250
ACS ACTIVIDADES CO EURO.5*	EUR	5 348		2 306	3 042	118 007	0,05	3 042
AENA S.M.E S.A. EUR10*	EUR	1 569		677	892	161 504	0,06	
CELLNEX TELECOM SA EURO.25*	EUR	4 512		1 945	2 567	75 081	0,03	
CORP ACCIONA ENERGI EUR1*	EUR	5 906		2 546	3 360	62 227	0,02	
ENDESA SA EUR1.2*	EUR	24 089		10 386	13 703	231 410	0,09	
IBERDROLA SA EURO.75 (POST SUBDIVISION)*	EUR	51 471		22 190	29 281	341 640	0,14	
INDITEX EURO.03 (POST SUBD)*	EUR	18 052		7 784	10 268	458 447	0,18	
REDEIA CORP SA EURO.5*	EUR	31 618		13 631	17 987	282 708	0,11	
REPSOL SA EUR1*	EUR	39 031		16 827	22 204	315 095	0,13	
TELEFONICA SA EUR1*	EUR	43 832		18 897	24 935	95 096	0,04	24 935
Total Spanien						2 228 110	0,89	

Titel		31.12.2023 Anzahl/ Nominal	Käufe ¹	Verkäufe ²	30.6.2024 Anzahl/ Nominal	Verkehrswert ³ in CHF	in % ³	Davon ausgeliehen Anzahl/Nominal
Schweiz								
ROCHE HLDGS AG CHF1(BR)*	CHF	1 704		735	969	265 312	0,11	
Total Schweiz						265 312	0,11	
Grossbritannien								
3I GROUP ORD GBPO.738636*	GBP	6 298		2 715	3 583	124 786	0,05	
ASTRAZENECA ORD USDO.25*	GBP	6 222		2 681	3 541	496 995	0,20	
BAE SYSTEMS ORD GBPO.025*	GBP	65 666		28 309	37 357	560 136	0,22	
BARRATT DEVEL ORD GBPO.10*	GBP	25 845		11 142	14 703	78 864	0,03	
BRIT AMER TOBACCO ORD GBPO.25*	GBP	8 439		3 638	4 801	132 521	0,05	
COCA-COLA EUROPACI COM EURO.01*	USD	2 704		1 166	1 538	100 710	0,04	
HALMA ORD GBPO.10*	GBP	5 947		2 564	3 383	103 987	0,04	
INFORMA PLC (GB) ORD GBPO.001*	GBP	18 625		8 029	10 596	103 006	0,04	
KINGFISHER ORD GBPO.157142857*	GBP	59 121		25 489	33 632	95 050	0,04	
LAND SECURITIES GP ORD GBPO.1066666666*	GBP	18 072		7 793	10 279	72 334	0,03	
LLOYDS BANKING GP ORD GBPO.1*	GBP	374 961		161 653	213 308	132 636	0,05	
NATIONAL GRID ORD GBPO.12431289*	GBP	45 529		19 628	25 901	259 674	0,10	
OCADO GROUP PLC ORD GBPO.02*	GBP	12 770		5 506	7 264	23 838	0,01	
RECKITT BENCK GRP ORD GBPO.10*	GBP	6 081		2 623	3 458	168 197	0,07	
RELX PLC GBPO.1444*	GBP	20 291		8 747	11 544	477 184	0,19	
RENTOKIL INITIAL ORD GBPO.01*	GBP	30 132		12 991	17 141	89 799	0,04	
ROLLS-ROYCE HLDGS ORD GBPO.20*	GBP	45 635		19 673	25 962	134 714	0,05	
SAGE GROUP GBPO.01051948*	GBP	36 759		15 848	20 911	258 554	0,10	
SEVERN TRENT ORD GBPO.9789*	GBP	12 486		5 382	7 104	192 056	0,08	
SPIRAX GROUP PLC ORD GBPO.269230769*	GBP	1 440		621	819	78 891	0,03	
SSE PLC ORD GBPO.50*	GBP	6 416		2 765	3 651	74 215	0,03	
ST JAMES'S PLACE ORD GBPO.15*	GBP	21 552		9 291	12 261	76 114	0,03	
UNITED UTILITIES G ORD GBPO.05*	GBP	10 686		4 608	6 078	67 840	0,03	
WPP PLC ORD GBPO.10*	GBP	16 733		7 213	9 520	78 336	0,03	
Total Grossbritannien						3 980 437	1,59	
Vereinigte Staaten								
3M CO.COM*	USD	4 698		2 025	2 673	245 456	0,10	
AECOM TECHNOLOGY C COM STK USDO.01*	USD	5 441		2 346	3 095	245 132	0,10	
AFLAC INC.COM USDO.10*	USD	5 804		2 501	3 303	265 079	0,11	
AKAMAI TECHNOLOGIES INC COM*	USD	13 437		5 793	7 644	618 750	0,25	
ALLIANT ENERGY CORP COM*	USD	10 785		4 650	6 135	280 607	0,11	
AMER ELEC PWR INC COM USDO.50*	USD	13 672		5 894	7 778	613 242	0,24	
ARISTA NETWORKS IN COM USDO.0001*	USD	1 818		784	1 034	325 649	0,13	
AXON ENTERPRISE I COM USDO.00001*	USD	1 720		742	978	258 587	0,10	
BERKLEY(WR)CORP COM USDO.20*	USD	7 293		3 143	4 150	293 040	0,12	
BERKSHIRE HATHAWAY CLASS'B COM USDO.0033*	USD	7 585		3 269	4 316	1 577 716	0,63	
BIOMARIN PHARMA COM USDO.001*	USD	4 743		2 045	2 698	199 603	0,08	
BLACKROCK INC COM STK USDO.01*	USD	710		306	404	285 824	0,11	
BOOZ ALLEN HAMILTO COM USDO.01 CLASS 'A'*	USD	3 243		1 397	1 846	255 292	0,10	
BOSTON SCIENTIFIC COM USDO.01*	USD	11 195		4 827	6 368	440 673	0,18	
BXP INC USDO.01*	USD	7 887		3 399	4 488	248 266	0,10	4 488
CAMPBELL SOUP CO CAP USDO.0375*	USD	13 667		5 892	7 775	315 725	0,13	
CARLISLE COS INC COM*	USD	1 410		607	803	292 390	0,12	100
CDW CORP COM USDO.01*	USD	2 439		1 052	1 387	728 985	0,11	
CHARLES RIV LABS INTL INC COM*	USD	2 138		921	1 217	225 915	0,09	1 217
CHENIERE ENERGY INC COM NEW*	USD	7 875		3 395	4 480	703 818	0,28	
CLOROX CO DEL COM*	USD	2 745		1 184	1 561	191 428	0,08	
CME GROUP INC COM STK USDO.01 CLASS'A'*	USD	4 114		1 774	2 340	413 396	0,16	
COSTAR GROUP INC COM*	USD	4 985		2 149	2 836	188 941	0,08	
COTERRA ENERGY INC COM USDO.10*	USD	19 826		8 547	11 279	270 309	0,11	
DECKERS OUTDOOR CORP COM*	USD	638		276	362	314 868	0,13	
DEERE & CO COM USD1*	USD	1 018		440	578	194 060	0,08	
DEVON ENERGY CORP NEW COM*	USD	13 190		5 686	7 504	319 623	0,13	
DEXCOM INC COM*	USD	3 389		1 460	1 929	196 533	0,08	
DIGITAL REALTY TRU COM STK USDO.01*	USD	3 413		1 472	1 941	265 203	0,11	
DOMINION ENERGY IN COM STK NPV*	USD	9 412		4 059	5 353	235 700	0,09	
DUKE ENERGY CORP COM USDO.001 (POST REV SPLT)*	USD	32 019		13 802	18 217	1 640 745	0,65	
ECOLAB INC COM*	USD	2 437		1 052	1 385	296 206	0,12	
EDWARDS LIFESCIENCES CORP COM*	USD	7 328		3 159	4 169	346 042	0,14	
ENTEGRIS INC COM*	USD	4 191		1 807	2 384	290 062	0,12	
EQUIFAX INC COM*	USD	2 068		892	1 176	256 220	0,10	
ERIE INDY CO CL A*	USD	1 138		491	647	210 697	0,08	
F M C CORP COM NEW*	USD	7 685		3 312	4 373	226 147	0,09	
FAIR ISAAC CORP COM*	USD	359		154	205	274 231	0,11	
FASTENAL COM USDO.01*	USD	8 018		3 458	4 560	257 494	0,10	
FIRST HORIZON CORP COM USDO.625*	USD	57 271		24 687	32 584	461 745	0,18	
FRANKLIN RES INC COM*	USD	19 377		8 353	11 024	221 403	0,09	11 024
GALLAGHER ARTHUR J & CO COM*	USD	8 445		3 641	4 804	1 119 409	0,45	
GARTNER INC COM*	USD	1 079		464	615	248 168	0,10	
GEN DYNAMICS CORP COM USD1*	USD	2 131		919	1 212	315 992	0,13	
GRACO INC COM*	USD	6 333		2 730	3 603	256 681	0,10	2 200
HEICO CORP NEW CL A*	USD	3 895		1 679	2 216	353 495	0,14	
HENRY JACK & ASSOC COM USDO.01*	USD	10 615		4 577	6 038	900 782	0,36	
HUBBELL INC COM USDO.001*	USD	1 433		618	815	267 663	0,11	
HUBSPOT INC COM USDO.001*	USD	774		334	440	233 194	0,09	
IDEX CORP COM*	USD	2 744		1 183	1 561	282 226	0,11	
IDEXX LABORATORIES COM USDO.10*	USD	847		365	482	211 019	0,08	
ILLINOIS TOOL WKS COM NPV*	USD	2 392		1 032	1 360	289 588	0,12	
INCYTE CORPORATION COM USDO.001*	USD	27 349		11 788	15 561	847 656	0,34	
INTERCONTINENTAL E COM USDO.01*	USD	15 578		6 716	8 862	1 090 109	0,43	100
INTERNATIONAL FLAVORS&FRAGRANC COM*	USD	5 815		2 507	3 308	283 018	0,11	
INTERPUBLIC GROUP COM USDO.10*	USD	14 684		6 330	8 354	218 376	0,09	
INTUITIVE SURGICAL COM USDO.001*	USD	1 539		663	876	350 174	0,14	
JOHNSON & JOHNSON COM USD1*	USD	13 211		5 695	7 516	987 147	0,39	
JUNIPER NETWORKS COM USDO.00001*	USD	45 915		19 793	26 122	855 834	0,34	
KRAFT HEINZ CO COM USDO.01*	USD	13 964		6 020	7 944	230 002	0,09	
LAMB WESTON HLDGS COM USD1.00 WI*	USD	4 196		1 809	2 387	180 348	0,07	2 387
LENNOX INTL INC COM*	USD	1 043		451	592	284 594	0,11	
LIBERTY BROADBAND COM USDO.01 CL 'C'*	USD	6 255		2 696	3 559	175 321	0,07	
LIVE NATION INC COM*	USD	4 961		2 139	2 822	237 711	0,09	

Titel		31.12.2023 Anzahl/ Nominal	Käufe ¹	Verkäufe ²	30.6.2024 Anzahl/ Nominal	Verkehrswert ³ in CHF	in % ³	Davon ausgeliehen Anzahl/Nominal
MARSH & MCLENNAN COM USD1*	USD	10 298		4 439	5 859	1 109 419	0,44	
METTLER TOLEDO INTERNATIONAL COM*	USD	501		216	285	357 924	0,14	
MOLINA HEALTHCARE INC COM*	USD	1 255		541	714	190 748	0,08	
MOODY'S CORP COM USD0.01*	USD	1 446		624	822	310 920	0,12	
NASDAQ INC COM STK USD0.01*	USD	8 861		3 820	5 041	272 968	0,11	
NEWS CORP NEW COM USD0.01 CL'A*	USD	23 295		10 042	13 253	328 335	0,13	
NEXTERA ENERGY INC COM USD0.01*	USD	5 992		2 582	3 410	216 978	0,09	
PAYCOM SOFTWARE IN COM USD0.01*	USD	2 224		958	1 266	162 726	0,06	
PEPSICO INC CAP USD0.016666*	USD	12 292		5 299	6 993	1 036 405	0,41	
PPG INDS INC COM*	USD	3 395		1 463	1 932	218 557	0,09	
PROGRESSIVE CP(OH) COM USD1*	USD	12 420		5 355	7 065	1 318 670	0,53	
PTC INC COM USD0.01*	USD	5 485		2 363	3 122	509 662	0,20	
QORVO INC COM USD 0.0001*	USD	5 050		2 176	2 874	299 682	0,12	
QUANTA SVCS INC COM*	USD	2 093		902	1 191	271 935	0,11	
RELIANCE INC RG*	USD	2 352		1 014	1 338	343 385	0,14	
RESMED INC COM USD0.004*	USD	3 063		1 319	1 744	299 985	0,12	
ROKU INC COM USD0.0001 CLASS A*	USD	4 045		1 744	2 301	123 916	0,05	2 301
ROLLINS INC COM*	USD	9 646		4 159	5 487	240 565	0,10	
ROPER TECHNOLOGIES COM USD0.01*	USD	5 078		2 188	2 890	1 463 799	0,58	
RPM INTERNATIONAL COM USD0.01*	USD	4 236		1 826	2 410	233 195	0,09	
SEMPRA COM NPV*	USD	7 314		3 152	4 162	284 462	0,11	
SHERWIN-WILLIAMS COM USD1*	USD	1 651		712	939	251 811	0,10	
SMITH A O COM*	USD	6 098		2 628	3 470	255 002	0,10	
SNAP INC COM USD0.00001 CL A*	USD	31 345		13 511	17 834	266 186	0,11	
SOUTHERN CO COM*	USD	32 974		14 214	18 760	1 307 655	0,52	
SPLUNK INC COM USD0.001*	USD	3 093		3 093				
SUN COMMUNITIES COM USD0.01*	USD	4 204		1 812	2 392	258 665	0,10	
SUPER MICRO COMPUT COM STK USD0.001*	USD	1 237		534	703	517 596	0,21	703
TAKE TWO INTERACTI COM USD0.01*	USD	2 577		1 110	1 467	204 974	0,08	
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC COM*	USD	1 287		555	732	255 204	0,10	
TERADYNE INC COM USD0.125*	USD	5 616		2 420	3 196	425 878	0,17	
TRANSUNION COM USD0.01*	USD	5 752		2 479	3 273	218 113	0,09	
TYLER TECHNOLOGIES INC COM*	USD	1 103		475	628	283 729	0,11	
VERISIGN INC COM*	USD	4 371		1 885	2 486	397 191	0,16	
VERISK ANALYTICS I CL A USD0.001*	USD	3 916		1 688	2 228	539 661	0,22	
VERTEX PHARMACEUTI COM USD0.01*	USD	2 711		1 168	1 543	649 899	0,26	
WASTE CONNECTIONS COM NPV (POST REV SPLT)*	CAD	12 989		2 859	10 130	1 596 777	0,64	
WASTE CONNECTIONS COM NPV (POST REV SPLT)*	USD	4 814		4 814				
WATERS CORP COM*	USD	1 763		760	1 003	261 484	0,10	
WATSCO INC COM*	USD	1 096		473	623	259 335	0,10	
WEBSTER FINL CORP CONN COM*	USD	9 344		4 027	5 317	208 267	0,08	
WEC ENERGY GROUP COM USD0.01*	USD	19 594		8 446	11 148	785 980	0,31	
WEST PHARMACEUTICA COM USD0.25*	USD	1 099		475	624	184 698	0,07	
XCEL ENERGY INC COM*	USD	27 017		11 646	15 371	737 719	0,29	
ZOETIS INC COM USD0.01 CL 'A'*	USD	2 470		1 065	1 405	218 873	0,09	
ZSCALER INC COM USD0.001*	USD	2 189		943	1 246	215 187	0,09	
Total Vereinigte Staaten						45 153 427	18,01	
Total Inhaberaktien						72 169 768	28,79	
Weitere Aktien								
Schweiz								
ROCHE HLDGS AG GENUSSSCHEINE NPV*	CHF	1 436		620	816	203 592	0,08	
Total Schweiz						203 592	0,08	
Vereinigte Staaten								
CAMDEN PROP TST SBI USD0.01*	USD	7 027		3 029	3 998	391 989	0,16	
Total Vereinigte Staaten						391 989	0,16	
Total Weitere Aktien						595 581	0,24	
Namensaktien								
Argentinien								
MERCADOLIBRE INC COM STK USD0.001*	USD	273		117	156	230 374	0,09	
Total Argentinien						230 374	0,09	
Österreich								
MONDI PLC ORD EURO.22(POST CONS)*	GBP		5 774	1 765	4 009	69 151	0,03	
Total Österreich						69 151	0,03	
Belgien								
UCB NPV*	EUR	8 131		3 505	4 626	617 934	0,25	
WAREHOUSES DE PAUW NPV (POST SPLIT)*	EUR	5 645		2 434	3 211	78 239	0,03	
Total Belgien						696 172	0,28	
Bermuda								
AEGON LIMITED EURO.12*	EUR	33 886		14 609	19 277	107 084	0,04	
LIBERTY GLOBAL LTD COM USD0.01 CLASS C*	USD	27 394		11 808	15 586	250 000	0,10	15 586
Total Bermuda						357 084	0,14	
Finnland								
ELISA OYJ NPV*	EUR	14 724		6 348	8 376	345 578	0,14	
FORTUM OYJ EUR3.40*	EUR	10 127		4 366	5 761	75 734	0,03	5 761
METSO CORPORATION RG*	EUR	21 819		9 408	12 411	118 141	0,05	
NESTE OIL OYJ NPV*	EUR	5 152		2 222	2 930	46 913	0,02	
NOKIA OYJ NPV*	EUR	50 229		21 654	28 575	97 929	0,04	
ORION CORP SER'B'NPV*	EUR	12 367		5 332	7 035	270 061	0,11	7 035
SAMPO PLC NPV A*	EUR	15 865		6 840	9 025	348 539	0,14	
STORA ENSO OYJ NPV SER'R'*	EUR	14 329		6 177	8 152	100 139	0,04	
UPM-KYMMENE CORP NPV*	EUR	5 876		2 533	3 343	105 022	0,04	
Total Finnland						1 508 056	0,60	
Frankreich								
GECINA EUR7.50*	EUR	1 545		666	879	72 760	0,03	
Total Frankreich						72 760	0,03	

Titel		31.12.2023 Anzahl/ Nominal	Käufe ¹	Verkäufe ²	30.6.2024 Anzahl/ Nominal	Verkehrswert ³ in CHF	in % ³	Davon ausgeliehen Anzahl/Nominal
Deutschland								
BRENNTAG AG*	EUR	2 020		871	1 149	69 670	0,03	1 149
DAIMLER TRUCK HOLD NPV (YOUNG SHARE)*	EUR	4 315		1 860	2 455	87 883	0,04	2 455
DEUTSCHE BANK AG NPV(REGD)*	EUR	14 521		6 260	8 261	118 607	0,05	
DEUTSCHE BOERSE AG NPV(REGD)*	EUR	3 284		1 416	1 868	343 793	0,14	
DEUTSCHE POST AG NPV(REGD)*	EUR	4 194		1 809	2 385	86 801	0,03	
DEUTSCHE TELEKOM NPV(REGD)*	EUR	29 126		12 557	16 569	374 675	0,15	
E.ON SE NPV*	EUR	40 628		17 516	23 112	272 779	0,11	
EVONIK INDUSTRIES NPV*	EUR	9 418		4 060	5 358	98 301	0,04	5 358
HANNOVER RUECKVERS ORD NPV(REGD)*	EUR	2 069		892	1 177	268 309	0,11	
LEG IMMOBILIEN SE NPV*	EUR	1 978		853	1 125	82 625	0,03	
MTU AERO ENGINES H NPV (REGD)*	EUR	711		306	405	93 143	0,04	
SCOUT24 SE NPV*	EUR	2 246		969	1 277	87 565	0,03	
SIEMENS AG NPV(REGD)*	EUR	1 133		489	644	107 745	0,04	
SIEMENS HEALTHINEE NPV*	EUR	3 216		1 386	1 830	94 819	0,04	1 830
TALANX AG NPV*	EUR	2 288		986	1 302	93 480	0,04	
TELEFONICA DEUTSCH NPV*	EUR	159 675		65 525	94 150	198 756	0,08	
VONOVIA SE NPV*	EUR	6 492		2 798	3 694	94 454	0,04	
Total Deutschland						2 573 404	1,03	
Italien								
DAVIDE CAMPARI MIL EURO.01*	EUR	14 996		6 465	8 531	72 498	0,03	
ENI SPA EUR1*	EUR	23 375		10 077	13 298	183 831	0,07	13 298
FERRARI NV EURO.01(NEW)*	EUR	2 768		1 193	1 575	577 462	0,23	
MEDIOBANCA SPA EURO.5*	EUR	16 289		7 023	9 266	122 167	0,05	9 266
PRYSMIAN SPA EURO.10*	EUR	4 553		1 963	2 590	144 224	0,06	
RECORDATI EURO.125*	EUR	10 589		4 566	6 023	282 489	0,11	
TERNA SPA ORD EURO.22*	EUR	51 209		22 077	29 132	202 510	0,08	
UNICREDIT SPA NPV (POST REV SPLIT)*	EUR	7 533		3 248	4 285	142 807	0,06	4 285
Total Italien						1 727 989	0,69	
Japan								
AEON CO LTD NPV*	JPY	9 500		3 800	5 700	109 503	0,04	
AGC INC NPV*	JPY	4 600		1 800	2 800	81 429	0,03	
AJINOMOTO CO INC NPV*	JPY	6 331		2 600	3 731	117 571	0,05	
ASAHI GROUP HLDGS NPV*	JPY	6 308		2 600	3 708	117 550	0,05	
ASAHI KASEI CORP NPV*	JPY	29 600		11 600	18 000	103 619	0,04	
ASTELLAS PHARMA NPV*	JPY	24 780		9 800	14 980	133 054	0,05	
BRIDGESTONE CORP NPV*	JPY	7 451		3 000	4 451	157 192	0,06	
CANON INC NPV*	JPY	12 557		4 900	7 657	186 237	0,07	263
DENSO CORP NPV*	JPY	22 644		9 000	13 644	190 394	0,08	
EAST JAPAN RAILWAY NPV*	JPY	4 600	10 800	7 100	8 300	123 541	0,05	
ENEOS HOLDINGS INC NPV*	JPY	49 400		19 400	30 000	138 527	0,06	
FUJII FILM HLD CORP NPV*	JPY	5 184	12 252	7 884	9 552	200 739	0,08	
FUJITSU NPV*	JPY	2 200	16 000	5 800	12 400	174 351	0,07	
HITACHI NPV*	JPY	10 800	32 500	10 800	32 500	653 770	0,26	
HONDA MOTOR CO NPV*	JPY	54 828		21 600	33 228	319 265	0,13	
HOYA CORP NPV*	JPY	4 300		1 700	2 600	271 675	0,11	
INPEX CORPORATION NPV*	JPY	13 000		5 100	7 900	104 458	0,04	
ITOCHU CORP NPV*	JPY	13 300		5 300	8 000	350 994	0,14	
JAPAN POST BANK CO NPV*	JPY	20 400		8 100	12 300	104 406	0,04	
JAPAN POST HOLD CO NPV*	JPY	29 400		11 500	17 900	159 489	0,06	
JAPAN TOBACCO INC NPV*	JPY	13 837		5 600	8 237	200 068	0,08	
KDDI CORP NPV*	JPY	17 109		6 800	10 309	244 981	0,10	
KEYENCE CORP NPV*	JPY	2 300		1 000	1 300	512 341	0,20	
KUBOTA CORP NPV*	JPY	15 400		6 000	9 400	118 149	0,05	
KYOCERA CORP NPV*	JPY	19 488		7 700	11 788	121 922	0,05	
MARUBENI CORP NPV*	JPY	18 200		7 200	11 000	182 840	0,07	
mitsubishi chemical group corp*	JPY	24 800		9 800	15 000	74 836	0,03	
MITSUBISHI CORP NPV*	JPY	39 300		15 600	23 700	416 775	0,17	
MITSUBISHI ELEC CP NPV*	JPY	25 400		10 000	15 400	220 877	0,09	15 400
MITSUBISHI ESTATE NPV*	JPY	17 600		6 900	10 700	150 627	0,06	
MITSUBISHI HVY IND NPV*	JPY	4 200	33 000	11 600	25 600	246 402	0,10	
MITSUBISHI UFJ FIN NPV*	JPY	131 000		51 600	79 400	766 891	0,31	
MITSUI & CO NPV*	JPY	15 122	18 444	15 122	18 444	376 171	0,15	
MITSUI O.S.K.LINES NPV*	JPY	5 400		2 000	3 400	91 509	0,04	
MIZUHO FINL GP NPV*	JPY	30 500		12 000	18 500	347 033	0,14	
MS&AD INSURANCE GROUP HOLDINGS INC NPV*	JPY	5 700	13 200	8 600	10 300	205 699	0,08	
MURATA MFG CO NPV*	JPY	22 000		8 700	13 300	246 814	0,10	
NEC CORP NPV*	JPY	4 100		1 600	2 500	184 974	0,07	
NINTENDO CO LTD NPV*	JPY	12 900		5 000	7 900	377 586	0,15	
NIPPON TEL&TEL CP NPV*	JPY	321 400		126 700	194 700	165 103	0,07	
NIPPON YUSEN KK NPV*	JPY	6 900		2 700	4 200	109 850	0,04	
NISSAN MOTOR CO NPV*	JPY	39 400		15 600	23 800	72 579	0,03	23 800
NOMURA HOLDINGS NPV*	JPY	50 000		19 700	30 300	156 060	0,06	
NOMURA RESEARCH IN NPV*	JPY	6 100		2 500	3 600	90 919	0,04	
NTT DATA GROUP CO NPV*	JPY	13 700		5 500	8 200	108 196	0,04	
OMRON CORP NPV*	JPY	4 170		1 700	2 470	76 289	0,03	
ORIX CORP NPV*	JPY	16 800		6 700	10 100	200 407	0,08	
OTSUKA HLDGS CO NPV*	JPY	5 538		2 100	3 438	130 021	0,05	
PANASONIC CORP*	JPY	29 800		11 800	18 000	132 427	0,05	
RENEASAS ELECTRONIC NPV*	JPY	19 700		7 700	12 000	201 707	0,08	
RESONA HOLDINGS NPV*	JPY	32 400		12 800	19 600	116 552	0,05	
SEVEN & I HOLDINGS NPV*	JPY	8 647	21 741	14 747	15 641	171 253	0,07	
SHIMADZU CORP NPV*	JPY	6 000		2 400	3 600	80 944	0,03	
SOFTBANK CORP NPV*	JPY	34 500		13 600	20 900	229 359	0,09	
SOFTBANK GROUP CO NPV*	JPY	12 737		5 000	7 737	449 062	0,18	
SOMPO HOLDINGS INC NPV*	JPY	4 100	9 900	6 300	7 700	147 753	0,06	
SONY GROUP CORPORA NPV*	JPY	14 079		5 600	8 479	646 067	0,26	
SUBARU CORPORATION NPV*	JPY	9 600		3 800	5 800	110 484	0,04	
SUMITOMO CORP NPV*	JPY	13 200		5 200	8 000	179 519	0,07	
SUMITOMO ELECTRIC NPV*	JPY	14 400		5 700	8 700	121 622	0,05	
SUMITOMO MITSUI FG NPV*	JPY	14 900		5 900	9 000	539 210	0,22	
SUMITOMO MITSUI TR NPV*	JPY	10 800		4 300	6 500	133 259	0,05	
SUMITOMO RLTY&DEV NPV*	JPY	4 900		1 900	3 000	79 118	0,03	
TAKEDA PHARMACEUTI NPV*	JPY	19 709		7 700	12 009	279 878	0,11	

Titel		31.12.2023 Anzahl/ Nominal	Käufe ¹	Verkäufe ²	30.6.2024 Anzahl/ Nominal	Verkehrswert ³ in CHF	in % ³	Davon ausgeliehen Anzahl/Nominal
TDK CORP NPV*	JPY	5 227		2 000	3 227	177 834	0,07	
TOKIO MARINE HLDG NPV*	JPY	20 347		8 100	12 247	410 829	0,16	
TOKYO ELECTRON NPV*	JPY	5 453		2 100	3 353	653 698	0,26	
TOYOTA MOTOR CORP NPV*	JPY	118 375		46 700	71 675	1 317 292	0,53	
UNICHARM CORP NPV*	JPY	5 600		2 200	3 400	98 138	0,04	
WEST JAPAN RAILWAY NPV*	JPY	4 800	7 400	6 500	5 700	95 365	0,04	
YAMAHA MOTOR CO NPV*	JPY	17 268		6 800	10 468	87 072	0,03	
YASKAWA ELEC CORP NPV*	JPY	4 652		1 800	2 852	92 039	0,04	
Total Japan						16 544 162	6,60	
Luxemburg								
ARCELORMITTAL NPV(POST STOCK SPLIT)*	EUR	7 126		3 072	4 054	83 435	0,03	4 054
EUROFINS SCIENTIFI EURO.01*	EUR	2 998		1 293	1 705	76 437	0,03	1 705
Total Luxemburg						159 872	0,06	
Niederlande								
ADYEN NV EURO.01*	EUR	149		64	85	91 128	0,04	
BE SEMICONDUCTOR EURO.01*	EUR	1 258		542	716	107 675	0,04	567
JDE PEETS N.V. EURO.01*	EUR	9 817		4 233	5 584	100 027	0,04	1 830
NN GROUP N.V. EURO.12*	EUR	4 882		2 104	2 778	116 247	0,05	
PROSUS N.V. EURO.05*	EUR	5 266		2 269	2 997	95 999	0,04	
UNIVERSAL MUSIC GR EUR10.00*	EUR	6 525		2 813	3 712	99 312	0,04	
Total Niederlande						610 388	0,24	
Portugal								
EDP ENERGIAS PORTU EUR1(REGD)*	EUR	32 975		14 217	18 758	63 211	0,03	
GALP ENERGIA EUR1-B*	EUR	10 651		4 591	6 060	115 090	0,05	
JERONIMO MARTINS EUR5*	EUR	13 580		5 854	7 726	135 793	0,05	
Total Portugal						314 094	0,13	
Spanien								
FERROVIAL SE EURO.01*	EUR	16 177		6 973	9 204	321 414	0,13	
Total Spanien						321 414	0,13	
Schweiz								
ABB LTD CHF0.12 (REGD)*	CHF	7 684		3 312	4 372	218 250	0,09	
ADECCO GROUP AG CHF0.1 (REGD)*	CHF	3 945		1 701	2 244	66 916	0,03	
ALCON AG CHF0.04*	CHF	6 994		3 017	3 977	319 035	0,13	
BARRY CALLEBAUT AG CHF0.02 (REGD)*	CHF	225		98	127	185 928	0,07	
BKW AG CHF2.5*	CHF	2 488		1 073	1 415	202 770	0,08	
BQE CANT VAUDOISE CHF1*	CHF	3 000		1 294	1 706	162 667	0,06	1 532
CLARIANT CHF1.76 (REGD)*	CHF	11 963		5 158	6 805	96 223	0,04	
DSM FIRMENICH AG EURO.01*	EUR	1 905		821	1 084	110 244	0,04	
EMS-CHEMIE HLDG AG CHF0.01(REGD)(POST RECON)*	CHF	571		246	325	239 363	0,10	
GEBERIT CHF0.10(REGD)*	CHF	859		371	488	259 030	0,10	
GIVAUDAN AG CHF10*	CHF	137		60	77	328 020	0,13	
HOLCIM LTD CHF2 (REGD)*	CHF	3 941		1 699	2 242	178 508	0,07	
JULIUS BAER GRUPPE CHF0.02 (REGD)*	CHF	2 659		1 146	1 513	75 953	0,03	
KUEHNE&NAGEL INTL CHF1(REGD)(POST-SUBD)*	CHF	1 836		791	1 045	270 028	0,11	1 044
LOGITECH INTL CHF0.25(REGD) (POST-SUBD)*	CHF	1 902		819	1 083	94 134	0,04	
LONZA GROUP AG CHF1(REGD)*	CHF	458		198	260	127 504	0,05	
NESTLE SA CHF0.10(REGD)*	CHF	3 992		1 722	2 270	208 204	0,08	
NOVARTIS AG CHF0.49 (REGD)*	CHF	6 107		2 633	3 474	334 095	0,13	
PARTNERS GROUP HLG CHF0.01 (REGD)*	CHF	148		63	85	98 090	0,04	
RICHEMONT(CIE FIN) CHF1.00 (REG) SER 'A'*	CHF	1 449		625	824	115 566	0,05	
SCHINDLER-HLDG AG CHF0.1 (REGD)(POST-SUBD)*	CHF	2 779		1 198	1 581	354 144	0,14	
SGS SA CHF0.04*	CHF	6 188		2 667	3 521	281 680	0,11	
SIG GROUP AG CHF0.01*	CHF	6 449		2 780	3 669	60 355	0,02	
SIKA AG CHF0.01 (REG)*	CHF	679		293	386	99 279	0,04	
SONOVA HOLDING AG CHF0.05 (REGD)*	CHF	591		254	337	93 551	0,04	
STRAUMANN HLDG CHF0.01 (REGD) (POST SPLIT)*	CHF	1 301		561	740	82 362	0,03	
SWATCH GROUP CHF0.45(REGD)*	CHF	3 413		1 472	1 941	71 235	0,03	
SWISS PRIME SITE CHF15.3 (REGD)*	CHF	5 918		2 551	3 367	286 868	0,11	
SWISSCOM AG CHF1(REGD)*	CHF	866		374	492	248 706	0,10	
UBS GROUP CHF0.10 (REGD)*	CHF	7 007		3 020	3 987	105 456	0,04	
VAT GROUP AG CHF0.10*	CHF	440		190	250	127 350	0,05	
ZURICH INSURANCE GRP CHF0.10*	CHF	1 444		622	822	393 820	0,16	
Total Schweiz						5 895 334	2,35	
Grossbritannien								
ABRDN PLC ORD GBPO.1396825396*	GBP	65 469		28 225	37 244	62 698	0,03	
AMCOR PLC ORD USDO.01*	USD	110 415		47 595	62 820	552 082	0,22	
ANGLO AMERICAN USDO.54945*	GBP	6 761		2 915	3 846	109 306	0,04	
ANTOFAGASTA ORD GBPO.05*	GBP	9 097		3 923	5 174	124 010	0,05	
ASHTED GROUP ORD GBPO.10*	GBP	2 718		1 171	1 547	92 819	0,04	
ASSOCD BRIT FOODS ORD GBPO.0568*	GBP	5 028		2 167	2 861	80 402	0,03	
AUTO TRADER GROUP ORD GBPO.01*	GBP	17 718		7 638	10 080	91 738	0,04	
BERKELEY GP HLDGS ORD GBPO.053943*	GBP	2 754		1 187	1 567	81 666	0,03	
BP ORD USDO.25*	GBP	27 847		12 006	15 841	85 508	0,03	
COMPASS GROUP ORD GBPO.1105*	GBP	15 550		6 705	8 845	217 020	0,09	
CRODA INTL ORD GBPO.10609756*	GBP	2 588		1 117	1 471	65 969	0,03	
EXPERIAN ORD USDO.10*	GBP	5 359		2 310	3 049	127 662	0,05	
FERGUSON PLC (NEW) ORD GBPO.10*	USD	2 476		1 067	1 409	245 186	0,10	
HSBC HLDGS ORD USDO.50(UK REG)*	GBP	100 808		43 461	57 347	445 504	0,18	
INTERCONTL HOTELS ORD GBPO.208521303*	GBP	2 321		1 001	1 320	124 841	0,05	
LONDON STOCK EXCH ORD GBPO.06918604*	GBP	1 430		617	813	86 809	0,03	
M&G PLC ORD GBPO.05*	GBP	68 487		29 526	38 961	90 283	0,04	
MONDI ORD EURO.20*	GBP	7 753		7 753				
NEXT ORD GBPO.10*	GBP	1 655		713	942	96 689	0,04	
PERSIMMON ORD GBPO.10*	GBP	9 849		4 247	5 602	86 034	0,03	
PHOENIX GP HLDGS ORD GBPO.10*	GBP	31 309		13 499	17 810	105 503	0,04	
RIO TINTO ORD GBPO.10*	GBP	12 835		5 533	7 302	431 396	0,17	
SAINSBURY(J) ORD GBPO.28571428*	GBP	41 028		17 687	23 341	67 609	0,03	
SCHROEDERS PLC ORD GBPO.20*	GBP	30 294		13 060	17 234	71 219	0,03	
STELLANTIS N V COM EURO.01*	EUR	10 526		4 537	5 989	106 532	0,04	
TAYLOR WIMPEY ORD GBPO.01*	GBP	101 182		43 622	57 560	92 943	0,04	

Titel		31.12.2023 Anzahl/ Nominal	Käufe ¹	Verkäufe ²	30.6.2024 Anzahl/ Nominal	Verkehrswert ³ in CHF	in % ³	Davon ausgeliehen Anzahl/Nominal
UNILEVER PLC ORD GBPO.031111*	GBP	2 173		2 173				
UNILEVER PLC ORD GBPO.031111*	EUR	7 841		2 144	5 697	281 355	0,11	
VODAFONE GROUP ORD USDO.2095238(POST CONS)*	GBP	183 841		79 257	104 584	82 874	0,03	
WISE PLC CLS A ORD GBPO.01*	GBP	13 525		5 831	7 694	59 562	0,02	
Total Grossbritannien						4 165 217	1,66	
Vereinigte Staaten								
ABBVIE INC COM USDO.01*	USD	14 233		6 135	8 098	1 248 128	0,50	
ACCENTURE PLC SHS CL A 'NEW'*	USD	8 135		3 506	4 629	1 262 070	0,50	
ADOBE INC COM USDO.0001*	USD	683		295	388	193 693	0,08	
AGILENT TECHNOLOGIES INC COM*	USD	4 260		1 836	2 424	282 361	0,11	
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQ INC COM*	USD	5 200		2 242	2 958	310 913	0,12	
ALLSTATE CORP COM*	USD	3 317		1 431	1 886	270 585	0,11	
ALPHABET INC CAP STK USDO.001 CL A*	USD	3 773		1 626	2 147	351 421	0,14	
AMAZON COM INC COM USDO.01*	USD	2 656		1 146	1 510	262 218	0,10	
AMER EXPRESS CO COM USDO.20*	USD	3 180		1 371	1 809	376 400	0,15	
AMER FINL GP OHIO COM NPV*	USD	7 728		3 331	4 397	486 070	0,19	
AMER INTL GRP COM USDO.50*	USD	7 809		3 367	4 442	296 335	0,12	4 442
AMER TOWER CORP COM NEW USDO.01*	USD	2 475		1 066	1 409	246 110	0,10	
AMERIPRISE FINL INC COM*	USD	1 439		621	818	314 008	0,13	
AMGEN INC COM USDO.0001*	USD	5 615		2 420	3 195	897 052	0,36	
AMPHENOL CORP NEW CL A*	USD	27 495	31 286	27 495	31 286	1 894 013	0,76	
ANALOG DEVICES INC COM*	USD	2 775		1 195	1 580	324 081	0,13	
AON PLC COM USDO.01 CL A*	USD	2 973		1 282	1 691	446 104	0,18	
APA CORPORATION COM USDO.625*	USD	16 953		7 308	9 645	255 156	0,10	
APOLLO GLOBAL MANA COM USDO.00001*	USD	4 948		2 133	2 815	298 665	0,12	
APPLE INC COM NPV*	USD	10 861		4 683	6 178	1 169 268	0,47	
ARAMARK COM USDO.01*	USD	14 482		6 243	8 239	251 869	0,10	
ARCH CAPITAL GROUP COM USDO.01*	USD	5 573		2 402	3 171	287 482	0,11	
ARES MANAGEMNT COR COM USDO.01 CLASS A*	USD	4 007		1 726	2 281	273 185	0,11	
ASPEN TECHNOLOGY COM USDO.10*	USD	1 751		755	996	177 775	0,07	996
ASSURANT INC COM*	USD	4 884		2 105	2 779	415 161	0,17	
AT&T INC COM USD1*	USD	87 057		37 527	49 530	850 541	0,34	
ATMOS ENERGY CORP COM*	USD	4 762		2 052	2 710	284 067	0,11	
AUTO DATA PROCESS COM USDO.10*	USD	6 354		2 739	3 615	775 370	0,31	
AUTODESK INC COM USDO.01*	USD	2 049		883	1 166	259 270	0,10	
AUTOZONE INC COM USDO.01*	USD	767		330	437	1 163 967	0,46	
AVERY DENNISON CORP COM*	USD	2 829		1 220	1 609	316 135	0,13	
BALL CORP COM NPV*	USD	7 539		3 249	4 290	231 377	0,09	
BECTON DICKINSON COM USD1*	USD	6 327		2 727	3 600	756 043	0,30	
BENTLEY SYSTEMS IN COM USDO.01 CLASS B*	USD	8 557		3 689	4 868	215 920	0,09	
BIOGEN INC COM STK USDO.0005*	USD	2 025		873	1 152	239 977	0,10	452
BK OF AMERICA CORP COM USDO.01*	USD	16 364		7 055	9 309	332 679	0,13	
BLACKSTONE INC COM USDO.00001*	USD	3 600		1 551	2 049	227 944	0,09	
BOEING CO COM USD5*	USD	1 810		780	1 030	168 461	0,07	
BOOKING HLDGS INC COM USDO.008*	USD	147		63	84	299 024	0,12	
BORG WARNER INC COM*	USD	13 829		5 960	7 869	227 972	0,09	
BRISTOL-MYRS SQUIB COM STK USDO.10*	USD	28 221		12 165	16 056	599 192	0,24	
BROADCOM CORP COM USD1.00*	USD	3 502		1 509	1 993	2 875 359	1,15	
CAPITAL ONE FINL COM USDO.01*	USD	4 127		1 778	2 349	292 242	0,12	
CARDINAL HEALTH INC COM*	USD	4 264		1 837	2 427	214 426	0,09	
CARLYLE GROUP INC COM USDO.01*	USD	13 510		5 823	7 687	277 338	0,11	7 687
CATERPILLAR INC DEL COM*	USD	1 509		650	859	257 119	0,10	
CBOE GLOBAL MARKET COM USDO.01*	USD	11 644		5 019	6 625	1 012 405	0,40	
CELANESE CORP COM SERIES 'A' USDO.0001*	USD	3 626		1 562	2 064	250 182	0,10	2 064
CENCORA INC RG*	USD	2 847		1 228	1 619	327 774	0,13	1 619
CENTENE CORP DEL COM*	USD	6 636		2 859	3 777	225 023	0,09	
CF INDS HLDGS INC COM*	USD	12 559		5 414	7 145	475 887	0,19	
CH ROBINSON WORLDW COM USDO.1*	USD	12 338		5 319	7 019	555 797	0,22	
CHARTER COMMUN INC COM USDO.001 CLASS 'A'*	USD	1 240		536	704	189 126	0,08	704
CHESAPEAKE ENERGY COM USDO.01*	USD	5 850		2 522	3 328	245 793	0,10	3 328
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC CL A*	USD	196	5 600	196	5 600	315 265	0,13	
CHUBB LIMITED ORD CHF24.15*	USD	2 383		1 027	1 356	310 815	0,12	
CHURCH & DWIGHT INC COM*	USD	5 416		2 335	3 081	287 047	0,11	
CIGNA GROUP/THE USDO.25*	USD	1 632		704	928	275 663	0,11	
CISCO SYSTEMS COM USDO.001*	USD	42 951		18 514	24 437	1 043 276	0,42	
CITIZENS FINL GP COM USDO.01*	USD	15 863		6 838	9 025	292 198	0,12	
CLOUDFLARE INC COM USDO.001 CL A*	USD	5 577		2 403	3 174	236 244	0,09	
COGNIZANT TECHNOL COM CL'A'USDO.01*	USD	12 153		5 238	6 915	422 540	0,17	
COINBASE GLOBAL IN COM USDO.00001 CL A*	USD	3 368		1 452	1 916	382 617	0,15	
COMCAST CORP COM CLS'A' USDO.01*	USD	25 775		11 110	14 665	516 049	0,21	
CONAGRA BRANDS IN COM USD5*	USD	18 999		8 190	10 809	276 043	0,11	
CONSOLIDATED EDISON INC COM*	USD	25 741		11 095	14 646	1 176 847	0,47	
CONSTELLATION ENE. COM NPV*	USD	3 038		1 309	1 729	311 155	0,12	
CORNING INC COM USDO.50*	USD	16 459		7 094	9 365	326 938	0,13	9 365
CORTEVA INC COM USDO.01*	USD	12 412		5 350	7 062	342 299	0,14	
CRH ORD EURO.32*	USD	2 043		881	1 162	78 292	0,03	
CROWDSTRIKE HOLDIN COM USDO.0005 CL A*	USD	2 040		879	1 161	399 772	0,16	
CROWN CASTLE INC COM USDO.01*	USD	4 564		1 967	2 597	227 999	0,09	
CUMMINS INC COM*	USD	2 283		984	1 299	323 255	0,13	
CVS HEALTH CORP COM STK USDO.01*	USD	6 299		2 714	3 585	190 261	0,08	
D R HORTON INC COM*	USD	3 202		1 381	1 821	230 611	0,09	
DANAHER CORP COM USDO.01*	USD	2 252		970	1 282	287 829	0,11	
DARDEN RESTAURANTS INC COM*	USD	3 610		1 557	2 053	279 159	0,11	2 053
DATADOG INC COM USDO.00001 CL A*	USD	3 551		1 530	2 021	235 526	0,09	
DAYFORCE INC RG*	USD	6 028		2 599	3 429	152 832	0,06	3 429
DELL TECHNOLOGIES COM USDO.01 CL C*	USD	17 393		7 497	9 896	1 226 371	0,49	
DENTSPLY SIRONA IN COM NPV*	USD	13 480		5 810	7 670	171 686	0,07	
DISCOVER FINL SVCS COM STK USDO.01*	USD	5 569		2 401	3 168	372 385	0,15	
DOMINOS PIZZA INC COM USDO.01*	USD	2 005		865	1 140	528 931	0,21	
DOORDASH INC COM USDO.00001 CLASS A*	USD	4 475		1 930	2 545	248 773	0,10	
DRAFTKINGS INC NEW COM USDO.0001 CL A*	USD	12 265		5 287	6 978	239 342	0,10	
DYNATRACE INC COM USDO.001*	USD	7 481		3 225	4 256	171 106	0,07	
EASTMAN CHEM CO COM*	USD	6 038		2 604	3 434	302 315	0,12	
EBAY INC COM USDO.001*	USD	12 373		5 333	7 040	339 840	0,14	
ELECTRONIC ARTS INC COM*	USD	9 793		4 223	5 570	697 375	0,28	
ELEVANCE HEALTH INC USDO.01*	USD	1 051		453	598	291 175	0,12	

Titel		31.12.2023 Anzahl/ Nominal	Käufe ¹	Verkäufe ²	30.6.2024 Anzahl/ Nominal	Verkehrswert ³ in CHF	in % ³	Davon ausgeliehen Anzahl/Nominal
ELI LILLY AND CO COM NPV*	USD	5 613		2 419	3 194	2 598 557	1,04	
EMERSON ELEC CO COM*	USD	5 133		2 213	2 920	289 050	0,12	
EQUITABLE HOLDINGS COM USD0.01*	USD	17 775		17 775				
ESSENTIAL UTILS IN COM USD0.50*	USD	15 390		6 632	8 758	293 785	0,12	8 758
ESTEE LAUDER COS CLASS'A'COM USD0.01*	USD	3 380		1 458	1 922	183 764	0,07	
EVEREST GROUP LTD COM USD0.01*	USD	1 133		488	645	220 838	0,09	
EVERSOURCE ENERGY COM USD5*	USD	10 200		4 398	5 802	295 668	0,12	
EXELON CORP COM NPV*	USD	11 804		5 089	6 715	208 840	0,08	
EXPEDIA GROUP INC COM USD0.001*	USD	3 498		1 508	1 990	225 297	0,09	
EXPEDTRS INTL WASH COM USD0.01*	USD	19 093		8 229	10 864	1 218 249	0,49	
EXTRA SPACE STORAG COM USD0.01*	USD	3 228		1 393	1 835	256 260	0,10	
EXXON MOBIL CORP COM NPV*	USD	10 930		4 712	6 218	643 232	0,26	
FIDELITY NATL INF COM STK USD0.01*	USD	7 391		3 186	4 205	284 756	0,11	
FIFTH THIRD BANCORP COM*	USD	17 155		7 395	9 760	320 030	0,13	1 442
FISERV INC COM USD0.01*	USD	8 453		3 644	4 809	644 057	0,26	
FREPORT-MCMORAN COM STK USD0.10*	USD	18 967		8 175	10 792	471 308	0,19	
GARMIN LTD COM CHF10.00*	USD	4 565		1 967	2 598	380 347	0,15	
GEN DIGITAL INC COM USD0.01*	USD	50 706		21 858	28 848	647 552	0,26	
GENERAL MLS INC COM*	USD	29 973		12 920	17 053	969 385	0,39	
GENERAL MOTORS CO COM USD0.01*	USD	14 303		6 167	8 136	339 670	0,14	
GENUINE PARTS CO COM STK USD1*	USD	4 050		1 746	2 304	286 374	0,11	
GILEAD SCIENCES COM USD0.001*	USD	31 975		13 784	18 191	1 121 529	0,45	
GODADDY INC COM CL A USD0.001*	USD	14 547		6 271	8 276	1 038 997	0,41	
GRAINGER W W INC COM*	USD	528		228	300	243 226	0,10	
GSK PLC ORD GBP0.3125*	GBP	41 068		17 705	23 363	405 906	0,16	
HALLIBURTON COM STK USD2.50*	USD	16 768		7 229	9 539	289 554	0,12	
HARTFORD FINL SVCS COM USD0.01*	USD	7 605		3 279	4 326	390 834	0,16	
HEALTHCARE REALTY COM USD0.01 CL A*	USD	37 248		16 056	21 192	313 831	0,13	21 192
HEALTHPEAK PPTY'S I COM USD1*	USD	41 539		17 906	23 633	416 238	0,17	
HERSHEY COMPANY COM USD1.00*	USD	9 036		3 894	5 142	849 405	0,34	
HEWLETT PACKARD EN COM USD0.01*	USD	24 296		10 474	13 822	262 941	0,10	
HOME DEPOT INC COM USD0.05*	USD	4 586		1 976	2 610	807 362	0,32	
HORMEL FOODS CORP COM USD0.0586*	USD	44 570		19 212	25 358	694 766	0,28	
HUNTINGTON BANCSHARES INC COM*	USD	41 763		18 002	23 761	281 415	0,11	
HYATT HOTELS CORP COM USD0.01 CLASS 'A'*	USD	4 701		2 026	2 675	365 178	0,15	2 226
INGERSOLL RAND INC COM USD1.00*	USD	7 048		3 039	4 009	327 250	0,13	
INTEL CORP COM USD0.001*	USD	10 463		4 511	5 952	165 642	0,07	
INTL BUSINESS MCHN COM USD0.20*	USD	16 975		7 318	9 657	1 500 822	0,60	
INTL PAPER CO COM USD1.00*	USD	13 803		5 949	7 854	304 536	0,12	
IQVIA HOLDINGS INC COM USD0.01*	USD	2 444		1 054	1 390	264 100	0,11	
JACOBS SOLUTIONS COM USD1.00*	USD	3 430		1 479	1 951	244 935	0,10	
JOHNSON CTLS INTL COM USD0.01*	USD	7 279		3 138	4 141	247 342	0,10	
KELLANOVA COM USD0.25*	USD	26 437		11 396	15 041	779 594	0,31	
KENVUE INC COM USD0.01*	USD	23 433		10 101	13 332	217 799	0,09	
KEURIG DR PEPPER COM USD0.01*	USD	40 076		17 274	22 802	684 362	0,27	
KEYCORP NEW COM*	USD	33 831		14 583	19 248	245 780	0,10	
KEYSIGHT TECHNOLOG COM USD0.01 'WD'*	USD	15 117		6 517	8 600	1 056 799	0,42	
KIMCO REALTY COM USD0.01*	USD	30 843		13 295	17 548	306 858	0,12	17 548
KKR & CO INC COM NPV CLASS A*	USD	6 040		2 604	3 436	324 938	0,13	3 436
KLA CORPORATION COM USD0.001*	USD	893		384	509	377 120	0,15	
KNIGHT SWIFT TRANS CL A COM STK USD0.01*	USD	8 114		3 498	4 616	207 065	0,08	
KROGER CO COM USD1*	USD	19 599		8 448	11 151	500 313	0,20	
L3HARRIS TECHNOLOG COM USD1.00*	USD	2 872		1 237	1 635	329 955	0,13	
LEAR CORP COM USD0.01*	USD	3 869		1 668	2 201	225 887	0,09	2 201
LENNAR CORP COM CL'A'USD0.10*	USD	3 369		1 452	1 917	258 168	0,10	
LIBERTY MEDIA CORP COM USD0.01 FORMULA ONE C*	USD	6 935		2 988	3 947	254 800	0,10	
LIBERTY MEDIA CORP COM USD0.01 SER C SIRIUSXM*	USD	17 580		7 579	10 001	199 150	0,08	10 001
LKQ CORP COM*	USD	11 443		4 932	6 511	243 334	0,10	
LOWE'S COS INC COM USD0.50*	USD	2 501		1 078	1 423	281 904	0,11	
LULULEMON ATHLETIC COM STK USD0.01*	USD	842		362	480	128 838	0,05	
MARATHON PETROLEUM COM USD0.01*	USD	7 663		3 303	4 360	679 677	0,27	4 360
MASCO CORP COM*	USD	7 356		3 171	4 185	250 722	0,10	
MASTERCARD INC COM USD0.0001 CLASS 'A'*	USD	2 826		1 218	1 608	637 454	0,25	
MCCORMICK & CO INC COM NAVTG NPV*	USD	5 709		2 461	3 248	207 049	0,08	
MCDONALD'S CORP COM USD0.01*	USD	10 024		4 321	5 703	1 305 983	0,52	
MCKESSON CORP COM USD0.01*	USD	4 323		1 863	2 460	1 291 053	0,51	
MERCK & CO INC COM USD0.50*	USD	18 178		7 835	10 343	1 150 624	0,46	
META PLATFORMS INC*	USD	1 231		529	702	318 071	0,13	
METLIFE INC COM USD0.01*	USD	7 066		3 046	4 020	253 552	0,10	
MICROCHIP TECHNOLGY COM USD0.001*	USD	5 905		2 545	3 360	276 266	0,11	
MICRON TECHNOLOGY COM USD0.10*	USD	5 628		2 425	3 203	378 572	0,15	
MICROSOFT CORP COM USD0.0000125*	USD	8 269		3 564	4 705	1 889 666	0,75	
MORGAN STANLEY COM STK USD0.01*	USD	6 036		2 602	3 434	299 908	0,12	
MOTOROLA SOLUTIONS COM USD0.01*	USD	7 247		3 123	4 124	1 430 634	0,57	
NETAPP INC COM USD0.001*	USD	5 737		2 473	3 264	377 774	0,15	
NETFLIX INC COM USD0.001*	USD	853		368	485	294 127	0,12	
NEWMONT CORPORATIO COM USD1.60*	USD	35 790		15 428	20 362	766 108	0,31	
NIKE INC CLASS'B'COM NPV*	USD	3 843		1 657	2 186	148 052	0,06	
NORFOLK STHN CORP COM USD1*	USD	2 396		1 033	1 363	262 951	0,10	
NORTHERN TRUST CP COM USD1.666*	USD	6 114		2 636	3 478	262 465	0,10	
NRG ENERGY INC COM USD0.01*	USD	8 294		3 575	4 719	330 165	0,13	
OCCIDENTAL PETRLM COM USD0.20*	USD	7 139		3 078	4 061	230 010	0,09	
OLD DOMINION FGHT LINES INC COM*	USD	1 020	1 548	1 406	1 162	184 401	0,07	
ONEOK INC*	USD	8 127		3 503	4 624	338 851	0,14	
ORACLE CORP COM USD0.01*	USD	21 786		9 392	12 394	1 572 579	0,63	
OREILLY AUTO NEW COM USD0.01*	USD	1 640		706	934	886 343	0,35	
OVINTIV INC COM USD0.01*	USD	11 970		5 159	6 811	286 861	0,11	
PALANTIR TECH INC COM USD0.001 CLASS A*	USD	23 208		10 004	13 204	300 543	0,12	
PALO ALTO NETWORKS COM USD0.0001*	USD	1 390		600	790	240 661	0,10	
PFIZER INC COM USD0.05*	USD	59 465		25 633	33 832	850 632	0,34	
PG&E CORP COM*	USD	22 498		9 699	12 799	200 811	0,08	
PHILLIPS 66 COM USD0.01*	USD	4 193		1 808	2 385	302 550	0,12	
PINTEREST INC COM USD0.00001 CL A*	USD	12 181		5 250	6 931	274 477	0,11	
PNC FINANCIAL SVCS COM USD5*	USD	3 748		1 615	2 133	298 011	0,12	
PROCTER & GAMBLE COM NPV*	USD	14 907		6 425	8 482	1 257 008	0,50	
PROLOGIS INC COM USD0.01*	USD	5 104		2 201	2 903	292 976	0,12	
PUBLIC SVC ENTERPRISE GROUP COM*	USD	7 831		3 376	4 455	295 040	0,12	
QIAGEN NV ORD EUR0.01 (POST REV SPLT)*	EUR		13 422	4 102	9 320	346 917	0,14	

Titel		31.12.2023 Anzahl/ Nominal	Käufe ¹	Verkäufe ²	30.6.2024 Anzahl/ Nominal	Verkehrswert ³ in CHF	in % ³	Davon ausgeliehen Anzahl/Nominal
QUALCOMM INC COM USD0.0001*	USD	3 313		1 428	1 885	337 383	0,13	
REGENERON PHARMACE COM USD0.001*	USD	2 028		874	1 154	1 089 902	0,43	
REPUBLIC SERVICES COM USD0.01*	USD	19 930		8 591	11 339	1 980 174	0,79	
ROBERT HALF INTL COM USD0.001*	USD	5 243		2 260	2 983	171 500	0,07	
ROBLOX CORPORATION COM USD0.0001 CL A*	USD	10 580		4 561	6 019	201 257	0,08	
ROCKWELL AUTOMATIO COM USD1*	USD	1 469		634	835	206 551	0,08	
ROSS STORES INC COM USD0.01*	USD	3 654		1 575	2 079	271 485	0,11	
SALESFORCE, INC. *	USD	1 724		743	981	226 640	0,09	
SBA COMMUNICATIONS COM USD0.01 CL A*	USD	2 066		890	1 176	207 441	0,08	
SCHEIN HENRY INC COM*	USD	6 420		2 768	3 652	210 356	0,08	3 652
SEAGATE TECHNOLOGY COM USD0.00001*	USD	5 484		2 363	3 121	289 624	0,12	
SERVICENOW INC COM USD0.001*	USD	660		285	375	265 088	0,11	
SKYWORKS SOLUTIONS INC COM*	USD	4 958		2 138	2 820	270 079	0,11	
SMUCKER(JM)CO COM NPV*	USD	4 032		1 737	2 295	224 872	0,09	
SNOWFLAKE INC COM USD0.0001 CLASS A*	USD	2 373		1 022	1 351	164 000	0,07	
SOLVENTUM CORP COM USD0.01 WI*	USD		891	222	669	31 790	0,01	
SOUTHWEST AIRLINES COM USD1*	USD	18 139		7 818	10 321	265 342	0,11	9 781
STARBUCKS CORP COM USD0.001*	USD	4 958		2 138	2 820	197 276	0,08	
T ROWE PRICE GROUP COM USD0.20*	USD	5 343		2 303	3 040	314 997	0,13	
T-MOBILE US INC COM USD0.0001*	USD	18 005		7 761	10 244	1 621 782	0,65	
TARGET CORP COM STK USD0.0833*	USD	3 614		1 558	2 056	273 507	0,11	
TELEFLEX INC COM*	USD	2 148		925	1 223	231 150	0,09	
TENARIS S.A. USD1*	EUR	7 895		3 404	4 491	62 066	0,02	4 491
TEXAS INSTRUMENTS COM USD1*	USD	17 643		7 605	10 038	1 754 689	0,70	10 038
THERMO FISHER SCIE COM USD1*	USD	1 117		481	636	316 045	0,13	
TRACTOR SUPPLY CO COM USD0.008*	USD	2 401		1 035	1 366	331 422	0,13	741
TRADEWEB MARKETS I COM USD0.00001 CL A*	USD	4 167		1 796	2 371	225 842	0,09	
TRANE TECHNOLOGIES COM USD1*	USD	1 827		789	1 038	306 808	0,12	
TRANSDIGM GROUP INC COM*	USD	547		235	312	358 195	0,14	
TRAVELERS CO INC COM NPV*	USD	7 250		3 125	4 125	753 725	0,30	
TRUIST FINL CORP COM USD5*	USD	12 085		5 209	6 876	240 045	0,10	
TYSON FOODS INC CL A*	USD	8 729		3 763	4 966	254 984	0,10	
U HAUL HOLDING COM COM USD0.25 SER N*	USD	7 216		3 110	4 106	221 453	0,09	3 177
UBER TECHNOLOGIES COM USD0.00001*	USD	7 139		3 078	4 061	265 225	0,11	
UIPATH INC COM USD0.00001 CL A*	USD	16 461		7 095	9 366	106 719	0,04	
ULTA BEAUTY INC COM STK USD0.01*	USD	1 026		441	585	202 845	0,08	
UNITED RENTALS INC COM*	USD	857		370	487	283 021	0,11	487
UNITEDHEALTH GRP COM USD0.01*	USD	5 213		2 247	2 966	1 357 304	0,54	
US BANCORP COM USD0.01*	USD	10 540		4 544	5 996	213 904	0,09	
UTD THERAPEUTIC COM USD0.01*	USD	1 573		678	895	256 193	0,10	
VAIL RESORTS INC COM*	USD	1 986		856	1 130	182 907	0,07	
VALERO ENERGY CORP NEW COM*	USD	3 814		1 644	2 170	305 676	0,12	2 170
VERIZON COMMUN COM USD0.10*	USD	57 569		24 816	32 753	1 213 769	0,48	
VISA INC COM STK USD0.0001*	USD	5 756		2 480	3 276	772 663	0,31	3 276
WALGREENS BOOTS AL COM USD0.01*	USD	20 809		8 969	11 840	128 684	0,05	10 940
WALMART INC COM USD0.10*	USD	11 772	28 932	20 610	20 094	1 222 603	0,49	
WALT DISNEY CO. DISNEY COM USD0.01*	USD	5 729		2 469	3 260	290 864	0,12	
WASTE MGMT INC DEL COM*	USD	17 310		7 462	9 848	1 887 934	0,75	
WESTERN DIGITAL CORP COM*	USD	9 209		3 970	5 239	356 707	0,14	1 471
WESTLAKE CORP COM USD0.01*	USD	3 104		1 338	1 766	229 819	0,09	
WESTROCK CO COM USD0.01*	USD	12 024		5 183	6 841	308 964	0,12	
WHIRLPOOL CORP COM*	USD	3 820		1 646	2 174	199 653	0,08	1 885
WORKDAY INC COM USD0.001 CL A*	USD	1 624		701	923	185 422	0,07	
XYLEM INC COM USD0.01 WI*	USD	4 128		1 779	2 349	286 289	0,11	
YUM BRANDS INC COM*	USD	8 566		3 692	4 874	580 145	0,23	
ZOOM VIDEO COMMUNI COM USD0.001 CL A*	USD	6 390		2 754	3 636	193 392	0,08	
Total Vereinigte Staaten						114 059 572	45,50	

Total Namensaktien **149 305 043** **59,56**

Investmentzertifikate, closed end

Grossbritannien

SEGRO PLC REIT*	GBP	15 173		6 541	8 632	88 071	0,04	
-----------------	-----	--------	--	-------	-------	--------	------	--

Total Grossbritannien **88 071** **0,04**

Total Investmentzertifikate, closed end **88 071** **0,04**

Anrechte

Italien

AMPLIFON SPA RIGHTS 09.07.24*	EUR		2 895		2 895	0	0,00	
-------------------------------	-----	--	-------	--	-------	---	------	--

Total Italien **0,00**

Spanien

ACS ACTIVIDADES DE CONS-RIGHTS (STOCK DIVIDEND) 24-02.02.24*	EUR		4 381	4 381				
--	-----	--	-------	-------	--	--	--	--

EDP RENOVAVEIS SA (STOCK DIVIDEND) RIGHTS 24-20.05.24*	EUR		5 906	5 906				
--	-----	--	-------	-------	--	--	--	--

Total Spanien **0,00**

Grossbritannien

NATIONAL GRID PLC RIGHTS 10.06.24*	GBP		7 554	7 554				
------------------------------------	-----	--	-------	-------	--	--	--	--

Total Grossbritannien **0,00**

Total Anrechte **0,00**

Total Effekten, die an einer Börse gehandelt werden **222 158 462** **88,62**

Effekten, die nicht an einer Börse oder einem andern geregelten Markt gehandelt werden

Namensaktien

Vereinigte Staaten

QIAGEN NV EURO.01**	EUR	16 891		16 891				
---------------------	-----	--------	--	--------	--	--	--	--

Total Vereinigte Staaten **0,00**

Total Namensaktien **0,00**

Titel	31.12.2023 Anzahl/ Nominal	Käufe ¹	Verkäufe ²	30.6.2024 Anzahl/ Nominal	Verkehrswert ³ in CHF	in % ³	Davon ausgeliehen Anzahl/Nominal
Investmentzertifikate, open end							
Global							
SWISS LIFE FUNDS (CH) MONEY MARKET SWISS FRANCS A CAP**	CHF	100 000	30 000	100 000	30 000	3 051 300	1,21
Total Global						3 051 300	1,21
Total Investmentzertifikate, open end						3 051 300	1,21
Total Effekten, die nicht an einer Börse oder einem andern geregelten Markt gehandelt werden						3 051 300	1,21
Total Wertschriften						225 209 762	89,83
(davon ausgeliehen)						14 835 383	5,92)
Bankguthaben auf Sicht					22 616 261	9,02	
Derivative Finanzinstrumente					1 825 316	0,73	
Sonstige Vermögenswerte					1 046 700	0,42	
Gesamtfondsvermögen					250 698 039	100,00	
Kurzfristige Bankverbindlichkeiten					-6 757 533		
Andere Verbindlichkeiten					-141 947		
Nettofondsvermögen					243 798 559		

Bewertungskategorie	Verkehrswert per 30.6.2024	in % des Gesamt- fondsvermögens ³
Anlagen bewertet zu den Kursen, die am Hauptmarkt bezahlt werden	223 983 778	89,35
Anlagen bewertet aufgrund von am Markt beobachtbaren Parametern	3 051 300	1,21
Anlagen bewertet mit geeigneten Bewertungsmodellen unter Berücksichtigung der aktuellen Marktgegebenheiten	-	-
Total	227 035 078	90,56

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					
SWISS MARKET INDEX PUT 11400.00000 20.12.24*	18	CHF	-2 052 000	32 580	0.01
EURO STOXX 50 PUT 4700.00000 20.09.24*	124	EUR	-5 612 798	82 042	0.03
EURO STOXX 50 PUT 4600.00000 21.03.25*	124	EUR	-5 493 377	154 412	0.06
EURO STOXX 50 PUT 4800.00000 20.06.25*	124	EUR	-5 732 220	288 163	0.11
SWISS MARKET INDEX PUT 11500.00000 20.09.24*	18	CHF	-2 070 000	18 306	0.01
EURO STOXX 50 PUT 4650.00000 20.12.24*	124	EUR	-5 553 088	126 109	0.05
SWISS MARKET INDEX PUT 11300.00000 20.06.25*	18	CHF	-2 034 000	63 738	0.03
FTSE 100 INDEX PUT 7600.00000 20.06.25*	27	GBP	-2 330 908	53 366	0.02
FTSE 100 INDEX PUT 7800.00000 20.09.24*	29	GBP	-2 569 452	16 965	0.01
FTSE 100 INDEX PUT 7700.00000 20.12.24*	29	GBP	-2 536 510	30 306	0.01
NIKKEI 225 INDEX PUT 37000.00000 13.12.24*	35	JPY	-7 234 160	178 899	0.07
NIKKEI 225 INDEX PUT 37000.00000 13.09.24*	35	JPY	-7 234 160	69 409	0.03
S&P 500 INDEX PUT 5000.00000 20.06.25*	83	USD	-37 291 900	917 381	0.37
S&P 500 INDEX PUT 5150.00000 20.09.24*	83	USD	-38 410 657	255 077	0.10
S&P 500 INDEX PUT 5100.00000 20.12.24*	83	USD	-38 037 738	543 268	0.22
S&P 500 INDEX PUT 5000.00000 21.03.25*	83	USD	-37 291 900	680 950	0.27
NIKKEI 225 INDEX PUT 37000.00000 14.03.25*	35	JPY	-7 234 160	263 948	0.11
			-208 719 028	3 774 919	1.51

Instrument	Anzahl Kontrakte	Währung	Gebundene Basiswerte in Obligationen/Aktien in CHF	Variation Margin in CHF	In % des Vermögens
Futures auf Indices/Commodities/Währungen					
EURO FX CURRENCY FUTURE 16.09.24*	-195	USD	-23 550 509	134 706	0.05
GBP CURRENCY FUTURE 16.09.24*	-100	USD	-7 103 995	66 833	0.03
JAPANESE YEN CURRENCY FUTURE 16.09.24*	-325	USD	-22 971 164	613 295	0.25
			-53 625 668	814 834	0.33

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 PUT 4200.00000 20.12.24*	-124	EUR	5 015 692	-53 142	-0.02
SWISS MARKET INDEX PUT 10000.00000 20.12.24*	-18	CHF	1 800 000	-7 776	0.00
EURO STOXX 50 INDEX PUT 4200.00000 20.09.24*	-124	EUR	5 015 692	-22 212	-0.01
EURO STOXX 50 PUT 4200.00000 21.03.25*	-124	EUR	5 015 692	-80 848	-0.03
EURO STOXX 50 PUT 4200.00000 20.06.25*	-124	EUR	5 015 692	-121 451	-0.05
SWISS MARKET INDEX PUT 10000.00000 20.09.24*	-18	CHF	1 800 000	-3 060	0.00
SWISS MARKET INDEX PUT 10000.00000 20.06.25*	-18	CHF	1 800 000	-23 526	-0.01

Halbjahresbericht per 30. Juni 2024

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

Instrument	Anzahl Kontrakte	Währung	Deckung in CHF	Variation Margin in CHF	In % des Vermögens
FTSE 100 INDEX PUT 6800.00000 20.09.24*	-29	GBP	2 240 035	-3 294	0.00
FTSE 100 INDEX PUT 6800.00000 20.12.24*	-29	GBP	2 240 035	-8 565	0.00
FTSE 100 INDEX PUT 7000.00000 20.06.25*	-27	GBP	2 146 889	-28 523	-0.01
S&P 500 INDEX PUT 4400.00000 20.09.24*	-83	USD	32 816 872	-52 209	-0.02
NIKKEI 225 INDEX PUT 31000.00000 13.12.24*	-30	JPY	5 195 188	-25 138	-0.01
NIKKEI 225 INDEX PUT 31000.00000 13.09.24*	-30	JPY	5 195 188	-4 357	0.00
NIKKEI 225 INDEX PUT 32000.00000 14.03.25*	-35	JPY	6 256 571	-80 162	-0.03
S&P 500 INDEX PUT 4400.00000 20.12.24*	-83	USD	32 816 872	-171 916	-0.07
S&P 500 INDEX PUT 4400.00000 21.03.25*	-83	USD	32 816 872	-292 742	-0.12
S&P 500 INDEX PUT 4400.00000 20.06.25*	-83	USD	32 816 873	-419 012	-0.18
			180 004 163	-1 397 933	-0.56

Instrument	Anzahl Kontrakte	Währung	Deckung in CHF	Variation Margin in CHF	In % des Vermögens
Futures auf Indices/Commodities/Währungen					
EURO STOXX 50 INDEX FUTURE 20.09.24*	1	EUR	47 441	72	0.00
SWISS MARKET INDEX FUTURE 20.09.24*	1	CHF	120 230	-260	0.00
FTSE 100 INDEX FUTURE 20.09.24*	1	GBP	93 282	176	0.00
S&P500 EMINI FUTURE 20.09.24*	6	USD	1 488 486	5 082	0.00
NIKKEI 225 (OSE) INDEX FUTURE 12.09.24*	1	JPY	221 103	4 408	0.00
CHF CURRENCY FUTURE 16.09.24*	1 750	USD	220 805 676	-1 375 982	-0.55
			222 776 218	-1 366 504	-0.55

Obige Angaben können Rundungsdifferenzen enthalten.

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

Während der Berichtsperiode getätigte engagementreduzierende Derivate

Instrument	Währung	Käufe/ Kontrakte	Verkäufe/ Kontrakte
Optionen/Warrants auf Indices/Commodities			
EURO STOXX 50 INDEX PUT 4300.00000 20.12.24	EUR	0	200
EURO STOXX 50 INDEX PUT 4400.00000 20.12.24	EUR	245	245
SWISS MARKET INDEX PUT 11400.00000 20.12.24	CHF	18	0
SWISS MARKET INDEX PUT 10500.00000 20.12.24	CHF	0	25
SWISS MARKET INDEX PUT 10500.00000 15.03.24	CHF	0	25
EURO STOXX 50 PUT 4200.00000 21.06.24	EUR	0	200
EURO STOXX 50 INDEX PUT 4400.00000 21.06.24	EUR	245	245
EURO STOXX 50 PUT 4800.00000 21.06.24	EUR	200	200
EURO STOXX 50 INDEX PUT 4200.00000 15.03.24	EUR	0	200
EURO STOXX 50 PUT 4400.00000 15.03.24	EUR	200	200
EURO STOXX 50 INDEX PUT 4200.00000 20.09.24	EUR	0	200
EURO STOXX 50 INDEX PUT 4400.00000 20.09.24	EUR	245	245
EURO STOXX 50 PUT 4700.00000 20.09.24	EUR	200	76
SWISS MARKET INDEX PUT 11000.00000 20.09.24	CHF	25	25
EURO STOXX 50 PUT 4600.00000 21.03.25	EUR	200	76
EURO STOXX 50 PUT 4800.00000 20.06.25	EUR	124	0
SWISS MARKET INDEX PUT 10800.00000 20.06.25	CHF	18	18
SWISS MARKET INDEX PUT 10500.00000 21.06.24	CHF	0	25
SWISS MARKET INDEX PUT 11500.00000 20.09.24	CHF	18	0
EURO STOXX 50 PUT 4650.00000 20.12.24	EUR	200	76
SWISS MARKET INDEX PUT 11300.00000 20.06.25	CHF	18	0
FTSE 100 INDEX PUT 7600.00000 20.06.25	GBP	27	0
FTSE 100 INDEX PUT 7800.00000 20.09.24	GBP	29	0
FTSE 100 INDEX PUT 7200.00000 15.03.24	GBP	0	55
FTSE 100 INDEX PUT 7200.00000 21.06.24	GBP	0	55
FTSE 100 INDEX PUT 7200.00000 20.09.24	GBP	55	55
FTSE 100 INDEX PUT 7100.00000 20.12.24	GBP	0	55
FTSE 100 INDEX PUT 7700.00000 20.12.24	GBP	29	0
S&P 500 INDEX PUT 4300.00000 21.06.24	USD	0	119
NIKKEI 225 INDEX PUT 32000.00000 13.09.24	JPY	0	45
S&P 500 INDEX PUT 4300.00000 20.09.24	USD	0	119
S&P 500 INDEX PUT 4700.00000 20.09.24	USD	160	160
S&P 500 INDEX PUT 4500.00000 20.09.24	USD	119	119
S&P 500 INDEX PUT 4300.00000 15.03.24	USD	0	119
NIKKEI 225 INDEX PUT 32500.00000 13.12.24	JPY	0	25
NIKKEI 225 INDEX PUT 32000.00000 14.06.24	JPY	0	45
NIKKEI 225 INDEX PUT 32000.00000 08.03.24	JPY	0	45
S&P 500 INDEX PUT 4500.00000 15.03.24	USD	119	119
S&P 500 INDEX PUT 4500.00000 20.12.24	USD	0	200
S&P 500 INDEX PUT 4500.00000 21.06.24	USD	119	119
NIKKEI 225 INDEX PUT 34000.00000 14.06.24	JPY	45	45
NIKKEI 225 INDEX PUT 34000.00000 13.09.24	JPY	45	45
NIKKEI 225 INDEX PUT 34000.00000 13.12.24	JPY	45	45
S&P 500 INDEX PUT 4700.00000 15.03.24	USD	120	120
S&P 500 INDEX PUT 4700.00000 21.06.24	USD	160	160
S&P 500 INDEX PUT 4700.00000 20.12.24	USD	160	160
NIKKEI 225 INDEX PUT 37000.00000 13.12.24	JPY	45	10
NIKKEI 225 INDEX PUT 37000.00000 13.09.24	JPY	45	10
NIKKEI 225 INDEX PUT 37000.00000 14.06.24	JPY	45	45
S&P 500 INDEX PUT 4900.00000 21.03.25	USD	120	120
S&P 500 INDEX PUT 5050.00000 21.06.24	USD	110	110
S&P 500 INDEX PUT 5000.00000 20.09.24	USD	110	110
S&P 500 INDEX PUT 4900.00000 20.12.24	USD	110	110
S&P 500 INDEX PUT 4900.00000 21.06.24	USD	88	88
S&P 500 INDEX PUT 4900.00000 20.09.24	USD	88	88
NIKKEI 225 INDEX PUT 35000.00000 14.03.25	JPY	35	35
S&P 500 INDEX PUT 5000.00000 20.06.25	USD	85	2
S&P 500 INDEX PUT 5150.00000 20.09.24	USD	85	2
S&P 500 INDEX PUT 5100.00000 20.12.24	USD	85	2
S&P 500 INDEX PUT 5000.00000 21.03.25	USD	85	2
NIKKEI 225 INDEX PUT 37000.00000 14.03.25	JPY	35	0

Instrument	Währung	Käufe/ Kontrakte	Verkäufe/ Kontrakte
Futures auf Indices/Commodities/Währungen			
EURO FX CURRENCY FUTURE 16.09.24	USD	0	195
EURO FX CURRENCY FUTURE 17.06.24	USD	270	270
EURO FX CURRENCY FUTURE 18.03.24	USD	270	20
JAPANESE YEN CURRENCY FUTURE 18.03.24	USD	400	400
GBP CURRENCY FUTURE 18.03.24	USD	150	150
JAPANESE YEN CURRENCY FUTURE 17.06.24	USD	400	400
GBP CURRENCY FUTURE 17.06.24	USD	100	100
GBP CURRENCY FUTURE 16.09.24	USD	0	100
JAPANESE YEN CURRENCY FUTURE 16.09.24	USD	0	325

Während der Berichtsperiode getätigte engagementerhöhende Derivate

Instrument	Währung	Käufe/ Kontrakte	Verkäufe/ Kontrakte
Optionen/Warrants auf Indices/Commodities			
EURO STOXX 50 INDEX PUT 3900.00000 20.12.24	EUR	200	200
EURO STOXX 50 PUT 4200.00000 20.12.24	EUR	0	124
SWISS MARKET INDEX PUT 9000.00000 20.12.24	CHF	25	0
SWISS MARKET INDEX PUT 10000.00000 20.12.24	CHF	0	18
SWISS MARKET INDEX PUT 9000.00000 21.06.24	CHF	25	0
EURO STOXX 50 INDEX PUT 3500.00000 21.06.24	EUR	200	0
EURO STOXX 50 INDEX PUT 3900.00000 21.06.24	EUR	200	200
EURO STOXX 50 INDEX PUT 3500.00000 15.03.24	EUR	200	0
EURO STOXX 50 INDEX PUT 3900.00000 15.03.24	EUR	200	200
EURO STOXX 50 INDEX PUT 4200.00000 20.09.24	EUR	0	124
EURO STOXX 50 PUT 3500.00000 20.09.24	EUR	200	0
EURO STOXX 50 INDEX PUT 3900.00000 20.09.24	EUR	200	200
EURO STOXX 50 INDEX PUT 3900.00000 21.03.25	EUR	150	150
EURO STOXX 50 PUT 4200.00000 21.03.25	EUR	0	124
EURO STOXX 50 PUT 4200.00000 20.06.25	EUR	0	124
SWISS MARKET INDEX PUT 10000.00000 20.09.24	CHF	0	18
SWISS MARKET INDEX PUT 9800.00000 20.06.25	CHF	18	18
SWISS MARKET INDEX PUT 10000.00000 20.06.25	CHF	0	18
SWISS MARKET INDEX PUT 9000.00000 20.09.24	CHF	25	25
SWISS MARKET INDEX PUT 9000.00000 15.03.24	CHF	25	0
EURO STOXX 50 INDEX PUT 3600.00000 20.12.24	EUR	200	0
FTSE 100 INDEX PUT 6000.00000 20.09.24	GBP	35	35
FTSE 100 INDEX PUT 6800.00000 20.09.24	GBP	0	29
FTSE 100 INDEX PUT 6000.00000 20.12.24	GBP	55	0
FTSE 100 INDEX PUT 6800.00000 20.12.24	GBP	0	29
FTSE 100 INDEX PUT 6000.00000 21.06.24	GBP	55	0
FTSE 100 INDEX PUT 6000.00000 15.03.24	GBP	55	0
FTSE 100 INDEX PUT 7000.00000 20.06.25	GBP	0	27
NIKKEI 225 INDEX PUT 30000.00000 14.06.24	JPY	45	45
S&P 500 INDEX PUT 4300.00000 21.06.24	USD	88	88
S&P 500 INDEX PUT 3600.00000 20.09.24	USD	119	0
S&P 500 INDEX PUT 4400.00000 20.09.24	USD	2	85
S&P 500 INDEX PUT 4300.00000 20.09.24	USD	88	88
S&P 500 INDEX PUT 4100.00000 20.09.24	USD	120	120
S&P 500 INDEX PUT 4000.00000 15.03.24	USD	119	119
S&P 500 INDEX PUT 4000.00000 21.06.24	USD	119	119
S&P 500 INDEX PUT 4000.00000 20.09.24	USD	119	119
NIKKEI 225 INDEX PUT 30000.00000 13.09.24	JPY	45	45
S&P 500 INDEX PUT 3600.00000 15.03.24	USD	119	0
S&P 500 INDEX PUT 3600.00000 21.06.24	USD	119	0
NIKKEI 225 INDEX PUT 26500.00000 13.12.24	JPY	25	0
NIKKEI 225 INDEX PUT 28000.00000 13.09.24	JPY	45	0
NIKKEI 225 INDEX PUT 28000.00000 14.06.24	JPY	45	0
NIKKEI 225 INDEX PUT 28000.00000 08.03.24	JPY	45	0
S&P 500 INDEX PUT 3900.00000 20.12.24	USD	200	0
NIKKEI 225 INDEX PUT 30000.00000 13.12.24	JPY	45	45
S&P 500 INDEX PUT 4100.00000 15.03.24	USD	120	120
S&P 500 INDEX PUT 4100.00000 21.06.24	USD	120	120
S&P 500 INDEX PUT 4100.00000 20.12.24	USD	120	120
NIKKEI 225 INDEX PUT 31000.00000 13.12.24	JPY	10	40
NIKKEI 225 INDEX PUT 31000.00000 13.09.24	JPY	10	40
NIKKEI 225 INDEX PUT 31000.00000 14.06.24	JPY	40	40
S&P 500 INDEX PUT 4000.00000 21.03.25	USD	80	80
S&P 500 INDEX PUT 4300.00000 20.12.24	USD	88	88
S&P 500 INDEX PUT 4300.00000 21.03.25	USD	88	88
NIKKEI 225 INDEX PUT 32000.00000 14.03.25	JPY	0	35
S&P 500 INDEX PUT 4300.00000 20.06.25	USD	85	85
S&P 500 INDEX PUT 4400.00000 20.12.24	USD	2	85
S&P 500 INDEX PUT 4400.00000 21.03.25	USD	2	85
S&P 500 INDEX PUT 4400.00000 20.06.25	USD	2	85

Futures auf Indices/Commodities/Währungen

EURO STOXX 50 INDEX FUTURE 15.03.24	EUR	0	1
EURO STOXX 50 INDEX FUTURE 21.06.24	EUR	1	1
EURO STOXX 50 INDEX FUTURE 20.09.24	EUR	1	0
SWISS MARKET INDEX FUTURE 15.03.24	CHF	0	1
SWISS MARKET INDEX FUTURE 21.06.24	CHF	1	1
SWISS MARKET INDEX FUTURE 20.09.24	CHF	1	0
FTSE 100 INDEX FUTURE 15.03.24	GBP	0	1
FTSE 100 INDEX FUTURE 21.06.24	GBP	1	1
FTSE 100 INDEX FUTURE 20.09.24	GBP	1	0
S&P500 EMINI FUTURE 15.03.24	USD	0	6
NIKKEI 225 (OSE) INDEX FUTURE 07.03.24	JPY	0	1
CHF CURRENCY FUTURE 18.03.24	USD	445	2 770
S&P500 EMINI FUTURE 20.09.24	USD	6	0
NIKKEI 225 (OSE) INDEX FUTURE 13.06.24	JPY	1	1
S&P500 EMINI FUTURE 21.06.24	USD	6	6
CHF CURRENCY FUTURE 17.06.24	USD	2 295	2 295
NIKKEI 225 (OSE) INDEX FUTURE 12.09.24	JPY	1	0
CHF CURRENCY FUTURE 16.09.24	USD	1 800	50

Während der Berichtsperiode getätigte Derivate auf Devisen

Verkauf Währung	Verkauf Betrag	Kauf Währung	Kauf Betrag	Fälligkeit
Devisentermingeschäfte				
USD	55 000 000	CHF	46 884 200	16.01.2024
CHF	6 509 566	EUR	7 000 000	21.03.2024
CHF	5 858 570	JPY	1 000 000 000	21.03.2024
CHF	9 740 015	GBP	8 700 000	21.03.2024
CHF	25 607 326	JPY	4 350 000 000	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	390 036 380,51	159,98%
Netto Gesamtengagement aus Derivaten	–	–
Engagement aus Effektenleihe und Pensionsgeschäften	–	–

Pensionsgeschäfte

Die Fondsleitung tätigt keine Pensionsgeschäfte.

Vergütung an die Fondsleitung

Verwaltungskommission

- Effektiv erhobene Verwaltungskommission:
 - Klasse I-A1: 0,143625% p.a.;
 - Klasse I-A2: 0,593625% p.a.;
 - Klasse R-A3: 1,501125% 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: 0,006375% p.a.;
- Maximale erhobene Depotbankkommission für alle Klassen gemäss Fondsvertrag: 0,25% p.a.;

Die Verwaltungskommission der Zielfonds, in die Vermögen der Teilvermögen investiert wird, darf unter Berücksichtigung von allfälligen Rückvergütungen maximal 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%

Ausgabe- und Rücknahmepreis

Falls an einem Bewertungstag die Summe der Zeichnungen und Rücknahmen von Anteilen des Anlagefonds zu einem Nettovermögenszufluss bzw. -abfluss führt, wird der Nettoinventarwert des Anlagefonds erhöht bzw. reduziert (Swinging Single Pricing). Die maximale Anpassung beläuft sich auf 2% des Nettoinventarwerts. Berücksichtigt werden die Nebenkosten (Geld/Brief-Spannen, marktübliche Courtagen, Kommissionen, Steuern und Abgaben usw.) sowie die Kosten für die Überprüfung und Aufrechterhaltung von Qualitätsstandards bei physischen Anlagen, die aus der Anlage des einbezahlten Betrags bzw. aus dem Verkauf eines dem gekündigten Anteil entsprechenden Teils der Anlagen erwachsen. Die Anpassung führt zu einer Erhöhung des Nettoinventarwerts, wenn die Nettobewegung zu einem Anstieg der Anzahl Anteile des Anlagefonds führt. Die Anpassung resultiert in einer Verminderung des Nettoinventarwerts, wenn die Nettobewegung einen Rückgang der Anzahl der Anteile des Anlagefonds bewirkt. Die Berücksichtigung dieser Nebenkosten entfällt, falls die Fondsleitung einer Ein- oder Auszahlung in Anlagen statt in bar gemäss § 17 gestattet sowie beim Wechsel zwischen Anteilsklassen innerhalb des Anlagefonds. Der unter Anwendung des Swinging Single Pricing ermittelte Nettoinventarwert ist somit ein modifizierter Nettoinventarwert.

Die Fondsleitung kann, anstelle der oben erwähnten durchschnittlichen Nebenkosten bei der Anpassung auch die tatsächliche Höhe der Nebenkosten berücksichtigen, sofern dies unter Berücksichtigung der relevanten Umstände (z.B. Höhe des Betrags, allgemeine Marktsituation, spezifische Marktsituation für die betreffende Anlageklasse) im Ermessen der Fondsleitung angemessen erscheint. Die Anpassung kann in einem solchen Fall höher oder tiefer als die durchschnittlichen Nebenkosten ausfallen.

Umrechnungskurse

CAD 1 = CHF	0.656703	JPY 1 = CHF	0.005586
EUR 1 = CHF	0.963075	USD 1 = CHF	0.898600
GBP 1 = CHF	1.135920		

Effektenleihe

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.

Effektenleihe und Sicherheiten

Berichtszeitraum: 1. Januar 2024 - 30. Juni 2024	Swiss Life Funds (CH) Equity Global Protect Enhanced (CHF hedged)
Kontrahentenrisiko aus der Effektenleihe per 30. Juni 2024	
<hr/>	
UBS AG	
– Marktwert der verliehenen Effekten	14 835 382.69 CHF
– Sicherheiten	15 677 366.66 CHF
<hr/>	
Aufschlüsselung der Sicherheiten (Gewichtung in %) per 30. Juni 2024	
<hr/>	
nach Art der Vermögenswerte:	
– Anleihen	100.00
– Aktien	-
– Geldmarktanlagen	-
<hr/>	
Effektenleihe	
<hr/>	
Erträge aus der Effektenleihe	32 750.43 CHF
Operative Kosten der Effektenleihe	9 825.13 CHF
Fondserträge aus der Effektenleihe	22 925.30 CHF
<hr/>	

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.