

Halbjahresbericht

CS Fund 2

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

31. März 2024

Inhaltsverzeichnis

Verwaltung und Organe	3
Credit Suisse (CH) Corporate CHF Bond Fund	4
Credit Suisse (CH) Global Corporate Bond Fund	15
Erläuterungen zum Halbjahresbericht	34

Verwaltung und Organe

Fondsleitung

Credit Suisse Funds AG, Zürich

Verwaltungsrat

- Andreas Binder, Präsident
- Patrick Tschumper, Vizepräsident (ab 1. Januar 2024, Mitglied ab 1. März 2023 bis 31. Dezember 2023)
- Luca Diener, Vizepräsident (bis 31. Dezember 2023)
- Eugène Del Cioppo, Mitglied (ab 1. Januar 2024)
- Thomas Vonaesch, Mitglied
- Jürg Roth, Mitglied
Managing Director, Credit Suisse (Schweiz) AG
- Hans Peter Bär, Mitglied

Geschäftsleitung

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

Depotbank

Credit Suisse (Schweiz) AG, Zürich

Prüfgesellschaft

PricewaterhouseCoopers AG, Zürich

Informationen über Dritte

Übertragung der Anlageentscheide

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

Übertragung weiterer Teilaufgaben

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

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

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

Kurze Übersicht

Kennzahlen	Währung	31.03.2024	30.09.2023	30.09.2022
Konsolidierung				
Nettofondsvermögen in Mio.	CHF	68.91	83.33	122.37
Anteilklasse A				
Nettofondsvermögen in Mio.	CHF	54.98	59.22	89.05
Inventarwert pro Anteil	CHF	108.75	-	-
Inventarwert pro Anteil (Swung NAV)	CHF	-	105.08	101.80
Inventarwert pro Anteil (Unswung NAV)	CHF	-	105.45	102.16
Anteilklasse EA				
Nettofondsvermögen in Mio.	CHF	4.59	13.98	16.35
Inventarwert pro Anteil	CHF	965.53	-	-
Inventarwert pro Anteil (Swung NAV)	CHF	-	935.68	906.88
Inventarwert pro Anteil (Unswung NAV)	CHF	-	938.97	910.07
Anteilklasse IA				
Nettofondsvermögen in Mio.	CHF	4.81	5.36	11.63
Inventarwert pro Anteil	CHF	958.39	-	-
Inventarwert pro Anteil (Swung NAV)	CHF	-	928.52	899.91
Inventarwert pro Anteil (Unswung NAV)	CHF	-	931.78	903.07
Anteilklasse UA				
Nettofondsvermögen in Mio.	CHF	4.53	4.77	5.35
Inventarwert pro Anteil	CHF	94.52	-	-
Inventarwert pro Anteil (Swung NAV)	CHF	-	91.50	88.66
Inventarwert pro Anteil (Unswung NAV)	CHF	-	91.82	88.97

Wechselkurse

Wechselkurse per	31.03.2024
ENGLISCHES PFUND	1.137786
EURO	0.972750
SCHWEIZER FRANKEN	1.000000
US DOLLAR	0.900694

Vermögensrechnung per 31. März 2024

	Konsolidierung	
	31.03.2024	30.09.2023
	CHF	CHF
Vermögenswerte		
Bankguthaben, einschliesslich Treuhandanlagen bei Drittbanken, aufgeteilt in:		
- Sichtguthaben	786'052.91	814'880.89
Effekten, einschliesslich ausgeliehene und pensionierte Effekten, aufgeteilt in:		
- Obligationen, Wandelobligationen, Optionsanleihen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte	67'798'335.47	82'256'834.93
- Strukturierte Produkte	0.54	0.54
Derivative Finanzinstrumente	-305'623.68	-392'823.65
Sonstige Vermögenswerte	685'571.05	720'276.85
Gesamtfondsvermögen abzüglich:	68'964'336.29	83'399'169.56
Andere Verbindlichkeiten	55'255.91	71'325.26
Nettofondsvermögen	68'909'080.38	83'327'844.30
	Konsolidierung	
	01.10.2023 - 31.03.2024	01.10.2022 - 30.09.2023
	CHF	CHF
Veränderung des Nettofondsvermögens		
Nettofondsvermögen zu Beginn der Berichtsperiode	83'327'844.30	122'372'425.55
Ausschüttungen	-532'824.77	-695'845.52
Ausgaben von Anteilen	237'991.30	4'167'796.97
Rücknahmen von Anteilen	-16'824'498.41	-46'478'176.01
Sonstiges aus Anteilverkehr	247'287.35	1'100'478.57
Gesamterfolg	2'453'280.61	2'861'164.74
Nettofondsvermögen am Ende der Berichtsperiode	68'909'080.38	83'327'844.30
Entwicklung der Anteile im Umlauf		
Bestand zu Beginn der Berichtsperiode	634'132.237	962'628.807
Ausgegebene Anteile	1'479.448	14'346.185
Zurückgenommene Anteile	-72'344.655	-342'842.755
Bestand am Ende der Berichtsperiode	563'267.030	634'132.237
Währung Anteilklasse		
Inventarwert pro Anteil		
Inventarwert pro Anteil (Swung NAV)		
Inventarwert pro Anteil (Unswung NAV)		

Anteilklasse A		Anteilklasse EA		Anteilklasse IA		Anteilklasse UA	
01.10.2023 - 31.03.2024	01.10.2022 - 30.09.2023	01.10.2023 - 31.03.2024	01.10.2022 - 30.09.2023	01.10.2023 - 31.03.2024	01.10.2022 - 30.09.2023	01.10.2023 - 31.03.2024	01.10.2022 - 30.09.2023
CHF	CHF	CHF	CHF	CHF	CHF	CHF	CHF
59'217'659.52	89'051'300.37	13'983'828.33	16'346'994.30	5'359'616.01	11'628'304.51	4'766'740.46	5'345'826.39
-372'030.51	-359'809.99	-57'364.06	-176'514.24	-55'595.45	-117'461.45	-47'834.75	-42'059.84
124'406.53	1'153'168.84	49'097.84	2'954'346.86	44'293.13	60'281.27	20'193.80	0.00
-6'106'337.31	-33'366'328.24	-9'591'476.58	-5'808'532.93	-731'329.78	-6'567'509.92	-395'354.74	-735'804.92
160'770.77	788'183.97	62'278.88	122'743.59	7'326.50	165'920.95	16'911.20	23'630.06
1'958'896.49	1'951'144.57	142'545.77	544'790.75	182'830.11	190'080.65	169'008.24	175'148.77
54'983'365.49	59'217'659.52	4'588'910.18	13'983'828.33	4'807'140.52	5'359'616.01	4'529'664.21	4'766'740.46
561'573.202	871'704.572	14'892.731	17'962.382	5'752.006	12'876.362	51'914.298	60'085.491
1'160.441	11'090.037	52.000	3'190.871	47.007	65.277	220.000	0.000
-57'155.512	-321'221.407	-10'192.000	-6'260.522	-783.143	-7'189.633	-4'214.000	-8'171.193
505'578.131	561'573.202	4'752.731	14'892.731	5'015.870	5'752.006	47'920.298	51'914.298
(CHF)	(CHF)	(CHF)	(CHF)	(CHF)	(CHF)	(CHF)	(CHF)
108.75	0.00	965.53	0.00	958.39	0.00	94.52	0.00
0.00	105.08	0.00	935.68	0.00	928.52	0.00	91.50
0.00	105.45	0.00	938.97	0.00	931.78	0.00	91.82

Erfolgsrechnung für die Zeit vom 1. Oktober 2023 bis zum 31. März 2024

	Konsolidierung	
	01.10.2023 - 31.03.2024	01.10.2022 - 30.09.2023
	CHF	CHF
Ertrag		
Erträge der Bankguthaben	4'985.45	12'986.48
Negativzinsen	0.00	-1'837.46
Erträge der Effektenleihen	8'327.00	32'626.75
Erträge der Ausgleichszahlungen	43'540.05	231'066.98
Erträge der Effekten, aufgeteilt in:		
- Obligationen, Wandelobligationen, Optionsanleihen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte	612'108.14	1'515'017.40
Einkauf in laufende Nettoerträge bei der Ausgabe von Anteilen	896.09	27'117.09
Total Erträge	669'856.73	1'816'977.24
Aufwendungen		
Passivzinsen	250.43	1'053.74
Prüfaufwand	6'946.50	14'494.70
Reglementarische Vergütung an:		
- die Fondsleitung	307'630.69	841'221.35
- die Depotbank	15'019.95	43'716.18
Sonstige Aufwendungen	8'664.48	8'002.69
Ausrichtung laufender Nettoerträge bei Rücknahme von Anteilen	68'644.64	261'624.71
Total Aufwendungen	407'156.69	1'170'113.37
Nettoertrag	262'700.04	646'863.87
Realisierte Kapitalgewinne und -verluste	-23'605'165.00	-3'114'652.47
Realisierter Erfolg	-23'342'464.96	-2'467'788.60
Nicht realisierte Kapitalgewinne und -verluste	25'795'745.57	5'328'953.34
Gesamterfolg	2'453'280.61	2'861'164.74

Anteilklasse A		Anteilklasse EA		Anteilklasse IA		Anteilklasse UA	
01.10.2023 - 31.03.2024	01.10.2022 - 30.09.2023	01.10.2023 - 31.03.2024	01.10.2022 - 30.09.2023	01.10.2023 - 31.03.2024	01.10.2022 - 30.09.2023	01.10.2023 - 31.03.2024	01.10.2022 - 30.09.2023
CHF	CHF	CHF	CHF	CHF	CHF	CHF	CHF
3'963.89	9'157.80	356.17	2'122.19	335.95	1'025.19	329.44	681.30
0.00	-1'324.20	0.00	-251.93	0.00	-178.68	0.00	-82.65
6'676.65	23'228.07	544.32	5'095.12	553.07	2'670.95	552.96	1'632.61
34'717.74	163'101.62	2'873.95	36'769.36	3'006.99	19'737.85	2'941.37	11'458.15
485'042.59	1'076'512.43	45'825.85	236'937.92	40'931.32	125'536.82	40'308.38	76'030.23
519.54	3'432.47	104.64	23'279.17	246.44	405.45	25.47	0.00
530'920.41	1'274'108.19	49'704.93	303'951.83	45'073.77	149'197.58	44'157.62	89'719.64
200.46	749.46	16.44	176.53	16.99	67.61	16.54	60.14
5'513.71	10'267.46	507.68	2'313.34	466.02	1'177.92	459.09	735.98
273'145.80	712'335.95	9'847.20	59'980.17	10'064.81	36'947.21	14'572.88	31'958.02
11'906.53	31'050.34	1'116.00	6'797.72	1'006.42	3'694.98	991.00	2'173.14
6'870.60	5'749.65	641.16	1'158.09	581.52	716.68	571.20	378.27
22'251.36	136'707.94	40'910.36	60'186.73	2'945.41	58'858.86	2'537.51	5'871.18
319'888.46	896'860.80	53'038.84	130'612.58	15'081.17	101'463.26	19'148.22	41'176.73
211'031.95	377'247.39	-3'333.91	173'339.25	29'992.60	47'734.32	25'009.40	48'542.91
-18'835'761.44	-2'214'825.29	-1'571'577.85	-521'785.83	-1'646'352.12	-199'994.87	-1'551'473.59	-178'046.48
-18'624'729.49	-1'837'577.90	-1'574'911.76	-348'446.58	-1'616'359.52	-152'260.55	-1'526'464.19	-129'503.57
20'583'625.98	3'788'722.47	1'717'457.53	893'237.33	1'799'189.63	342'341.20	1'695'472.43	304'652.34
1'958'896.49	1'951'144.57	142'545.77	544'790.75	182'830.11	190'080.65	169'008.24	175'148.77

Zusammensetzung des Portefeuilles und Bestandesveränderungen

Titelbezeichnung	Währung	30.09.2023 Anzahl/ Nominal	Käufe (1)	Verkäufe (1)	31.03.2024 Anzahl/ Nominal	Kurswert CHF	in % des Gesamtfonds- vermögens
Börsennotierte / an einem geregelten Markt gehandelte Wertpapiere; bewertet zu den Kursen, die am Hauptmarkt bezahlt werden							
Anleihen							
Australien							
0.113	COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA 0.113%/19-10.12.2029	CHF	1'000'000		1'000'000	926'000.00	1.34
1.285	MACQUARIE GROUP LTD 1.285%/22-11.09.2029	CHF	1'000'000		1'000'000	984'000.00	1.43
0.293	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD 0.2925%/22-03.02.2028	CHF	1'000'000	300'000	700'000	671'650.00	0.97
						2'581'650.00	3.74
Chile							
2.718	EMBOTELLADORA ANDINA SA 2.7175%/23-20.09.2028	CHF	300'000		300'000	310'200.00	0.45
0.385	SCOTIABANK CHILE 0.385%/21-22.07.2026	CHF	1'460'000	460'000	1'000'000	964'500.00	1.40
						1'274'700.00	1.85
Deutschland							
3.645	DEUTSCHE BANK AG 3.645%/23-27.01.2029	CHF	1'000'000		1'000'000	1'035'000.00	1.50
0.435	DEUTSCHE TELEKOM AG 0.435%/20-06.02.2032	CHF	1'500'000	500'000	1'000'000	922'500.00	1.34
2.625	DZ BANK AG 2.625%/23-27.08.2029	CHF	1'000'000		1'000'000	1'025'500.00	1.49
2.503	E.ON SE 2.5025%/22-05.12.2029	CHF	1'000'000		1'000'000	1'050'500.00	1.52
2.500	MUENCHENER HYPOTHEKENBANK EG 2.5%/24-20.02.2030	CHF		700'000	700'000	714'000.00	1.04
4.253	MUENCHENER HYPOTHEKENBNK (subordinated) 4.2525%/23-07.06.2033	CHF	800'000		800'000	849'600.00	1.23
0.300	MUENCHENER HYPOTHEKENBNK 0.3%/17-20.12.2024	CHF	1'000'000	1'000'000			
						5'597'100.00	8.12
Finnland							
1.810	NORDEA BANK ABP 1.81%/22-15.06.2027	CHF	1'400'000		1'400'000	1'407'700.00	2.04
						1'407'700.00	2.04
Frankreich							
1.000	BNP PARIBAS SA 1%/18-06.06.2025	CHF	1'000'000	500'000	500'000	497'250.00	0.72
2.125	CREDIT AGRICOLE (subordinated.) 2.125%/01-29.09.2025	CHF	500'000		500'000	502'250.00	0.73
2.490	ENGIE SA 2.49%/23-04.07.2031	CHF	1'000'000		1'000'000	1'045'000.00	1.52
0.625	ORANGE SA 0.625%/19-22.06.2029	CHF	1'400'000	400'000	1'000'000	954'500.00	1.38
3.500	RCI BANQUE SA 3.5%/23-10.05.2028	CHF	1'000'000		1'000'000	1'057'000.00	1.53
2.618	SOCIETE GENERALE 2.6175%/23-27.02.2030	CHF	1'500'000		1'500'000	1'565'250.00	2.27
						5'621'250.00	8.15
Grossbritannien							
0.813	HSBC HOLDINGS PLC 0.8125%/21-03.11.2031	CHF	1'600'000		1'600'000	1'464'800.00	2.12
1.000	LLOYDS BANKING GROUP PLC 1%/18-04.03.2025	CHF	1'000'000	300'000	700'000	696'780.00	1.01
1.915	NATIONWIDE BLDG SOCIETY 1.915%/22-08.09.2028	CHF	1'000'000		1'000'000	1'008'500.00	1.46
0.898	NATWEST MARKETS PLC 0.8975%/22-04.04.2025	CHF	1'000'000	200'000	800'000	795'280.00	1.15
0.375	VODAFONE GROUP 0.375%/16-03.12.2024	CHF	500'000		500'000	496'000.00	0.72
						4'461'360.00	6.47
Irland							
0.250	INTESA SANPAOLO BANK IRELAND PLC 0.25%/19-30.09.2024	CHF	400'000		400'000	397'040.00	0.58
						397'040.00	0.58
Kanada							
0.050	CANADIAN IMPERIAL BANK OF COMMERCE 0.05%/19-15.10.2026	CHF	1'000'000	300'000	700'000	673'750.00	0.98
0.200	ROYAL BANK OF CANADA 0.2%/21-22.09.2031	CHF	1'500'000		1'500'000	1'333'500.00	1.93
2.203	TORONTO-DOMINION BANK 2.2025%/23-31.01.2028	CHF	1'000'000	300'000	700'000	715'400.00	1.04
						2'722'650.00	3.95
Liechtenstein							
1.923	HILTI AG (LIECHTENSTEIN) 1.9225%/23-10.11.2031	CHF		240'000	240'000		
0.200	LGT BANK LTD 0.2%/20-04.11.2030	CHF	1'500'000	500'000	1'000'000	915'000.00	1.33
						915'000.00	1.33
Luxemburg							
0.732	AROUNDTOWN SA 0.732%/18-30.01.2025	CHF	500'000	500'000			
						0.00	0.00
Mexiko							
0.500	BANCO MERCANTILE DEL NORTE SA GRAND CAYMAN BRANCH 0.5%/20-06.12.2024	CHF	940'000		940'000	925'430.00	1.34
						925'430.00	1.34
Neuseeland							
0.038	TRANSPower NEW ZEALAND LIMITED 0.038%/21-16.03.2029	CHF	1'010'000		1'010'000	948'390.00	1.38
						948'390.00	1.38
Niederlande							
2.625	ABN AMRO BANK NV 2.625%/23-02.03.2028	CHF	1'600'000		1'600'000	1'640'000.00	2.38
0.750	BMW INTL INVESTMENT BV 0.75%/19-03.09.2027	CHF	1'000'000	1'000'000			
1.700	DIGITAL INTREPID HOLDING 1.7%/22-30.03.2027	CHF	1'000'000	300'000	700'000	691'950.00	1.00
2.625	ENBW INTL FINANCE BV 2.625%/23-15.06.2029	CHF	1'000'000		1'000'000	1'039'500.00	1.51

Titelbezeichnung	Währung	30.09.2023 Anzahl/ Nominal	Käufe (1)	Verkäufe (1)	31.03.2024 Anzahl/ Nominal	Kurswert CHF	in % des Gesamtfonds- vermögens
2.130 TOYOTA MOTOR FINANCE (NETHERLANDS) BV 2.13%/23-15.06.2027	CHF	390'000			390'000	397'215.00	0.58
2.493 VOLKSWAGEN FINANCIAL SERVICES NV 2.4925%/24-12.02.2030	CHF		400'000		400'000	413'000.00	0.60
						4'181'665.00	6.06
Norwegen							
1.168 DNB BANK ASA 1.1675%/22-03.06.2027	CHF	1'000'000		300'000	700'000	690'200.00	1.00
0.125 SPAREBANK 1 NORD NORGE 0.125%/19-11.12.2025	CHF	1'000'000		300'000	700'000	684'600.00	0.99
1.500 SPAREBANK 1 SMN 1.5%/22-15.06.2027	CHF	1'000'000		300'000	700'000	699'300.00	1.01
						2'074'100.00	3.01
Österreich							
2.870 BAWAG P.S.K. 2.87%/22-03.10.2025	CHF	1'000'000		600'000	400'000	406'200.00	0.59
3.125 BUNDESIMMOBILIEN GESELLSCHAFT M.B.H. 3.125%/06-01.09.2031	CHF	800'000			800'000	894'000.00	1.30
0.250 ERSTE GROUP BANK AG 0.25%/21-02.10.2028	CHF	1'500'000		500'000	1'000'000	934'000.00	1.35
1.625 HYPO VORARLBERG BANK AG (subordinated) 1.625%/19-29.11.2029	CHF	1'500'000			1'500'000	1'373'250.00	1.99
						3'607'450.00	5.23
Schweiz							
2.200 BALOISE LIFE LTD (subordinated) FRN FF/17-19.06.2048	CHF	1'000'000			1'000'000	992'000.00	1.44
2.375 BANK JULIUS BAER & CO AG 2.375%/24-04.04.2031	CHF		500'000		500'000	507'395.00	0.74
2.300 BARRY CALLEBAUT LTD 2.3%/24-23.01.2032	CHF		340'000	340'000			
0.600 BUEHLER HOLDING AG 0.6%/17-21.12.2026	CHF	1'000'000		300'000	700'000	681'800.00	0.99
- HELVETIA SCHWEIZERISCHE (subordinated) FIX-TO-FRN FRN/20-12.08.2040	CHF	1'000'000		300'000	700'000	640'850.00	0.93
0.400 PARTNERS GROUP HOLDING A 0.4%/19-21.06.2027	CHF	1'000'000			1'000'000	963'500.00	1.40
1.000 ROCHE KAPITALMARKT AG 1%/22-25.02.2037	CHF	1'500'000		500'000	1'000'000	947'500.00	1.37
2.600 SANDOZ GROUP LTD 2.6%/23-17.11.2031	CHF		360'000		360'000	376'920.00	0.55
- SONOVA HOLDING LTD. 0%/19-11.10.2029	CHF	1'200'000			1'200'000	1'111'800.00	1.61
- SWIFF LIFE (reg. -S-) T. -2- FIX-TO-FRN 4.375%/16-24.09.2046	CHF	1'500'000		800'000	700'000	730'800.00	1.06
0.825 SWISS PRIME SITE FINANCE AG 0.825%/17-11.05.2026	CHF	1'000'000		300'000	700'000	688'800.00	1.00
0.150 UBS AG LONDON 0.15%/21-29.06.2028	CHF	500'000			500'000	471'750.00	0.68
- UBS GROUP AG (subordinated) FIX-TO-FRN FRN/19-PERPETUAL	CHF	1'000'000		200'000	800'000	766'400.00	1.11
- ZURICH INSURANCE CO (subordinated) FIX-TO-FRN FRN/22-03.05.2052	CHF	1'500'000		300'000	1'200'000	1'093'200.00	1.59
						9'972'715.00	14.46
Spanien							
2.240 BANCO SANTANDER SA 2.24%/24-16.02.2032	CHF		500'000		500'000	513'250.00	0.74
0.477 CAIXABANK S.A. 0.477%/21-01.07.2027	CHF	1'000'000			1'000'000	959'000.00	1.39
0.775 CELLNEX TELECOM SA 0.775%/20-18.02.2027	CHF	1'500'000		500'000	1'000'000	965'500.00	1.40
2.933 SANTANDER CONSUMER FINANCE S.A. 2.9325%/23-04.07.2028	CHF	1'000'000			1'000'000	1'045'500.00	1.52
						3'483'250.00	5.05
Vereinigte Staaten							
0.250 CITIGROUP INC S. -C- 0.25%/21-30.08.2029	CHF	1'000'000			1'000'000	924'500.00	1.34
2.875 EQUINIX INC 2.875%/23-12.09.2028	CHF	860'000			860'000	885'800.00	1.28
1.000 GOLDMAN SACHS GROUP INC 1%/18-24.11.2025	CHF	1'000'000		300'000	700'000	693'700.00	1.01
0.300 METROPOLITAN LIFE GLOBAL FUNDING 0.3%/17-19.01.2026	CHF	1'000'000		300'000	700'000	684'600.00	0.99
0.125 NEW YORK LIFE GLOBAL FDG 0.125%/20-11.09.2029	CHF	1'500'000		300'000	1'200'000	1'109'400.00	1.61
1.840 THERMO FISHER SCIENTIFIC INC 1.8401%/24-08.03.2032	CHF		300'000		300'000	305'250.00	0.44
1.000 VERIZON COMMUNICATIONS 1%/17-30.11.2027	CHF	1'000'000		300'000	700'000	688'450.00	1.00
1.250 WELLS FARGO & CO 1.25%/14-03.09.2024	CHF	1'000'000		500'000	500'000	499'250.00	0.72
						5'790'950.00	8.40
Total Anleihen						55'962'400.00	81.15
Total Börsennotierte / an einem geregelten Markt gehandelte Wertpapiere; bewertet zu den Kursen, die am Hauptmarkt bezahlt werden						55'962'400.00	81.15
Wertpapiere bewertet aufgrund von am Markt beobachtbaren Parametern							
Anleihen							
Deutschland							
4.000 COMMERZBANK AG 4%/17-30.03.2027	EUR	1'000'000		1'000'000			
- DEUTSCHE PFANDBRIEFBANK (subordinated) FIX-TO-FRN 2.875%/17-28.06.2027	EUR	1'500'000		300'000	1'200'000	603'926.00	0.88
- MUNICH RE (subordinated) FIX-TO-FRN FRN/18-26.05.2049	EUR	1'000'000			1'000'000	941'583.09	1.37
						1'545'509.09	2.24
Finnland							
- NORDEA BANK (subordinated) (reg. -S-) T. 11 FIX-TO-FRN 6.125%/14-PERPETUAL	USD	300'000		300'000			
						0.00	0.00
Frankreich							
- AXA (subordinated) (reg. -S-) S. 36 FIX-TO-FRN 3.941%/14-PERPETUAL	EUR	1'000'000		300'000	700'000	677'023.30	0.98
- BNP PARIBAS (subordinated) FIX-TO-FRN FRN/18-20.11.2030	EUR	1'000'000			1'000'000	946'407.93	1.37

Titelbezeichnung	Währung	30.09.2023 Anzahl/ Nominal	Käufe (1)	Verkäufe (1)	31.03.2024 Anzahl/ Nominal	Kurswert CHF	in % des Gesamtfonds- vermögens
- TOTAL (subordinated) (reg. -S-) FIX-TO-FRN 2.625%/15-PERPETUAL	EUR	1'000'000		300'000	700'000	668'981.58	0.97
						2'292'412.81	3.32
Niederlande							
- COOPERATIEVE RABOBANK UA (subordinated) FIX-TO-FRN FRN/18-PERPETUAL	EUR	1'000'000		200'000	800'000	763'328.60	1.11
- ELM (subordinated) FIX-TO-FRN 2.6%/15-PERPETUAL	EUR	1'000'000		300'000	700'000	662'669.40	0.96
1.625 GIVAUDAN FIN EUROPE 1.625%/20-22.04.2032	EUR	1'500'000		300'000	1'200'000	1'032'325.10	1.50
- IBERDROLA INTL BV (subordinated) FIX-TO-FRN FRN/20-PERPETUAL	EUR	1'200'000		300'000	900'000	783'550.13	1.14
- NN GROUP (subordinated) FIX-TO-FRN 4.5%/14-PERPETUAL	EUR	1'500'000		1'500'000			
7.375 TEVA PHARM FNC NL II 7.375%/23-15.09.2029	EUR	850'000			850'000	914'201.15	1.33
- VOLKSWAGEN INTL FIN NV (subordinated) S. -NC10- FIX-TO-FRN FRN/18-PERPETUAL	EUR	1'500'000		900'000	600'000	568'206.62	0.82
						4'724'281.00	6.85
Portugal							
- ENERGIAS DE PORTUGAL SA (subordinated) FIX-TO-FRN FRN/23-23.04.2083	EUR	500'000			500'000	508'451.56	0.74
						508'451.56	0.74
Schweden							
- SVENSKA HANDELSBANKEN AB (subordinated) FIX-TO-FRN FRN/20-PERPETUAL	USD	1'400'000		200'000	1'200'000	919'854.02	1.33
						919'854.02	1.33
Vereinigte Staaten							
0.875 CHUBB INA HOLDINGS INC 0.875%/19-15.12.2029	EUR	1'000'000			1'000'000	853'685.40	1.24
4.000 GLENCORE FUNDING 4%/15-16.04.2025	USD	1'000'000		300'000	700'000	619'944.38	0.90
1.625 MONDELEZ INTERNATIONAL 1.625%/15-08.03.2027	EUR	400'000			400'000	371'578.83	0.54
2.425 ZIMMER BIOMET HOLDINGS 2.425%/16-13.12.2026	EUR	1'000'000		1'000'000			
						1'845'208.61	2.68
Total Anleihen						11'835'717.09	17.16
Total Wertpapiere bewertet aufgrund von am Markt beobachtbaren Parametern						11'835'717.09	17.16
Wertpapiere bewertet aufgrund geeigneten Bewertungsmodellen unter Berücksichtigung der aktuellen Marktgegebenheiten							
Anleihen							
Island							
- GLITNIR 0%/16-08.01.2030	EUR	89'792			89'792	218.36	0.00
						218.36	0.00
Schweiz							
- SAIRGROUP 0%/98-07.07.2005	CHF	4'000'000		4'000'000			
6.250 SAIRGROUP 6.25%/95-12.04.2005	CHF	3'000'000		3'000'000			
- SAIRGROUP FRN 88-15.02.2013 (MATURED)	CHF	20'000'000		20'000'000			
						0.00	0.00
Vereinigte Staaten							
12.750 WINSTAR COMMUNICATIONS 12.75%/00-15.04.2010	EUR	1'500'000			1'500'000	0.02	0.00
						0.02	0.00
Total Anleihen						218.38	0.00
Strukturierte Produkte							
Island							
GLITNIR HOLDCO EHF HLUASKIRTEINI AHLUTIR SHARE CERTIFICATE A SHARES	EUR	557'598			557'598	0.54	0.00
						0.54	0.00
Total Strukturierte Produkte						0.54	0.00
Total Wertpapiere bewertet aufgrund geeigneten Bewertungsmodellen unter Berücksichtigung der aktuellen Marktgegebenheiten						218.92	0.00
Derivative Finanzinstrumente							
Wertpapiere bewertet aufgrund von am Markt beobachtbaren Parametern							
Devisentermingeschäfte							
Devisentermingeschäfte (siehe Liste)						-305'623.68	-0.44
Total Devisentermingeschäfte						-305'623.68	-0.44
Total Wertpapiere bewertet aufgrund von am Markt beobachtbaren Parametern						-305'623.68	-0.44

Titelbezeichnung	Währung	30.09.2023 Anzahl/ Nominal	Käufe (1)	Verkäufe (1)	31.03.2024 Anzahl/ Nominal	Kurswert CHF	in % des Gesamtfonds- vermögens
Total Derivative Finanzinstrumente						-305'623.68	-0.44
Total Anlagen						67'492'712.33	97.87
Bankguthaben auf Sicht						786'052.91	1.14
Bankguthaben auf Zeit						0.00	0.00
Sonstige Vermögenswerte						685'571.05	0.99
Gesamtfondsvermögen (GFV)						68'964'336.29	100.00
./. Bankverbindlichkeiten						0.00	0.00
./. Andere Verbindlichkeiten						55'255.91	0.08
./. Andere Kredite						0.00	0.00
Nettofondsvermögen						68'909'080.38	99.92

(1) Umfassen auch Corporate Actions

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

Anlagekategorien	Kurswert CHF	in % des Gesamtfonds- vermögens
Börsennotierte / an einem geregelten Markt gehandelte Wertpapiere; bewertet zu den Kursen, die am Hauptmarkt bezahlt werden	55'962'400.00	81.15
Wertpapiere bewertet aufgrund von am Markt beobachtbaren Parametern	11'530'093.41	16.72
Wertpapiere bewertet aufgrund geeigneten Bewertungsmodellen unter Berücksichtigung der aktuellen Marktgegebenheiten	218.92	0.00

Aufstellung der Devisentermingeschäfte für die Zeit vom 1. Oktober 2023 bis zum 31. März 2024

Fälligkeit	Transaktion	Währung	Betrag	Gegen	Gegenwert	Devisengewinn/-verlust Mandatswährung	in % des GFV
08.11.2023	Bought	CHF	15'362'120	EUR	16'200'000	0.00	0.00
08.11.2023	Bought	CHF	2'916'491	USD	3'340'000	0.00	0.00
08.11.2023	Bought	EUR	2'850'000	CHF	2'721'590	0.00	0.00
08.11.2023	Bought	EUR	1'150'000	CHF	1'088'500	0.00	0.00
08.11.2023	Bought	USD	990'000	CHF	878'558	0.00	0.00
08.11.2023	Bought	USD	480'000	CHF	433'957	0.00	0.00
08.11.2023	Bought	USD	290'000	CHF	260'631	0.00	0.00
22.02.2024	Bought	CHF	11'811'466	EUR	12'350'000	0.00	0.00
22.02.2024	Bought	CHF	1'416'928	USD	1'600'000	0.00	0.00
22.02.2024	Bought	CHF	17'470	USD	20'000	0.00	0.00
22.02.2024	Bought	CHF	67'677	USD	80'000	0.00	0.00
22.02.2024	Bought	EUR	750'000	CHF	719'494	0.00	0.00
22.02.2024	Bought	EUR	300'000	CHF	278'724	0.00	0.00
22.02.2024	Bought	EUR	600'000	CHF	566'327	0.00	0.00
22.02.2024	Bought	EUR	10'700'000	CHF	10'155'242	0.00	0.00
22.02.2024	Bought	USD	1'700'000	CHF	1'498'292	0.00	0.00
23.05.2024	Bought	CHF	9'811'641	EUR	10'400'000	-266'998.62	-0.39
23.05.2024	Bought	CHF	1'501'240	USD	1'720'000	-38'625.06	-0.06
Total Devisentermingeschäfte						-305'623.68	-0.44

Ausgeliehene Wertpapierbestände (Lending and Borrowing)

Titelbezeichnung	Agent	Lending / Borrowing	31.03.2024 Anzahl/ Nominal
COOPERATIEVE RABOBANK UA (subordinated) FIX-TO-FRN FRN/18-PERPETUAL	Credit Suisse (Schweiz) AG	Lending	600'000
DEUTSCHE PFANDBRIEFBANK (subordinated) FIX-TO-FRN 2.875%/17-28.06.2027	Credit Suisse (Schweiz) AG	Lending	1'200'000
PARTNERS GROUP HOLDING A 0.4%/19-21.06.2027	Credit Suisse (Schweiz) AG	Lending	250'000
ROYAL BANK OF CANADA 0.2%/21-22.09.2031	Credit Suisse (Schweiz) AG	Lending	1'500'000
SVENSKA HANDELSBANKEN AB (subordinated) FIX-TO-FRN FRN/20-PERPETUAL	Credit Suisse (Schweiz) AG	Lending	1'000'000

14 Credit Suisse (CH) Corporate CHF Bond Fund

Halbjahresbericht per 31. März 2024

Ausserbilanzgeschäfte	31.03.2024		30.09.2023	
	Basiswertäquivalent in Fondswährung	in % des NFV	Basiswertäquivalent in Fondswährung	in % des NFV
- Währungsrisiko	11'665'794.44	16.93%	19'651'616.47	23.58%
Brutto-Gesamtingagement aus Derivaten	11'665'794.44	16.93%	19'651'616.47	23.58%
- Währungsrisiko	0.00	0.00%	0.00	0.00%
Netto-Gesamtingagement aus Derivaten	0.00	0.00%	0.00	0.00%
Volumen der verliehenen Wertpapiere und Provisionserträge aus Wertpapiere				
- Volumen der verliehenen Positionen	3'605'205.30	5.23%	8'617'271.92	10.34%
- Kommission Einkommen	8'327.00	0.01%	32'626.75	0.04%

Kurze Übersicht

Kennzahlen	Währung	31.03.2024	30.09.2023	30.09.2022
Konsolidierung				
Nettofondsvermögen in Mio.	CHF	682.70	653.89	947.78
Anteilklasse BH CHF				
Nettofondsvermögen in Mio.	CHF	5.00	5.02	5.61
Inventarwert pro Anteil (Swung NAV)	CHF	85.01	81.62	82.17
Inventarwert pro Anteil (Unswung NAV)	CHF	85.22	81.50	82.38
Anteilklasse BH EUR				
Nettofondsvermögen in Mio.	CHF	10.09	10.08	13.61
Inventarwert pro Anteil (Swung NAV)	EUR	92.85	88.09	87.33
Inventarwert pro Anteil (Unswung NAV)	EUR	93.09	87.97	87.54
Anteilklasse EBH CHF				
Nettofondsvermögen in Mio.	CHF	13.77	13.16	12.45
Inventarwert pro Anteil (Swung NAV)	CHF	83.81	80.42	80.76
Inventarwert pro Anteil (Unswung NAV)	CHF	84.02	80.30	80.96
Anteilklasse UBH EUR				
Nettofondsvermögen in Mio.	CHF	0.72	0.67	0.67
Inventarwert pro Anteil (Swung NAV)	EUR	93.31	88.50	87.64
Inventarwert pro Anteil (Unswung NAV)	EUR	93.54	88.38	87.86
Anteilklasse ZB CHF				
Nettofondsvermögen in Mio.	CHF	160.14	145.14	148.26
Inventarwert pro Anteil (Swung NAV)	CHF	1'017.61	966.98	982.29
Inventarwert pro Anteil (Unswung NAV)	CHF	1'020.12	965.60	984.75
Anteilklasse ZBH CHF				
Nettofondsvermögen in Mio.	CHF	427.37	359.92	468.47
Inventarwert pro Anteil (Swung NAV)	CHF	843.79	809.17	810.38
Inventarwert pro Anteil (Unswung NAV)	CHF	845.91	807.98	812.41
Anteilklasse ZBH DUR CHF				
Nettofondsvermögen in Mio.	CHF	65.61	119.89	298.70
Inventarwert pro Anteil (Swung NAV)	CHF	905.50	882.28	849.31
Inventarwert pro Anteil (Unswung NAV)	CHF	907.78	880.98	851.43

Wechselkurse

Wechselkurse per	31.03.2024
AUSTRALISCHER DOLLAR	0.587605
ENGLISCHES PFUND	1.137786
EURO	0.972750
JAPANISCHER YEN	0.005951
KANADISCHER DOLLAR	0.665583
SCHWEDISCHE KRONE	0.084235
SCHWEIZER FRANKEN	1.000000
US DOLLAR	0.900694

Vermögensrechnung per 31. März 2024

	Konsolidierung	
	31.03.2024	30.09.2023
	CHF	CHF
Vermögenswerte		
Bankguthaben, einschliesslich Treuhandanlagen bei Drittbanken, aufgeteilt in:		
- Sichtguthaben	14'945'298.81	3'498'369.96
Effekten, einschliesslich ausgeliehene und pensionierte Effekten, aufgeteilt in:		
- Obligationen, Wandelobligationen, Optionsanleihen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte	668'826'684.66	656'471'460.34
Derivative Finanzinstrumente	-9'627'315.74	-8'944'762.44
Sonstige Vermögenswerte	8'575'783.59	7'828'951.79
Gesamtfondsvermögen abzüglich:	682'720'451.32	658'854'019.65
Andere Verbindlichkeiten	21'688.69	29'476.05
Bankverbindlichkeiten	739.29	4'930'509.63
Nettofondsvermögen	682'698'023.34	653'894'033.97
	Konsolidierung	
	01.10.2023 - 31.03.2024	01.10.2022 - 30.09.2023
	CHF	CHF
Veränderung des Nettofondsvermögens		
Nettofondsvermögen zu Beginn der Berichtsperiode	653'894'033.97	947'777'415.10
Ablieferung Verrechnungssteuer	-8'655'877.53	-10'859'088.47
Ausgaben von Anteilen	76'763'954.48	40'444'632.61
Rücknahmen von Anteilen	-78'672'876.20	-340'600'485.14
Sonstiges aus Anteilverkehr	-94'672.66	10'680'613.92
Gesamterfolg	39'463'461.28	6'450'945.95
Nettofondsvermögen am Ende der Berichtsperiode	682'698'023.34	653'894'033.97
Entwicklung der Anteile im Umlauf		
Bestand zu Beginn der Berichtsperiode	1'083'526.017	1'469'066.890
Ausgegebene Anteile	94'889.534	62'135.071
Zurückgenommene Anteile	-102'090.176	-447'675.944
Bestand am Ende der Berichtsperiode	1'076'325.375	1'083'526.017
Währung Anteilklasse		
Inventarwert pro Anteil (Swung NAV)		
Inventarwert pro Anteil (Unswung NAV)		

Anteilklasse BH CHF		Anteilklasse BH EUR		Anteilklasse EBH CHF		Anteilklasse UBH EUR	
01.10.2023 - 31.03.2024	01.10.2022 - 30.09.2023	01.10.2023 - 31.03.2024	01.10.2022 - 30.09.2023	01.10.2023 - 31.03.2024	01.10.2022 - 30.09.2023	01.10.2023 - 31.03.2024	01.10.2022 - 30.09.2023
CHF	CHF	CHF	CHF	CHF	CHF	CHF	CHF
5'017'924.03	5'608'365.74	10'079'169.69	13'613'655.71	13'163'292.61	12'453'094.90	673'406.49	666'409.84
-51'423.66	-53'878.12	-100'497.08	-129'398.05	-155'158.56	-137'021.02	-7'477.25	-7'121.04
85'529.34	452'365.73	174'401.50	0.00	0.00	834'551.75	0.00	0.00
-329'231.37	-1'009'351.56	-756'135.79	-3'800'492.07	0.00	0.00	0.00	0.00
11'784.65	32'623.29	-2'849.86	207'361.82	5'059.94	-9'134.62	256.38	755.58
266'139.78	-12'201.05	691'036.80	188'042.28	759'155.50	21'801.60	49'679.35	13'362.11
5'000'722.77	5'017'924.03	10'085'125.26	10'079'169.69	13'772'349.49	13'163'292.61	715'864.97	673'406.49
61'569.511	68'082.235	118'302.352	161'275.238	163'920.000	153'816.767	7'867.092	7'867.092
1'024.917	5'481.280	1'987.708	0.000	0.000	10'103.233	0.000	0.000
-3'915.458	-11'994.004	-8'909.291	-42'972.886	0.000	0.000	0.000	0.000
58'678.970	61'569.511	111'380.769	118'302.352	163'920.000	163'920.000	7'867.092	7'867.092
(CHF)	(CHF)	(EUR)	(EUR)	(CHF)	(CHF)	(EUR)	(EUR)
85.01	81.62	92.85	88.09	83.81	80.42	93.31	88.50
85.22	81.50	93.09	87.97	84.02	80.30	93.54	88.38

	Anteilklasse ZB CHF	
	01.10.2023 - 31.03.2024	01.10.2022 - 30.09.2023
	CHF	CHF
Veränderung des Nettofondsvermögens		
Nettofondsvermögen zu Beginn der Berichtsperiode	145'144'534.52	148'263'561.94
Ablieferung Verrechnungssteuer	-1'919'103.31	-1'835'380.87
Ausgaben von Anteilen	6'529'361.07	194'197.00
Rücknahmen von Anteilen	0.00	-442'870.05
Sonstiges aus Anteilverkehr	-120'845.64	192'737.12
Gesamterfolg	10'503'321.77	-1'227'710.62
Nettofondsvermögen am Ende der Berichtsperiode	160'137'268.41	145'144'534.52
Entwicklung der Anteile im Umlauf		
Bestand zu Beginn der Berichtsperiode	150'314.866	150'559.866
Ausgegebene Anteile	6'664.652	200.000
Zurückgenommene Anteile	0.000	-445.000
Bestand am Ende der Berichtsperiode	156'979.518	150'314.866
Währung Anteilklasse	(CHF)	(CHF)
Inventarwert pro Anteil (Swung NAV)	1'017.61	966.98
Inventarwert pro Anteil (Unswung NAV)	1'020.12	965.60

Anteilklasse ZBH CHF		Anteilklasse ZBH DUR CHF	
01.10.2023 - 31.03.2024	01.10.2022 - 30.09.2023	01.10.2023 - 31.03.2024	01.10.2022 - 30.09.2023
CHF	CHF	CHF	CHF
359'922'940.56	468'474'110.02	119'892'765.92	298'698'216.80
-4'879'138.74	-5'842'752.69	-1'543'078.93	-2'853'536.68
68'692'998.32	34'568'751.35	1'281'664.25	4'394'766.78
-19'564'317.59	-143'917'278.55	-58'023'191.45	-191'430'492.91
-1'250'475.45	4'442'123.49	1'262'397.24	5'814'147.24
24'452'918.94	2'197'986.94	2'741'209.14	5'269'664.69
427'374'926.04	359'922'940.56	65'611'766.17	119'892'765.92
445'461.559	576'647.458	136'090.637	350'818.234
83'787.257	41'359.794	1'425.000	4'990.764
-24'026.607	-172'545.693	-65'238.820	-219'718.361
505'222.209	445'461.559	72'276.817	136'090.637
(CHF)	(CHF)	(CHF)	(CHF)
843.79	809.17	905.50	882.28
845.91	807.98	907.78	880.98

Erfolgsrechnung für die Zeit vom 1. Oktober 2023 bis zum 31. März 2024

	Konsolidierung	
	01.10.2023 - 31.03.2024	01.10.2022 - 30.09.2023
	CHF	CHF
Ertrag		
Erträge der Bankguthaben	146'609.45	302'819.00
Negativzinsen	-4.67	-27'551.51
Erträge der Effekten, aufgeteilt in:		
- Obligationen, Wandelobligationen, Optionsanleihen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte	12'734'382.56	29'561'770.95
Sonstige Erträge	0.00	14'706.83
Einkauf in laufende Nettoerträge bei der Ausgabe von Anteilen	574'814.35	785'417.08
Total Erträge	13'455'801.69	30'637'162.35
Aufwendungen		
Passivzinsen	20'072.68	-39'777.78
Prüfaufwand	6'946.48	14'494.70
Reglementarische Vergütung an:		
- die Fondsleitung	87'989.07	200'109.69
- die Depotbank	6'094.57	13'410.01
Sonstige Aufwendungen	8'107.44	8'500.29
Ausrichtung laufender Nettoerträge bei Rücknahme von Anteilen	507'730.99	5'870'574.66
Total Aufwendungen	636'941.23	6'067'311.57
Nettoertrag	12'818'860.46	24'569'850.78
Realisierte Kapitalgewinne und -verluste	-29'979'584.57	-26'277'553.10
Realisierter Erfolg	-17'160'724.11	-1'707'702.32
Nicht realisierte Kapitalgewinne und -verluste	56'624'185.39	8'158'648.27
Gesamterfolg	39'463'461.28	6'450'945.95

22 Credit Suisse (CH) Global Corporate Bond Fund

Halbjahresbericht per 31. März 2024

Anteilklasse BH CHF		Anteilklasse BH EUR		Anteilklasse EBH CHF		Anteilklasse UBH EUR	
01.10.2023 - 31.03.2024	01.10.2022 - 30.09.2023	01.10.2023 - 31.03.2024	01.10.2022 - 30.09.2023	01.10.2023 - 31.03.2024	01.10.2022 - 30.09.2023	01.10.2023 - 31.03.2024	01.10.2022 - 30.09.2023
CHF	CHF	CHF	CHF	CHF	CHF	CHF	CHF
1'101.53	2'131.12	2'149.66	4'613.01	2'970.12	5'011.72	150.47	264.76
0.00	-176.99	0.00	-414.79	0.00	-387.37	0.00	-21.10
96'494.27	205'466.65	188'261.16	447'058.97	260'238.79	484'446.05	13'214.13	25'586.73
0.00	118.76	0.00	234.83	0.00	290.69	0.00	15.15
631.45	3'080.70	2'152.60	0.00	0.00	12'540.08	0.00	0.00
98'227.25	210'620.24	192'563.42	451'492.02	263'208.91	501'901.17	13'364.60	25'845.54
146.18	-258.76	289.33	-587.96	406.33	-587.30	20.70	-31.64
52.60	102.03	102.86	220.34	141.99	241.87	7.24	12.67
20'002.22	44'922.47	38'833.43	97'830.93	27'106.51	53'160.60	2'046.91	4'195.69
1'056.01	2'371.62	2'050.13	5'165.01	2'844.55	5'578.61	143.88	294.77
72.12	84.48	140.71	184.21	193.65	197.14	9.84	10.45
2'148.06	14'745.37	3'766.19	50'002.95	0.00	0.00	0.00	0.00
23'477.19	61'967.21	45'182.65	152'815.48	30'693.03	58'590.92	2'228.57	4'481.94
74'750.06	148'653.03	147'380.77	298'676.54	232'515.88	443'310.25	11'136.03	21'363.60
-277'959.98	-262'355.59	-428'454.63	-630'552.27	-765'015.16	-681'589.55	-30'401.59	-42'319.74
-203'209.92	-113'702.56	-281'073.86	-331'875.73	-532'499.28	-238'279.30	-19'265.56	-20'956.14
469'349.70	101'501.51	972'110.66	519'918.01	1'291'654.78	260'080.90	68'944.91	34'318.25
266'139.78	-12'201.05	691'036.80	188'042.28	759'155.50	21'801.60	49'679.35	13'362.11

	Anteilklasse ZB CHF	
	01.10.2023 - 31.03.2024	01.10.2022 - 30.09.2023
	CHF	CHF
Ertrag		
Erträge der Bankguthaben	32'645.11	55'931.16
Negativzinsen	-1.10	-4'549.33
Erträge der Effekten, aufgeteilt in:		
- Obligationen, Wandelobligationen, Optionsanleihen und sonstige Forderungswertpapiere und -rechte	2'859'664.83	5'426'292.24
Sonstige Erträge	0.00	3'204.86
Einkauf in laufende Nettoerträge bei der Ausgabe von Anteilen	83'206.91	4'892.81
Total Erträge	2'975'515.75	5'485'771.74
Aufwendungen		
Passivzinsen	4'649.28	-6'854.92
Prüfaufwand	1'558.22	2'700.32
Reglementarische Vergütung an:		
- die Fondsleitung	0.00	0.00
- die Depotbank	0.00	0.00
Sonstige Aufwendungen	1'252.14	584.56
Ausrichtung laufender Nettoerträge bei Rücknahme von Anteilen	0.00	6'189.19
Total Aufwendungen	7'459.64	2'619.15
Nettoertrag	2'968'056.11	5'483'152.59
Realisierte Kapitalgewinne und -verluste	-5'455'884.86	-12'232'797.85
Realisierter Erfolg	-2'487'828.75	-6'749'645.26
Nicht realisierte Kapitalgewinne und -verluste	12'991'150.52	5'521'934.64
Gesamterfolg	10'503'321.77	-1'227'710.62

Halbjahresbericht per 31. März 2024

Anteilklasse ZBH CHF		Anteilklasse ZBH DUR CHF	
01.10.2023 - 31.03.2024	01.10.2022 - 30.09.2023	01.10.2023 - 31.03.2024	01.10.2022 - 30.09.2023
CHF	CHF	CHF	CHF
87'535.54	162'126.88	20'057.02	72'740.35
-3.10	-14'074.57	-0.47	-7'927.36
7'704'798.57	15'810'679.31	1'611'710.81	7'162'241.00
0.00	8'005.81	0.00	2'836.73
476'902.03	702'263.50	11'921.36	62'639.99
8'269'233.04	16'669'000.93	1'643'688.72	7'292'530.71
12'838.36	-20'613.45	1'722.50	-10'843.75
4'196.09	7'794.58	887.48	3'422.89
0.00	0.00	0.00	0.00
0.00	0.00	0.00	0.00
5'697.83	6'510.00	741.15	929.45
106'592.03	2'927'040.95	395'224.71	2'872'596.20
129'324.31	2'920'732.08	398'575.84	2'866'104.79
8'139'908.73	13'748'268.85	1'245'112.88	4'426'425.92
-23'723'093.98	-18'728'884.69	701'225.63	6'300'946.59
-15'583'185.25	-4'980'615.84	1'946'338.51	10'727'372.51
40'036'104.19	7'178'602.78	794'870.63	-5'457'707.82
24'452'918.94	2'197'986.94	2'741'209.14	5'269'664.69

Zusammensetzung des Portefeuilles und Bestandesveränderungen

Titelbezeichnung	Währung	30.09.2023 Anzahl/ Nominal	Käufe (1)	Verkäufe (1)	31.03.2024 Anzahl/ Nominal	Kurswert CHF	in % des Gesamtfonds- vermögens	
Wertpapiere bewertet aufgrund von am Markt beobachtbaren Parametern								
Anleihen								
Australien								
4.747	MACQUARIE GROUP LTD 4.7471%/23-23.01.2030	EUR	4'050'000	4'050'000		0.00	0.00	
Belgien								
-	AGEAS (subordinated) FIX-TO-FRN FRN/19-02.07.2049	EUR	4'600'000	200'000	4'400'000	4'018'414.69	0.59	
1.261	EUROCLEAR BANK SA 1.261%/21-03.08.2026	USD	15'100'000	5'500'000	9'600'000	7'905'560.87	1.16	
-	KBC GROUP NV (subordinated) FIX-TO-FRN FRN/19-03.12.2029	EUR	3'700'000	200'000	3'500'000	3'306'878.22	0.48	
-	KBC GROUP NV (subordinated) FIX-TO-FRN FRN/24-17.04.2035	EUR		3'400'000	3'400'000	3'352'991.43	0.49	
1.875	PROXIMUS 0.875%/15-01.10.2025	EUR	4'600'000	200'000	4'400'000	4'167'319.37	0.61	
4.250	SOLVAY SA 4.25%/24-03.10.2031	EUR	1'600'000		1'600'000	1'570'609.93	0.23	
						24'321'774.51	3.56	
Bermudas								
2.000	CBQ FINANCE LTD 2%/21-12.05.2026	USD		250'000	250'000		0.00	
						0.00	0.00	
Dänemark								
-	DANSKE BANK A/S (subordinated) FIX-TO-FRN FRN/19-21.06.2029	EUR	900'000		900'000	871'307.74	0.13	
						871'307.74	0.13	
Deutschland								
4.125	AMPRION GMBH 4.125%/23-07.09.2034	EUR	3'500'000	200'000	3'300'000	3'338'574.30	0.49	
2.600	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND 2.6%/23-15.08.2033	EUR	4'000'000	4'000'000				
-	COMMERZBANK AG FIX-TO-FRN FRN/24-17.01.2031	EUR		600'000	600'000	598'795.72	0.09	
4.000	DEUTSCHE BAHN FIN GMBH 4%/23-23.11.2043	EUR		1'250'000	1'250'000			
-	DEUTSCHE BANK AG FIX-TO-FRN FRN/20-19.11.2030	EUR	3'700'000	200'000	3'500'000	2'996'819.02	0.44	
-	DEUTSCHE BANK NY S. -D- FIX-TO-FRN FRN/20-18.09.2031	USD	5'900'000	300'000	5'600'000	4'440'942.41	0.65	
1.875	VOLKSWAGEN BANK GMBH 1.875%/19-31.01.2024	EUR		100'000	100'000			
						11'375'131.45	1.67	
Frankreich								
-	ARKEMA (subordinated) FIX-TO-FRN FRN/24-PERPETUAL	EUR		1'100'000	1'100'000			
4.250	ARKEMA 4.25%/23-20.05.2030	EUR	4'400'000	4'400'000				
0.625	BANQUE FED CRED MUTUEL 0.625%/21-03.11.2028	EUR	6'400'000	300'000	6'100'000	5'189'442.26	0.76	
-	BNP PARIBAS (subordinated) FIX-TO-FRN FRN/20-12.08.2035	USD	7'800'000	1'000'000	900'000	7'900'000	5'806'877.06	0.85
5.375	BOUYGUES SA 5.375%/22-30.06.2042	EUR		4'100'000	200'000	3'900'000	4'493'743.14	0.66
3.250	BPCE SA 3.25%/18-11.01.2028	USD	3'700'000	1'000'000	300'000	4'400'000	3'703'039.48	0.54
-	BPCE SA FIX-TO-FRN FRN/21-20.01.2032	USD	4'600'000		300'000	4'300'000	3'142'579.66	0.46
2.000	BPIFRANCE SACA 2%/22-02.09.2030	EUR		100'000	100'000			
4.375	ELECTRICITE DE FRANCE SA 4.375%/22-12.10.2029	EUR	3'500'000		200'000	3'300'000	3'335'396.33	0.49
3.750	ELIS SA 3.75%/24-21.03.2030	EUR		2'100'000	2'100'000	2'033'602.94	0.30	
1.250	FRANCE 1.25%/18-25.05.2034	EUR		185'000	185'000	155'200.03	0.02	
3.875	KLEPIERRE SA 3.875%/24-23.09.2033	EUR		1'800'000	1'800'000	1'747'798.29	0.26	
1.000	SCHLUMBERGER FINANCE FRA 1%/18-18.02.2026	EUR	4'600'000		200'000	4'400'000	4'090'919.58	0.60
1.488	SOCIETE GENERALE SA 1.488%/20-14.12.2026	USD	5'800'000	1'000'000	300'000	6'500'000	5'437'379.77	0.80
-	SUEZ (subordinated) FIX-TO-FRN FRN/19-PERPETUAL	EUR	900'000		900'000	813'097.41	0.12	
5.750	TELEPERFORMANCE SE 5.75%/23-22.11.2031	EUR		5'900'000	200'000	5'700'000	5'816'696.76	0.85
2.500	TOTAL CAPITAL INTERNATIONAL 2.5%/14-25.03.2026	EUR		100'000	100'000			
0.696	TOTAL CAPITAL INTL SA 0.696%/19-31.05.2028	EUR	3'500'000		200'000	3'300'000	2'898'440.92	0.42
-	TOTAL SA (subordinated) FIX-TO-FRN FRN/19-PERPETUAL	EUR		200'000	200'000			
-	TOTALENERGIES SE (subordinated) FIX-TO-FRN FRN/22-PERPETUAL	EUR	4'800'000		200'000	4'600'000	4'172'611.13	0.61
						52'836'824.76	7.74	
Grossbritannien								
4.875	ANGLO AMERICAN CAPITAL (reg. -S-) 4.875%/15-14.05.2025	USD	4'600'000		200'000	4'400'000	3'920'967.91	0.57
1.625	ANGLO AMERICAN CAPITAL 1.625%/17-18.09.2025	EUR	3'700'000		200'000	3'500'000	3'300'409.43	0.48
4.500	ANGLO AMERICAN CAPITAL 4.5%/23-15.09.2028	EUR	4'000'000		200'000	3'800'000	3'821'353.05	0.56
2.645	BARCLAYS PLC 2.645%/20-24.06.2031	USD	4'700'000		200'000	4'500'000	3'424'850.09	0.50
-	BARCLAYS PLC FIX-TO-FRN FRN/22-09.08.2028	USD	3'700'000		200'000	3'500'000	3'143'698.32	0.46
-	BP CAPITAL MARKETS PLC (subordinated) FIX-TO-FRN FRN/20-PERPETUAL	EUR	5'000'000		300'000	4'700'000	4'451'911.97	0.65
1.500	BRITISH TELECOMMUNICATIO 1.5%/17-23.06.2027	EUR	4'600'000		200'000	4'400'000	4'029'671.35	0.59
-	BRITISH TELECOMMUNICATIONS STEP UP 00-15.12.2030	USD	4'600'000	1'000'000	300'000	5'300'000	5'854'775.99	0.86
3.750	EASYJET PLC 3.75%/24-20.03.2031	EUR		4'150'000		4'150'000	4'011'278.11	0.59
-	HSBC HOLDINGS PLC FIX-TO-FRN FRN/19-07.11.2025	USD	8'700'000		400'000	8'300'000	7'329'762.22	1.07
-	HSBC HOLDINGS PLC FRN/18-19.06.2029	USD	4'600'000	1'000'000	300'000	5'300'000	4'626'985.35	0.68
-	LLOYDS BANKING GROUP PLC FIX-TO-FRN FRN/22-11.08.2026	USD	8'550'000		400'000	8'150'000	7'252'131.37	1.06
5.418	NATIONAL GRID PLC 5.418%/24-11.01.2034	USD		3'950'000		3'950'000	3'533'408.09	0.52
1.750	RECKITT BENCKISER TSY 1.75%/20-19.05.2032	GBP	5'700'000		5'700'000			
-	ROYAL BK SCOTLND GRP PLC FIX-TO-FRN FRN/19-28.03.2027	GBP	4'600'000		200'000	4'400'000	4'793'341.54	0.70
1.750	ROYALTY PHARMA PLC 1.75%/21-02.09.2027	USD	8'200'000		400'000	7'800'000	6'273'626.83	0.92

Titelbezeichnung	Währung	30.09.2023 Anzahl/ Nominal	Käufe (1)	Verkäufe (1)	31.03.2024 Anzahl/ Nominal	Kurswert CHF	in % des Gesamtfonds- vermögens
4.050 STANDARD CHARTERED (reg. -S-) 4.05%/16-12.04.2026	USD	2'700'000		200'000	2'500'000	2'189'745.82	0.32
4.000 THAMES WATER UTIL FIN 4%/23-18.04.2027	EUR		3'500'000		3'500'000	3'215'293.80	0.47
4.375 THAMES WATER UTIL FIN 4.375%/23-18.01.2031	EUR		1'625'000		1'625'000	1'467'254.76	0.21
6.150 VODAFONE GROUP 6.15%/07-27.02.2037	USD	7'000'000		3'000'000	4'000'000	3'848'523.25	0.56
4.000 WPP FINANCE 2013 4%/24-12.09.2033	EUR		3'550'000		3'550'000	3'465'417.98	0.51
						83'954'407.23	12.30
Irland							
- AIB GROUP PLC FIX-TO-FRN FRN/22-04.07.2026	EUR	3'400'000		200'000	3'200'000	3'106'387.63	0.46
- AIB GROUP PLC FIX-TO-FRN FRN/24-28.03.2035	USD		600'000		600'000	542'481.06	0.08
4.250 CRH SMW FINANCE DAC 4.25%/23-11.07.2035	EUR	1'000'000		100'000	900'000	917'707.91	0.13
0.875 RYANAIR DAC 0.875%/21-25.05.2026	EUR		160'000	160'000			
- ZURICH FINANCE IRELAND (subordinated) FIX-TO-FRN FRN/21-19.04.2051	USD	4'600'000		200'000	4'400'000	3'291'000.59	0.48
						7'857'577.19	1.15
Italien							
2.500 INTESA SANPAOLO SPA 2.5%/20-15.01.2030	GBP	2'700'000		100'000	2'600'000	2'531'072.86	0.37
5.125 INTESA SANPAOLO SPA 5.125%/23-29.08.2031	EUR	3'050'000		3'050'000			
4.000 REPUBLIC OF ITALY 4%/19-17.10.2049	USD	4'600'000		4'600'000			
0.850 UNICREDIT SPA 0.85%/21-19.01.2031	EUR	4'600'000		4'600'000			
						2'531'072.86	0.37
Japan							
0.342 NTT FINANCE CORP 0.342%/21-03.03.2030	EUR		100'000	100'000			
						0.00	0.00
Kaimaninseln							
0.875 HUTCHISON FINANCE 16 0.875%/16-03.10.2024	EUR		240'000	240'000			
1.375 TENCENT MUSIC ENT GRP 1.375%/20-03.09.2025	USD		200'000	200'000			
						0.00	0.00
Kanada							
- BANK OF NOVA SCOTIA (subordinated) FIX-TO-FRN FRN/19-03.07.2029	CAD	3'700'000		200'000	3'500'000	2'314'283.07	0.34
5.650 BANK OF NOVA SCOTIA 5.65%/23-01.02.2034	USD		4'100'000	200'000	3'900'000	3'616'543.99	0.53
4.850 BANK OF NOVA SCOTIA S. -I- 4.85%/23-01.02.2030	USD	6'550'000		300'000	6'250'000	5'589'709.72	0.82
5.850 BELL CANADA 5.85%/22-10.11.2032	CAD	5'000'000		300'000	4'700'000	3'329'105.92	0.49
3.630 BROOKFIELD RENEWABLE PAR 3.63%/16-15.01.2027	CAD	4'600'000		200'000	4'400'000	2'842'818.11	0.42
4.200 CANADIAN PACIFIC RAILWAY 4.2%/23-15.11.2069	USD	3'700'000		200'000	3'500'000	2'484'808.81	0.36
3.100 ENBRIDGE INC 3.1%/21-21.09.2033	CAD	4'600'000		200'000	4'400'000	2'507'116.53	0.37
4.550 ENBRIDGE PIPELINES 4.55%/13-17.08.2043	CAD	2'300'000		100'000	2'200'000	1'306'374.96	0.19
5.750 RIO TINTO ALCAN INC 5.75%/05-01.06.2035	USD	1'800'000		100'000	1'700'000	1'602'824.49	0.23
5.000 ROYAL BANK OF CANADA 5%/23-01.02.2033	USD	8'200'000		400'000	7'800'000	6'995'066.87	1.02
3.631 TORONTO-DOMINION BANK 3.631%/22-13.12.2029	EUR	5'400'000		300'000	5'100'000	5'020'706.13	0.74
						37'609'358.60	5.51
Luxemburg							
1.125 CK HUTCHISON GROUP TELECOM FINANCE S.A. 1.125%/19-17.10.2028	EUR	3'700'000		200'000	3'500'000	3'086'258.52	0.45
1.625 CNH INDUSTRIAL FIN EUR S 1.625%/19-03.07.2029	EUR	4'600'000	783'000	300'000	5'083'000	4'510'164.40	0.66
2.500 JOHN DEERE BANK SA 2.5%/22-14.09.2026	EUR	2'000'000		2'000'000			
4.625 P3 GROUP SARL 4.625%/24-13.02.2030	EUR		1'650'000		1'650'000	1'618'535.87	0.24
						9'214'958.79	1.35
Mexiko							
0.750 AMERICA MOVIL SAB DE CV 0.75%/19-26.06.2027	EUR		130'000	130'000			
3.625 AMERICA MOVIL SAB DE CV 3.625%/19-22.04.2029	USD	3'700'000		200'000	3'500'000	2'945'914.83	0.43
						2'945'914.83	0.43
Niederlande							
0.750 BMW FINANCE 0.75%/17-12.07.2024	EUR		130'000	130'000			
0.625 COOPERATIEVE RABOBANK UA 0.625%/19-27.02.2024	EUR		100'000	100'000			
0.625 DAIMLER INTL FINANCE BV 0.625%/19-06.05.2027	EUR		170'000	170'000			
6.650 E.ON INTERNATIONAL FINANCE (reg. -S-) 6.65%/08-30.04.2038	USD	7'944'000		400'000	7'544'000	7'370'361.74	1.08
- ELM (subordinated) FIX-TO-FRN 4.5%/16-PERPETUAL	EUR	1'800'000		100'000	1'700'000	1'657'660.36	0.24
4.000 ENBW INTL FINANCE BV 4%/23-24.01.2035	EUR	4'900'000		200'000	4'700'000	4'694'955.50	0.69
2.875 ENEL FINANCE INTL NV 2.875%/22-11.04.2029	GBP	3'000'000			3'000'000	3'107'247.61	0.46
4.750 ENEL FINANCE INTL NV 4.75%/17-25.05.2047	USD	9'600'000		500'000	9'100'000	6'998'427.36	1.03
- IBERDROLA INTL BV (subordinated) FIX-TO-FRN FRN/20-PERPETUAL	EUR	5'200'000		300'000	4'900'000	4'265'995.13	0.62
- ING GROEP NV FIX-TO-FRN FRN/22-16.02.2027	EUR	1'800'000		100'000	1'700'000	1'577'374.44	0.23
- ING GROUP (subordinated) FIX-TO-FRN 17-26.09.2029	EUR	1'800'000		100'000	1'700'000	1'631'796.88	0.24
- ING GROUP NV FIX-TO-FRN FRN/20-26.05.2031	EUR	4'100'000		200'000	3'900'000	3'641'103.44	0.53
6.250 INNOGY FINANCE 6.25%/02-03.06.2030	GBP	4'600'000		200'000	4'400'000	5'373'216.36	0.79
8.375 KONINKLIJKE KPN -144A- 8.375%/00-01.10.2030	USD	1'540'000		100'000	1'440'000	1'520'109.94	0.22
4.500 SANDOZ FINANCE B.V. 4.5%/23-17.11.2033	EUR		6'700'000	300'000	6'400'000	6'624'474.19	0.97
3.875 SHELL INTERNATIONAL FIN 3.875%/18-13.11.2028	USD	7'800'000		2'300'000	5'500'000	4'811'198.98	0.70
- SWISS LIFE RENT (subordinated) FIX-TO-FRN 4.375%/15-PERPETUAL	EUR	4'600'000		200'000	4'400'000	4'259'812.33	0.62

Titelbezeichnung	Währung	30.09.2023 Anzahl/ Nominal	Käufe (1)	Verkäufe (1)	31.03.2024 Anzahl/ Nominal	Kurswert CHF	in % des Gesamtfonds- vermögens
2.750 TENNET HOLDING BV 2.75%/22-17.05.2042	EUR	5'450'000		5'450'000			
4.750 TENNET HOLDING BV 4.75%/22-28.10.2042	EUR	3'700'000		1'100'000	2'600'000	2'905'006.98	0.43
1.000 TEVA PHARMACEUTIC FINANCIAL 1%/16-28.07.2025	CHF	2'500'000		100'000	2'400'000	2'349'600.00	0.34
4.100 TEVA PHARMACEUTICAL FINANCE 4.1%/16-01.10.2046	USD	4'900'000		200'000	4'700'000	2'913'078.21	0.43
1.908 UPJOHN FINANCE BV 1.908%/20-23.06.2032	EUR	9'100'000		3'100'000	6'000'000	4'927'640.22	0.72
- VOLKSWAGEN INTL FIN NV (subordinated) FIX-TO-FRN FRN/20-PERPETUAL	EUR		4'100'000	200'000	3'900'000	3'518'793.75	0.52
- VOLKSWAGEN INTL FIN NV (subordinated) FIX-TO-FRN FRN/22-PERPETUAL	EUR		2'700'000	100'000	2'600'000	2'385'367.82	0.35
- VOLKSWAGEN INTL FIN NV (subordinated) FIX-TO-FRN FRN/22-PERPETUAL	EUR	800'000	2'200'000	200'000	2'800'000	2'498'994.75	0.37
1.000 WUERTH FINANCE INTL BV 1%/18-26.05.2025	EUR		187'000	187'000			
						79'032'215.99	11.58
Norwegen							
4.000 TELENOR ASA 4%/23-03.10.2030	EUR	1'850'000		1'850'000			
						0.00	0.00
Österreich							
- OMV AG (subordinated) FIX-TO-FRN FRN/20-PERPETUAL	EUR	4'800'000		200'000	4'600'000	4'248'635.43	0.62
0.750 OMV AG 0.75%/20-16.06.2030	EUR		150'000	150'000			
- RAIFFEISEN BANK INTL (subordinated) FIX-TO-FRN FRN/19-12.03.2030	EUR	5'200'000		300'000	4'900'000	4'455'367.18	0.65
						8'704'002.61	1.27
Saudi-Arabien							
1.625 SAUDI ARABIAN OIL CO 1.625%/20-24.11.2025	USD		230'000	230'000			
						0.00	0.00
Schweden							
2.125 ENERGA FINANCE 2.125%/17-07.03.2027	EUR	2'300'000		1'200'000	1'100'000	1'011'120.12	0.15
5.337 SWEDBANK AB 5.337%/22-20.09.2027	USD	4'600'000		4'600'000			
2.125 TELE2 AB 2.125%/18-15.05.2028	EUR	3'450'000		200'000	3'250'000	2'998'749.93	0.44
						4'009'870.05	0.59
Schweiz							
- UBS GROUP AG FIX-TO-FRN FRN/23-11.01.2031	EUR	1'600'000	3'000'000	200'000	4'400'000	4'409'658.63	0.65
4.125 UBS GROUP FUNDING (Jersey) LIMITED (reg. -S-) 4.125%/15-24.09.2025	USD	6'400'000		300'000	6'100'000	5'382'922.89	0.79
4.253 UBS GROUP FUNDING SWITZE 4.253%/17-23.03.2028	USD	9'600'000		500'000	9'100'000	7'898'383.23	1.16
						17'690'964.75	2.59
Spanien							
- BANCO DE SABADELL SA FRN/24-15.01.2030	EUR		2'700'000	2'700'000			
2.749 BANCO SANTANDER SA (subordinated) 2.749%/20-03.12.2030	USD	8'200'000		400'000	7'800'000	5'801'589.08	0.85
0.800 BONOS Y OBLIG DEL ESTADO 0.8%/22-30.07.2029	EUR		220'000		220'000	192'726.48	0.03
2.629 FCC AQUALIA SA 2.629%/17-08.06.2027	EUR	6'400'000		300'000	6'100'000	5'771'960.96	0.85
- IBERDROLA FINANZAS SAU (subordinated) FIX-TO-FRN FRN/24-PERPETUAL	EUR		1'500'000		1'500'000	1'471'367.06	0.22
5.250 SERVICIOS MEDIO AMBIENTE 5.25%/23-30.10.2029	EUR		4'250'000	2'300'000	1'950'000	2'016'459.68	0.30
4.665 TELEFONICA EMISIONES SAU 4.665%/18-06.03.2038	USD	6'700'000		300'000	6'400'000	5'248'930.18	0.77
						20'503'033.44	3.00
Südkorea							
4.000 THE KOREA DEVELOPMENT BANK 4%/22-08.09.2025	USD	5'600'000		300'000	5'300'000	4'694'151.04	0.69
						4'694'151.04	0.69
Supranational							
3.750 AFRICA FINANCE CORP 3.75%/19-30.10.2029	USD	4'400'000		1'200'000	3'200'000	2'535'231.49	0.37
3.875 INTER-AMERICAN DEVEL BK 3.875%/11-28.10.2041	USD	7'300'000		400'000	6'900'000	5'573'611.61	0.82
1.100 INTL BK RECON & DEVELOP 1.1%/20-18.11.2030	AUD	9'310'000		500'000	8'810'000	4'185'698.68	0.61
						12'294'541.78	1.80
Vereinigte Arabische Emirate							
3.500 EMIRATES TELECOMMUNICATIONS 3.5%/14-18.06.2024	USD	1'900'000		1'900'000			
0.125 FIRST ABU DHABI BANK PJS 0.125%/21-16.02.2026	EUR		255'000	255'000			
						0.00	0.00
Vereinigte Staaten							
3.200 ABBVIE INC 3.2%/20-21.11.2029	USD		200'000	200'000			
4.950 ABBVIE INC 4.95%/24-15.03.2031	USD		350'000	350'000			
5.050 ABBVIE INC 5.05%/24-15.03.2034	USD		1'000'000		1'000'000	911'836.03	0.13
5.350 ALLSTATE CORP 5.35%/03-01.06.2033	USD	5'845'000		300'000	5'545'000	5'019'122.67	0.74
5.750 AMGEN INC 5.75%/23-02.03.2063	USD	6'200'000		300'000	5'900'000	5'421'123.14	0.79
3.450 APPLE 3.45%/15-09.02.2045	USD	1'800'000		100'000	1'700'000	1'233'794.67	0.18
4.375 APPLE 4.375%/15-13.05.2045	USD	3'700'000		200'000	3'500'000	2'908'810.72	0.43
4.250 ASHTEAD CAPITAL INC -144A- 4.25%/19-01.11.2029	USD	4'600'000		1'500'000	3'100'000	2'606'446.70	0.38
5.500 ASHTEAD CAPITAL INC 5.5%/22-11.08.2032	USD	400'000		400'000			
5.550 ASHTEAD CAPITAL INC 5.55%/23-30.05.2033	USD	800'000		800'000			
0.800 AT&T INC 0.8%/19-04.03.2030	EUR		200'000	200'000			

Titelbezeichnung	Währung	30.09.2023 Anzahl/ Nominal	Käufe (1)	Verkäufe (1)	31.03.2024 Anzahl/ Nominal	Kurswert CHF	in % des Gesamtfonds- vermögens
4.300 AT&T INC 4.3%/23-18.11.2034	EUR	2'250'000		100'000	2'150'000	2'208'447.94	0.32
4.850 AT&T INC 4.85%/17-25.05.2047	CAD	4'600'000		200'000	4'400'000	2'650'674.86	0.39
4.900 AT&T INC 4.9%/18-15.08.2037	USD	9'600'000		500'000	9'100'000	7'772'241.88	1.14
- BANK OF AMERICA CORP FIX-TO-FRN FRN/20-31.03.2029	EUR	5'900'000			5'900'000	5'766'199.36	0.84
- BANK OF AMERICA CORP S. -N- FIX-TO-FRN FRN/20-29.04.2031	USD	7'650'000		800'000	6'850'000	5'319'132.55	0.78
- BANK OF NY MELLON CORP FIX-TO-FRN FRN/23-01.02.2034	USD	2'200'000		100'000	2'100'000	1'821'720.26	0.27
6.650 BAYER CORP/NJ 6.65%/98-15.02.2028	USD		6'000'000		6'000'000	5'556'293.96	0.81
4.500 BERKSHIRE HATHAWAY 4.5%/13-11.02.2043	USD	4'600'000		200'000	4'400'000	3'812'954.03	0.56
5.650 BERRY GLOBAL INC 5.65%/24-15.01.2034	USD		2'400'000		2'400'000	2'150'426.00	0.31
1.950 BEST BUY CO INC 1.95%/20-01.10.2030	USD	7'800'000		400'000	7'400'000	5'537'064.13	0.81
3.543 BP CAP MARKETS AMERICA 3.543%/20-06.04.2027	USD	3'700'000		200'000	3'500'000	3'037'619.03	0.44
3.900 BRISTOL-MYERS SQUIBB CO 3.9%/22-15.03.2062	USD	2'550'000		100'000	2'450'000	1'679'829.37	0.25
4.550 BRISTOL-MYERS SQUIBB CO 4.55%/20-20.02.2048	USD	2'681'000		100'000	2'581'000	2'080'390.44	0.30
5.200 BRISTOL-MYERS SQUIBB CO 5.2%/24-22.02.2034	USD		550'000		550'000	503'119.81	0.07
3.250 CARGILL INC 3.25%/19-23.05.2029	USD	7'800'000		400'000	7'400'000	6'236'303.85	0.91
5.337 CELANESE US HOLDINGS LLC 5.337%/22-19.01.2029	EUR	1'006'000		1'006'000			
3.700 CHARTER COMM OPT LLC/CAP 3.7%/20-01.04.2051	USD	1'800'000		100'000	1'700'000	947'295.47	0.14
4.800 CIGNA CORP 4.8%/20-15.07.2046	USD	1'800'000		100'000	1'700'000	1'391'996.24	0.20
- CITIGROUP INC FIX-TO-FRN FRN/19-08.10.2027	EUR		250'000	250'000			
- CITIGROUP INC FIX-TO-FRN FRN/20-08.04.2026	USD	4'600'000		200'000	4'400'000	3'863'701.75	0.57
- CITIGROUP INC FIX-TO-FRN FRN/20-31.03.2031	USD	8'700'000		400'000	8'300'000	7'128'140.87	1.04
1.125 COCA-COLA 1.125%/15-09.03.2027	EUR		100'000	100'000			
7.050 COMCAST 7.05%/03-15.03.2033	USD	6'050'000		300'000	5'750'000	5'869'404.62	0.86
3.400 COMCAST CORP 3.4%/20-01.04.2030	USD	2'700'000		100'000	2'600'000	2'167'177.12	0.32
4.150 COMCAST CORP 4.15%/18-15.10.2028	USD	1'400'000		1'400'000			
4.500 CRH AMERICA FINANCE INC 4.5%/18-04.04.2048	USD	5'900'000		300'000	5'600'000	4'394'992.58	0.64
3.250 CVS HEALTH CORP 3.25%/19-15.08.2029	USD		200'000	200'000			
4.900 DELL INT LLC / EMC CORP 4.9%/21-01.10.2026	USD	4'590'000		200'000	4'390'000	3'927'675.11	0.58
0.750 DOVER CORP 0.75%/19-04.11.2027	EUR	2'700'000		100'000	2'600'000	2'302'285.25	0.34
3.250 EMD FINANCIAL (reg -S-) 3.25%/15-19.03.2025	USD	6'900'000		6'900'000			
7.000 EOT CORP 7%/20-01.02.2030	USD		4'107'000		4'107'000	3'925'207.27	0.57
0.250 EQUINIX INC 0.25%/21-15.03.2027	EUR		158'000	158'000			
3.500 EXPRESS SCRIPTS HOLDING 3.5%/14-15.06.2024	USD	1'800'000		1'800'000			
4.250 FEDEX CORP 4.25%/20-15.05.2030	USD	900'000			900'000	784'222.94	0.11
4.500 FEDEX CORP 4.5%/15-01.02.2065	USD	2'700'000		2'700'000			
6.798 FORD MOTOR CREDIT CO LLC 6.798%/23-07.11.2028	USD		7'300'000	400'000	6'900'000	6'483'457.11	0.95
5.905 GE HEALTHCARE TECH INC 5.905%/23-22.11.2032	USD	5'300'000		3'100'000	2'200'000	2'080'643.80	0.30
5.850 GENERAL MOTORS FINL CO 5.85%/23-06.04.2030	USD	2'000'000	2'000'000	200'000	3'800'000	3'486'505.33	0.51
3.650 GILEAD SCIENCES 3.65%/15-01.03.2026	USD	5'000'000		300'000	4'700'000	4'123'453.02	0.60
5.634 GLENCORE FUNDING LLC 5.634%/24-04.04.2034	USD	2'450'000		2'450'000		2'212'924.29	0.32
4.000 GOLDMAN SACHS GROUP 4%/14-03.03.2024	USD	6'400'000		6'400'000			
4.500 HEALTH CARE REIT 4.5%/14-01.12.2034	GBP	4'600'000		200'000	4'400'000	4'652'615.63	0.68
2.700 HOME DEPOT INC 2.7%/20-15.04.2030	USD	5'900'000		300'000	5'600'000	4'494'508.51	0.66
5.375 INTERPUBLIC GROUP COS 5.375%/23-15.06.2033	USD	4'900'000		200'000	4'700'000	4'223'950.71	0.62
- JPMORGAN CHASE & CO FIX-TO-FRN FRN/20-22.04.2031	USD	4'600'000		200'000	4'400'000	3'428'597.88	0.50
- JPMORGAN CHASE & CO FIX-TO-FRN FRN/21-04.02.2032	USD	4'600'000		200'000	4'400'000	3'226'917.99	0.47
- JPMORGAN CHASE & CO FIX-TO-FRN FRN/21-22.04.2032	USD	4'600'000		200'000	4'400'000	3'345'690.76	0.49
4.450 KROGER 4.45%/17-01.02.2047	USD	2'800'000		100'000	2'700'000	2'092'798.67	0.31
3.150 KYNDRYL HOLDINGS INC 3.15%/22-15.10.2031	USD	9'000'000		500'000	8'500'000	6'447'648.20	0.94
7.300 LASMO (USA) 7.3%/97-15.11.2027	USD	4'600'000		200'000	4'400'000	4'216'334.44	0.62
5.300 MARRIOTT INTERNATIONAL 5.3%/24-15.05.2034	USD		3'000'000		3'000'000	2'671'657.88	0.39
5.875 METLIFE 5.875%/10-06.02.2041	USD	5'900'000		300'000	5'600'000	5'307'734.72	0.78
5.250 METLIFE INC 5.25%/23-15.01.2054	USD	6'400'000		300'000	6'100'000	5'406'328.33	0.79
4.750 MICROSOFT 4.75%/15-03.11.2055	USD	2'700'000		100'000	2'600'000	2'314'710.87	0.34
4.200 MOLSON COORS BREWING 4.2%/16-15.07.2046	USD	5'750'000		300'000	5'450'000	4'107'032.91	0.60
5.000 MOLSON COORS BREWING 5%/12-01.05.2042	USD	2'950'000		100'000	2'850'000	2'431'981.73	0.36
- MORGAN STANLEY S. -I- FIX-TO-FRN FRN/22-17.07.2026	USD	6'400'000		300'000	6'100'000	5'435'447.78	0.80
3.625 NETFLIX INC 3.625%/19-15.06.2030	EUR	5'800'000		5'800'000			
3.800 NEW ENGLAND POWER CO -144A- 3.8%/17-05.12.2047	USD	3'700'000		200'000	3'500'000	2'427'308.48	0.36
4.000 ORACLE 4%/16-15.07.2046	USD	2'700'000		100'000	2'600'000	1'847'497.24	0.27
4.100 ORACLE CORP 4.1%/21-25.03.2061	USD	4'600'000		200'000	4'400'000	2'967'100.06	0.43
7.000 OWENS CORNING 7%/06-01.12.2036	USD	2'700'000		1'100'000	1'600'000	1'623'469.31	0.24
1.125 PARKER-HANNIFIN CORP 1.125%/17-01.03.2025	EUR	6'000'000		6'000'000			
0.750 PEPSICO INC 0.75%/19-18.03.2027	EUR	3'070'000		200'000	2'870'000	2'607'590.03	0.38
4.700 PLAINS ALL AMERICAN 4.7%/14-15.06.2044	USD	7'300'000		400'000	6'900'000	5'272'753.55	0.77
3.100 PRINCIPAL FINANCIAL GROU 3.1%/16-15.11.2026	USD	3'895'000		200'000	3'695'000	3'170'515.33	0.46
1.750 SIMON PROPERTY GROUP LP 1.75%/21-01.02.2028	USD	5'900'000		300'000	5'600'000	4'496'475.63	0.66
6.250 SIMON PROPERTY GROUP LP 6.25%/23-15.01.2034	USD		3'600'000	200'000	3'400'000	3'275'868.93	0.48
0.750 STRYKER CORP 0.75%/19-01.03.2029	EUR	150'000		150'000			
1.500 T-MOBILE USA INC 1.5%/21-15.02.2026	USD		2'995'000		2'995'000	2'518'676.36	0.37
1.250 UNITED STATES OF AMERICA 1.25%/20-15.05.2050	USD	3'500'000		200'000	3'300'000	1'521'441.80	0.22

Titelbezeichnung	Währung	30.09.2023 Anzahl/ Nominal	Käufe (1)	Verkäufe (1)	31.03.2024 Anzahl/ Nominal	Kurswert CHF	in % des Gesamtfonds- vermögens
2.000 UNITED STATES OF AMERICA 2%/20-15.02.2050	USD	7'000'000		2'300'000	4'700'000	2'652'404.41	0.39
2.750 UNITED STATES OF AMERICA 2.75%/12-15.11.2042	USD	3'700'000		200'000	3'500'000	2'468'500.91	0.36
3.500 UNITED STATES OF AMERICA 3.5%/09-15.02.2039	USD	4'600'000		4'600'000			
4.250 UNITED STATES OF AMERICA 4.25%/10-15.11.2040	USD	6'400'000		6'400'000			
4.500 UNITED STATES OF AMERICA 4.5%/06-15.02.2036	USD		8'000'000	400'000	7'600'000	7'115'880.16	1.04
1.375 UNITED STATES OF AMERICA S. -2050- 1.375%/20-15.08.2050	USD	6'300'000		300'000	6'000'000	2'855'764.32	0.42
1.875 US TREASURY N/B 1.875%/21-15.02.2041	USD	5'400'000		300'000	5'100'000	3'203'277.58	0.47
3.000 US TREASURY N/B 3%/22-15.08.2052	USD	4'600'000		200'000	4'400'000	3'080'656.47	0.45
3.375 US TREASURY N/B 3.375%/23-15.05.2033	USD	2'000'000		100'000	1'900'000	1'603'827.19	0.23
3.500 US TREASURY N/B 3.5%/23-15.02.2033	USD	3'600'000		3'600'000			
3.625 US TREASURY N/B 3.625%/23-15.02.2053	USD	7'200'000		400'000	6'800'000	5'381'142.66	0.79
4.000 US TREASURY N/B 4%/22-15.11.2052	USD	7'300'000		7'300'000			
4.125 US TREASURY N/B 4.125%/23-15.08.2053	USD	6'500'000		6'500'000			
4.500 US TREASURY N/B S. -F-2033- 4.5%/23-15.11.2033	USD		9'000'000	500'000	8'500'000	7'829'356.83	1.15
1.750 VERIZON COMMUNICATIONS 1.75%/20-20.01.2031	USD	4'600'000		200'000	4'400'000	3'217'327.39	0.47
4.862 VERIZON COMMUNICATIONS 4.862%/15-21.08.2046	USD	3'700'000		200'000	3'500'000	2'959'186.56	0.43
2.950 VF CORP 2.95%/20-23.04.2030	USD	8'700'000		1'900'000	6'800'000	5'062'450.40	0.74
4.279 WARNERMEDIA HOLDINGS INC 4.279%/23-15.03.2032	USD	3'850'000		200'000	3'650'000	2'938'365.66	0.43
5.141 WARNERMEDIA HOLDINGS INC 5.141%/23-15.03.2052	USD	6'900'000		300'000	6'600'000	4'936'322.55	0.72
2.000 WELLS FARGO & COMPANY 2%/15-27.04.2026	EUR	2'300'000		100'000	2'200'000	2'070'883.58	0.30
3.875 WI TREAS. NT/BD S. -E-2033- 3.875%/23-15.08.2033	USD	6'000'000		2'000'000	4'000'000	3'509'330.73	0.51
0.500 WI TREASURY N/B 0.5%/20-31.10.2027	USD		500'000		500'000	393'350.15	0.06
1.625 WI TREASURY N/B 1.625%/20-15.11.2050	USD	2'700'000		100'000	2'600'000	1'323'486.05	0.19
1.875 WI TREASURY N/B 1.875%/21-15.02.2051	USD	1'800'000		100'000	1'700'000	922'775.54	0.14
						288'379'577.04	42.24

Total Anleihen						668'826'684.66	97.96
Total Wertpapiere bewertet aufgrund von am Markt beobachtbaren Parametern						668'826'684.66	97.96

Derivative Finanzinstrumente

Börsennotierte / an einem geregelten Markt gehandelte Wertpapiere; bewertet zu den Kursen, die am Hauptmarkt bezahlt werden

Financial Futures**Deutschland**

EURO BOBL Commodities -100000- 03/24	EUR		130	130			
EURO BOBL Commodities -100000- 06/24	EUR			117	-117	0.00	0.00
EURO BUND Commodities -100000- 03/24	EUR		75	75			
EURO BUND Commodities -100000- 06/24	EUR			76	-76	0.00	0.00
						0.00	0.00

Vereinigte Staaten

ULTRA T-BOND USD -100000- 12/23	USD		119	119			
US TREASURY NOTES 10 YEARS -100000- 12/23	USD		115	115			
US TREASURY NOTES 10 YEARS -100000- 03/24	USD		297	297			
US TREASURY NOTES 10 YEARS -100000- 06/24	USD			281	-281	0.00	0.00
US TREASURY NOTES 30 YEARS -100000- 12/23	USD		127	127			
US TREASURY NOTES 30 YEARS -100000- 03/24	USD		123	123			
						0.00	0.00

Total Financial Futures

Total Financial Futures						0.00	0.00
--------------------------------	--	--	--	--	--	-------------	-------------

Total Börsennotierte / an einem geregelten Markt gehandelte Wertpapiere; bewertet zu den Kursen, die am Hauptmarkt bezahlt werden

Wertpapiere bewertet aufgrund von am Markt beobachtbaren Parametern

Devisentermingeschäfte

Devisentermingeschäfte (siehe Liste)						-12'284'240.55	-1.80
Total Devisentermingeschäfte						-12'284'240.55	-1.80

Swaps

Floating Swap ~ 13.12.2022 ~ 15.12.2029	EUR	10'000'000		10'000'000		0.00	0.00
Floating Swap ~ 04.01.2023 ~ 06.01.2043	USD	16'000'000		16'000'000		0.00	0.00
Floating Swap ~ 16.12.2022 ~ 20.12.2032	USD	23'000'000		23'000'000		0.00	0.00
Floating Swap ~ 30.12.2021 ~ 03.01.2028	USD	10'000'000			10'000'000	999'560.58	0.15
Floating Swap ~ 26.04.2023 ~ 28.04.2033	USD	4'000'000			4'000'000	279'597.19	0.04
Floating Swap ~ 29.12.2021 ~ 31.12.2051	USD	4'000'000		4'000'000		0.00	0.00
Floating Swap ~ 15.06.2020 ~ 17.06.2030	GBP	1'500'000		1'500'000		0.00	0.00
Floating Swap ~ 06.04.2023 ~ 12.04.2033	EUR	1'000'000		1'000'000		0.00	0.00
Floating Swap ~ 28.05.2021 ~ 01.06.2028	EUR	3'000'000		3'000'000		0.00	0.00
Floating Swap ~ 20.06.2023 ~ 22.06.2053	USD	1'500'000		1'500'000		0.00	0.00
Floating Swap ~ 13.12.2022 ~ 15.12.2029	EUR		8'000'000		8'000'000	45'118.15	0.01
Floating Swap ~ 29.12.2021 ~ 31.12.2051	USD		2'000'000		2'000'000	683'102.96	0.10
Floating Swap ~ 04.01.2023 ~ 06.01.2043	USD		10'000'000		10'000'000	656'366.83	0.10
Floating Swap ~ 20.02.2024 ~ 22.02.2034	USD		3'000'000		3'000'000	-6'820.90	0.00
						2'656'924.81	0.39

Total Swaps

Total Swaps						2'656'924.81	0.39
--------------------	--	--	--	--	--	---------------------	-------------

Total Wertpapiere bewertet aufgrund von am Markt beobachtbaren Parametern

-9'627'315.74 **-1.41**

Titelbezeichnung	Währung	30.09.2023 Anzahl/ Nominal	Käufe (1)	Verkäufe (1)	31.03.2024 Anzahl/ Nominal	Kurswert CHF	in % des Gesamtfonds- vermögens
Total Derivative Finanzinstrumente						-9'627'315.74	-1.41
Total Anlagen						659'199'368.92	96.55
Bankguthaben auf Sicht						14'945'299.08	2.19
Bankguthaben auf Zeit						0.00	0.00
Sonstige Vermögenswerte						8'575'783.59	1.26
Gesamtfondsvermögen (GFV)						682'720'451.52	100.00
./. Bankverbindlichkeiten						739.56	0.00
./. Andere Verbindlichkeiten						21'688.69	0.00
./. Andere Kredite						0.00	0.00
Nettofondsvermögen						682'698'023.27	100.00

(1) Umfassen auch Corporate Actions

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

Anlagekategorien	Kurswert CHF	in % des Gesamtfonds- vermögens
Börsennotierte / an einem geregelten Markt gehandelte Wertpapiere; bewertet zu den Kursen, die am Hauptmarkt bezahlt werden	0.00	0.00
Wertpapiere bewertet aufgrund von am Markt beobachtbaren Parametern	659'199'368.92	96.55
Wertpapiere bewertet aufgrund geeigneten Bewertungsmodellen unter Berücksichtigung der aktuellen Marktgegebenheiten	0.00	0.00

Aufstellung der Devisentermingeschäfte für die Zeit vom 1. Oktober 2023 bis zum 31. März 2024

Fälligkeit	Transaktion	Währung	Betrag	Gegen	Gegenwert	Devisengewinn/-verlust Mandatswährung	in % des GFV
08.11.2023	Bought	CAD	9'398'000	CHF	6'054'868	0.00	0.00
08.11.2023	Bought	CAD	416'000	CHF	280'540	0.00	0.00
08.11.2023	Bought	CAD	37'000	EUR	25'904	0.00	0.00
08.11.2023	Bought	CAD	21'000	EUR	14'309	0.00	0.00
08.11.2023	Bought	CHF	539'843	AUD	960'000	0.00	0.00
08.11.2023	Bought	CHF	1'768'547	AUD	3'145'000	0.00	0.00
08.11.2023	Bought	CHF	1'095'993	AUD	1'949'000	0.00	0.00
08.11.2023	Bought	CHF	12'207'666	CAD	18'948'000	0.00	0.00
08.11.2023	Bought	CHF	3'913'308	CAD	6'074'000	0.00	0.00
08.11.2023	Bought	CHF	119'365	CAD	177'000	0.00	0.00
08.11.2023	Bought	CHF	28'612'862	EUR	30'184'000	0.00	0.00
08.11.2023	Bought	CHF	9'029'205	EUR	9'525'000	0.00	0.00
08.11.2023	Bought	CHF	87'779'037	EUR	92'599'000	0.00	0.00
08.11.2023	Bought	CHF	2'856'162	EUR	3'000'000	0.00	0.00
08.11.2023	Bought	CHF	1'988'531	EUR	2'082'000	0.00	0.00
08.11.2023	Bought	CHF	1'584'521	EUR	1'659'000	0.00	0.00
08.11.2023	Bought	CHF	12'416	EUR	13'000	0.00	0.00
08.11.2023	Bought	CHF	289'914	EUR	301'000	0.00	0.00
08.11.2023	Bought	CHF	1'662'430	EUR	1'726'000	0.00	0.00
08.11.2023	Bought	CHF	2'864'787	EUR	3'000'000	0.00	0.00
08.11.2023	Bought	CHF	133'503	EUR	139'000	0.00	0.00
08.11.2023	Bought	CHF	761'466	EUR	793'000	0.00	0.00
08.11.2023	Bought	CHF	5'262'472	GBP	4'769'000	0.00	0.00
08.11.2023	Bought	CHF	14'967'535	GBP	13'564'000	0.00	0.00
08.11.2023	Bought	CHF	796'709	GBP	722'000	0.00	0.00
08.11.2023	Bought	CHF	420'346	GBP	378'000	0.00	0.00
08.11.2023	Bought	CHF	850'954	JPY	139'906'000	0.00	0.00
08.11.2023	Bought	CHF	2'622'547	JPY	431'175'000	0.00	0.00
08.11.2023	Bought	CHF	85'905'622	USD	98'284'000	0.00	0.00
08.11.2023	Bought	CHF	255'695'176	USD	292'539'000	0.00	0.00
08.11.2023	Bought	CHF	180'822	USD	206'000	0.00	0.00
08.11.2023	Bought	CHF	3'849'043	USD	4'385'000	0.00	0.00
08.11.2023	Bought	CHF	1'477'809	USD	1'628'000	0.00	0.00
08.11.2023	Bought	CHF	202'551	USD	223'000	0.00	0.00
08.11.2023	Bought	EUR	51'014	AUD	86'000	0.00	0.00
08.11.2023	Bought	EUR	387'389	CAD	570'000	0.00	0.00
08.11.2023	Bought	EUR	49'585	CHF	47'000	0.00	0.00
08.11.2023	Bought	EUR	1'291'000	CHF	1'243'451	0.00	0.00
08.11.2023	Bought	EUR	28'057	CHF	27'000	0.00	0.00
08.11.2023	Bought	EUR	507'000	CHF	481'042	0.00	0.00
08.11.2023	Bought	EUR	465'647	GBP	400'000	0.00	0.00
08.11.2023	Bought	EUR	83'227	JPY	12'970'000	0.00	0.00

Aufstellung der Devisentermingeschäfte für die Zeit vom 1. Oktober 2023 bis zum 31. März 2024

Fälligkeit	Transaktion	Währung	Betrag	Gegen	Gegenwert	Devisengewinn/-verlust Mandatswährung	in % des GFV
08.11.2023	Bought	EUR	8'017'364	USD	8'695'000	0.00	0.00
08.11.2023	Bought	GBP	471'000	CHF	523'765	0.00	0.00
08.11.2023	Bought	GBP	1'794'000	CHF	1'989'803	0.00	0.00
08.11.2023	Bought	GBP	203'000	CHF	225'156	0.00	0.00
08.11.2023	Bought	GBP	29'000	EUR	33'287	0.00	0.00
08.11.2023	Bought	JPY	749'803'000	CHF	4'560'546	0.00	0.00
08.11.2023	Bought	JPY	1'104'000	EUR	6'898	0.00	0.00
08.11.2023	Bought	USD	3'276'000	CHF	2'863'404	0.00	0.00
08.11.2023	Bought	USD	5'876'000	CHF	5'157'806	0.00	0.00
08.11.2023	Bought	USD	4'153'000	CHF	3'769'865	0.00	0.00
08.11.2023	Bought	USD	3'459'000	CHF	3'139'890	0.00	0.00
08.11.2023	Bought	USD	1'395'000	CHF	1'242'277	0.00	0.00
08.11.2023	Bought	USD	3'000'000	CHF	2'704'893	0.00	0.00
08.11.2023	Bought	USD	4'045'000	CHF	3'672'261	0.00	0.00
08.11.2023	Bought	USD	207'000	EUR	190'233	0.00	0.00
08.11.2023	Bought	USD	295'000	EUR	278'015	0.00	0.00
08.11.2023	Bought	USD	171'000	EUR	161'347	0.00	0.00
08.11.2023	Bought	USD	350'000	EUR	330'979	0.00	0.00
22.02.2024	Bought	AUD	426'000	CHF	244'783	0.00	0.00
22.02.2024	Bought	CAD	8'568'000	CHF	5'575'575	0.00	0.00
22.02.2024	Bought	CAD	790'000	CHF	505'194	0.00	0.00
22.02.2024	Bought	CAD	362'000	CHF	231'519	0.00	0.00
22.02.2024	Bought	CAD	2'395'000	CHF	1'533'370	0.00	0.00
22.02.2024	Bought	CAD	8'000	EUR	5'365	0.00	0.00
22.02.2024	Bought	CHF	1'040'641	AUD	1'797'000	0.00	0.00
22.02.2024	Bought	CHF	1'817'792	AUD	3'139'000	0.00	0.00
22.02.2024	Bought	CHF	531'034	AUD	917'000	0.00	0.00
22.02.2024	Bought	CHF	12'284'745	CAD	18'878'000	0.00	0.00
22.02.2024	Bought	CHF	3'587'552	CAD	5'513'000	0.00	0.00
22.02.2024	Bought	CHF	602'396	CAD	942'000	0.00	0.00
22.02.2024	Bought	CHF	480'536	CAD	747'000	0.00	0.00
22.02.2024	Bought	CHF	547'403	CAD	855'000	0.00	0.00
22.02.2024	Bought	CHF	126'846	CAD	201'000	0.00	0.00
22.02.2024	Bought	CHF	16'598'011	EUR	17'342'000	0.00	0.00
22.02.2024	Bought	CHF	89'907'966	EUR	93'938'000	0.00	0.00
22.02.2024	Bought	CHF	26'882'997	EUR	28'088'000	0.00	0.00
22.02.2024	Bought	CHF	6'095'233	EUR	6'366'000	0.00	0.00
22.02.2024	Bought	CHF	5'047'764	EUR	5'272'000	0.00	0.00
22.02.2024	Bought	CHF	2'139'259	EUR	2'236'000	0.00	0.00
22.02.2024	Bought	CHF	143'000	EUR	149'466	0.00	0.00
22.02.2024	Bought	CHF	123'765	EUR	129'000	0.00	0.00
22.02.2024	Bought	CHF	2'373'603	EUR	2'474'000	0.00	0.00
22.02.2024	Bought	CHF	5'753'316	EUR	6'000'000	0.00	0.00
22.02.2024	Bought	CHF	1'547'040	EUR	1'635'000	0.00	0.00
22.02.2024	Bought	CHF	4'736'890	EUR	5'000'000	0.00	0.00
22.02.2024	Bought	CHF	1'610'408	EUR	1'700'000	0.00	0.00
22.02.2024	Bought	CHF	31'000	EUR	32'939	0.00	0.00
22.02.2024	Bought	CHF	4'030'119	EUR	4'282'000	0.00	0.00
22.02.2024	Bought	CHF	903'507	EUR	963'000	0.00	0.00
22.02.2024	Bought	CHF	1'794'961	EUR	1'941'000	0.00	0.00
22.02.2024	Bought	CHF	60'109	EUR	65'000	0.00	0.00
22.02.2024	Bought	CHF	1'953'966	EUR	2'100'000	0.00	0.00
22.02.2024	Bought	CHF	849'067	EUR	900'000	0.00	0.00
22.02.2024	Bought	CHF	15'349'621	GBP	13'942'000	0.00	0.00
22.02.2024	Bought	CHF	4'927'909	GBP	4'476'000	0.00	0.00
22.02.2024	Bought	CHF	910'763	GBP	834'000	0.00	0.00
22.02.2024	Bought	CHF	650'441	GBP	590'000	0.00	0.00
22.02.2024	Bought	CHF	936'418	GBP	856'000	0.00	0.00
22.02.2024	Bought	CHF	701'094	GBP	660'000	0.00	0.00
22.02.2024	Bought	CHF	811'925	JPY	134'709'000	0.00	0.00
22.02.2024	Bought	CHF	2'598'799	JPY	431'175'000	0.00	0.00
22.02.2024	Bought	CHF	523'135	JPY	85'734'000	0.00	0.00
22.02.2024	Bought	CHF	81'760'650	USD	92'302'000	0.00	0.00
22.02.2024	Bought	CHF	253'875'933	USD	286'608'000	0.00	0.00
22.02.2024	Bought	CHF	2'144'729	USD	2'400'000	0.00	0.00
22.02.2024	Bought	CHF	12'707'289	USD	14'464'000	0.00	0.00
22.02.2024	Bought	CHF	7'138'744	USD	8'149'000	0.00	0.00
22.02.2024	Bought	CHF	497'400	USD	569'000	0.00	0.00
22.02.2024	Bought	CHF	7'057'134	USD	8'073'000	0.00	0.00

Aufstellung der Devisentermingeschäfte für die Zeit vom 1. Oktober 2023 bis zum 31. März 2024

Fälligkeit	Transaktion	Währung	Betrag	Gegen	Gegenwert	Devisengewinn/-verlust Mandatswährung	in % des GFV
22.02.2024	Bought	CHF	289'457	USD	335'000	0.00	0.00
22.02.2024	Bought	CHF	10'266'654	USD	11'882'000	0.00	0.00
22.02.2024	Bought	CHF	693'154	USD	800'000	0.00	0.00
22.02.2024	Bought	CHF	433'515	USD	500'000	0.00	0.00
22.02.2024	Bought	CHF	13'044'959	USD	15'004'000	0.00	0.00
22.02.2024	Bought	CHF	2'586'411	USD	3'000'000	0.00	0.00
22.02.2024	Bought	CHF	821'003	USD	964'000	0.00	0.00
22.02.2024	Bought	CHF	166'795	USD	200'000	0.00	0.00
22.02.2024	Bought	CHF	8'410'618	USD	10'085'000	0.00	0.00
22.02.2024	Bought	EUR	51'425	AUD	85'000	0.00	0.00
22.02.2024	Bought	EUR	347'405	CAD	511'000	0.00	0.00
22.02.2024	Bought	EUR	9'551	CAD	14'000	0.00	0.00
22.02.2024	Bought	EUR	171'000	CHF	163'727	0.00	0.00
22.02.2024	Bought	EUR	53'287	CHF	51'000	0.00	0.00
22.02.2024	Bought	EUR	116'969	CHF	112'000	0.00	0.00
22.02.2024	Bought	EUR	1'200'000	CHF	1'154'286	0.00	0.00
22.02.2024	Bought	EUR	2'318'000	CHF	2'217'712	0.00	0.00
22.02.2024	Bought	EUR	2'684'000	CHF	2'567'877	0.00	0.00
22.02.2024	Bought	EUR	32'311	CHF	31'000	0.00	0.00
22.02.2024	Bought	EUR	2'771'000	CHF	2'658'550	0.00	0.00
22.02.2024	Bought	EUR	155'000	CHF	146'661	0.00	0.00
22.02.2024	Bought	EUR	11'368'000	CHF	10'699'299	0.00	0.00
22.02.2024	Bought	EUR	800'000	CHF	755'017	0.00	0.00
22.02.2024	Bought	EUR	33'515	CHF	31'000	0.00	0.00
22.02.2024	Bought	EUR	437'098	GBP	380'000	0.00	0.00
22.02.2024	Bought	EUR	12'574	GBP	11'000	0.00	0.00
22.02.2024	Bought	EUR	6'934	GBP	6'000	0.00	0.00
22.02.2024	Bought	EUR	24'126	GBP	21'000	0.00	0.00
22.02.2024	Bought	EUR	74'734	JPY	11'866'000	0.00	0.00
22.02.2024	Bought	EUR	7'178'978	USD	7'757'000	0.00	0.00
22.02.2024	Bought	EUR	274'874	USD	301'000	0.00	0.00
22.02.2024	Bought	EUR	109'927	USD	119'000	0.00	0.00
22.02.2024	Bought	EUR	186'700	USD	207'000	0.00	0.00
22.02.2024	Bought	GBP	1'407'000	CHF	1'549'054	0.00	0.00
22.02.2024	Bought	GBP	700'000	CHF	764'429	0.00	0.00
22.02.2024	Bought	GBP	242'000	CHF	264'695	0.00	0.00
22.02.2024	Bought	GBP	145'000	CHF	159'854	0.00	0.00
22.02.2024	Bought	GBP	4'500'000	CHF	4'960'350	0.00	0.00
22.02.2024	Bought	GBP	1'654'000	CHF	1'809'387	0.00	0.00
22.02.2024	Bought	GBP	151'000	CHF	162'841	0.00	0.00
22.02.2024	Bought	GBP	16'000	EUR	18'389	0.00	0.00
22.02.2024	Bought	JPY	776'325'000	CHF	4'679'103	0.00	0.00
22.02.2024	Bought	JPY	5'599'000	CHF	33'194	0.00	0.00
22.02.2024	Bought	JPY	60'357'000	CHF	368'289	0.00	0.00
22.02.2024	Bought	JPY	2'401'000	CHF	14'257	0.00	0.00
22.02.2024	Bought	USD	9'144'000	CHF	8'099'709	0.00	0.00
22.02.2024	Bought	USD	1'246'000	CHF	1'094'668	0.00	0.00
22.02.2024	Bought	USD	11'410'000	CHF	10'024'210	0.00	0.00
22.02.2024	Bought	USD	7'897'000	CHF	6'917'985	0.00	0.00
22.02.2024	Bought	USD	11'051'000	CHF	9'680'974	0.00	0.00
22.02.2024	Bought	USD	8'816'000	CHF	7'706'639	0.00	0.00
22.02.2024	Bought	USD	8'000'000	CHF	6'948'701	0.00	0.00
22.02.2024	Bought	USD	35'363'000	CHF	30'745'727	0.00	0.00
22.02.2024	Bought	USD	63'000	EUR	57'809	0.00	0.00
22.02.2024	Bought	USD	52'000	EUR	47'615	0.00	0.00
03.04.2024	Bought	CHF	7'103'776	EUR	7'300'000	5'667.16	0.00
03.04.2024	Bought	CHF	5'046'552	USD	5'600'000	6'002.01	0.00
23.05.2024	Bought	CAD	9'944'000	CHF	6'445'870	136'339.25	0.02
23.05.2024	Bought	CAD	280'000	CHF	185'510	-170.32	0.00
23.05.2024	Bought	CHF	2'230'285	AUD	3'885'000	-42'064.78	-0.01
23.05.2024	Bought	CHF	912'781	AUD	1'590'000	-17'215.70	0.00
23.05.2024	Bought	CHF	281'871	AUD	491'000	-5'316.29	0.00
23.05.2024	Bought	CHF	13'864'713	CAD	21'389'000	-294'877.85	-0.04
23.05.2024	Bought	CHF	1'984'840	CAD	3'062'000	-42'214.04	-0.01
23.05.2024	Bought	CHF	14'581'955	EUR	15'407'000	-348'787.49	-0.05
23.05.2024	Bought	CHF	37'626'120	EUR	39'755'000	-899'983.56	-0.13
23.05.2024	Bought	CHF	101'275'829	EUR	107'006'000	-2'422'428.40	-0.35
23.05.2024	Bought	CHF	326'657	EUR	345'000	-7'678.24	0.00
23.05.2024	Bought	CHF	107'000	EUR	112'951	-2'458.70	0.00

Aufstellung der Devisentermingeschäfte für die Zeit vom 1. Oktober 2023 bis zum 31. März 2024

Fälligkeit	Transaktion	Währung	Betrag	Gegen	Gegenwert	Devisengewinn/-verlust Mandatswährung	in % des GFV
23.05.2024	Bought	CHF	1'345'234	EUR	1'420'000	-30'866.22	0.00
23.05.2024	Bought	CHF	51'157	EUR	54'000	-1'173.79	0.00
23.05.2024	Bought	CHF	116'704	EUR	122'000	-1'520.24	0.00
23.05.2024	Bought	CHF	78'870	EUR	82'000	-590.05	0.00
23.05.2024	Bought	CHF	709'833	EUR	738'000	-5'310.46	0.00
23.05.2024	Bought	CHF	15'000	EUR	15'470	10.06	0.00
23.05.2024	Bought	CHF	2'532'883	GBP	2'303'000	-72'481.74	-0.01
23.05.2024	Bought	CHF	17'681'790	GBP	16'077'000	-505'987.34	-0.07
23.05.2024	Bought	CHF	37'535	GBP	34'000	-927.59	0.00
23.05.2024	Bought	CHF	405'343	JPY	68'753'000	-4'769.42	0.00
23.05.2024	Bought	CHF	3'033'357	JPY	514'508'000	-35'691.62	-0.01
23.05.2024	Bought	CHF	44'147'333	USD	50'539'000	-1'098'514.61	-1.16
23.05.2024	Bought	CHF	289'870'448	USD	331'838'000	-7'212'823.60	-1.06
23.05.2024	Bought	CHF	888'098	USD	1'019'000	-24'190.40	0.00
23.05.2024	Bought	CHF	3'485'528	USD	4'000'000	-95'589.31	-0.01
23.05.2024	Bought	CHF	5'120'216	USD	5'882'000	-145'849.34	-0.02
23.05.2024	Bought	CHF	190'637	USD	219'000	-5'430.30	0.00
23.05.2024	Bought	CHF	1'019'247	USD	1'161'000	-20'125.70	0.00
23.05.2024	Bought	CHF	142'504	USD	161'000	-1'621.75	0.00
23.05.2024	Bought	CHF	231'017	USD	261'000	-2'629.04	0.00
23.05.2024	Bought	CHF	619'276	USD	691'000	744.14	0.00
23.05.2024	Bought	EUR	51'565	AUD	85'000	254.85	0.00
23.05.2024	Bought	EUR	349'294	CAD	510'000	887.86	0.00
23.05.2024	Bought	EUR	8'882	CAD	13'000	1.19	0.00
23.05.2024	Bought	EUR	48'607	CHF	46'000	1'099.87	0.00
23.05.2024	Bought	EUR	108'654	CHF	103'000	2'286.31	0.00
23.05.2024	Bought	EUR	18'815	CHF	18'000	231.98	0.00
23.05.2024	Bought	EUR	1'967'000	CHF	1'907'386	-1'361.16	0.00
23.05.2024	Bought	EUR	3'694'000	CHF	3'582'046	-2'556.25	0.00
23.05.2024	Bought	EUR	445'084	GBP	383'000	-1'938.55	0.00
23.05.2024	Bought	EUR	15'185	GBP	13'000	9.63	0.00
23.05.2024	Bought	EUR	73'916	JPY	11'866'000	839.99	0.00
23.05.2024	Bought	EUR	7'298'664	USD	7'911'000	-9'025.91	0.00
23.05.2024	Bought	EUR	44'104	USD	48'000	-231.15	0.00
23.05.2024	Bought	EUR	146'834	USD	160'000	-944.81	0.00
23.05.2024	Bought	EUR	46'209	USD	50'000	19.73	0.00
23.05.2024	Bought	GBP	6'212'000	CHF	6'832'076	194'361.05	0.03
23.05.2024	Bought	GBP	189'000	CHF	214'086	-306.37	0.00
23.05.2024	Bought	JPY	792'497'000	CHF	4'672'282	55'104.33	0.01
23.05.2024	Bought	USD	31'598'000	CHF	27'601'801	682'571.67	0.10
23.05.2024	Bought	USD	4'690'000	CHF	4'203'187	-5'019.54	0.00
Total Devisentermingeschäfte						-12'284'240.55	-1.80

Ausserbilanzgeschäfte

	31.03.2024		30.09.2023	
	Basiswertäquivalent in Fondswährung	in % des NFV	Basiswertäquivalent in Fondswährung	in % des NFV
Engagement erhöhende Derivatpositionen:				
- Marktrisiko (Zinsänderungsrisiko)	0.00	0.00%	0.00	0.00%
- Währungsrisiko	0.00	0.00%	0.00	0.00%
Total engagement erhöhende Positionen	0.00	0.00%	0.00	0.00%
Engagement reduzierende Derivatpositionen:				
- Marktrisiko (Zinsänderungsrisiko)	77'571'857.79	11.36%	68'750'722.93	10.51%
- Währungsrisiko	518'586'338.83	75.96%	517'287'886.62	79.11%
Total engagement reduzierende Positionen	596'158'196.62	87.32%	586'038'609.55	89.62%

Gemäss Fondsreglement getätigte Ein- und Auszahlungen in Anlagen statt in bar

Klasse	Datum	Anteile	Währung	NAV	Anteile Ausgabe	Anteile Rücknahme
Z	22.01.2024	4'323.516	CHF	976.53	x	

Erläuterungen zum Halbjahresbericht per 31. März 2024

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

Am 19. März 2023 haben die Credit Suisse Group AG und die UBS Group AG eine Vereinbarung zum Zusammenschluss unterzeichnet, welche per 12. Juni 2023 vollzogen wurde. Der Fonds bezieht verschiedene Dienstleistungen und unterhält Bankbeziehungen mit konsolidierten Tochtergesellschaften der Credit Suisse Group AG bzw. der UBS Group AG. Die Credit Suisse Funds AG wurde per 30. April 2024 in die UBS Fund Management AG fusioniert. Ab diesem Zeitpunkt hat die UBS Fund Management AG die Fondsleitungsfunktion übernommen.

Erläuterung 2: Verkaufsrestriktionen USA

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

Erläuterung 3: Kennzahlen und technische Daten

Fondsname	Anteilklasse	Valor	Währung	Depotbankkommission	Verwaltungs- ¹ kommission	Total Expense Ratio (TER) ²
Credit Suisse (CH) Corporate CHF Bond Fund	A	277 020	CHF	0.04%	0.98%	1.05%
	EA	23 723 966	CHF	0.04%	0.38%	0.45%
	IA	20 191 423	CHF	0.04%	0.43%	0.50%
	UA	26 422 906	CHF	0.04%	0.63%	0.70%
Credit Suisse (CH) Global Corporate Bond Fund	BH CHF	39 364 170	CHF	0.04%	0.81%	0.85%
	BH EUR	41 217 488	EUR	0.04%	0.81%	0.85%
	EBH CHF	111 963 421	CHF	0.04%	0.41%	0.45%
	UBH EUR	41 217 489	EUR	0.04%	0.61%	0.65%
	ZB CHF	12 648 038	CHF	0.00%	0.00%	0.00%
	ZBH CHF	12 648 039	CHF	0.00%	0.00%	0.00%
	ZBH DUR CHF	21 698 345	CHF	0.00%	0.00%	0.00%

¹ Die Fondsleitung hat keine Gebührenteilvereinbarungen oder Vereinbarungen betreffend Retrozessionen in Form von sogenannten «soft commissions» geschlossen.

² Die TER (Total Expense Ratio) bezeichnet die Summe aller periodisch erhobenen Kosten und Kommissionen, die dem Fondsvermögen belastet werden, und zwar rückwirkend als Prozentsatz des durchschnittlichen Fondsvermögens. Allfällige Rückvergütungen/Bestandespflegekommissionen von Zielfonds wurden dem Fonds gutgeschrieben und reduzieren somit die TER.

Erläuterung 4: Fondsp performance

Fondsname	Anteilklasse	Valor	Lancierungsdatum	Währung	kum. Seit Lancierung	2023 ¹	2022 ¹	2021 ¹
Credit Suisse (CH) Corporate CHF Bond Fund	A	277 020	27.01.2014	CHF	-	5.5%	-9.9%	-0.9%
	EA	23 723 966	08.05.2014	CHF	-	6.2%	-9.4%	-0.3%
	IA	20 191 423	27.01.2014	CHF	-	6.1%	-9.4%	-0.4%
	UA	26 422 906	27.02.2015	CHF	-	5.9%	-9.6%	-0.6%
Credit Suisse (CH) Global Corporate Bond Fund	BH CHF	39 364 170	15.12.2017	CHF	-	4.3%	-16.9%	-2.0%
	BH EUR	41 217 488	11.06.2018	EUR	-	6.3%	-16.8%	-1.7%
	EBH CHF	111 963 421	18.06.2021	CHF	-14.1%	4.7%	-16.3%	-
	UBH EUR	41 217 489	11.06.2018	EUR	-	6.5%	-16.6%	-1.5%
	ZB CHF	12 648 038	06.01.2014	CHF	-	0.4%	-14.7%	0.9%
	ZBH CHF	12 648 039	06.01.2014	CHF	-	5.2%	-16.1%	-1.1%
	ZBH DUR CHF	21 698 345	24.04.2014	CHF	-	5.6%	-7.6%	0.9%

¹ Die Fondsp performance basiert auf offiziellen publizierten Nettoinventarwerten, die auf den Börsenschlusskursen des jeweiligen Monatsendes basieren.

Die historische Performance stellt keinen Indikator für die laufende oder zukünftige Performance dar. Die Performancedaten lassen die bei der Ausgabe und Rücknahme der Anteile erhobenen Kommissionen und Kosten unberücksichtigt.

Erläuterung 5: Identität der Vertragspartner bei OTC-Geschäften

Fondsname	Vertragspartner
Credit Suisse (CH) Corporate CHF Bond Fund	CREDIT SUISSE (SCHWEIZ) AG
Credit Suisse (CH) Global Corporate Bond Fund	BNP-PARIBAS SA PARIS CITIBANK N.A. LONDON CREDIT SUISSE (SCHWEIZ) AG JP MORGAN SECURITIES PLC LONDON THE BANK OF NEW YORK MELLON (BRUSSELS) UBS AG LONDON BRANCH

Erläuterung 6: Entgegengenommene Sicherheiten

Fondsname	Sicherheit	Wert in Fondswährung
Credit Suisse (CH) Corporate CHF Bond Fund	Collaterals Sec Lending - Equities	1'467'235.07
	Collaterals Sec Lending - Fixed Rate Bonds	2'244'986.96

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

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

Erläuterung 8: Zusammensetzung des Portefeuilles

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

Erläuterung 9: Ausweis Ausserbilanzgeschäfte (Commitment-Ansatz I)

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

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

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

Erläuterung 11: Letzter Bewertungstag

Im März fällt der letzte Bewertungstag (28. März 2024) nicht mit dem effektiven Monatsende per 31. März 2024 zusammen. Deshalb wurden die Anlagen des Fonds per 28. März 2024 bewertet und der letzte Nettoinventarwert auf diesen Tag berechnet.

Erläuterung 12: Bewertung des Fondsvermögens und der Anteile

1. Der Nettoinventarwert jedes Teilvermögens und der Anteil der einzelnen Klassen (Quoten) wird zum Verkehrswert auf Ende des Rechnungsjahres sowie für jeden Tag, an dem Anteile ausgegeben oder zurückgenommen werden, in der Rechnungseinheit des entsprechenden Teilvermögens berechnet. Für Tage, an welchen die Börsen bzw. Märkte der Hauptanlageländer eines Teilvermögens geschlossen sind (z.B. Banken- und Börsenfeiertage), findet keine Berechnung des Vermögens des entsprechenden Teilvermögens statt.
2. An einer Börse oder an einem anderen geregelten, dem Publikum offenstehenden Markt gehandelte Anlagen sind mit den am Hauptmarkt bezahlten aktuellen Kursen zu bewerten. Andere Anlagen oder Anlagen, für die keine aktuellen Kurse verfügbar sind, sind mit dem Preis zu bewerten, der bei sorgfältigem Verkauf im Zeitpunkt der Schätzung wahrscheinlich erzielt würde. Die Fondsleitung wendet in diesem Fall zur Ermittlung des Verkehrswerts angemessene und in der Praxis anerkannte Bewertungsmodelle und -grundsätze an.
3. Offene kollektive Kapitalanlagen werden mit ihrem Rücknahmepreis bzw. Nettoinventarwert bewertet. Werden sie regelmässig an einer Börse oder an einem anderen geregelten, dem Publikum offenstehenden Markt gehandelt, so kann die Fondsleitung diese gemäss Ziff. 2 bewerten.
4. Der Wert von Geldmarktinstrumenten, welche nicht an einer Börse oder an einem anderen geregelten, dem Publikum offenstehenden Markt gehandelt werden, wird wie folgt bestimmt: Der Bewertungspreis solcher Anlagen wird, ausgehend vom Nettoerwerbspreis, unter Konstanthaltung der daraus berechneten Anlagerendite sukzessive dem Rückzahlungspreis angeglichen. Bei wesentlichen Änderungen der Marktbedingungen wird die Bewertungsgrundlage der einzelnen Anlagen der neuen Marktrendite angepasst. Dabei wird bei fehlendem aktuellem Marktpreis in der Regel auf die Bewertung von Geldmarktinstrumenten mit gleichen Merkmalen (Qualität und Sitz des Emittenten, Ausgabewährung, Laufzeit) abgestellt.
5. Bankguthaben werden mit ihrem Forderungsbetrag plus aufgelaufene Zinsen bewertet. Bei wesentlichen Änderungen der Marktbedingungen oder der Bonität wird die Bewertungsgrundlage für Bankguthaben auf Zeit den neuen Verhältnissen angepasst.
6. Der Nettoinventarwert eines Anteils einer Klasse eines Teilvermögens ergibt sich aus der der betreffenden Anteilklasse am Verkehrswert des Vermögens dieses Teilvermögens zukommenden Quote, vermindert um allfällige Verbindlichkeiten dieses Teilvermögens, die der betreffenden Anteilklasse zugeteilt sind, dividiert durch die Anzahl der im Umlauf befindlichen Anteile der entsprechenden Klasse. Er wird auf die jeweils kleinste gängige Einheit der Rechnungseinheit gerundet.
7. Falls an einem Bewertungstag die Summe der Zeichnungen und Rücknahmen von Anteilen eines Teilvermögens zu einem Nettovermögenszufluss bzw. -abfluss führt, wird der Nettoinventarwert des jeweiligen Teilvermögens erhöht bzw. reduziert (Swinging Single Pricing). Die maximale Anpassung beläuft sich auf 2% des Nettoinventarwerts. Berücksichtigt werden die Nebenkosten (namentlich marktübliche Courtagen, Kommissionen, Steuern und Abgaben) sowie Kosten für die Überprüfung und Aufrechterhaltung von Qualitätsstandards bei physischen Anlagen, die im Durchschnitt aus der Anlage des einbezahlten Betrags bzw. aus dem Verkauf eines dem gekündigten Anteil entsprechenden Teils der Anlagen durchschnittlich erwachsen. Die Anpassung führt zu einer Erhöhung des Nettoinventarwertes, wenn die Nettobewegung zu einem Anstieg der Anzahl Anteile des Teilvermögens führen. Die Anpassung resultiert in einer Verminderung des Nettoinventarwerts, wenn die Nettobewegung einen Rückgang der Anzahl der Anteile des Teilvermögens bewirkt. Der unter Anwendung des Swinging Single Pricing ermittelte Nettoinventarwert ist somit ein gemäss Satz 1 dieser Ziffer modifizierter Nettoinventarwert.
Der bei den Zeichnungen bzw. Rücknahmen anfallende Zu- bzw. Abschlag zum Nettoinventarwert erfolgt jeweils pauschal bezogen auf einen Durchschnittswert aus einer im Prospekt definierten Periode.

8. Die Quoten am Verkehrswert des Nettovermögens eines Teilvermögens (Vermögen eines Teilvermögens, abzüglich der Verbindlichkeiten), welche den jeweiligen Anteilklassen zuzurechnen sind, werden erstmals bei der Erstausgabe mehrerer Anteilklassen (wenn diese gleichzeitig erfolgt) oder der Erstausgabe einer weiteren Anteilklasse auf der Basis der dem entsprechenden Teilvermögen für jede Anteilklasse zufließenden Betreffnisse bestimmt. Die Quote wird bei folgenden Ereignissen jeweils neu berechnet:
- a) bei der Ausgabe und Rücknahme von Anteilen;
 - b) auf den Stichtag von Ausschüttungen beziehungsweise Thesaurierungen, sofern (i) solche Ausschüttungen beziehungsweise Thesaurierungen nur auf einzelnen Anteilklassen (Ausschüttungsklassen beziehungsweise Thesaurierungsklassen) anfallen oder sofern (ii) die Ausschüttungen beziehungsweise Thesaurierungen der verschiedenen Anteilklassen in Prozenten ihres jeweiligen Nettoinventarwertes unterschiedlich ausfallen oder sofern (iii) auf den Ausschüttungen beziehungsweise Thesaurierungen der verschiedenen Anteilklassen in Prozenten der Ausschüttung beziehungsweise der Thesaurierung unterschiedliche Kommissions- oder Kostenbelastungen anfallen;
 - c) bei der Inventarwertberechnung im Rahmen der Zuweisung von Verbindlichkeiten (einschliesslich der fälligen oder aufgelaufenen Kosten und Kommissionen) an die verschiedenen Anteilklassen, sofern die Verbindlichkeiten der verschiedenen Anteilklassen in Prozenten ihres jeweiligen Nettoinventarwertes unterschiedlich ausfallen, namentlich, wenn (i) für die verschiedenen Anteilklassen unterschiedliche Kommissionssätze zur Anwendung gelangen oder wenn (ii) klassenspezifische Kostenbelastungen erfolgen;
 - d) bei der Inventarwertberechnung im Rahmen der Zuweisung von Erträgen oder Kapitalerträgen an die verschiedenen Anteilklassen, sofern die Erträge oder Kapitalerträge aus Transaktionen anfallen, die nur im Interesse einer Anteilklasse oder im Interesse mehrerer Anteilklassen, nicht jedoch proportional zu deren Quote am Nettovermögen eines Teilvermögens getätigt wurden.

CREDIT SUISSE 
Teil des UBS-Konzerns

Credit Suisse Funds AG
Teil des UBS-Konzerns
Uetlibergstrasse 231 / SYSU 13
CH-8045 Zürich

www.credit-suisse.com